

兴证期货-兴场 FOF 一号集合资产管理计划

2021 年年度报告

1、基金产品概况

1.1 基金基本情况

基金名称	兴证期货-兴场 FOF 一号集合资产管理计划
基金编码	SGK186
基金运作方式	开放式
基金成立日期	2019 年 6 月 10 日
基金管理人	兴证期货有限公司
基金托管人（如有）	东方证券股份有限公司
投资顾问（如有）	无
期末基金总份额（万份）/ 期末基金实缴总额（万元）	2,082.853896
基金到期日期	2024 年 6 月 9 日

1.2 基金产品说明

投资目标	在投资期限内，积极获取各种投资收益，在严格控制风险的前提下，谋求委托资产的稳定增值。
投资策略	以定量和定性相结合的方式选择和组合子基金，通过多策略分散投资，在严格控制风险的情况下，实现 FOF 的稳健增值。从策略应呈现的风险收益特征出发，对子基金进行分类，然后根据既定目标进行 FOF 的资产配置。
业绩比较基准（如有）	无
风险收益特征	R3 中风险，适合专业投资者和风险承受能力为 C3、C4 和 C5 的普通投资者，并符合期货公司资产管理业务合格投资者相关标准。

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		兴证期货有限公司	东方证券股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	高梦颖	刘东海
	联系电话	021-20370902	021-53530913
	电子邮箱	gaomy@xzfutures.com	liudonghai@orientsec.com.cn
传真		-	021-63320039
注册地址		福建省福州市鼓楼区温泉街道湖东路 268 号 6 层兴业证券大厦	上海市中山南路 318 号 2 号楼 22 层、23 层、25-29 层

办公地址	上海市浦东新区长柳路 36 号兴业证券大厦 8 楼	上海市中山南路 318 号 2 号楼 3 楼
邮政编码	-	200010
法定代表人	孔祥杰	金文忠

1.4 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	-	-
注册登记机构	东方证券股份有限公司	上海市黄浦区中山南路 318 号 2 号楼
外包机构	东方证券股份有限公司	上海市黄浦区中山南路 318 号 2 号楼
-	-	-
-	-	-

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	2021 年	2020 年	2019 年
本期已实现收益	689,001.94	481,535.81	4,076.46
本期利润	197,112.69	657,296.76	108,710.55
期末数据和指标	2021 年末	2020 年末	2019 年末
期末可供分配利润	2,654,831.23	423,336.56	339.69
期末可供分配基金份额利润	0.1275	0.0512	0.0000
期末基金净资产	23,586,892.77	9,047,564.65	10,080,397.29
报告期期末单位净值	1.1324	1.0949	1.0110
累计期末指标	2021 年末	2020 年末	2019 年末
基金份额累计净值增长率(%)	13.24	9.49	1.10

√ 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	3.42	-	-	-
自基金合同生效起至今	13.24	-	-	-

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
2021	0.0000	0.00	0.00	0.00	-

2020	0.0000	0.00	0.00	0.00	-
2019	0.0000	0.00	0.00	0.00	-

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	826.35661
报告期期间基金总申购份额	1,779.142806
减：报告期期间基金总赎回份额	522.64552
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）	2,082.853896

4、管理人说明的其他情况

4.1 报告期内基金投资决策依据和业绩表现

本计划投资决策依据：以定量和定性相结合的方式选择和组合子基金，通过多策略分散投资，在严格控制风险的情况下，实现 FOF 的稳健增值。从策略应呈现的风险收益特征出发，对子基金进行分类，然后根据既定目标进行 FOF 的资产配置。截止 2021 年 12 月 31 日本基金期末基金单位净值为 1.1324 元，期末基金累计单位净值 1.1324 元。

4.2 投资经理

本计划投资经理为廉正，期货从业资格编码：F3054039，本计划本报告期内未发生变更。

投资经理从业经验：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。2011 年至 2015 年 9 月历任新湖期货有限公司研究所资深分析师、资产管理部投资经理、部门副经理；2015 年 9 月至 2018 年 11 月任西南期货有限公司资产管理部总经理兼投资经理；2018 年 11 月加盟兴证期货资产管理部。长期从事宏观经济、商品及大类资产配置研究和投资工作。

本计划投资经理符合法律法规规定的以下条件：

- （1）已取得从业资格；
- （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，本计划管理人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：高梦颖

服务电话：021-20370902

E-MAIL：gaomy@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 报告期末所投子基金和穿透后投资标的情况

所投子基金	穿透后主要投资标的
朋锦追光私募证券投资基金	期货
孝庸鲲鹏一号 1 期私募投资基金	期货
跃威佳成一号私募证券投资基金	期权
永泉奇点 7 号混合投资私募基金	期货
跃威权鑫一号私募证券投资基金	期权
国恩静静量化私募证券投资基金	股票
国恩回报 19 号私募证券投资基金	债券
凡二巴舍里耶量化对冲 6 期私募证券投资基金	股票
国恩回报 17 号私募证券投资基金	债券
正瀛实恒对冲一号私募基金	期货

4.7 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。

本计划报告期内管理人兴证期货有限公司自有资金按照不超过本计划总份额的 20% 参与、退出，另有一名从业人员参与申购本计划，公司自有资金及从业人员所持份额与投资者所持份额享有同等权益、承担同等风险。

公司将继续遵守相关法律法规要求，严格履行管理人职责。

5、 托管人报告（如有）

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

金额单位：元

6.1 资产负债表

资产	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	384,468.65	35,004.38
结算备付金	5,010.00	4,974.00
存出保证金	0.00	0.00
交易性金融资产	0.00	0.00
其中：股票投资	0.00	0.00
基金投资	0.00	0.00
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	1,890,547.26	1,000,000.00
应收利息	72.37	86.77
应收股利	0.00	0.00
应收申购款	0.00	0.00
递延所得税资产	0.00	0.00
其他资产	21,331,373.16	8,020,346.32
资产总计	23,611,471.44	9,060,411.47
负债和所有者权益	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
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	0.00
应付管理人报酬	20,482.19	10,710.60
应付托管费	2,048.24	1,068.11
应付销售服务费	0.00	0.00
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	2,048.24	1,068.11
负债合计	24,578.67	12,846.82
所有者权益:		
实收基金	20,828,342.88	8,263,370.02
未分配利润	2,758,549.89	784,194.63
所有者权益合计	23,586,892.77	9,047,564.65
负债和所有者权益总计	23,611,471.44	9,060,411.47

6.2 利润表

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
一、收入	259,813.09	713,958.16
1. 利息收入	4,722.05	1,838.19
其中: 存款利息收入	4,722.05	1,838.19
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)	690,426.44	382,063.12
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	-140.00	-20.00
股利收益	690,566.44	382,083.12
3. 公允价值变动收益(损失以“-”填列)	-491,889.25	175,760.95
4. 汇兑收益(损失以“-”填列)	0.00	0.00
5. 其他收入(损失以“-”填列)	56,553.85	154,295.90
减: 二、费用	62,700.40	56,661.40
1. 管理人报酬	49,063.64	44,066.20
其中: 固定管理费	49,063.64	44,066.20
业绩报酬	0.00	0.00
2. 托管费	4,906.38	4,394.60
3. 销售服务费	0.00	0.00
4. 外包服务费	4,906.38	4,394.60
5. 交易费用	24.00	6.00
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	3,800.00	3,800.00
三、利润总额	197,112.69	657,296.76

(亏损总额以“-”号填列)		
减：所得税费用	0.00	0.00
四、净利润 (净亏损以“-”号填列)	197,112.69	657,296.76

6.3 所有者权益变动表

项目	本期 2021年1月1日至2021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)	8,263,370.02	784,194.63	9,047,564.65
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	0	197,112.69	197,112.69
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)	12,564,972.86	1,777,242.57	14,342,215.43
其中：1. 基金申购款	17,791,428.06	2,308,571.94	20,100,000.00
2. 基金赎回款	-5,226,455.20	-531,329.37	-5,757,784.57
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	0.00	0.00
五、期末所有者权益(基金净值)	20,828,342.88	2,758,549.89	23,586,892.77
项目	上年度可比期间 2020年1月1日至2020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)	9,970,381.36	110,015.93	10,080,397.29
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	0	657,296.76	657,296.76
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)	-1,707,011.34	16,881.94	-1,690,129.40
其中：1. 基金申购款	3,303,055.33	296,944.67	3,600,000.00
2. 基金赎回款	-5,010,066.67	-280,062.73	-5,290,129.40
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	0.00	0.00
五、期末所有者权益(基金净值)	8,263,370.02	784,194.63	9,047,564.65

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	384,468.65

境内未上市、未挂牌公司股权投资	股权投资	-
	其中：优先股	-
	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	-
新三板投资	新三板挂牌企业投资	-
境内证券投资规模	结算备付金	5,010.00
	存出保证金	-
	股票投资	-
	债券投资	-
	其中：银行间市场债券	-
	其中：利率债	-
	其中：信用债	-
	资产支持证券	-
	基金投资（公募基金）	-
	其中：货币基金	-
	期货及衍生品交易保证金	-
	买入返售金融资产	-
	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	SGP100: 2632568.99; SL9129: 1706486.32; SLH988: 1194856.15; SLP822: 1086111.54; SLX125: 2607710.68; SNX988: 1692697.59; SSJ458: 3019047.62; SSU677: 4343921.45; STB619: 2085997.79; SY0679: 961975.03;
	未在协会备案的合伙企业份额	-
另类投资	另类投资	-
境内债权类投资	银行委托贷款规模	-
	信托贷款	-

	应收账款投资	-
	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	-
其他资产	其他资产	应收利息#72.37; 证券清算款#1890547.26;
基金负债情况	债券回购总额	-
	融资、融券总额	-
	其中：融券总额	-
	银行借款总额	-
	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	0.00	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（如有）

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
港股通	-	-

-	-	-
合计	-	-

信息披露报告是否经托管机构复核：是