



辰运兴瑞私募证券投资基金 2024 年年度报告

1、基金产品概况

1.1 基金基本情况

基金名称	辰运兴瑞私募证券投资基金
基金编码	SZB461
基金运作方式	开放式
基金成立日期	2023 年 2 月 9 日
基金管理人	上海辰运投资管理有限公司
基金托管人（如有）	申万宏源证券有限公司
投资顾问（如有）	-
期末基金总份额（万份）/ 期末基金实缴总额（万元）	4,412.858071
基金到期日期	2035 年 2 月 8 日

1.2 基金产品说明

投资目标	严格控制风险确保投资安全性的前提下，通过积极而主动的投资管理，力争实现基金资产长期稳健的增值。
投资策略	“核心品种+板块配置+仓位匹配是投资策略的重要组成部分，以核心品种为基础，不断地优化组合是管理人贯穿投资过程始终的策略。不同类型的投资标的适合不同的交易策略，对于弱周期的品种，左侧交易的策略比较适合，对于周期性较强的品种，右侧交易比较适合。
业绩比较基准（如有）	本基金无业绩比较基准。
风险收益特征	本基金属于【R3】风险投资品种。

1.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		上海辰运投资管理有限公司	申万宏源证券有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨磊	陈琦
	联系电话	13883167617	010-88013567
	电子邮箱	ianrae.yang@cyasset.cn	chenqi6@swyhsc.com
传真		-	-
注册地址		上海市松江区新松江路 1800 弄 3 号 3 层 306 室	上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层
办公地址		上海市普陀区兰溪路 900 弄天汇广场 13 号 801 室	北京市西城区太平桥大街 19 号

邮政编码	-	200031
法定代表人	-	张剑

1.4 信息披露方式

--

1.5 其他相关资料（如有）

项目	名称	办公地址
会计师事务所	-	-
注册登记机构	申万宏源证券有限公司	北京市西城区太平桥大街 19 号
外包机构	申万宏源证券有限公司	北京市西城区太平桥大街 19 号
-	-	-

2、主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

2.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：元

期间数据和指标	2024 年	2023 年	2022 年
本期已实现收益	1,787,958.55	1,700,712.86	0.0
本期利润	1,787,958.55	1,700,712.86	0.0
期末数据和指标	2024 年末	2023 年末	2022 年末
期末可供分配利润	5,431,644.28	2,054,351.14	0.0
期末可供分配基金份额利润	0.1231	0.0519	-
期末基金净资产	49,560,224.99	41,600,712.86	0.00
报告期期末单位净值	1.1231	1.0519	-
累计期末指标	2024 年末	2023 年末	2022 年末
基金份额累计净值增长率(%)	12.31	5.19	0.00

备注：

√无分级□二级 □三级

2.2 基金净值表现

阶段	净值增长率 (%)	净值增长率标准差 (%)	业绩比较基准收 益率(%)	业绩比较基准收 益率标准差(%)
当年	6.77	0.02	-	-
自基金合同 生效起至今	12.31	0.02	-	-

备注：

2.3 过去三年基金的利润分配情况

金额单位：元

年度	每份基金份额分红	现金形式发放总	再投资形式发放	年度利润分	备注
----	----------	---------	---------	-------	----

		额	总额	配合计	
2014	0	0.0	0.0	0.0	-
2015	0	0.0	0.0	0.0	-

备注：

3、基金份额变动情况

单位：万份/万元

报告期期初基金份额总额	3,954.636172
报告期期间基金总申购份额	4,312.858071
减：报告期期间基金总赎回份额	3,854.636172
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	0
期末基金总份额（万份）/期末基金实缴总额（万元）	4,412.858071

备注：

4、管理人说明的其他情况

1) 基金运作合规守信情况：

本报告期内，本基金管理人严格遵守《私募投资基金信息披露管理办法》及其他有关法律法规、基金合同等规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。

报告期内，本基金运作整体合法合规，没有损害基金持有人利益。基金的投资范围、投资比例符合有关法律法规及基金合同的规定。

2) 基金估值程序：

截止到报告期末，本管理人委托申万宏源证券有限公司为本基金提供估值核算服务。对于与基金资产有关的估值与会计核算问题，经相关当事人在平等基础上充分讨论后，达成一致意见。1、本基金成立前，本管理人协调本基金其他当事人商定本基金的估值与会计核算方法，并在合同中约定。2、在本基金的存续期内，本基金管理人定期评估基金估值与会计核算方法的合理性。3、在本基金的运作过程中，经济环境发生重大变化且对基金资产的估值产生重大影响的，由本管理人协调本基金其他当事人采取必要措施，调整估值方法。

3) 基金运作情况和运用杠杆情况：

截止报告期末，本基金资产总值为 49601489.85 元，净资产为 49560224.99 元，本基金总资产与净资产的比例为 1.00083262

5、托管人报告（如有）

5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明

报告期内，申万宏源证券有限公司（以下称“托管人”）在本基金的托管过程中，严格遵守《私募投资基金信息披露管理办法》及其他有关法律法规、基金合同等有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，托管人根据《私募投资基金信息披露管理办法》及其他有关法律法规、基金合同等规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督。

报告期内，管理人在本基金的投资运作合规守信、净值计算、基金份额申购赎回价格、基金费用开支及利益分配等情况上，托管人未发现管理人存在损害份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

报告期内，托管人对管理人所编制和披露的本年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、份额变动情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

6、年度财务报表

金额单位：元

6.1 资产负债表

资产	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	147,977.76	129,976.76
结算备付金	61,746.53	11,187.64
存出保证金	0.0	0.0
交易性金融资产	0.0	0.0
其中：股票投资	0.0	0.0
基金投资	0.0	0.0
债券投资	0.0	0.0
资产支持证券投资	0.0	0.0
贵金属投资	0.0	0.0
衍生金融资产	0.0	0.0
买入返售金融资产	49,391,765.56	41,532,653.11
应收证券清算款	0.0	0.0
应收利息	0.0	0.0
应收股利	0.0	0.0
应收申购款	0.0	0.0
递延所得税资产	0.0	0.0
其他资产	0.0	0.0
资产总计	49,601,489.85	41,673,817.51
负债和所有者权益	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
负债：		
短期借款	0.0	0.0
交易性金融负债	0.0	0.0
衍生金融负债	0.0	0.0
卖出回购金融资产款	0.0	0.0
应付证券清算款	0.0	0.0
应付赎回款	0.0	0.0
应付管理人报酬	28,643.62	59,807.36
应付托管费	2,121.70	2,492.28
应付销售服务费	0.0	0.0

应付交易款项	0.0	0.0
应付利息	8,377.84	8,312.73
应付利润	0.0	0.0
递延所得税负债	0.0	0.0
其他负债	2,121.70	2,492.28
负债合计	41,264.86	73,104.65
所有者权益：		
实收基金	44,128,580.71	39,546,361.72
未分配利润	5,431,644.28	2,054,351.14
所有者权益合计	49,560,224.99	41,600,712.86
负债和所有者权益总计	49,601,489.85	41,673,817.51

备注：

6.2 利润表

项目	本期	上年度可比期间
	2024年1月1日至2024年12月31日	2023年2月9日至2023年12月31日
一、收入	1,889,665.81	1,798,222.03
1. 利息收入	1,889,665.81	1,798,222.03
其中：存款利息收入	9,211.13	10,298.22
债券利息收入	0.0	0.0
资产支持证券利息收入	0.0	0.0
买入返售金融资产收入	1,936,868.33	1,830,668.11
其他利息收入	-56,413.65	-42,744.30
2. 投资收益（损失以“-”填列）	0.0	0.0
其中：股票投资收益	0.0	0.0
基金投资收益	0.0	0.0
债券投资收益	0.0	0.0
资产支持证券投资收益	0.0	0.0
贵金属投资收益	0.0	0.0
衍生工具收益	0.0	0.0
股利收益	0.0	0.0
3. 公允价值变动收益（损失以“-”填列）	0.0	0.0
4. 汇兑收益（损失以“-”填列）	0.0	0.0
5. 其他收入（损失以“-”填列）	0.0	0.0
减：二、费用	101,707.26	97,509.17
1. 管理人报酬	76,497.40	73,425.08
其中：固定管理费	76,497.40	73,425.08
业绩报酬	0.0	0.0
2. 托管费	6,374.99	6,119.33
3. 销售服务费	0.0	0.0

4. 手续费	6,374.99	6,119.33
5. 交易费用	0.0	0.0
6. 利息支出	0.0	0.0
其中：卖出回购金融资产支出	0.0	0.0
7. 其他费用	12,459.88	11,845.43
三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)	1,787,958.55	1,700,712.86
减：所得税费用	0.0	0.0
四、净利润 (净亏损以“-”号填列)	1,787,958.55	1,700,712.86

备注：

6.3 所有者权益变动表

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	39,546,361.72	2,054,351.14	41,600,712.86
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	0.0	1,787,958.55	1,787,958.55
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	4,582,218.99	1,589,334.59	6,171,553.58
其中：1. 基金申购款	43,128,580.71	4,671,419.29	47,800,000.0
2. 基金赎回款	-38,546,361.72	-3,082,084.70	-41,628,446.42
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	0.0	0.0	0.0
五、期末所有者权益(基金净值)	44,128,580.71	5,431,644.28	49,560,224.99
项目	上年度可比期间 2023年2月9日至2023年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	3,200,000.0	0.0	3,200,000.0
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	0.0	1,700,712.86	1,700,712.86
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	36,346,361.72	353,638.28	36,700,000.0
其中：1. 基金申购款	36,346,361.72	353,638.28	36,700,000.0
2. 基金赎回款	0.0	0.0	0.0
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值	0.0	0.0	0.0

减少“三”列			
五、期末所有者权益（基金净值）	39,546,361.72	2,054,351.14	41,600,712.86

备注:

7、期末投资组合情况

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：元

项目		金额
现金类资产	银行存款	147,977.76
境内未上市、未挂牌公司股权投资	股权投资	0
	其中：优先股	0
	其他股权类投资	-
上市公司定向增发投资	上市公司定向增发股票投资	0
新三板投资	新三板挂牌企业投资	0
境内证券投资规模	结算备付金	61,746.53
	存出保证金	0
	股票投资	0
	债券投资	0
	其中：银行间市场债券	0
	其中：利率债	0
	其中：信用债	0
	资产支持证券	0
	基金投资（公募基金）	0
	其中：货币基金	0
	期货及衍生品交易保证金	0
	买入返售金融资产	49,391,765.56
	其他证券类标的	-
资管计划投资	商业银行理财产品投资	-
	信托计划投资	-
	基金公司及其子公司资产管理计划投资	-
	保险资产管理计划投资	-
	证券公司及其子公司资产管理计划投资	-
	期货公司及其子公司资产管理计划投资	-
	私募基金产品投资	-
	未在协会备案的合伙企业份额	-

另类投资	另类投资	0
受托贷款规模	受托贷款规模	-
受托贷款	受托贷款	-
应收账款投资	应收账款投资	-
境内债权类投资	各类受（收）益权投资	-
	票据（承兑汇票等）投资	-
	其他债权投资	-
境外投资	境外投资	0
其他资产	其他资产	-
基金负债情况	债券回购总额	0
	融资、融券总额	0
	其中：融券总额	0
	银行借款总额	0
	其他融资总额	-

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：元

序号	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	0.0	0.00
B	采矿业	0.0	0.00
C	制造业	0.0	0.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	0.0	0.00
E	建筑业	0.0	0.00
F	批发和零售业	0.0	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	0.0	0.00
H	住宿和餐饮业	0.0	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	0.0	0.00
J	金融业	0.0	0.00
K	房地产业	0.0	0.00
L	租赁和商务服务业	0.0	0.00
M	科学研究和技术服务业	0.0	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	0.0	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	0.0	0.00
P	教育	0.0	0.00
Q	卫生和社会工作	0.0	0.00
R	文化、体育和娱乐业	0.0	0.00
S	综合	0.0	0.00
	合计	0.0	0.00

备注：

7.1.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合（如有）

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
信息技术	0.0	0.0
公用事业	0.0	0.0
医疗保健	0.0	0.0
地产建筑业	0.0	0.0
基础材料	0.0	0.0
工业	0.0	0.0
消费者常用品	0.0	0.0
消费者非必需品	0.0	0.0
电信服务	0.0	0.0
能源	0.0	0.0
金融	0.0	0.0
合计	0.0	0.00

备注：

以上分类采用全球行业标准（GICS）。

8、 信息披露报告

信息披露报告是否经托管机构复核：是