

大越期货 1 号资产管理计划 2018 年年度报告

1、基金产品概况

1.1 基金基本情况

基金名称	大越期货 1 号资产管理计划
基金编号	S68999
基金运作方式	开放式
基金成立日期	2015 年 08 月 26 日
基金管理人	大越期货股份有限公司
基金托管人	宁波银行股份有限公司
投资顾问（如有）	无
报告期末基金份额总额（份）	23089554.19
基金到期日期	2025/8/25

1.2 基金产品说明

投资目标	采用主观交易的方式，通过多策略组合，多市场的配置，在控制风险的基础上（策略以对冲，趋势交易为主），力争资产的长期稳定增值。
投资策略	期货投资策略将结合主观、客观策略，在相对价格、绝对价格运行中积极寻找交易机会。对趋势、套利、对冲、量化不同交易模型进行分头寸分配，实现多策略、多品种、做周期的操作模式。 固定收益投资策略将通过自上而下的宏观研究和自下而上的个券研究，进行积极投资及合理的资产配置，在有效控制风险的前提下，深入挖掘债券的投资价值。同时辅以封闭式基金套利等策略，实现资产的稳定增值。
业绩比较基准	无
风险收益特征	R3

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	大越期货股份有限公司	宁波银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	王雅萍
	联系电话	0575-85201502
	电子邮箱	wangyaping@dyqh.info
传真	0575-85127511	wanghaiyan@nbc.cn
注册地址	浙江省绍兴市越城区解放北路 186 号 7 楼	0574-89103213
办公地址	中国浙江宁波市鄞州区宁东路 345 号	浙江省绍兴市越城区解放北
	中国浙江宁波市鄞州区宁东	

	路 186 号 7 楼	路 345 号
邮政编码	312000	315100
法定代表人	徐丽莉	陆华裕

1.4 信息披露方式

短信

1.5 其他相关资料（如有）

项目	名称	办公地址
会计师事务所		
注册登记机构	宁波银行股份有限公司	中国浙江宁波市鄞州区宁东路 345 号
外包机构	宁波银行股份有限公司	中国浙江宁波市鄞州区宁东路 345 号
-	-	-

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	2018 年
本期已实现收益	776870.75
本期利润	1273088.26
期末数据和指标	2018 年末
期末可供分配利润	1160806.87
期末可供分配基金份额利润	0.0503
期末基金资产净值	24758987.26
期末基金份额净值	1.0723
累计期末指标	2018 年末
基金份额累计净值增长率	0.0513

备注：

-

注：如为分级基金，应按级别分别列示。

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	5.13	-	-	-
自基金合同生效起至今	28.60	-	-	-

备注：

-

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

如为分级基金，应按级别分别列示。

表中指标均以不带百分号数值形式填写，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
2018 年	0.0034	141067.53	0.00	141067.53	-
2017 年	0.1397	5078771.46	0.00	5078771.46	-
2016 年	0.0636	2226881.39	0.00	2226881.39	-

备注：

-

如为分级基金，应按级别分别列示。

3、基金份额变动情况

单位：份

报告期期初基金份额总额	41668164.42
报告期期间基金总申购份额	-
减：报告期期间基金总赎回份额	18578610.23
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	23089554.19

备注：

-

如为分级基金，应按级别分别列示。

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

无

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

在本报告期内，本托管人在大越期货 1 号资产管理计划的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》、资产管理合同和其他有关规定，不存在损害委托人利益的行为，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

本报告期内，本托管人按照国家有关规定、资产管理合同和其他有关规定，对委托资产净值计算、费用开支等方面进行了认真的复核，对委托资产的投资运作方面进行了监督，未发现管理人有关损害委托人利益的行为。

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

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

6、年度财务报表

金额单位：元

6.1 资产负债表

资产	2018/12/31
资产：	
银行存款	166.58
结算备付金	12968105.73
存出保证金	2641752.00
交易性金融资产	8720777.28
其中：股票投资	211970.00
基金投资	5563183.58
债券投资	2945623.70
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	400004.00
应收证券清算款	0.00
应收利息	111245.13
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	87740.40
资产总计	24929791.12
负债和所有者权益	2018-12-31
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	152300.67
应付托管费	8461.16
应付销售服务费	8461.16
应付交易费用	0.00
应交税费	1580.87
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	0.00
负债合计	170803.86
所有者权益：	本期末：
实收基金	23089554.19
未分配利润	1669433.07
所有者权益合计	24758987.26
负债和所有者权益总计	24929791.12

备注：

-

6.2 利润表

项目	本期
	2018/01/01 至 2018/12/31
一、收入	2241304.10
1. 利息收入	295396.88
其中：存款利息收入	953.38
债券利息收入	287392.58
资产支持证券利息收入	0.00
买入返售金融资产收入	7050.92
其他利息收入	0.00
2. 投资收益（损失以“-”填列）	1449689.71
其中：股票投资收益	-103487.52
基金投资收益	-96576.14
债券投资收益	-163835.60
资产支持证券投资收益	0.00
基金红利收益	94760.34
衍生工具收益	1714935.80
股利收益	3892.83
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	496217.51

4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	0.00
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	0.00
减：二、费用	968215.84
1. 管理人报酬	687673.91
其中：固定管理费	0.00
业绩报酬	0.00
2. 托管费	36450.16
3. 销售服务费	0.00
4. 外包服务费	36450.16
5. 交易费用	186835.58
6. 利息支出	18334.85
其中：卖出回购金融资产支出	18334.85
7. 其他费用	2471.18
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	1273088.26
减：所得税费用	0
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	1273088.26

备注：

-

6.3 所有者权益变动表

项目	本期 2018/01/01 至 2018/12/31		
	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）	41668164.42	537412.34	42205576.76
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	0.00	1273088.26	1273088.26
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）	-18578610.23	0.00	-18578610.23
其中：1. 基金申购款	0.00	0.00	0.00
2. 基金赎回款	18578610.23	0.00	18578610.23
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	-141067.53	-141067.53
五、期末所有者权益（基金净值）	23089554.19	1669433.07	24758987.26

备注：

-

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	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	211970.00	0.85
	其中：普通股	211970.00	0.85
	存托凭证	0.00	0.00
2	基金投资	5563183.58	22.32
3	固定收益投资	2945623.70	11.82
	其中：债券	2945623.70	11.82
	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	0.00
	期权	0.00	0.00
	权证	0.00	0.00
5	买入返售金融资产	400004.00	1.60
	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	15610024.31	62.62
8	其他各项资产	198985.53	0.80
	合计	24929791.12	100.00

备注：

-

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合(不含港股通)

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	118570.00	0.48
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	55600.00	0.22
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	37800.00	0.15
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	211970.00	0.86

备注：

—

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	占基金资产净值比例（%）
港股通	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

备注：

—

信息披露报告是否经托管机构复核：

是