

兴证期货满亿 1 号单一资产管理计划

2024 年年度报告

产品管理人：兴证期货有限公司

产品托管人：上海银行股份有限公司

§ 1 重要提示

产品管理人保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

产品托管人上海银行股份有限公司根据本产品合同规定，于 2025 年 3 月复核了本报告中的收益表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

产品管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用产品资产，但不保证产品一定盈利。

产品的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本产品的募集说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 01 月 01 日至 12 月 31 日止。

§ 2 产品概况

2.1 产品基本情况

产品名称	兴证期货满亿 1 号单一资产管理计划
产品编码	SB8567
投资及销售币种	人民币
产品运作类型	开放式
产品成立日	2023 年 8 月 4 日
产品到期日	2026 年 8 月 3 日
报告期末资产管理计划份额总额（份额）	2,392,320.1300
投资目标	本资产管理计划追求在有效控制风险的前提下谋求资产的稳健增值。
投资策略	以定量和定性相结合的方式选择标的，在严格控制风险的情况下，实现稳健增值。
业绩比较基准（若有）	无
风险收益特征（若有）	基于本计划的投资范围及投资策略，本计划不承诺保本及最低收益，资产管理计划风险收益特征界定为[R2]级别的产品，适合专业委托人或普通委托人中[C2、C3、C4、C5]的委托人认购。

§ 3 产品净值表现

3.1 期末净值数据

单位：人民币元

主要财务指标	报告期末(2024 年 12 月 31 日)
1. 本期已实现收益	10,893,268.23

2. 本期利润	10,893,268.23
3. 期末资产净值	2,791,450.28
4. 期末份额净值	1.1668
5. 期末份额累计净值	1.1668

注：本期已实现收益=本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额

3.2 本报告期产品净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	11.26	0.31	-	-

§ 4 年度财务报表

4.1 资产负债表

单位：元

一、资产：	本期末 （2024 年 12 月 31 日）	上年度末 （2023 年 12 月 31 日）	二、负债：	本期末 （2024 年 12 月 31 日）	上年度末 （2023 年 12 月 31 日）
银行存款	0.72	1,001,286.30	短期借款	-	-
结算备付金	2,975,689.00	195,913.01	交易性金融负债	-	-
存出保证金	-	-	衍生金融负债	-	-
交易性金融资产	-	-	卖出回购金融资产款	-	-
其中：股票投资	-	-	应付证券清算款	-	-
债券投资	-	-	应付赎回款	-	-
资产支持证券	-	-	应付赎回费	-	-
基金投资	-	-	应付管理人报酬	153,462.81	124,181.02
衍生金融资产	-	-	应付托管费	29,237.82	23,594.43
买入返售金融资产	-	-	应付行管费	1,538.81	1,241.81
发放贷款和垫款	-	-	应付销售服务费	-	-
债权投资	-	-	应付交易	-	-

			费用		
应收证券清算款	-	-	应付税费	-	-
应收利息	-	-	应付利息	-	-
应收股利	-	-	应付利润	-	-
应收申购款	-	-	应付客户服务费	-	-
其他资产	-	-	其他负债	-	-
-	-	-	负债合计	184,239.44	149,017.26
-	-	-	实收基金	2,392,320.13	999,542.08
-	-	-	其他综合收益	-	-
-	-	-	未分配利润	399,130.15	48,639.97
-	-	-	所有者权益合计	2,791,450.28	1,048,182.05
资产总计：	2,975,689.72	1,197,199.31	负债与持有人权益总计：	2,975,689.72	1,197,199.31

4.2 利润表

单位：元

项目	本期 (2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日)	上年度可比区间 (2023 年 8 月 4 日 (基金合同生效日) 至 2023 年 12 月 31 日)
一、收入	11,612,399.70	2,594,708.98
1、利息收入	11,612,399.70	2,594,708.98
存款利息收入	11,612,399.70	2,594,708.98
债券利息收入	-	-
其中：资产支持证券利息收入	-	-
存款投资利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	-
其他利息收入	-	-
2、投资收益（损失以“-”填列）	-	-
股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-
其中：资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	-	-
投资收益_差价收入_增值税抵扣	-	-

其他投资收益	-	-
3、公允价值变动损益（损失以“-”填列）	-	-
4、汇兑收益（损失以“-”填列）	-	-
5、其他收入（损失以“-”填列）	-	-
二、费用	719,131.47	153,624.15
1、管理人报酬	599,002.76	128,020.07
2、托管费	114,122.37	24,324.03
3、销售服务费	-	-
4、行政管理费	6,006.34	1,280.05
5、受托费	-	-
6、运营服务费	-	-
7、投资顾问费	-	-
8、交易费用	-	-
9、利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
10、信用减值损失	-	-
11、税金及附加	-	-
12、其他费用	-	-
三、利润总额（亏损总额以“-”填列）	10,893,268.23	2,441,084.83
四、净利润（净亏损以“-”填列）	10,893,268.23	2,441,084.83
五、其他综合收益的税后净额	-	-
六、综合收益总额	10,893,268.23	2,441,084.83

4.3 所有者权益变动表

单位：人民币元

项目	本报告期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日			
	实收资金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末余额	999,542.08	-	48,639.97	1,048,182.05
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初余额	999,542.08	-	48,639.97	1,048,182.05
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	1,392,778.05	-	350,490.18	1,743,268.23
（一）、综合收益总额	-	-	10,893,268.23	10,893,268.23
（二）、产品持有人申购和赎回	1,392,778.05	-	-10,542,778.05	-9,150,000.00
其中：产品申购	148,853,784,576.65	-	15,044,215,423.35	163,898,000,000.00
产品赎回	-148,852,391,798.60	-	-15,054,758,201.40	-163,907,150,000.00
（三）、利润分配	-	-	-	-

（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末余额	2,392,320.13	-	399,130.15	2,791,450.28

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占产品总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	基金投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	2,975,689.72	100.00
7	其他资产	-	-
8	合计	2,975,689.72	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。

§ 6 基金份额变动情况

单位：份

报告期期初基金份额总额	999,542.0800
报告期期间基金总申购份额	148,853,784,576.6500
减：报告期期间基金总赎回份额	148,852,391,798.6000
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	2,392,320.1300

注：如为分级基金，应按级别分别列示。

§ 7 基金费用发生情况

7.1 管理费

单位：人民币元

项目	报告期 (2024 年 1 月 1 日-2024 年 12 月 31 日)
当期计提的管理费	599,002.76
当期支付的管理费	569,720.97

。

7.2 托管费

单位：人民币元

项目	报告期 (2024 年 1 月 1 日-2024 年 12 月 31 日)
当期计提的托管费	114,122.37
当期支付的托管费	108,478.98

。

§ 8 收益分配

本报告期内，本计划未发生收益分配。

§ 9 管理人报告

9.1 产品经理简介

本计划投资经理廉正，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。

9.2 报告期内产品的投资策略和运作分析

本计划以定量和定性相结合的方式选择标的，在严格控制风险的情况下，实现稳健增值。截止 2024 年 12 月 31 日，本计划单位净值为 1.1668 元，累计单位净值 1.1668 元。

§ 10 托管报告

本报告期内，上海银行股份有限公司作为兴证期货满亿 1 号单一资产管理计划的托管人，根据《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》有关要求以及本计划法律性文件的相关约定，托管人对管理人编制的《兴证期货满亿 1 号单一资产管理计划 2024 年年度报告》的财务指标、净值表现、投资组合报告等财务数据进行了复核，认为上述内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 11 重要事项提示

本资产管理计划的管理人及托管人在本报告期内没有发生涉及本资产管理计划管理、财产、托管业务的重大诉讼事项。

- 2、本报告期内资产管理计划的投资组合策略没有重大改变。
- 3、本资产管理计划的管理人、托管人涉及托管业务机构及其高级管理人员没有受到任何处罚。
- 4、报告期内本资产管理计划投资经理发生变更的说明。

自 2024 年 6 月 6 日起，本资产管理计划投资经理邢敏离任，由原共同管理的其他投资经理廉正继续管理。

- 5、重大关联交易状况

无