

私募证券投资基金信息披露年度报告

(2020-01-01 至 2020-10-19)

1、基金产品概况

1.1 基金基本情况

基金名称	赋成量化对冲 30 号证券私募投资基金
基金编码	SS0611
基金运作方式	开放式
基金成立日期	2017-03-10
基金管理人	安徽赋成资产管理有限公司
基金托管人	国信证券股份有限公司
投资顾问（如有）	
期末基金总份额（万份）/期末基金实缴总额（万元）	600.000000
基金到期日期	9999-12-31

1.2 基金产品说明

投资目标	在控制风险的前提下，实现客户资产长期、持续、稳定的增值。
投资策略	1、股票投资策略： 本基金基于自上而下的优势主题分析框架下，采取事件驱动、财务指标、反向共振等多因子量化策略模型进行综合筛选，精选未来具有高成长速度、广阔成长空间、较好成长模式并且成长估值相对合理的个股进行重点投资。 2、股指期货策略： 本基金通过利用股指期货的独立性和领先性，使用对冲策略有效分散投
业绩比较基准（如有）	无
风险收益特征	本基金属于高风险投资品种，适合风险识别、评估、承受能力为进取型的合格投资者。

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		安徽赋成资产管理有限公司	国信证券股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	吴燕飞	薛璐
	联系电话	0551-63660729	0755-22940163
	电子邮箱	623227483@qq.com	03339@guosen.com.cn
传真		0551-62833610	0755-22940165
注册地址		合肥市蜀山区肥西路 58 号兴科大厦 1202 室	深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层
办公地址		合肥市庐阳区金寨路 329 号国轩凯旋大厦 2003 室	深圳市福田区福华一路 125 号国信金融大厦 19 楼

邮政编码	200031	518061
法定代表人	章蔚蔚	张纳沙

1.4 信息披露方式

募基金管理人根据法律法规规定以信件、传真、电子邮箱、官网或第三方服务机构登录查询等方式向基金投资者披露，并按规定通过私募基金信息披露备份平台报送信息。

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	国信证券股份有限公司	深圳市福田区福华一路125号国信金融大厦19楼
外包机构	国信证券股份有限公司	深圳市福田区福华一路125号国信金融大厦19楼

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	2020 年	2019 年	2018 年
本期已实现收益	274,183.41	-1,078,526.99	-165,866.17
本期利润	497,031.35	-919,945.92	-779,257.94
期末数据和指标	2020 年末	2019 年末	2018 年末
期末可供分配利润	-1,204,872.66	-1,659,427.55	-739,481.63
期末可供分配基金份额利润	-0.2008	-0.2766	-0.1232
期末基金净资产	4,837,603.80	4,340,572.45	5,260,518.37
报告期期末单位净值	0.806	0.723	0.877
累计期末指标	2020 年末	2019 年末	2018 年末
基金份额累计净值增长率	-19.40	-27.70	-12.30

2.2 基金净值表现

阶段	净值增长率	净值增长率标准差 (选填)	业绩比较基准收 益率(选填)	业绩比较基准收 益率标准差(选填)
当年	11.48			
自基金合同 生效起至今	-19.40			

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

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
2020	0.0000	0.00	0.00	0.00	
2019	0.0000	0.00	0.00	0.00	
2018	0.0000	0.00	0.00	0.00	

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	600.000000
报告期期间基金总申购份额	0.000000
减：报告期期间基金总赎回份额	0.000000
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	600.000000

4、管理人说明的其他情况（如报告期内高管、基金经理及其关联基金经验、基金运作合规守信情况、基金投资策略和业绩表现、对宏观经济、证券市场及其行业走势展望、内部基金监察稽核工作、基金估值程序、基金运作情况和运用杠杆情况、投资收益分配和损失承担情况、会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项、对本基金持有人数或基金资产净值预警情形、可能存在的利益冲突等）

4.1、基金管理人及其管理基金的经验

安徽赋成资产管理有限公司，成立于2013年12月16日，初始注册资本3000万元，专注于证券市场投资的私募基金，其投资团队打造了安徽本土第一只量化对冲基金；公司团队由在中国资本市场拥有丰富经验和出色业绩的专业投资人士及在实业、证券公司、法律事务等方面具备专业经验和人脉资源的人士构成；业务范围包括证券投资、投资管理和投资咨询等。截至报告期末，管理规模近10个亿。

4.2、管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》和《证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、《基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人

谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.3.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2017 年股市投资收益将整体优于 2016 年，估值中枢望缓慢抬升，上证综指的点位波动在 2800-3600 点之间。行情将以震荡中攀升，爬坡中波折的形式演绎。一季度行情回暖，风险偏好由修复到高涨，同时有养老金入市、两会预期、年报行情、开工旺季等多个因素共振，重点看大基建（PPP 与一带一路）与周期品（农业供给侧改革与上游化工）；二、三季度或将迎来阶段性的震荡休整；四季度在十九大召开的政策利好预期下，风险偏好有望再次带动股市向上。2、市场风格年中切换 上半年经济惯性企稳、通胀上升的窗口期，市场偏好传统周期性行业与低估值蓝筹板块；下半年，随着补库存周期进入尾声、影响式微，经济与企业盈利增速再次放缓，且经历前一波股价上涨后，周期性行业估值不再占优，但此时投资者风险偏好仍高，则资金有望留存市场内，并转而向消费类蓝筹板块与严重低估的优质成长股（传媒、计算机）转移。

2018 年我们的对冲策略也做出了两次重大的调整，一方面细化了策略分类，根据产品需求调整不同策略的配比；另一方面，不再盲目对冲，根据市场特性，选择不同的股指期货进行敞口覆盖，实现风险的转换。

4.3.2 报告期内基金的业绩表现

截止报告期末，本基金的单位净值为 0.988。

4.4 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2018 年，我的核心观点依旧不变：看好经济发展的长期向好，股市维持震荡走高趋势，但过程一定是曲折的；市场最悲观的预期已经出现过，市场的主跌浪已经结束。2018 年 A 股市场将震荡上升，存在结构性机会。

从宏观政策角度看：人民币汇率将基本稳定。2017 年人民币兑美元升值、兑欧元升值，对一篮子汇率升值不大。人民币中期强势主要基于中国经济新周期。央行继续加强完善宏观审慎政策。继 2017 年第一季度将表外理财纳入广义信贷指标范围之后，又于 2017 年第三季度评估时，将绿色金融纳入 MPA“信贷政策执行情况”进行评估。还将在 2018 年第一季度的评估中把同业存单纳入同业负债占比指标，对资产规模 5000 亿元以上的银行发行的同业存单进行考核，对资产规模 5000 亿元以下的银行发行的同业存单进行监测。继续完善利率市场化、汇率市场化形成机制。2017 年 5 月份，外汇市场自律机制在“收盘汇率+一篮子货币汇率变化”的人民币兑美元汇率中间价形成机制基础上，组织各报价

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

报告期内，国信证券股份有限公司（以下称“托管人”）严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规的规定及基金合同的约定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内，托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益分配的情况等方面进行了必要的监督、复核和审查，结合托管人通过公开市场信息查询到的相关信息，发现基金管理人及本基金存在如下事项，托管人认为该等事项可能影响本基金份额持有人的利益，特提示投资者关注：

1. 管理人未在规定时限内确认基金年度报告；

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

由于未收到管理人编制的年度报告，托管人无法获取充分、适当的依据就“财务信息等内容的真实、准确和完整”发表托管人意见。

托管人提示投资者关注：

非标准化投资标的根据合同约定的估值方法估值，估值结果可能存在不能反映其公允价值的风险，更不能代表其最终变现价值。

因托管人获取信息有限，请投资者谨慎识别和判断风险，并及时向基金管理人获取本基金实际投资项目状况及风险状况等。

6、年度财务报表

6.1 资产负债表

单位：元

资产	本期末 2020-10-19	上年度末 2019-12-31
资产：		
银行存款	0.43	2.06
结算备付金	0.00	0.00
存出保证金	4,883,383.26	120.62
交易性金融资产	0.00	4,375,288.00
其中：股票投资	0.00	4,375,288.00
基金投资	0.00	0.00
债券投资	0.00	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	173.33	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	4,883,557.02	4,375,410.68
负债和所有者权益	本期末 2020-10-19	上年度末 2019-12-31
负债：		
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	1,168.40
应付赎回款	0.00	0.00
应付管理人报酬	2,076.46	10,634.11
应付托管费	8,360.96	11,517.86
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	27,154.84	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	8,360.96	11,517.86
负债合计	45,953.22	34,838.23
所有者权益：		
实收基金	6,000,000.00	6,000,000.00
未分配利润	-1,162,396.20	-1,659,427.55
所有者权益合计	4,837,603.80	4,340,572.45
负债和所有者权益合计	4,883,557.02	4,375,410.68

6.2 利润表

单位：元

项目	本期	上年度可比期间
	2020-01-01 至 2020-10-19	2019-01-01 至 2019-12-31
一、收入	577,626.12	-810,307.12
1.利息收入	265.68	4,513.53
其中：存款利息收入	265.68	1,023.41

债券利息收入	0.00	0.00
资产支持证券利息收入	0.00	0.00
买入返售金融资产利息收入	0.00	3,490.12
其他利息收入	0.00	0.00
2.投资收益（损失以“-”填列）	378,757.90	-973,300.07
其中：股票投资收益	274,092.06	-1,033,356.38
基金投资收益	0.00	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
贵金属投资收益	0.00	0.00
衍生工具收益	0.00	0.00
股利收益	104,665.84	60,056.31
3.公允价值变动收益（损失以“-”填列）	222,847.94	158,581.07
4.汇兑收益（损失以“-”填列）	0.00	0.00
5.其他收入（损失以“-”填列）	-24,245.40	-101.65
减：二、费用	80,594.77	109,638.80
1.管理人报酬	36,908.89	45,455.76
其中：固定管理费	36,908.89	45,455.76
业绩报酬	0.00	0.00
2.托管费	11,844.26	15,000.00
3.销售服务费	0.00	0.00
4.外包服务费	11,844.26	15,000.00
5.交易费用	17,087.92	34,170.84
6.利息支出	0.00	0.00
其中：卖出回购金融资产款支出	0.00	0.00
7.其他费用	2,909.44	12.20
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	497,031.35	-919,945.92
减：所得税费用	0.00	0.00
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	497,031.35	-919,945.92

6.3 所有者权益变动表

单位：元

项目	本期 (2020-01-01 至 2020-10-19)
----	---------------------------------

	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）	6,000,000.00	-1,659,427.55	4,340,572.45
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	0.00	497,031.35	497,031.35
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	0.00	0.00	0.00
五、期末所有者权益（基金净值）	6,000,000.00	-1,162,396.20	4,837,603.80
项目	上年度可比期间 (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）	6,000,000.00	-739,481.63	5,260,518.37
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	0.00	-919,945.92	-919,945.92
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	0.00	0.00	0.00
五、期末所有者权益（基金净值）	6,000,000.00	-1,659,427.55	4,340,572.45

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	银行存款	0.43 元
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	4,883,383.26 元
	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	
	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	
	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	应收利息#173.33；
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	0.00	0.00
B	采矿业	0.00	0.00
C	制造业	0.00	0.00
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	0.00	0.00
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	0.00	0.00

备注：以上股票投资不含港股通。

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 (%)
农、林、牧、渔业	0.00	0.00
采矿业	0.00	0.00
制造业	0.00	0.00
电力、热力、燃气及水生产和供应业	0.00	0.00
建筑业	0.00	0.00
批发和零售业	0.00	0.00
交通运输、仓储和邮政业	0.00	0.00
住宿和餐饮业	0.00	0.00
信息传输、软件和信息技术服务业	0.00	0.00
金融业	0.00	0.00

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
房地产业	0.00	0.00
租赁和商务服务业	0.00	0.00
科学研究和技术服务业	0.00	0.00
水利、环境和公共设施管理业	0.00	0.00
居民服务、修理和其他服务业	0.00	0.00
教育	0.00	0.00
卫生和社会工作	0.00	0.00
文化、体育和娱乐业	0.00	0.00
综合	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

备注：以上分类采用中国证券监督管理委员会制定的《上市公司行业分类指引》

信息披露报告是否经托管机构复核：是