

大越期货精选FOF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	大越期货精选 FOF 集合资产管理计划
基金编码	SVE376
基金运作方式	开放式
基金成立日期	2022-03-08
基金管理人	大越期货股份有限公司
基金托管人（如有）	海通证券股份有限公司
投资顾问（如有）	无
期末基金总份额（万份）/期末基金实缴总额（万元）	1,520.804973
基金到期日期	2027-03-07

1.2 基金产品说明

投资目标	通过将基金投资者投入的资金加以集合运用，对资产进行专业化的管理和运用，谋求资产的稳定增值
投资策略	通过投资接受国务院金融监督管理机构监管发行的资产管理产品（包括私募基金）来获得稳健收益
业绩比较基准（如有）	无
风险收益特征	中风险，中收益

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

管理人网站、短信

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	-	-
外包机构	海通证券股份有限公司	上海市广东路 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

金额单位：元

期间数据和指标	2022 年	2021 年	2020 年
本期已实现收益	749,741.13	0	0
本期利润	-337,828.96	0	0
期末数据和指标	2022 年末	2021 年末	2020 年末
期末可供分配利润	-337,835.29	0	0
期末可供分配基金份额利润	-0.0222	0	0
期末基金净资产	14,870,214.44	0	0
报告期末单位净值	0.9778	0	0
累计期末指标	2022 年末	2021 年末	2020 年末
基金份额累计净值增长率	-2.22%	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	-2.22	0.00	0.00	0.00
自基金合同生效起至今	-2.22	0.00	0.00	0.00

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
2022	0	0	0	0	-
2021	0	0	0	0	-
2020	0	0	0	0	-

备注：

-

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：万份/万元

报告期期初基金份额总额	1,520.012666
报告期期间基金总申购份额	1,000.800640
减：报告期期间基金总赎回份额	1,000.008333
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	0.000000
期末基金总份额/期末基金实缴总额	1,520.804973

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

4.1 投资经理简介

姓名	职务	任本计划的投资经理期限		期货从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈浩	投资经理	2019/11/01	-	10	1982 年出生，毕业于西南交通大学，长期从事金融投资，有敏锐的金融眼光，精于固定收益投资，善于利用利率波动带来的机会，运用套利、对冲等交易模式获得稳定收益，在低风险的前提下，发掘市场中稳定而又确定性的收益。

注：1、此处的任职日期和离任日期均以公告为准。

4.2 管理人对报告期内本计划运作合规守信情况的说明

本报告期内，本计划管理人严格遵守《大越期货海赢一号集合资产管理计划合同》的规定和《中华人民共和国证券投资基金法》等法律、法规和监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用资产，在认真控制投资风险的基础上，为计划份额持有人谋取最大利益。本报告期内，本计划运作整体合法合规，没有损害计划份额持有人利益。计划的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及合同的规定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本计划管理人建立并健全了有效的公平交易执行体系，涵盖了研究、授权、投资决策和交易执行等投资管理活动的各个环节，确保公平对待不同投资组合，防范导致不公平交易以及利益输送的异常交易发生。

公司建立了明确的投资决策及授权制度，以科学规范的投资角色体系，采用集中交易管理加强交易执行环节的内部控制，通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现；通过建

立层级完备的公司股票池和债券库，完善各类具体资产管理业务组织结构，规范各项业务之间的关系，在保证各项投资组合既具有相对独立性的同时，确保其在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；通过对异常交易行为的监控、分析评估、监督稽核和信息披露确保公平交易过程和结果的有效监督。

本报告期内，本公司严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，确保本公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行等投资管理活动和环节得到公平对待，各投资组合均严格按照法律、法规和公司制度执行投资交易，本报告期内未发现任何违反公平交易的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 报告期内计划投资策略和运作分析

2022年又是跌宕起伏的一年，高通胀和大幅度加息是影响金融市场的主要因素。一季度俄乌冲突爆发，随着欧美国家对俄罗斯制裁持续升级，供应担忧下，能源价格大涨拉开了2022年通胀走高远超预期的序幕。为压制通胀，各国央行纷纷开启加息周期，全球债券收益率收益率全线走高，美元走强。至二季度末，国内在疫情封锁措施下，供应链受阻，全球经济受到压制，经济衰退担忧高涨，风险资产全面走弱，大宗商品全面大幅度回落。同时各国央行开始扩大加息步伐，美元持续走高，债券收益率持续走高。三季度随着情绪和缓，金融资产价格开始修正，风险偏好回升，大宗商品触底反弹。同时，夏日高温另欧洲能源危机爆发，欧洲经济担忧升温，美联储加息幅度继续扩大，美元和美债收益率持续走高，股市受压走低，大宗商品低位震荡。四季度超预期放缓的通胀数据快速推升宽松预期，风险偏好走强，债市股市商品全线走高，快速收复二季度跌幅。年末，国内防疫政策优化，风险情绪再受提振，美元继续回落，大宗商品维持高位。

4.5 报告期内计划持有人数或基金资产净值预警说明

无。

4.6 报告期内其他情况说明

无。

5、托管人报告（如有）

5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明

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，并依规依约履行托管人义务。

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。海通证券股份有限公司对报告期内资产净值的计算、利润分配等方面进行了复核，未发现管理人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	2022-12-31	2021-12-31
资产：	0	0
银行存款	373.89	0
结算备付金	359,400.00	0
存出保证金	0	0
交易性金融资产	0	0
其中：股票投资	0	0
基金投资	0	0
债券投资	0	0
资产支持证券投资	0	0
贵金属投资	0	0
衍生金融资产	0	0
买入返售金融资产	0	0
应收证券清算款	0	0
应收利息	0	0
应收股利	0	0
应收申购款	0	0
递延所得税资产	0	0
其他资产	14,532,601.58	0
资产总计	14,892,375.47	0

负债和所有者权益	2022-12-31	2021-12-31
负债：	0	0
短期借款	0	0
交易性金融负债	0	0
衍生金融负债	0	0
卖出回购金融资产款	0	0
应付证券清算款	0	0
应付赎回款	0	0
应付管理人报酬	19,104.35	0
应付托管费	1,528.34	0
应付销售服务费	0	0
应付交易费用	0	0
应交税费	0	0
应付利息	0	0
应付利润	0	0
递延所得税负债	0	0
其他负债	1,528.34	0
负债合计	22,161.03	0
所有者权益：	0	0
实收基金	15,208,049.73	0
未分配利润	-337,835.29	0
所有者权益合计	14,870,214.44	0
负债和所有者权益总计	14,892,375.47	0

备注：

-

6.2 利润表

项目	本期	上年度可比期间
	2022-03-08 至 2022-12-31	至 2021-12-31
一、收入	-264,325.89	0
1.利息收入	1,970.86	0
其中：存款利息收入	1,970.86	0
债券利息收入	0	0
资产支持证券利息收入	0	0
买入返售金融资产收入	0	0
其他利息收入	0	0
2.投资收益（损失以“-”填列）	620,171.67	0
其中：股票投资收益	0	0
基金投资收益	0	0
债券投资收益	0	0
资产支持证券投资收益	0	0

贵金属投资收益	0	0
衍生工具收益	0	0
股利收益	620,171.67	0
3.公允价值变动收益 (损失以“-”填列)	-1,087,570.09	0
4.汇兑收益(损失以“-”填列)	0	0
5.其他收入(损失以“-”填列)	201,101.67	0
减：二、费用	73,503.07	0
1. 管理人报酬	62,683.63	0
其中：固定管理费	62,683.63	0
业绩报酬	0	0
2. 托管费	5,014.72	0
3. 销售服务费	0	0
4. 外包服务费	5,014.72	0
5. 交易费用	0	0
6. 利息支出	0	0
其中：卖出回购金融资产支出	0	0
7. 其他费用	790.00	0
三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)	-337,828.96	0
减：所得税费用	0	0
四、净利润 (净亏损以“-”号填列)	-337,828.96	0

备注：

-

6.3 所有者权益变动表

项目	本期 2022-03-08 至 2022-12-31		
	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)	15,200,126.66	0	15,200,126.66
二、本期经营活动产生 的基金净值变动数(本 期利润)	0	-337,828.96	-337,828.96
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)	7,923.07	-6.33	7,916.74
其中：1、基金申购款	10,008,006.40	-8,006.40	10,000,000.00
2、基金赎回款	-10,000,083.33	8,000.07	-9,992,083.26
四、本期向基金份额持 有人分配利润产生的	0	0	0

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)	15,208,049.73	-337,835.29	14,870,214.44
项目	至 2021-12-31		
	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	0	0
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	0	0	0
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	0	0
其中：1、基金申购款	0	0	0
2、基金赎回款	0	0	0
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	0
五、期末所有者权益(基金净值)	0	0	0

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

项目	金额
现金类资产	373.89
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
	存出保证金
	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）	-
	其中：货币基金	-
	期货及衍生品交易保证金	-
	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	0.00
	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	14532601.58
	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	0

B	采矿业	0	0
C	制造业	0	0
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	0	0
E	建筑业	0	0
F	批发和零售业	0	0
G	交通运输、仓储和邮政业	0	0
H	住宿和餐饮业	0	0
I	信息传输、软件和信息技术服务业	0	0
J	金融业	0	0
K	房地产业	0	0
L	租赁和商务服务业	0	0
M	科学研究和技术服务业	0	0
N	水利、环境和公共设施管理业	0	0
O	居民服务、修理和其他服务业	0	0
P	教育	0	0
Q	卫生和社会工作	0	0
R	文化、体育和娱乐业	0	0
S	综合	0	0
	合计	0	0

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(人民币)	占基金资产净值比例(%)
港股通	0	0.00
合计	-	-

备注：

-

信息披露报告是否经托管机构复核：

是