

大越期货 1 号资产管理计划 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 1 号资产管理计划
基金编号	S68999
基金运作方式	契约型封闭式运作
基金成立日期	2015 年 8 月 25 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）	12,300,000.00
基金到期日期	2025 年 8 月 24 日

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、多周期的操作模式。 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	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	宁波银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	王雅萍	朱广科
	联系电话	0575-85201502	0574-87050338
	电子邮箱	wangyaping@dyqh.info	custody-audit@nbcb.cn
传真		0575-85127511	0574-89103213
注册地址		浙江省绍兴市越城区解放北路 186 号 7 楼	中国浙江宁波市鄞州区宁东路 345 号
办公地址		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

管理人网站、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	2022 年
本期已实现收益	-122,282.82
本期利润	-855,960.32
期末数据和指标	2022 年末
期末可供分配利润	0
期末可供分配基金份额利润	0
期末基金资产净值	11,758,844.03
期末基金份额净值	0.956
累计期末指标	2022 年末
基金份额累计净值增长率	-4.48%

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	-4.48%	-	-	-
自基金合同生效起至今	38.90%	-	-	-

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 近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 年	0	0	0	0	
2021 年	0.0468682555	759,172.94	0	759,172.94	
2020 年	0.0047049553	93,599.38	0	93,599.38	-

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	13,398,020.00
报告期期间基金总申购份额	0.00
减：报告期期间基金总赎回份额	1,098,020.00
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	12,300,000.00

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	2015/08/26	-	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。
许卫民	副总经理 兼投资经理	2017/01/09	-	14	现任大越期货副总经理兼投资经理，有 20 年期货从业经历，在宏观研究和策略指导上经验丰富，以趋势策略和宏观对冲为主要操作风格。
吴胜根	投资经理	2019/10/31	-	7	有 11 年的投资经历。09 年接触金融产品开启了投资生涯。2016 年后逐步形成，以板块个股基本面和指数估值为基础，业绩和市场预期为指引，进行个股投资和指数基金的轮动，对于市场板块风格变化有独特见解，擅长趋势操作。

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 1 号资产管理计划合同》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

回顾 2022 年，受到美联储加息、俄乌战争、国内上海疫情封城等利空因素影响，指数弱势下行，随着疫情解封、指数估值低位、电新板块走强，市场在 5、6 月份开启一波反弹行情。在巴菲特减仓比亚迪、俄乌战争升级、美国对华科技制裁、美联储持续加息，人民币汇率贬值，外资大幅流出，在 10 月底部分指数再创年内新低，随着二十大召开、“地产三只箭”、疫情防控政策变更，市场在 11 月份迎来普涨。不过全年来看主流指数跌幅均超过 20%，像沪深 300 跌 21.63%，中证 500 跌 20.31%，本计划净值虽然跑赢主流指数，但是也出现大幅下跌。本计划配置了消费、银行地产、科技、新能源、港股、中概股和转债，其中在二季度末进行了调仓，减仓新能源创业板，增加了转债仓位，四季度增加了港股仓位。后期来看，消费配置价值逐步提升，此外关注地产销售端何时企稳，或是金融地产板块转折点，对于后市谨慎乐观。

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

本报告期内，本计划依旧持有违约债券 16 天广 01，市值及应收利息合计占比 1.928%。本管理人将密切关注债券后继处置进展情况，切实维护委托人利益。

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遵规守信、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、误导性陈述或者重大遗漏。

6、年度财务报表

金额单位：元

6.1 资产负债表

资产	2022/12/31	2021/12/31
资产：		
银行存款	73.11	11,764.43
结算备付金	52,065.79	1,113,364.23
存出保证金		643,302.00
交易性金融资产	11,615,518.65	11,878,301.96
其中：股票投资	3,593,957.00	1,134,862.00
基金投资	4,256,186.25	8,272,758.06

债券投资	3,765,375.40	2,470,681.90
资产支持证券投资		
贵金属投资		
衍生金融资产		
买入返售金融资产		
应收证券清算款		
应收利息	17,960.50	39,282.51
应收股利		
应收申购款		
递延所得税资产		
其他资产	96,844.07	96,844.07
资产总计	11,782,462.12	13,782,859.20
负债和所有者权益	2022/12/31	2021/12/31
负债:		
短期借款		
交易性金融负债		
衍生金融负债		
卖出回购金融资产款		
应付证券清算款		
应付赎回款		
应付管理人报酬	20,931.64	84,896.38
应付托管费	1,162.85	4,716.51
应付外包服务费	1,162.85	4,716.51
应付交易费用		
应交税费	360.75	10,842.09
应付利息		
应付利润		
递延所得税负债		
其他负债		
负债合计	23,618.09	105,171.49
所有者权益:	本期末:	本期末:
实收基金	12,300,000.00	13,398,020.00
未分配利润	-541,155.97	279,667.71
所有者权益合计	11,758,844.03	13,677,687.71
负债和所有者权益总计	11,782,462.12	13,782,859.20

备注:

-

6.2 利润表

项目	本年累计金额(2022/01/01 至 2022/12/31)
一、收入	-577,527.44
1、利息收入	56,870.31
其中：存款利息收入	10,263.31
债券利息收入	39,190.66
资产支持证券利息收入	
买入返售金融资产收入	8,524.91
其他利息收入	-1,108.57
2、投资收益（损失以“-”填列）	99,279.75
其中：股票投资收益	-296,516.16
债券投资收益	568,485.43
基金投资收益	134,459.95
资产支持证券投资收益	
股利收益	59,570.53
理财产品投资收益	
港股通股利收入	
信托投资收益	
衍生工具收益	-366,720.00
3、公允价值变动损益（损失以“-”填列）	-733,677.50
4、汇兑收益（损失以“-”填列）	
5、其他收入（损失以“-”填列）	
二、费用	278,432.88
1、管理人报酬	220,569.06
2、托管费	19,343.77
3、外包服务费	19,343.77
4、销售服务费	
5、投资顾问费	
6、交易费用	18,306.34
7、利息支出	
其中：卖出回购金融资产支出	
8、增值税费及附加	856.94
9、其他费用	13.00
三、利润总额（亏损总额以“-”填列）	-855,960.32
减：所得税费用	
四、净利润（净亏损以“-”填列）	-855,960.32

备注：

-

6.3 所有者权益变动表

项目	本期 2022/01/01 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）	13,398,020.00	279,667.71	13,677,687.71
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	0	-855,960.32	-855,960.32
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）	-1,098,020.00	35,136.64	-1,062,883.36
其中：1. 基金申购款	0.00	0.00	0.00
2. 基金赎回款	-1,098,020.00	35,136.64	-1,062,883.36
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）	12,300,000.00	-541,155.97	11,758,844.03

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	3,593,957.00	30.50
	其中：普通股	3,593,957.00	30.50
	存托凭证		-
2	基金投资	4,256,186.25	36.12
3	固定收益投资	3,783,335.90	32.11
	其中：债券	3,783,335.90	32.11
	资产支持证券		-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期		-

	期货	-	-
	期权		-
	权证		-
5	买入返售金融资产		
	其中：买断式回购的买入返售金融资产		-
6	货币市场工具		-
7	银行存款、结算备付金和存出保证金合计	52,138.90	0.44
8	其他各项资产	96,844.07	0.82
	合计	11,782,462.12	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		
B	采矿业		
C	制造业	1,973,809.00	16.79
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业		
E	建筑业		
F	批发和零售业		
G	交通运输、仓储和邮政业		
H	住宿和餐饮业		
I	信息传输、软件和信息技术服务业		
J	金融业	1,474,120.00	12.54
K	房地产业		
L	租赁和商务服务业	133,600.00	1.14
M	科学研究和技术服务业		
N	水利、环境和公共设施管理业		
O	居民服务、修理和其他服务业		
P	教育		
Q	卫生和社会工作	12,428.00	0.11
R	文化、体育和娱乐业		
S	综合		
	合计	3,593,957.00	30.58

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		
合计		

备注：

-

信息披露报告是否经托管机构复核：

是

