

兴证期货-兴享添利 3 号单一资产管理计划 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-兴享添利 3 号单一资产管理计划
基金编码	SVE684
基金运作方式	开放式
基金成立日期	2022 年 3 月 4 日
基金管理人	兴证期货有限公司
基金托管人（如有）	宁波银行股份有限公司
投资顾问（如有）	上海元康投资管理有限公司
期末基金总份额（万份）/ 期末基金实缴总额（万元）	1,500.090027
基金到期日期	2032 年 3 月 4 日

1.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制投资组合风险的前提下，积极配置优质债券、合理安排组合期限，力争获取稳健的收益。
投资策略	1、固定收益投资策略：在追求流动性、低风险和稳定收益的前提下，进行积极的固定收益投资组合管理，以提高计划资产的运用效率； 2、现金管理策略：通过存款，债券逆回购，货币基金等方式对闲散资金进行现金管理；
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	本计划属预期风险等级【R3】级的投资品种，适合具有【C3 及以上】级别风险识别、评估、承受能力的合格投资者。

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	宁波银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	林芷萱	朱广科
	联系电话	021-20370952	0574-87050338
	电子邮箱	linzhixuan@xzfutures.com	custody-audit@ncbc.cn
传真		021-20370952	0574-89103213
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	中国浙江宁波市鄞州区宁东路 345 号

办公地址	上海市浦东新区长柳路 36 号兴业证券大厦 8 楼	中国浙江宁波市鄞州区宁东路 345 号
邮政编码	200001	315100
法定代表人	周峰	陆华裕

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	174,384.34	-	-
本期利润	148,927.84	-	-
期末数据和指标	2022 年末	-年末	-年末
期末可供分配利润	148,027.57	-	-
期末可供分配基金份额利润	0.0099	-	-
期末基金净资产	15,148,927.84	-	-
报告期末单位净值	1.0099	-	-
累计期末指标	2022 年末	-年末	-年末
基金份额累计净值增长率（%）	0.99	-	-

√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	0.99	-	-	-
自基金合同 生效起至今	0.99	-	-	-

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
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	1,200
报告期期间基金总申购份额	300.090027
减：报告期期间基金总赎回份额	0
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）	1,500.090027

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：1、固定收益投资策略：在追求流动性、低风险和稳定收益的前提下，进行积极的固定收益投资组合管理，以提高计划资产的运用效率；2、现金管理策略：通过存款，债券逆回购，货币基金等方式对闲散资金进行现金管理。截止 2022 年 12 月 31 日本基金期末基金单位净值为 1.0099 元，期末基金累计单位净值 1.0099 元。

4.2 投资经理及投资顾问的指定

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。

本计划投资经理邢敏，期货从业资格编码：F03087819，本计划本报告期内未发生变更。

投资经理从业经验：材料物理学与金融学双学士，现任兴证期货资产管理部投资经理。有

六年的债券固收投资交易经验，2017 年 7 月至 2021 年 6 月在领睿资产管理公司任交易部副总经理、投资经理，2021 年 7 月加入兴证期货资管部。

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。

本计划投资顾问为上海元康投资管理有限公司，在本计划运作期间，投资顾问勤勉尽责为本计划提供投资建议，与我司不存在利益输送及其他不合规行为。投资顾问为满足以下条件的私募证券投资基金管理人：

- (1) 在证券投资基金业协会登记满 1 年、无重大违法违规记录的会员；
- (2) 具备 3 年以上连续可追溯证券、期货投资管理业绩且无不良从业记录的投资管理人员不少于 3 人；
- (3) 中国证监会规定的其他条件。

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。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合规守信、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	45,161.29	-
结算备付金	8,151,021.47	-
存出保证金	3,158,471.45	-
交易性金融资产	11,821,550.29	-
其中：股票投资	0.00	-
基金投资	0.00	-
债券投资	11,821,550.29	-
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	0.00	-
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	23,176,204.50	-
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	3,820.76	-
应付托管费	955.21	-
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	8,022,500.69	-
负债合计	8,027,276.66	-
所有者权益：		
实收基金	15,000,900.27	-
未分配利润	148,027.57	-
所有者权益合计	15,148,927.84	-
负债和所有者权益总计	23,176,204.50	-

6.2 利润表

项目	本期	上年度可比期间
	2022年3月4日至 2022年12月31日	- 至 -
一、收入	249,586.08	-
1. 利息收入	277,286.99	-
其中：存款利息收入	2,571.47	-
债券利息收入	168,726.68	-
资产支持证券利息收入	0.00	-
买入返售金融资产收入	222.35	-
其他利息收入	105,766.49	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	-2,241.50	-
其中：股票投资收益	0.00	-
基金投资收益	0.00	-
债券投资收益	558.50	-
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	-2,800.00	-
股利收益	0.00	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”填列）	-25,456.50	-
4. 汇兑收益（损失以“-”填列）	0.00	-

5. 其他收入（损失以“-”填列）	-2.91	-
减：二、费用	100,658.24	-
1. 管理人报酬	12,309.96	-
其中：固定管理费	12,309.96	-
业绩报酬	0.00	-
2. 托管费	3,077.51	-
3. 销售服务费	0.00	-
4. 外包服务费	3,077.51	-
5. 交易费用	18,344.53	-
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	63,848.73	-
三、利润总额 （亏损总额以“-”号填列）	148,927.84	-
减：所得税费用	0.00	-
四、净利润 （净亏损以“-”号填列）	148,927.84	-

6.3 所有者权益变动表

项目	本期 2022年3月4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）	12,000,000.00	0.00	12,000,000.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	0	148,927.84	148,927.84
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）	3,000,900.27	-900.27	3,000,000.00
其中：1. 基金申购款	3,000,900.27	-900.27	3,000,000.00
2. 基金赎回款	0.00	0.00	0.00
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）	15,000,900.27	148,027.57	15,148,927.84
项目	上年度可比期间 - 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	45,161.29
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	8,547,157.72
	存出保证金	2,762,335.20
	股票投资	-
	债券投资	11,821,550.29
	其中：银行间市场债券	10,192,150.68
	其中：利率债	11,821,550.29
	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	2,762,335.20
	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	-
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

序号	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
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： -