

兴诚-宁泉致远3号资产管理计划
2020年年度报告



基金管理人：兴证期货有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司



1、基金产品概况

1.1、基金基本情况

基金名称	兴诚-宁泉致远 3 号资产管理计划
基金编号	SCY196
基金运作方式	开放式
基金成立日期	2018-06-06
基金管理人	兴证期货有限公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司
投资顾问（如有）	无
报告期末基金份额总额	112,768,503.26
基金清算日期	2020-12-31

1.2、基金产品说明

投资目标	在投资期限内，积极获取股票、债券、新股申购等各种投资收益，在严格控制风险的前提下，谋求委托财产的稳定增值。
投资策略	本资产管理计划主要投向上海宁泉资产管理有限公司作为管理人发行的私募证券投资基金。
业绩比较基准(如有)	-
风险收益特征	本资产管理计划属于中高风险的资产管理计划品种。

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

期间数据和指标	2020 年	2019 年	2018 年
本期已实现收益	59,400,003.45	3,964,688.76	-169,168.30
本期利润	18,073,461.07	46,573,969.26	-1,451,906.42
期末数据和指标	2020 年末	2019 年末	2018 年末
期末可供分配利润	56,813,207.29	3,514,755.34	-1,451,906.42
期末可供分配基金份额利润	0.5038	0.0300	-0.0106
期末基金净资产	169,581,710.55	156,927,704.85	135,517,160.03
报告期期末单位净值	1.5038	1.3416	0.9894
累计期末指标	2020 年末（%）	2019 年末（%）	2018 年末（%）
基金份额累计净值增长率	50.38%	0.00%	0.00%

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	12.09	-	-	-
自基金合同生效起至今	50.38	-	-	-

注：

净值增长率=（期末累计净值-期初累计净值）/期初累计净值

当年净值增长率=（本年度末累计净值-上年度末累计净值）/上年度末累计净值

表中指标均以不带百分号数值形式表示，一般保留至小数点后2位。

2.3、过去三年基金的利润分配情况

年度	每份基金份额 分红数	现金形式发 放总额	再投资形式 发放总额	年度利润分配 合计	备注
2020 年	0.00	0.00	0.00	0.00	
2019 年	0.00	0.00	0.00	0.00	
2018 年	0.00	0.00	0.00	0.00	

3、基金份额变动情况

单位：份

报告期期初基金份额总额	116,968,654.67
报告期期间基金总申购份额	0.00
减：报告期期间基金总赎回份额	4,200,151.41
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	0.00
报告期期末基金份额总额	112,768,503.26

注：

如基金成立日晚于报告期期初，则以基金成立日的基金份额总额作为报告期期初基金份额总额。

4、管理人说明的其他情况

4.1 报告期内基金投资策略和业绩表现

本计划投资策略：本资产管理计划主要投向上海宁泉资产管理有限公司作为管理人发行的私募证券投资基金。委托人签署本资产管理合同即表明同意本资产管理计划投资于本公司或与本公司有关联关系的公司发行的证券或其他金融产品。截止 2020 年 12 月 31 日本基金期末基金单位净值为 1.5038 元，期末基金累计单位净值 1.5038 元。

4.2 投资经理

本计划有两位投资经理，分别为廉正先生和施海先生，本计划本报告期内未发生变更。

廉正先生，工学学士、产业经济学硕士，现任兴证期货资产管理部总经理兼投资经理，期货从业资格编码为 F3054039。2011 年从业以来先后从事宏观及商品研究、基于基本面的投资管理、量化策略开发与投资等，擅长大类资产配置与宏观对冲。曾获得《中国金属通报》2012 年度有色金属期货“十佳分析师”称号；《期货日报》、《证券时报》主办的“第七届中国最佳期货经营机构暨最佳分析师评选”中荣获“最佳有色金属期货分析师”第二名；上海期货交易所优秀分析师评选中获“2013 年度铜期货优秀分析师奖”。

施海先生，1983 年毕业于上海交通大学，期货从业资格编码为 F0273014，投资咨询从业证书号为 Z0011937。2011 年加入兴证期货有限公司，从事研究员工作，2019 年 2 月担任

资产管理部投资经理。施海先生从事期货研究 25 年，主要从事天然橡胶期货研究，多次被上海期货交易所评为天然橡胶优秀分析师，并担任天然橡胶讲师。

本计划投资经理符合法律法规规定的以下条件：

- (1) 已取得基金从业资格；
- (2) 具有 3 年以上投资管理、投资研究、投资咨询等相关业务经验；
- (3) 具有良好的诚信记录及职业操守，且最近 3 年未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚。

4.3 报告期内基金估值程序

根据监管相关规定及基金合同约定，本计划严格按照监管相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本计划托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.4 报告期内管理人履职情况

公司在资产管理业务经营过程中，将严格遵守以下管理人的职责：

- (1) 依法办理资产管理计划的销售、登记、备案事宜；
- (2) 对所管理的不同资产管理计划的受托财产分别管理、分别记账，进行投资；
- (3) 按照资产管理合同的约定确定收益分配方案，及时向投资者分配收益；
- (4) 依法计算并披露资产管理计划净值，确定参与、退出价格；
- (5) 办理与受托财产管理业务活动有关的信息披露事项；
- (6) 保存受托财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
- (7) 以管理人名义，代表投资者利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
- (8) 法律、行政法规和中国证监会规定的其他职责。

4.5 文件存放地点

兴证期货有限公司

地址：上海市浦东新区长柳路 36 号兴业证券大厦 8 楼

联系人：崔文婷

服务电话：021-20370952

E-MAIL：cuiwt@xzfutures.com

投资者对本报告书如有任何疑问，可以咨询管理人兴证期货有限公司。

4.6 报告期内其他说明情况

本计划本报告期内未进行利润分配、投资经理未变更、未发生关联交易、未发生损害投资者利益的事件及其他不符合法律法规的事项。本计划于 2020 年 12 月 31 日正式终止并进入清算阶段，为最大限度保证资产委托人的利益，清算完成后将按照合同约定进行分配。

5、托管人报告

5.1、报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规、基金合同和托管服务协议的有关规定，不存在任何损害基金投资者利益的行为，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遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

管理人在本基金的投资运作、基金资产净值计算、利润分配等问题上，不存在任何损害基金投资者利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同和托管服务协议的规定进行。

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

托管人依法对管理人编制和披露的本基金报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

6、年度财务报表

6.1、资产负债表

单位：元

资产	本期末 2020-12-31	上年度末 2019-12-31
资产：		
银行存款	169,980,484.72	9,112,342.75
结算备付金	0.00	0.00
存出保证金	0.00	0.00
交易性金融资产	0.00	10,492,456.50
其中：股票投资	0.00	0.00
基金投资	0.00	10,492,456.50
债券投资	0.00	0.00
资产支持证券投资	0.00	0.00
贵金属投资	0.00	0.00
衍生金融资产	0.00	0.00
买入返售金融资产	0.00	0.00
应收证券清算款	0.00	0.00
应收利息	2,122.92	666.82
应收股利	0.00	4,666.22
应收申购款	0.00	0.00
递延所得税资产	0.00	0.00
其他资产	0.00	144,253,972.09
资产总计	169,982,607.64	163,864,104.38

负债和所有者权益	本期末 2020-12-31	上年度末 2019-12-31
负债:		
短期借款	0.00	0.00
交易性金融负债	0.00	0.00
衍生金融负债	0.00	0.00
卖出回购金融资产款	0.00	0.00
应付证券清算款	0.00	0.00
应付赎回款	0.00	6,320,015.56
应付管理人报酬	44,544.12	297,954.32
应付托管费	44,544.12	39,803.68
应付销售服务费	311,808.85	278,625.97
应付交易费用	0.00	0.00
应交税费	0.00	0.00
应付利息	0.00	0.00
应付利润	0.00	0.00
递延所得税负债	0.00	0.00
其他负债	0.00	0.00
负债合计	400,897.09	6,936,399.53
所有者权益:		
实收基金	112,768,503.26	116,968,654.67
未分配利润	56,813,207.29	39,959,050.18
所有者权益合计	169,581,710.55	156,927,704.85
负债和所有者权益总计	169,982,607.64	163,864,104.38

6.2、利润表

单位：元

项目	本期	上年度可比期间
	2020-01-01 至 2020-12-31	2019-01-01 至 2019-12-31
一、收入	19,835,515.80	48,476,535.41
1.利息收入	11,955.70	11,491.90
其中：存款利息收入	11,955.70	11,491.90
债券利息收入	0.00	0.00
资产支持证券利息收入	0.00	0.00
买入返售金融资产收入	0.00	0.00
其他利息收入	0.00	0.00
2.投资收益（损失以“-”填列）	60,989,347.78	5,108,604.78
其中：股票投资收益	0.00	0.00
基金投资收益	0.00	0.00
债券投资收益	0.00	0.00
资产支持证券投资收益	0.00	0.00
贵金属投资收益	0.00	0.00
衍生工具收益	0.00	0.00
股利收益	233,667.97	368,610.47

3.公允价值变动收益（损失以“-”填列）	-41,326,542.38	42,609,280.50
4.汇兑收益（损失以“-”填列）	0.00	0.00
5.其他收入（损失以“-”填列）	160,754.70	747,158.23
减：二、费用	1,762,054.73	1,902,566.15
1.管理人报酬	166,099.58	160,056.70
其中：固定管理费	166,099.58	160,056.70
业绩报酬	0.00	0.00
2.托管费	166,099.58	160,056.70
3.销售服务费	1,162,697.17	1,120,396.75
4.外包服务费	0.00	0.00
5.交易费用	262,158.40	457,056.00
6.利息支出	0.00	0.00
其中：卖出回购金融资产支出	0.00	0.00
7.其他费用	5,000.00	5,000.00
三、利润总额	18,073,461.07	46,573,969.26
减：所得税费用	0.00	0.00
四、净利润	18,073,461.07	46,573,969.26

6.3、所有者权益变动表

单位：元

项目	本期 2020-01-01 至 2020-12-31		
	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）	116,968,654.67	39,959,050.18	156,927,704.85
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	0.00	18,073,461.07	18,073,461.07
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）	-4,200,151.41	-1,219,303.96	-5,419,455.37
其中：1.基金申购款	0.00	0.00	0.00
2.基金赎回款	-4,200,151.41	-1,219,303.96	-5,419,455.37
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）	0.00	0.00	0.00
五、期末所有者权益（基金净值）	112,768,503.26	56,813,207.29	169,581,710.55
项目	上年度可比期间 2019-01-01 至 2019-12-31		
	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）	136,969,066.45	-1,451,906.42	135,517,160.03
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	0.00	46,573,969.26	46,573,969.26
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）	-20,000,411.78	-5,163,012.66	-25,163,424.44

其中：1.基金申购款	0.00	0.00	0.00
2.基金赎回款	-20,000,411.78	-5,163,012.66	-25,163,424.44
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）	0.00	0.00	0.00
五、期末所有者权益（基金净值）	116,968,654.67	39,959,050.18	156,927,704.85

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

序号	项目	金额(元)	占资产总资产的比例(%)
1	权益投资	0.00	0.00
	其中：普通股	0.00	0.00
	存托凭证	0.00	0.00
2	基金投资	0.00	0.00
3	固定收益投资	0.00	0.00
	其中：债券	0.00	0.00
	资产支持证券	0.00	0.00
4	金融衍生品投资	0.00	0.00
	其中：远期	0.00	0.00
	期货	0.00	0.00
	期权	0.00	0.00
	权证	0.00	0.00
5	买入返售金融资产	0.00	0.00
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	0.00	0.00
6	货币市场工具	0.00	0.00
7	银行存款和结算备付金合计	169,980,484.72	100.00
8	其他	2,122.92	0.00
	合计	169,982,607.64	100.00

注：

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。本报表“其他”项中列示的主要包括期货交易保证金、各类应收款等，具体情况见《其他资产构成报表》。

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	0.00	0.00
B	采矿业	0.00	0.00

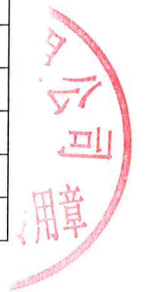
C	制造业	0.00	0.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	0.00	0.00
E	建筑业	0.00	0.00
F	批发和零售业	0.00	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	0.00	0.00
H	住宿和餐饮业	0.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	0.00	0.00
J	金融业	0.00	0.00
K	房地产业	0.00	0.00
L	租赁和商务服务业	0.00	0.00
M	科学研究和技术服务业	0.00	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	0.00	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	0.00	0.00
P	教育	0.00	0.00
Q	卫生和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

7.2.2、报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

金额单位：元

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

注：以上分类采用全球行业标准（GICS）。



附：其他资产构成报表

金额单位：元

序号	名称	金额
1	交易保证金	0.00
1.1	其中：期货交易保证金	0.00
2	应收证券清算款	0.00
3	应收股利	0.00
4	应收基金红利	0.00
5	应收利息	2,122.92
6	应收申购款	0.00
7	其他应收款	0.00
8	待摊费用	0.00
9	其他	0.00
10	合计	2,122.92