

钜沣量化对冲一号证券投资基金 2023年年度报告
2023年12月31日

安徽钜瑞资产管理有限公司
兴业证券股份有限公司
送出日期：2024-04-08

私募基金信息披露年度报告表

1、基金产品概况

1.1 基金基本情况

基金名称	钜沣量化对冲一号证券投资基金
基金编码	SE0703
基金运作方式	开放式
基金成立日期	2015-12-15
基金管理人	安徽钜瑞资产管理有限公司
基金托管人（如有）	兴业证券股份有限公司
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）	628.844329
基金到期日期	2025-12-15

1.2 基金产品说明

投资目标	“本基金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	“本基金依基金管理人的投资指令进行投资决策。基金管理人的投资策略如下：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，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资风险。同时在严格控制风险敞口的前提下，运用对冲策略，通过对经济增长趋势、资金流动、财政和货币政策变化等因素自上而下进行统计分析，并辅以对高频交易数据的捕捉分析，区分有信息含量和非理性的交易行为，来获取对股指期货价格走势判断的领先优势，制定投资策略，获取低风险甚至无风险的套利收益。”
业绩比较基准（如有）	-
风险收益特征	本基金具有较高风险高预期收益特征

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		安徽钜瑞资产管理有限公司	兴业证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	鲁政平	李少峰
	联系电话	0551-63660629	021-20370710
	电子邮箱	285983350@qq.com	disclosure_xztg@xyzq.com.cn
传真		0551-63660629	0591-38507797
注册地址		合肥市庐阳区金寨路329号国轩凯旋大厦2006室	福州市湖东路268号证券大厦

办公地址	合肥市庐阳区金寨路329号国轩凯旋大厦2006室	福州市湖东路268号证券大厦
邮政编码	230031	350003
法定代表人	鲁政平	杨华辉

1.4 信息披露方式

-

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	兴业证券股份有限公司	上海市浦东新区长柳路36号
外包机构	兴业证券股份有限公司	上海市浦东新区长柳路36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	2023年	2022年	2021年
本期已实现收益	-833,394.36	-109,610.35	-488,458.34
本期利润	440,391.55	-672,902.35	-682,296.63
期末数据和指标	2023年末	2022年末	2021年末
期末可供分配利润	-3,435,528.28	-3,467,786.13	-2,794,883.78
期末可供分配基金份额利润	-0.5463	-0.5515	-0.4444
期末基金净资产	3,261,048.71	2,820,657.16	3,493,559.51
报告期末单位净值	0.519	0.449	0.556
累计期末指标	2023年末	2022年末	2021年末
基金份额累计净值增长率	-48.10%	-55.10%	-44.40%

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 益率标准率(%)
当年	15.59	0.00	0.00	0.00
自基金合同生效 起至今	-48.10	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。

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
2023	0	0	0	0	—
2022	0	0	0	0	—
2021	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	628.844329
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	628.844329

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

—

5 、托管人报告（如有）

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

自本基金成立以来，作为本基金的托管人，兴业证券股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》、《私募投资基金监督管理暂行办法》及其他有关法律法规、基金合同的规定，尽职

尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何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，本托管人按照国家有关法律法规、行业规则以及基金合同的要求，对本基金管理人
人在本基金投资运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、基金份额单位净值的计算、
基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行
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

由本基金管理人编制，并经本托管人复核审查的本年度报告中的财务指标、净值表现、收益
分配、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

6 、年度财务报表

金额单位：元

6.1 资产负债表

资产	2023-12-31	2022-12-31
资产：	0	0
银行存款	365.88	1,639.81
结算备付金	274,245.49	318,295.47
存出保证金	315,290.38	13,389.67
交易性金融资产	2,749,858.10	2,559,607.00
其中：股票投资	2,749,858.10	2,559,607.00
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	0	0
资产总计	3,339,759.85	2,892,931.95
负债和所有者权益	2023-12-31	2022-12-31
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	12,315.45	11,392.96
应付托管费	6,359.92	6,531.07
应付销售服务费	0	0
应付交易费用	0	0

应交税费	53,675.85	47,819.69
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	6,359.92	6,531.07
负债合计	78,711.14	72,274.79
所有者权益：	0	0
实收基金	6,288,443.29	6,288,443.29
未分配利润	-3,027,394.58	-3,467,786.13
所有者权益合计	3,261,048.71	2,820,657.16
负债和所有者权益总计	3,339,759.85	2,892,931.95

备注：

-

6.2 利润表

项目	本期	上年度可比期间
	2023-01-01 至 2023-12-31	2022-01-01 至 2022-12-31
一、收入	572,450.47	-584,453.74
1、利息收入	303.25	84.60
其中：存款利息收入	303.25	84.60
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）	-696,409.97	-18,238.00
其中：股票投资收益	-973,967.54	55,548.00
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	262,034.05	-90,555.00
股利收益	15,523.52	16,769.00
3、公允价值变动收益		
（损失以“-”填列）	1,273,785.91	-563,292.00
4、汇兑收益（损失以“-”填列）	0	0
5、其他收入（损失以“-”填列）	-5,228.72	-3,008.34
减：二、费用	132,058.92	88,448.61

1. 管理人报酬	48,976.31	45,685.38
其中：固定管理费	48,976.31	45,685.38
业绩报酬	0	0
2、托管费	10,026.14	9,960.39
3、销售服务费	0	0
4、外包服务费	10,026.14	9,960.39
5、交易费用	62,402.89	22,481.44
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	627.44	361.01
三、利润总额		
(亏损总额以“-”号填列)	440,391.55	-672,902.35
减：所得税费用	0	0
四、净利润		
(净亏损以“-”号填列)	440,391.55	-672,902.35

备注：
-

6.3 所有者权益变动表

项目	本期		
	2023-01-01	至	2023-12-31
	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)	6,288,443.29	-3,467,786.13	2,820,657.16
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	0	440,391.55	440,391.55
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)	6,288,443.29	-3,027,394.58	3,261,048.71
	上年度可比期间		

项目	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）	6,288,443.29	-2,794,883.78	3,493,559.51
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	0	-672,902.35	-672,902.35
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	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）	6,288,443.29	-3,467,786.13	2,820,657.16

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	银行存款	365.88
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	274,245.49
	存出保证金	315,290.38
	股票投资	2,749,858.1
	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	140,202.4

	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	
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

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	1,372,238.10	42.08
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	917,100.00	28.12
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	99,900.00	3.06
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	111,120.00	3.41
N	水利、环境和公共设施管理业	249,500.00	7.65

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	2,749,858.10	84.32

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

