**创想天空新三板定增私募投资基金 2019年年度报告**

**2019年12月31日**

**送出日期：二零二零年三月十七日**

1. 基金产品概况
	1. 基金基本情况

|  |  |
| --- | --- |
| 基金名称 | 创想天空新三板定增私募投资基金 |
| 基金编号 | SS8584 |
| 基金运作方式 | 开放式 |
| 基金成立日期 | 2017-04-06 |
| 基金管理人 | 深圳前海第一基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 海通证券股份有限公司 |
| 投资顾问（如有） |  |
| 报告期末基金份额总额（份） | 7,003,009.03 |
| 基金到期日期 |  |

* 1. 基金产品说明

|  |  |
| --- | --- |
| 投资目标 | 本基金在深入研究的基础上构建投资组合，在严格控制投资风险的前提下，力求获得长期稳定的投资目标。 |
| 投资策略 | 采用PE的投资模式，重点投资于符合国家产业规划喝经济发展形势的行业，从中发掘持续追逐着中国经济发展而高速成长的成长型公司，实现基金持续的稳定增值。本基金为主动型股权投资基金、采取适度灵活的资产配资策略，在配置高成长型公司股票的基础上，配合风控措施择机加入债券类资产以降低风险。本基金是高风险的产品，其风险高于混合基金、债券基金与货币市场基金。 |
| 业绩比较基准（如有） |  |
| 风险收益特征 | 高风险 |

* 1. 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 | 深圳前海第一基金管理有限公司 | 海通证券股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 叶沛荣 | 朱稼翔 |
| 联系电话 | 13532868887 | 021-23219351 |
| 电子邮箱 | no1jijin@163.com | zhujx@htsec.com |
| 传真 | 0769-23039520 | 021-63410637 |
| 注册地址 | 深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室 | 上海市黄浦区广东路689号 |
| 办公地址 | 东莞市南城区鸿福路102号汇成大厦1501 | 上海市黄浦区广东路689号 |
| 邮政编码 | 523000 | 200001 |
| 法定代表人 | 叶灼荣 | 周杰 |

* 1. 信息披露方式

|  |
| --- |
| 管理人应当通过投资者预留电话、邮箱、邮寄信件、管理人官方网站或投资者认可的其他方式及时披露基金信息。 |

* 1. 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 |  |  |
| 外包机构 | 海通证券股份有限公司 | 上海市黄浦区广东路689号 |
| 其他 |  |  |

1. 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况
	1. 主要会计数据和财务指标

金额单位：元

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 期间数据和指标 | 2019年 | 2018年 | 2017年 |
| 本期已实现收益 | 875,038.41 | -288,454.93 | -85,994.97 |
| 本期利润 | -6,024,961.59 | 6,611,545.07 | -85,994.97 |
| 期末数据和指标 | 2019年末 | 2018年末 | 2017年末 |
| 期末可供分配利润 | -92,096.75 | -377,458.93 | -89,004.00 |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.0132 | -0.0539 | -0.0127 |
| 期末基金资产净值 | 6,910,912.28 | 13,525,550.10 | 6,914,005.03 |
| 期末基金份额净值 | 0.987 | 1.931 | 0.987 |
| 累计期末指标 | 2019年末 | 2018年末 | 2017年末 |
| 基金份额累计净值增长率 | 7.10% | 93.10% | -1.30% |

* 1. 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 | -44.54 | - | - | - |
| 自基金合同生效起至今 | 7.10 | - | - | - |

* 1. 过去三年基金的利润分配情况

金额单位：元

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 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 | 年度利润分配情况 | 备注 |
| 2019 | 0.0842 | 589,676.23 | 0.00 | 589,676.23 |  |
| 2018 | 0.0000 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |  |
| 2017 | 0.0000 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |  |

1. 基金份额变动情况

单位：份

|  |  |
| --- | --- |
| 报告期期初基金份额总额 | 7,003,009.03 |
| 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  | 0.00 |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | 0.00 |
| 报告期期末基金份额总额 | 7,003,009.03 |

1. 管理人说明的其他情况

|  |
| --- |
|  |

1. 托管人报告（如有）
	1. 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

|  |
| --- |
|  |

* 1. 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

|  |
| --- |
|  |

* 1. 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

|  |
| --- |
|  |

1. 年度财务报表

金额单位：元

* 1. 资产负债表

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 资产 | 2019-12-31 | 2018-12-31 |
| 资产： |  |  |
| 银行存款 | 62,085.55 | 946,961.93 |
| 结算备付金 | 509.99 | 508.19 |
| 存出保证金 | 0.00 | 0.00 |
| 交易性金融资产 | 6,998,428.52 | 13,898,428.52 |
| 其中：股票投资 | 6,900,000.00 | 13,800,000.00 |
|  基金投资 | 98,428.52 | 98,428.52 |
|  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 | 0.00 | 0.00 |
| 应收股利 | 5,964.91 | 3,393.83 |
| 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 | 7,066,988.97 | 14,849,292.47 |
| 负债和所有者权益 |  |  |
| 负债： | 本期末： | 上年度末： |
| 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 | 144,349.49 | 364,416.43 |
| 应付托管费 | 5,863.60 | 20,912.97 |
| 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 | 0.00 | 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 | 5,863.60 | 938,412.97 |
| 负债合计 | 156,076.69 | 1,323,742.37 |
| 所有者权益： |  |  |
| 实收基金 | 7,003,009.03 | 7,003,009.03 |
| 未分配利润 | -92,096.75 | 6,522,541.07 |
| 所有者权益合计 | 6,910,912.28 | 13,525,550.10 |
| 负债和所有者权益总计 | 7,066,988.97 | 14,849,292.47 |

* 1. 利润表

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
| 2019-1-1 至 2019-12-31 | 2018-1-1至 2018-12-31 |
| 一、收入 | -5,860,049.44 | 6,906,334.99 |
| 1、利息收入 | 2,379.48 | 2,795.51 |
| 其中：存款利息收入 | 2,379.48 | 2,795.51 |
|  债券利息收入 | 0.00 | 0.00 |
|  资产支持证券利息收入 | 0.00 | 0.00 |
|  买入返售金融资产收入 | 0.00 | 0.00 |
|  其他利息收入 | 0.00 | 0.00 |
| 2、投资收益（损失以“-”填列） | 2,571.08 | 3,539.48 |
| 其中：股票投资收益 | 0.00 | 0.00 |
|  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 | 2,571.08 | 3,539.48 |
| 3、公允价值变动收益
（损失以“-”填列） | -6,900,000.00 | 6,900,000.00 |
| 4、汇兑收益（损失以“-”填列） | 0.00 | 0.00 |
| 5、其他收入（损失以“-”填列） | 1,035,000.00 | 0.00 |
| 减：二、费用 | 164,912.15 | 294,789.92 |
| 1．管理人报酬 | 144,349.49 | 267,759.98 |
| 其中：固定管理费 | 144,349.49 | 267,759.98 |
| 业绩报酬 | 0.00 | 0.00 |
| 2、托管费 | 10,270.63 | 13,514.97 |
| 3、销售服务费 | 0.00 | 0.00 |
| 4、外包服务费 | 10,270.63 | 13,514.97 |
| 5、交易费用 | 0.00 | 0.00 |
| 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 | 21.40 | 0.00 |
| 三、利润总额
（亏损总额以“-”号填列） | -6,024,961.59 | 6,611,545.07 |
| 减：所得税费用 | 0.00 | 0.00 |
| **（净亏损以“-”号填列）**四、净利润（净亏损以“-”号填列） | -6,024,961.59 | 6,611,545.07 |

* 1. 所有者权益变动表

|  |  |
| --- | --- |
| 项目 | 本期 2019-1-1 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） | 7,003,009.03 | 6,522,541.07 | 13,525,550.10 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | 0.00 | -6,024,961.59 | -6,024,961.59 |
| 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（净值减少以“-”号填列） | 0.00 | -589,676.23 | -589,676.23 |
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 7,003,009.03 | -92,096.75 | 6,910,912.28 |
| 项目 | 2018-1-1 至 2018-12-31 |
| 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） | 7,003,009.03 | -89,004.00 | 6,914,005.03 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | 0.00 | 6,611,545.07 | 6,611,545.07 |
| 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（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） | 7,003,009.03 | 6,522,541.07 | 13,525,550.10 |

1. 期末投资组合情况
	1. 期末基金资产组合情况

金额单位：元

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 序号 | 项目 | 金额（元） | 占基金总资产的比例（%） |
| 1 | 权益投资 | 6,900,000.00 | 97.64 |
|  | 其中：普通股 | 6,900,000.00 | 97.64 |
|  |  存托凭证 | 0.00 | 0.00 |
| 2 | 基金投资 | 98,428.52 | 1.39 |
| 3 | 固定收益投资 | 0.00 | 0.00 |
|  | 其中：债券 | 0.00 | 0.00 |
|  | 资产支持证券 | 0.00 | 0.00 |
| 4 | 金融衍生品投资 | 0.00 | 0.00 |
|  | 其中：远期 | 0.00 | 0.00 |
|  |  期货 | 0.00 | 0.00 |
|  |  期权 | 0.00 | 0.00 |
|  |  权证 | 0.00 | 0.00 |
| 5 | 买入返售金融资产 | 0.00 | 0.00 |
|  | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | 0.00 | 0.00 |
| 6 | 货币市场工具 | 0.00 | 0.00 |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 62,595.54 | 0.89 |
| 8 | 其他各项资产 | 5,964.91 | 0.08 |
|  | 合计 | 7,066,988.97 | 100.00 |

* 1. 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

金额单元：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 | 6,900,000.00 | 99.84 |
| 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 | 6,900,000.00 | 99.84 |

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 | 0.00 | 0.00 |
| 合计 | 0.00 | 0.00 |

|  |  |
| --- | --- |
| 信息披露报告是否经托管机构复核 | 是 |