

# 兴证期货-兴瑞量化 CTA2 号集合资产管理计划 2022 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-兴瑞量化 CTA2 号集合资产管理计划 |
| 基金编码                         | STQ184                   |
| 基金运作方式                       | 开放式                      |
| 基金成立日期                       | 2022 年 1 月 27 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）                     | -                        |
| 期末基金总份额（万份）/<br>期末基金实缴总额（万元） | 3,205.386891             |
| 基金到期日期                       | 2028 年 1 月 27 日          |

### 1.2 基金产品说明

|            |                                                              |
|------------|--------------------------------------------------------------|
| 投资目标       | 在投资期限内，在严格控制风险的前提下，力求委托财产的保值增值。                              |
| 投资策略       | 本资产管理计划以多策略、多品种、多周期的 CTA 策略为主，通过多策略分散投资。                     |
| 业绩比较基准（如有） | 本基金不设业绩比较基准。                                                 |
| 风险收益特征     | R4 中高风险，适合专业投资者和风险承受能力为 C4、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   | 林芷萱                              | 刘东海                                  |
|         | 联系电话 | 021-20370952                     | 021-53530913                         |
|         | 电子邮箱 | linzhixuan@xzfutures.com         | liudonghai@orientsec.com.cn          |
| 传真      |      | 021-20370952                     | 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    |      | 200001                           | 200010                               |
| 法定代表人   |      | 周峰                               | 金文忠                                  |

#### 1.4 信息披露方式

资产管理人向资产委托人提供的报告，将严格按照有关规定通过以下至少一种方式进行。资产委托人信息查询将通过以下至少一种中国证监会允许的、资管合同约定的方式进行。

##### 1、网站

定期报告、临时报告等有关本资产管理计划的信息将在资产管理人指定网站（<http://simu.yixinfund.com>）上披露，资产委托人可随时查阅。

##### 2、传真、电子邮件或手机短信等

如委托人办理资产管理计划认购、参与或退出等业务时留有传真号、电子邮箱、手机及电话号码等联系方式的，资产管理人也可通过传真、电子邮件、手机短信、电话、电报等方式将报告信息通知资产委托人。资产委托人上述联系方式若发生变更应当及时通知资产管理人。

#### 1.5 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        | 2022 年        | -年  | -年  |
|----------------|---------------|-----|-----|
| 本期已实现收益        | -2,226,803.16 | -   | -   |
| 本期利润           | -1,930,988.96 | -   | -   |
| 期末数据和指标        | 2022 年末       | -年末 | -年末 |
| 期末可供分配利润       | -3,425,755.10 | -   | -   |
| 期末可供分配基金份额利润   | -0.1069       | -   | -   |
| 期末基金净资产        | 29,242,137.78 | -   | -   |
| 报告期期末单位净值      | 0.9123        | -   | -   |
| 累计期末指标         | 2022 年末       | -年末 | -年末 |
| 基金份额累计净值增长率（%） | -8.77         | -   | -   |

√ 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             | -8.77 | - | - | - |
| 自基金合同<br>生效起至今 | -8.77 | - | - | - |

### 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<br>数 | 现金形式发放<br>总额 | 再投资形式发<br>放总额 | 年度利润分<br>配合计 | 备注 |
|------|---------------|--------------|---------------|--------------|----|
| 2022 | 0.0000        | 0.00         | 0.00          | 0.00         | -  |
| 2021 | 0.0000        | 0.00         | 0.00          | 0.00         | -  |
| 2020 | 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               | 1,160.027167 |
| 报告期期间基金总申购份额              | 2,405.32774  |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 359.968016   |
| 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）  | 3,205.386891 |

### 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：本资产管理计划以多策略、多品种、多周期的 CTA 策略为主，通过多策略分散投资。截止 2022 年 12 月 31 日本基金期末基金单位净值为 0.9123 元，期末基金累计单位净值 0.9123 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：蔡培

服务电话：021-20370953

E-MAIL: caipei@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

本报告期内，本计划于 2022 年 12 月 16 日开放，此次开放期内，公司管理的兴证期货-兴珑厦担 FOF 集合资产管理计划申购 435 万元参与本计划。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。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，未发现明显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 2022 年 12 月 31 日 | 上年度末- |
|-----------|----------------------|-------|
| 资产:       |                      |       |
| 银行存款      | 95,263.48            | -     |
| 结算备付金     | 23,652,005.70        | -     |
| 存出保证金     | 2,564,466.10         | -     |
| 交易性金融资产   | 3,000,000.00         | -     |
| 其中: 股票投资  | 0.00                 | -     |
| 基金投资      | 3,000,000.00         | -     |
| 债券投资      | 0.00                 | -     |
| 资产支持证券投资  | 0.00                 | -     |
| 贵金属投资     | 0.00                 | -     |
| 衍生金融资产    | 0.00                 | -     |
| 买入返售金融资产  | 0.00                 | -     |
| 应收证券清算款   | 0.00                 | -     |
| 应收利息      | 0.00                 | -     |
| 应收股利      | 270.90               | -     |
| 应收申购款     | 0.00                 | -     |
| 递延所得税资产   | 0.00                 | -     |
| 其他资产      | 0.00                 | -     |
| 资产总计      | 29,312,006.18        | -     |
| 负债和所有者权益  | 本期末 2022 年 12 月 31 日 | 上年度末- |
| 负债:       |                      |       |
| 短期借款      | 0.00                 | -     |
| 交易性金融负债   | 0.00                 | -     |
| 衍生金融负债    | 0.00                 | -     |
| 卖出回购金融资产款 | 0.00                 | -     |
| 应付证券清算款   | 0.00                 | -     |
| 应付赎回款     | 0.00                 | -     |
| 应付管理人报酬   | 66,662.66            | -     |
| 应付托管费     | 1,602.87             | -     |
| 应付销售服务费   | 0.00                 | -     |
| 应付交易费用    | 0.00                 | -     |
| 应交税费      | 0.00                 | -     |
| 应付利息      | 0.00                 | -     |
| 应付利润      | 0.00                 | -     |
| 递延所得税负债   | 0.00                 | -     |
| 其他负债      | 1,602.87             | -     |
| 负债合计      | 69,868.40            | -     |
| 所有者权益:    |                      |       |
| 实收基金      | 32,053,868.91        | -     |
| 未分配利润     | -2,811,731.13        | -     |

|            |               |   |
|------------|---------------|---|
| 所有者权益合计    | 29,242,137.78 | - |
| 负债和所有者权益总计 | 29,312,006.18 | - |

#### 6.2 利润表

| 项目                    | 本期                         | 上年度可比期间 |
|-----------------------|----------------------------|---------|
|                       | 2022年1月27日至<br>2022年12月31日 | - 至 -   |
| 一、收入                  | -1,636,546.97              | -       |
| 1. 利息收入               | 21,637.76                  | -       |
| 其中：存款利息收入             | 21,637.76                  | -       |
| 债券利息收入                | 0.00                       | -       |
| 资产支持证券利息收入            | 0.00                       | -       |
| 买入返售金融资产收入            | 0.00                       | -       |
| 其他利息收入                | 0.00                       | -       |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）     | -1,953,493.30              | -       |
| 其中：股票投资收益             | 0.00                       | -       |
| 基金投资收益                | 0.00                       | -       |
| 债券投资收益                | 0.00                       | -       |
| 资产支持证券投资收益            | 0.00                       | -       |
| 贵金属投资收益               | 0.00                       | -       |
| 衍生工具收益                | -1,953,764.20              | -       |
| 股利收益                  | 270.90                     | -       |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”填列） | 295,814.20                 | -       |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”填列）     | 0.00                       | -       |
| 5. 其他收入（损失以“-”填列）     | -505.63                    | -       |
| 减：二、费用                | 294,441.99                 | -       |
| 1. 管理人报酬              | 188,132.24                 | -       |
| 其中：固定管理费              | 185,582.24                 | -       |
| 业绩报酬                  | 2,550.00                   | -       |
| 2. 托管费                | 4,639.72                   | -       |
| 3. 销售服务费              | 0.00                       | -       |
| 4. 外包服务费              | 4,639.72                   | -       |
| 5. 交易费用               | 96,969.64                  | -       |
| 6. 利息支出               | 0.00                       | -       |
| 其中：卖出回购金融资产支出         | 0.00                       | -       |
| 7. 其他费用               | 60.67                      | -       |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）   | -1,930,988.96              | -       |
| 减：所得税费用               | 0.00                       | -       |
| 四、净利润                 | -1,930,988.96              | -       |

|              |  |  |
|--------------|--|--|
| (净亏损以“-”号填列) |  |  |
|--------------|--|--|

### 6.3 所有者权益变动表

| 项目                                     | 本期<br>2022年1月27日至2022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）                        | 11,600,271.67                | 0.00          | 11,600,271.67 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | 0                            | -1,930,988.96 | -1,930,988.96 |
| 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）      | 20,453,597.24                | -880,742.17   | 19,572,855.07 |
| 其中：1. 基金申购款                            | 24,053,277.40                | -1,003,277.40 | 23,050,000.00 |
| 2. 基金赎回款                               | -3,599,680.16                | 122,535.23    | -3,477,144.93 |
| 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）                        | 32,053,868.91                | -2,811,731.13 | 29,242,137.78 |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>- 至 -             |               |               |
|                                        | 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）                        | -                            | -             | -             |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                            | -             | -             |
| 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）      | -                            | -             | -             |
| 其中：1. 基金申购款                            | -                            | -             | -             |
| 2. 基金赎回款                               | -                            | -             | -             |
| 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） | -                            | -             | -             |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | -                            | -             | -             |

## 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              | 95,263.48     |
| 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             | 23,652,005.70 |
|                 | 存出保证金             | 2,564,466.10  |
|                 | 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）        | 3,000,000.00  |
|                 | 其中：货币基金           | 3,000,000.00  |
|                 | 期货及衍生品交易保证金       | 2,564,466.10  |
|                 | 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          | -             |
|                 | 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    | 应收股利 270.90; |
| 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  | 0.00      | 0.00          |
| -    | -         | -             |
| 合计   | 0.00      | 0.00          |

## 8、信息披露报告

信息披露报告是否经托管机构复核：是

