

安信证券全球新动能 QDII 集合资产管理计划  
2022 年年度报告

管理人:安信证券资产管理有限公司

托管人:招商银行股份有限公司

报告期:2022 年 01 月 01 日-2022 年 12 月 31 日

## 重要提示

本报告由集合计划管理人编制。托管人招商银行股份有限公司根据本集合资产管理计划合同规定，已复核了本报告中的主要会计数据和财务指标、收益分配情况、年度财务报表、投资组合报告的财务数据内容。

管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用集合资产管理计划资产，但不保证集合资产管理计划一定盈利。

集合资产管理计划的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，委托人在做出投资决策前应仔细阅读本集合资产管理计划合同及风险揭示书。

本集合计划 2022 年年度报告的财务资料由信永中和会计师事务所审计。

本报告书中的内容由管理人负责解释。

## 一、资产管理计划产品概况

资产管理计划名称	安信证券全球新动能QDII集合资产管理计划
资产管理计划简称	安信证券全球新动能QDII
资产管理计划编码	SJP011
资产管理计划运作方式	契约型开放式
资产管理计划合同生效日	2020年01月21日
资产管理人	安信证券资产管理有限公司
资产托管人	招商银行股份有限公司
报告期末资产管理计划份额总额	21,700,734.95份

## 二、主要财务指标、资产管理计划净值表现、利润分配情况以及业绩表现

### (一) 主要会计数据和财务指标

单位：人民币元

<b>期间数据和指标</b>	
本期已实现收益	481,177.80
本期利润	-8,069,286.57
本期资产管理计划份额净值增长率	-23.27%
<b>期末数据和指标</b>	
期末可供分配利润	-1,275,965.46
期末可供分配资产管理计划份额利润	-0.0588
期末资产管理计划资产净值	20,424,769.49
期末资产管理计划份额净值	0.9412
<b>累计期末指标</b>	
资产管理计划份额累计净值增长率	-5.88%

### (二) 集合计划累计单位净值增长率历史走势图

安信证券全球新动能QDII集合资产管理计划累计净值增长率走势图



### （三）收益分配情况

本报告期内本集合计划未进行收益分配。

### （四）业绩表现

截至期末，安信证券全球新动能QDII集合资产管理计划产品单位净值为0.9412元，累计单位净值0.9412元，集合计划本期单位净值增长率-23.27%。

## 三、管理人报告

### （一）投资经理（或投资经理小组）简介

李珊珊，女，伦敦大学帝国理工学院金融学硕士及英国约克大学经济学学士，2007-08年任巴克莱资本消费与地产行业分析师，2008-15年先后担任国家主权财富基金中国投资有限责任公司（CIC）对冲基金投资分析师、公开市场股票自营投资经理，2015-18年任华夏财富创新投资有限公司投资经理，现任安信证券资产管理有限公司海外投资总监。

本报告期内投资经理是否变更：否。

### （二）投资经理工作报告

#### 1、市场回顾和运作情况

2022年对全球金融市场充满挑战，主导全球市场交易的主线是通胀持续超预期带来的无风险利率的不断抬升，而背后的原因包括美国需求的韧性超预期、俄乌局势带来的突发扰动、中国疫情对全球供应链带来冲击等多方面因素。整体看，大类资产主要表现为能源走强、美元走强，而其他资产普跌，美债利率涨幅创下历年之最，标普500指数下跌19%，对利率更敏感的纳斯达克指数全年下跌33%，创了2008年以来的年度最大跌幅。

## 2、市场展望与投资策略

美国经济软着陆/浅衰退的概率较大，并无系统性风险；随着经济下半年衰退，预计海外会逐步进入降息交易。短期，美国的就业、经济和通胀数据短期呈现出较强的韧性；但随着全球大宗商品拐点的出现、以及中国供应链的恢复，通胀向下趋势已经确立，预计美联储上半年将结束加息。经济方面，美国衰退仍然是全年主基调，但本轮经济周期中，居民和企业的资产负债表都较为健康；而近期SVB和瑞信银行的风险事件，均属于较为个例的原因（SVB主要因利率快速上行导致的流动性压力，瑞信则是历史遗留的资产端问题），并且美联储和瑞士央行均迅速反应，预计外溢风险较小。

美联储加息预期已经逐步明朗，再超预期的概率较小，无风险利率顶部或已现。短期美国经济进入衰退、企业盈利下修的压力逐步显现，预计大盘仍然缺乏向上的催化，以震荡筑底为主；而随着通胀和经济增长的逐步明朗，市场有望在下半年开始交易经济软着陆和货币宽松的预期，我们对美股整体谨慎乐观。

结构上，以半导体、软件龙头为代表的美股科技股已经在盈利下行的尾声，同时充分受益于美国本轮AI革命，下半年有望业绩回暖。同时，成长股对利率更敏感，随着降息预期的出现，估值空间将逐步打开。我们看好美股科技股的投资机会。

### （三）风险控制报告

#### 1、集合计划合规性声明

本报告期内，集合计划管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》及其他相关法律法规的规定，严格执行内部各项管理制度，本着诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用本集合计划资产。

本报告期内，集合计划管理人严格按照有关的法律法规、集合资产管理合同与说明书、与公司相关制度进行投资运作，没有出现重大违法违规行为，投资管理各项业务均符合相关规定。

#### 2、风险控制报告

本报告期内，管理人针对本集合计划的运作特点，通过日常风险监控工作和风险预警机制，对业务运作过程中可能出现的风险状况进行全面检查，及时进行风险提示，评

估集合计划运作过程中面临的市场风险、信用风险和流动性风险，确保集合计划运作风险水平与其投资目标相一致。

本报告期内，集合计划管理人严格按照有关法律法规、公司制度和集合计划合同书进行集合计划资产的管理运作。本集合计划持有的证券符合投资范围及投资比例的要求，相关的信息披露和财务数据皆真实、准确、及时。

#### 四、年度财务报表

##### (一) 资产负债表

会计主体：安信证券全球新动能QDII集合资产管理计划

报告截止日：2022年12月31日

单位：人民币元

项 目	2022 年 12 月 31 日	2021 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		
银行存款	4,839,975.87	6,780,379.89
结算备付金	1,001.00	189,794.96
存出保证金		3,776.26
交易性金融资产	16,267,840.32	34,279,701.00
其中：股票投资	15,402,000.55	31,255,701.00
基金投资	865,839.77	3,024,000.00
债券投资		
资产支持证券投资		
贵金属投资		
其他投资		
衍生金融资产		
买入返售金融资产		
债权投资		
其他债权投资		
其他权益工具投资		
应收清算款		36,807.87
应收股利	3,466.69	3,466.02
应收申购款		
递延所得税资产		
其他资产		248.01
<b>资产合计</b>	<b>21,112,283.88</b>	<b>41,294,174.01</b>
<b>负债：</b>		
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		
应付清算款	600,078.35	0.04
应付赎回款		
应付管理人报酬	69,277.92	166,699.78
应付托管费	10,658.12	25,646.09
应付销售服务费		
应付投资顾问费		
应交税费		56,748.81
应付利润		
递延所得税负债		
其他负债	7,500.00	23,246.56
<b>负债合计</b>	<b>687,514.39</b>	<b>272,341.28</b>
<b>净资产：</b>		
实收基金	21,700,734.95	33,441,415.17
其他综合收益		
未分配利润	-1,275,965.46	7,580,417.56
<b>净资产合计</b>	<b>20,424,769.49</b>	<b>41,021,832.73</b>
<b>负债与净资产总计</b>	<b>21,112,283.88</b>	<b>41,294,174.01</b>

注：截至 2022 年 12 月 31 日，本集合计划未达到业绩报酬计提标准，无暂估业绩报酬金额。集合计划份额净值 0.9412 元，集合计划份额总额 21,700,734.95 份。

## （二）利润表

会计主体：安信证券全球新动能 QDII 集合资产管理计划

本报告期：2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	2022 年度	2021 年度
<b>一、营业总收入</b>	<b>-7,630,364.48</b>	<b>9,243,647.93</b>
1. 利息收入	13,791.03	37,796.92
其中：存款利息收入	13,791.03	31,778.23
债券利息收入		
资产支持证券利息收入		
买入返售金融资产利息收入		6,018.69
证券出借利息收入		
其他利息收入		
2. 投资收益（损失以“-”填列）	402,235.53	34,598,158.53

其中：股票投资收益	-54,134.04	31,676,634.93
基金投资收益	403,395.51	3,735,769.13
债券投资收益		
资产支持证券投资收益		
贵金属投资收益		
衍生工具收益		
股利收益	71,934.34	235,872.98
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		
其他投资收益	-18,960.28	-1,050,118.51
3. 公允价值变动收益(损失以“-”填列)	-8,556,544.60	-24,592,826.98
4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)	510,153.56	-799,480.54
5.其他收入(损失以“-”号填列)		
<b>二、营业总支出</b>	<b>438,922.09</b>	<b>2,507,313.67</b>
1.管理人报酬	353,993.38	1,168,022.85
其中：暂估管理人报酬		
2. 托管费	54,460.52	179,695.76
3. 销售服务费		
4. 投资顾问费		
5. 利息支出		
其中：卖出回购金融资产利息支出		
6.信用减值损失		
7.税金及附加	-3,805.11	35,159.37
8.其他费用	34,273.30	1,124,435.69
<b>三、利润总额</b>	<b>-8,069,286.57</b>	<b>6,736,334.26</b>
减：所得税费用		
<b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>	<b>-8,069,286.57</b>	<b>6,736,334.26</b>
五、其他综合收益的税后净额		
<b>六、综合收益总额</b>	<b>-8,069,286.57</b>	<b>6,736,334.26</b>

### (三) 所有者权益(集合计划净值)变动表

会计主体：安信证券全球新动能QDII集合资产管理计划

本报告期：2022年01月01日至2022年12月31日

单位：人民币元



安信证券全球新动能 QDII 集合资产管理计划 2022 年年度报告

项 目	2022 年度				2021 年度			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上年年末净资产（计划净值）	33,441,415.17		7,580,417.56	41,021,832.73	179,885,679.42		37,056,301.25	216,941,980.67
加：会计政策变更								
前期差错更正								
其他								
二、本年初净资产（计划净值）	33,441,415.17		7,580,417.56	41,021,832.73	179,885,679.42		37,056,301.25	216,941,980.67
三、本年增减变动额（减少以“-”号填列）	-11,740,680.22		-8,856,383.02	-20,597,063.24	-146,444,264.25		-29,475,883.69	-175,920,147.94
（一）综合收益总额			-8,069,286.57	-8,069,286.57			6,736,334.26	6,736,334.26
（二）本年计划份额交易产生的计划净值变动数（减少以“-”号填列）	-11,740,680.22		-787,096.45	-12,527,776.67	-146,444,264.25		-36,212,217.95	-182,656,482.20
其中：1. 计划申购款					30,983,521.83		8,207,676.16	39,191,197.99
2. 计划赎回款	-11,740,680.22		-787,096.45	-12,527,776.67	-177,427,786.08		-44,419,894.11	-221,847,680.19
（三）本年年向计划份额持有人分配利润产生的计划净值变动数（减少以“-”号填列）								
（四）其他综合收益结转留存收益								

四、本年年末净资产（计划净值）	21,700,734.95	-1,275,965.46	20,424,769.49	33,441,415.17		7,580,417.56	41,021,832.73
-----------------	---------------	---------------	---------------	---------------	--	--------------	---------------

## 五、投资组合报告

### （一）期末资产管理计划资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额（元）	占资产管理计划总资产的比例（%）
1	权益投资	15,402,000.55	72.95
	其中：股票	15,402,000.55	72.95
2	基金投资	865,839.77	4.10
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	4,840,976.87	22.93
8	其他各项资产	3,466.69	0.02
9	合计	21,112,283.83	100.00

### （二）其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	
2	应收证券清算款	
3	应收股利	3,466.69
4	应收利息	

5	应收申购款	
6	其他应收款	
7	其他	
8	合计	3,466.69

(三) 报告期末在各个国家(地区)证券市场的股票及存托凭证投资分布

国家(地区)	公允价值(人民币元)	占资产管理计划资产净值比例(%)
美国	12,293,773.79	60.19
中国香港	3,108,226.76	15.22
合计	15,402,000.55	75.00

(四) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票及存托凭证投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占资产管理计划资产净值比例(%)
1	AAPL	Apple Inc	1343	1,215,294.77	5.95
2	AMD	Advanced Micro Devices Inc	2656	1,198,114.01	5.87
3	NVDA	NVIDIA Corp	1131	1,151,139.31	5.64
4	BA	Boeing Co	742	984,401.50	4.82
5	TSLA	Tesla Inc	945	810,714.96	3.97
6	HTHT	Huazhu Group Ltd	2600	768,139.66	3.76
7	BABA	ALIBABA GROUP HOLDING LTD SPON ADS EACH REP 8 ORD	979	600,627.87	2.94
8	2602	Onewo Inc	13300	582,738.08	2.85
9	ENPH	ENPHASE ENERGY INC	297	548,066.10	2.68
10	SNOW	SNOWFLAKE INC	545	544,835.78	2.67

(五) 报告期末按公允价值占资产管理计划资产净值比例大小排序的前十名公募基金投资明细

金额单位：人民币元

序号	名称	类型	运作方式	管理人	公允价值	占资产管理计划资产净值比例 (%)
1	KRANESHARES TR CSI CHINA INTER NET ETF	ETF基金	交易型 开放式	-	457,680.08	2.24
2	SELECT SECTOR S PDR TRUST ENERG Y	开放式 基金	交易型 开放式	-	408,159.69	2.00

#### (六) 两费及业绩报酬说明

项目	计提方式
管理费	1.3%/年，每日计提，按季支付
托管费	0.2%/年，每日计提，按季支付
业绩报酬	若符合业绩报酬提取条件，管理人于本资产管理计划分红日、投资者退出日和本资产管理计划终止日提取业绩报酬。如果投资者持有每笔资产管理计划份额的区间年化收益率小于或等于业绩报酬计提基准 6%，管理人不提取业绩报酬；如果投资者持有每笔资产管理计划份额的区间年化收益率大于业绩报酬计提基准 6%，管理人将对超过部分的收益提取 20% 作为业绩报酬。

### 六、资产管理计划份额变动

#### (一) 集合计划份额变动情况

单位：份

本报告期期初资产管理计划份额总额	33,441,415.17
本报告期资产管理计划总参与份额	-
减：本报告期资产管理计划总退出份额	11,740,680.22
本报告期资产管理计划拆分变动份额	-
本报告期期末资产管理计划份额总额	21,700,734.95

#### (二) 关联方持有本集合计划份额变动情况

单位：份

期初份额	3,095,081.22
报告期间参与份额	-
红利再投资份额	-
报告期间退出份额	
报告期末份额	3,095,081.22
期末份额占集合计划总份额的比例	14.26%

注：关联方指本公司董事、监事、从业人员及其配偶、控股股东、实际控制人或者其他关联方。

### 七、重大事项报告

本报告期内，本集合资产管理计划管理人住所地址变更，详见公告。

安信证券资产管理有限公司  
2023年04月25日

