

创元创优 2 号集合资产管理计划 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	创元创优 2 号集合资产管理计划
基金编码	SLC726
基金运作方式	开放式
基金成立日期	2020 年 08 月 05 日
基金管理人	创元期货股份有限公司
基金托管人（如有）	华泰证券股份有限公司
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）	8,454.591370
基金到期日期	2030 年 08 月 04 日

1.2 基金产品说明

投资目标	(1) 债券（国债、地方政府债、央行票据、中期票据、金融债、企业债、公司债、非公开定向债务融资工具（PPN）、中小企业私募债、可转换债券、短期融资券、超短期融资券、可交换债券） (2) 因可转换债券转股或可交换债券换股形成的股票及其派发的权证、因分离交易的可转换公司债券产生的权证 (3) 公募基金（封闭式基金、开放式基金、股票型基金、债券型基金、货币市场型基金、混合型基金） (4) 回购（债券正回购、债券逆回购） (5) 其他（现金、银行活期存款、定期存款、协议存款等）
投资策略	本计划主要投资策略包括资产配置策略，各类债券投资策略（持有到期策略、基于信用利差曲线变化的策略、利率策略），跨市场套利交易策略，可交换债券投资策略，现金类资产投资策略等。
业绩比较基准	无
风险收益特征	本计划为【R3】风险等级的产品，产品最终风险等级以销售机构评定结果为准，但销售机构所评定的产品风险不得低于管理人所评定的产品风险等级。主要适合于风险承受能力【C3、C4、C5】的合格投资者及专业投资者。

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	创元期货股份有限公司	华泰证券股份有限公司

信息披露负责人	姓名	张瑶祺	刘璐
	联系电话	052168363010	025-83388177
	电子邮箱	zhangyq@cyqh.com.cn	liu.lu@htsc.com
传真	-		025-83387215
注册地址	江苏省苏州市三香路 120 号 万盛大厦 2 楼、3 楼		南京市江东中路 228 号
办公地址	江苏省苏州市工业园区苏州 大道东 265 号现代传媒广场 25 楼		南京市江东中路 228 号
邮政编码	215000	210019	
法定代表人	吴文胜	张伟	

1.4 信息披露方式

资产管理人向资产委托人提供的报告，将严格按照监管规定通过以下至少一种方式进行。资产委托人信息查询将通过以下至少一种中国证监会允许的、本合同约定的方式进行，1) 网站、2) 邮寄服务、3) 传真或电子邮件。

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	华泰证券股份有限公司	南京市江东中路 228 号
外包机构	华泰证券股份有限公司	南京市江东中路 228 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	2021	2020
本期已实现收益	7,058,212.08	15,058,567.14	504,514.26
本期利润	7,299,609.31	19,841,826.26	-1,561,381.79
期末数据和指标	2022	2021	2020
期末可供分配利润	2,481,192.96	1,595,214.33	0.00
期末可供分配基金份额利润	0.0293	0.0120	0.0000
期末基金净资产	90,639,286.43	140,792,843.80	44,748,934.12
报告期期末单位净值	1.0721	1.0555	0.9703
累计期末指标	2022	2021	2020
基金份额累计净值增长率(%)	33.21	24.55	-2.97

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	6.95	-	-	-
自基金合同生效起至今	33.21	-	-	-

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	0.0700	4,397,641.57	926,909.25	5,324,550.82	-
2021	0.1900	14,089,518.57	217,354.58	14,306,873.15	-
2020	0.0000	0.00	0.00	0.00	-

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	13,339.362227
报告期期间基金总申购份额	6,689.550643
减：报告期期间基金总赎回份额	11,574.321500
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	8,454.591370

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

本报告期内，创元期货股份有限公司作为本产品管理人严格遵守相关法律法规，尽职尽责履行了管理人应尽的义务。管理人保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担责任。

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

在本报告期内，本基金托管人-华泰证券股份有限公司及时完成了基金名下的资金划拨，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，并严格遵守了基金合同和各项法律法规的相关规定，履行了基金托管人应尽的义务。

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，华泰证券对基金管理人的投资运作行为依基金合同约定进行了监督，对本基金资产净值计算、费用开支方面进行了复核，未发现基金管理人存在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

华泰证券作为基金托管人，复核了本基金年度报告中的有关财务数据、净值表现、收益分配、投资组合报告等内容，相关内容真实、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	2022/12/31	2021/12/31
资产：		
银行存款	1,024,020.07	68,044.13
结算备付金	3,524,039.60	83,547.70
存出保证金	0.00	0.00
交易性金融资产	78,346,088.87	85,202,251.06
其中：股票投资	0.00	0.00
基金投资	8,605,588.21	5,432,537.86
债券投资	69,740,500.66	79,769,713.20
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	8,007,490.42	53,030,364.15
应收证券清算款	0.00	0.00

应收利息	0.00	2,774,431.83
应收股利	62,102.90	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	90,963,741.86	141,158,638.87
负债和所有者权益		
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	0.00
应付赎回款	0.00	0.00
应付管理人报酬	139,587.96	196,571.51
应付托管费	4,652.93	6,552.40
应付销售服务费	4,652.93	6,552.40
应付交易费用	315.00	774.50
应交税费	175,246.61	155,344.26
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	0.00	0.00
负债合计	324,455.43	365,795.07
所有者权益:		
实收基金	84,545,913.70	133,393,622.27
未分配利润	6,093,372.73	7,399,221.53
所有者权益合计	90,639,286.43	140,792,843.80
负债和所有者权益总计	90,963,741.86	141,158,638.87

备注:

-

6.2 利润表

项目	本期	上年度可比期间
	2022/01/01 至 2022/12/31	2021/01/01 至 2021/12/31
一、收入	8,643,333.57	20,444,331.70
1. 利息收入	6,075,120.20	4,893,840.27
其中: 存款利息收入	28,502.27	16,877.95
债券利息收入	4,954,877.59	3,951,488.51

资产支持证券 利息收入	0.00	0.00
买入返售金融 资产收入	1,272,999.67	1,067,958.53
其他利息收入	-181,259.33	-142,484.72
2. 投资收益（损失以 “-”填列）	2,356,454.05	10,824,073.65
其中：股票投资收益	0.00	0.00
基金投资收益	122,675.05	18,618.28
债券投资收益	1,862,429.56	10,690,485.99
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	371,349.44	114,969.38
3. 公允价值变动收益 （损失以“-”号填列）	244,193.04	4,796,104.92
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）	-32,433.72	-69,687.14
减：二、费用	1,343,724.26	602,505.44
1. 管理人报酬	1,226,861.82	481,425.76
其中：固定管理费	694,386.61	481,425.76
业绩报酬	532,475.21	0.00
2. 托管费	23,146.24	16,047.49
3. 销售服务费	0.00	0.00
4. 外包服务费	23,146.24	16,047.49
5. 交易费用	2,773.24	3,285.09
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	67,796.72	85,699.61
三、利润总额（亏损 总额以“-”号填列）	7,299,609.31	19,841,826.26
减：所得税费用	0.00	0.00
四、净利润（净亏损 以“-”号填列）	7,299,609.31	19,841,826.26

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)	133,393,622.27	7,399,221.53	140,792,843.80
二、本期经营活动产生 的基金净值变动数 (本期利润)	0.00	7,299,609.31	7,299,609.31
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)	-48,847,708.57	-3,280,907.29	-52,128,615.86
其中：1. 基金申购款	66,895,506.43	5,401,402.82	72,296,909.25
2. 基金赎回款	-115,743,215.00	-8,682,310.11	-124,425,525.11
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	-5,324,550.82	-5,324,550.82
五、期末所有者权益 (基金净值)	84,545,913.70	6,093,372.73	90,639,286.43
项目	上年度可比期间 2021/01/01 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)	46,116,357.54	-1,367,423.42	44,748,934.12
二、本期经营活动产生 的基金净值变动数 (本期利润)	0.00	19,841,826.26	19,841,826.26
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)	87,277,264.73	10,233,305.06	97,510,569.79
其中：1. 基金申购款	115,899,804.13	10,657,550.45	126,557,354.58
2. 基金赎回款	-28,622,539.40	-424,245.39	-29,046,784.79
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	-21,308,486.37	-21,308,486.37
五、期末所有者权益 (基金净值)	133,393,622.27	7,399,221.53	140,792,843.80

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	1,024,020.07
境内未上市、未挂牌公司股权投资	股权投资	0.00
	其中：优先股	0.00
	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	0.00
新三板投资	新三板挂牌企业投资	0.00
境内证券投资规模	结算备付金	3,524,039.60
	存出保证金	0.00
	股票投资	0.00
	债券投资	69,740,500.66
	其中：银行间市场债券	3,849,959.66
	其中：利率债	0.00
	其中：信用债	69,740,500.66
	资产支持证券	0.00
	基金投资（公募基金）	8,605,588.21
	其中：货币基金	8,595,556.81
	期货及衍生品交易保证金	0.00
	买入返售金融资产	8,007,490.42
	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	应收股利#62102.90;
基金负债情况	债券回购总额	0.00
	融资、融券总额	0.00
	其中：融券总额	0.00
	银行借款总额	0.00
	其他融资总额	

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	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:

-

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

