大越期货海赢一号集合资产管理计划2019年年度报告

1、基金产品概况

1.1 基金基本情况

基金名称	大越期货海赢一号集合资产管理计划
基金编号	SJD232
基金运作方式	开放式
基金成立日期	2019-11-01
基金管理人	大越期货股份有限公司
基金托管人	海通证券股份有限公司
投资顾问（如有）	无
报告期末基金份额总额（份）	20,000,682.50
基金到期日期	2029-10-31

1.2 基金产品说明

投资目标	本计划在严格控制投资风险的前提下，追求资产的长期、持续、稳定增值，努力为投资者实现有吸引力的回报。
投资策略	本计划投资根据各阶段对市场、可投资品种及其他相关条件的综合判断，确定相应投资策略和构建投资组合。主要投资策略包括固定收益类策略、现金管理类策略、套利对冲策略、股票策略、期货策略、期权策略等。通过配置各类策略，达到分散风险、平滑收益的效果。
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	海通证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	王雅萍	邓来承
	联系电话	0575-85201502	021-23212375
	电子邮箱	wangyaping@dyqh.info	dlc11913@htsec.com
传真		0575-85127511	021-63410637
注册地址		浙江省绍兴市越城区解放北路186号7楼	上海市黄浦区广东路689号
办公地址		浙江省绍兴市越城区解放北路186号7楼	上海市黄浦区广东路689号
邮政编码		312000	200001
法定代表人		徐丽莉	周杰

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	海通证券股份有限公司	上海市黄浦区广东路 689 号
外包机构	海通证券股份有限公司	上海市黄浦区广东路 689 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	2019 年	2018 年	2017 年
本期已实现收益	-448,322.66	0.00	0.00
本期利润	-171,685.63	0.00	0.00
期末数据和指标	2019 年末	2018 年末	2017 年末
期末可供分配利润	-448,322.66	0.00	0.00
期末可供分配基金份额利润	-0.0224	0.00	0.00
期末基金资产净值	19,828,314.37	0.00	0.00
期末基金份额净值	0.9914	0.00	0.00
累计期末指标	2019 年末	2018 年末	2017 年末
基金份额累计净值增长率	-0.86%	0.00	0.00

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	-0.86	-	-	-
自基金合同生效起至今	-0.86	-	-	-

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
2019 年	0.00	0.00	0.00	0.00	-
2018 年	0.00	0.00	0.00	0.00	-
2017 年	0.00	0.00	0.00	0.00	-

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	20,000,682.50
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	-
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	20,000,682.50

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

本年度，海通证券股份有限公司作为本基金托管人依据有关法律法规与基金合同，托管本基金资产。

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

本年度，海通证券股份有限公司对管理人的投资运作行为按合同约定进行监督，未发现存在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

海通证券股份有限公司复核了基金本年度管理报告中的有关财务数据部分，内容真实、准确、完整。

6、年度财务报表

金额单位：元

6.1 资产负债表

资产	2019-12-31	2018-12-31
资产：		
银行存款	2,127.34	0.00
结算备付金	7,827,919.18	0.00
存出保证金	2,123,140.20	0.00
交易性金融资产	9,935,535.92	0.00
其中：股票投资	397,106.00	0.00
基金投资	9,532,429.92	0.00
债券投资	6,000.00	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	0.00	0.00
应收利息	1.85	0.00
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	0.00	0.00
资产总计	19,888,724.49	0.00
负债和所有者权益		
负债：	**本期末：**	**上年度末：**
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	50,384.06	0.00
应付托管费	1,679.49	0.00
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	6,667.08	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	1,679.49	0.00
负债合计	60,410.12	0.00
所有者权益：	**本期末：**	**上年度末：**
实收基金	20,000,000.00	0.00
未分配利润	-171,685.63	0.00
所有者权益合计	19,828,314.37	0.00
负债和所有者权益总计	19,888,724.49	0.00

备注：

-

6.2 利润表

项目	本期			上年度可比期间		
	2019-01-01	至	2019-12-31	2018-01-01	至	2018-12-31
一、收入	-101,991.35			0.00		
1.利息收入	5,902.78			0.00		
其中：存款利息收入	1,738.74			0.00		
债券利息收入	0.81			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	4,163.23			0.00		
其他利息收入	0.00			0.00		
2.投资收益（损失以“-”填列）	-385,978.82			0.00		
其中：股票投资收益	-873.90			0.00		
基金投资收益	154,696.08			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		
基金红利收益	0.00			0.00		
衍生工具收益	-555,255.00			0.00		
股利收益	15,454.00			0.00		
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	277,351.36			0.00		
4.汇兑收益（损失以“－”号填列）	0.00			0.00		
5.其他收入（损失以“-”号填列）	733.33			0.00		
减：二、费用	69,694.28			0.00		
1．管理人报酬	50,384.06			0.00		

其中：固定管理费	50,384.06	0.00
业绩报酬	0.00	0.00
2. 托管费	1,706.89	0.00
3. 销售服务费	0.00	0.00
4. 外包服务费	1,652.09	0.00
5. 交易费用	14,480.91	0.00
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	1,470.33	0.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-171,685.63	0.00
减：所得税费用	0.00	0.00
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-171,685.63	0.00

备注：

-

6.3 所有者权益变动表

项目	本期 2019-01-01 至 2019-12-31		
	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）	20,000,000.00	0.00	20,000,000.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	0.00	-171,685.63	-171,685.63
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）	0.00	0.00	0.00
其中：1.基金申购款	0.00	0.00	0.00
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）	0.00	0.00	0.00
五、期末所有者权益（基金净值）	20,000,000.00	-171,685.63	19,828,314.37
项目	**上年度可比期间 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）	0.00	0.00	0.00
二、本期经营活动产	0.00	0.00	0.00

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）	0.00	0.00	0.00
其中：1.基金申购款	0.00	0.00	0.00
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）	0.00	0.00	0.00
五、期末所有者权益（基金净值）	0.00	0.00	0.00

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	397,106.00	2.00
	其中：普通股	397,106.00	2.00
	存托凭证	0.00	0.00
2	基金投资	9,532,429.92	47.93
3	固定收益投资	6,000.00	0.03
	其中：债券	6,000.00	0.03
	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	0.00	0.00
	期权	0.00	0.00
	权证	0.00	0.00
5	买入返售金融资产	0.00	0.00
	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	7,830,046.52	39.37
8	其他各项资产	2,123,142.05	10.68
	合计	19,888,724.49	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	239,130.00	1.21
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	126,401.00	0.64
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	31,575.00	0.16
R	文化、体育和娱乐业	0.00	0.00
S	综合	0.00	0.00
	合计	397,106.00	2.00

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