

迈科众禄科技创新 11 号 FOF 集合资产管理计划 2024 年度信息披露

报告

1、产品概况

1.1 产品基本情况

产品名称	迈科众禄科技创新 11 号 FOF 集合资产管理计划
产品编码	SGP275
运作方式	开放式
成立日期	2019-06-21
管理人名称	迈科期货股份有限公司
托管人名称	国信证券股份有限公司
投资顾问 (如有)	
期末总份额 (万份) / 期末实缴总额 (万元)	73.372534
到期日期	2029-06-20

1.2 产品说明

投资目标	本计划拟按投资策略获得收益。
投资策略	本计划通过对基金公司、基金经理与基金的挑选，选出参与科创板新股申购的优质公募基金，从而获得稳定的回报。
业绩比较基准 (如有)	6%
风险收益特征	本计划属于 R3 级投资品种。

1.3 资产管理计划管理人和托管人

项目		资产管理人	资产托管人
名称		迈科期货股份有限公司	国信证券股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杜永康	薛璐
	联系电话	021-68817712	0755-22940163
	电子邮箱	mkqhzg@mkqh.com	03339@guosen.com.cn
传真		029-88830627	0755-22940165
注册地址		陕西省西安市高新区锦业路 12 号迈科中心 43 层、41 层 4101 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		陕西省西安市高新区锦业路 12 号迈科中心 43 层、41 层 4101 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		710077	518000
法定代表人		姜晴和	张纳沙

1.4 信息披露方式

可选择下列任何一种方式，并自披露之日起五个工作日届满之日视为送达投资人：1. 寄送给投资人；2. 包括但不限于在管理人、基金业协会网站等公布；3. 电子邮件或手机短信等；4. 如委托人进行认购、参与或退出等业务时留有电子邮箱及号码等联系方式的，管理人可通过电子邮件、电报等方式将报告通知资产委托人。

1.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	永拓会计师事务所（特殊普通合伙）陕西分所	陕西省西安市高新区高新六路万象汇街区 T2 座 1205 室
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、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	2024 年	2023 年	2022 年
本期已实现收益	121,905.75	64,275.92	702,110.38
本期利润	30,153.45	-64,619.49	-241,235.51
期末数据和指标	2024 年末	2023 年末	2022 年末
期末可供分配利润	193,679.15	292,300.38	356,919.87
期末可供分配份额利润	0.2640	0.2113	0.2580
期末净资产	927,404.49	1,675,932.58	1,740,552.07
报告期期末单位净值	1.2640	1.2113	1.2580
累计期末指标	2024 年末	2023 年末	2022 年末
份额累计净值增长率	26.40	21.13	25.80

2.2 资产管理计划净值表现

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	4.35			
自合同生效起至今	26.40			

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 过去三年的利润分配情况

年度	每份资产管理计划 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
2024	0.0000	0.00	0.00	0.00	
2023	0.0000	0.00	0.00	0.00	
2022	0.0000	0.00	0.00	0.00	

3、资产管理计划份额变动情况

单位：万份/万元

报告期期初份额总额	138.363220
报告期期间总申购份额	0.000000
减：报告期期间总赎回份额	64.990686
报告期期间拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	0.000000
期末总份额/期末实缴总额	73.372534

4、管理人说明的其他情况

一、管理人对报告期内本计划运作合规守信情况的说明

报告期内，本计划管理人严格遵守《中华人民共和国合同法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《期货交易管理条例》、《期货公司监督管理办法》、《私募投资基金监督管理暂行办法》、《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》等法律法规及行业规则以及中国证监会、中国期货业协会以及中国证券投资基金业协会的有关规定及其他相关法规和计划合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用本计划资产，在严格控制风险的前提下，为本计划份额持有人谋求最大利益。报告期内未有损害本计划份额持有人利益的行为。

二、管理人对报告期内本计划的投资策略和业绩表现的说明

报告期内，本计划管理人在有效控制投资风险的基础上，追求本计划财产的稳健增值。报告期内本计划的业绩表现相对稳定。

三、管理人内部有关本计划的监察稽核工作情况

报告期内，本计划管理人保证所管理的本计划财产与管理的其他计划财产和本计划管理人的固有财产相互独立，对所管理的不同财产分别管理、分别记账，切实防范可能存在的利益冲突。

四、管理人对报告期内本计划估值程序等事项的说明

本计划管理人按照新会计准则、中国证监会相关规定和本计划合同关于估值的约定，对本计划进行估值。

五、管理人对报告期内本计划利润分配情况的说明

根据相关法律法规和本计划合同的要求，结合本计划实际运作情况，报告期内，本计划未进行收益分配。

5、托管人报告

5.1 报告期内本资产管理计划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，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本资产管理计划投资运作遵规守信、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。

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

托管人认真复核了本报告中的财务指标、净值表现等财务信息相关内容，认为其不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

托管人提示投资者关注：

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。

6.2 利润表备注中的暂估业绩报酬未经托管人复核，该金额与投资者实际承担的管理人报酬可能存在差异。

6、年度财务报表

6.1 资产负债表

单位：元

资产	本期末 2024-12-31	上年度末 2023-12-31
资产：		
银行存款	29,382.15	247,659.26
结算备付金	0.00	0.00
存出保证金	0.00	0.00
交易性金融资产	912,093.31	1,445,982.30
其中：股票投资	0.00	0.00
基金投资	912,093.31	1,445,982.30
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	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	941,475.46	1,693,641.56
负债和所有者权益	本期末 2024-12-31	上年度末 2023-12-31
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	0.00
应付赎回款	0.00	0.00
应付管理人报酬	3,497.82	6,409.15
应付托管费	4,631.34	4,474.40
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	1,310.47	2,351.03
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	4,631.34	4,474.40
负债合计	14,070.97	17,708.98
所有者权益：		

实收基金	733,725.34	1,383,632.20
未分配利润	193,679.15	292,300.38
所有者权益合计	927,404.49	1,675,932.58
负债和所有者权益合计	941,475.46	1,693,641.56

6.2 利润表

单位：元

项目	本期	上年度可比期间
	2024-01-01 至 2024-12-31	2023-01-01 至 2023-12-31
一、收入	64,769.58	-20,856.70
1.利息收入	426.15	1,754.30
其中：存款利息收入	426.15	1,754.30
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	0.00
其他利息收入	0.00	0.00
2.投资收益（损失以“-”填列）	160,889.47	109,543.87
其中：股票投资收益	0.00	0.00
基金投资收益	155,936.83	95,918.63
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	4,952.64	13,625.24
3.公允价值变动收益（损失以“-”填列）	-92,004.19	-129,361.12
4.汇兑收益（损失以“-”填列）	0.00	0.00
5.其他收入（损失以“-”填列）	-4,541.85	-2,793.75
减：二、费用	34,616.13	43,762.79
1.管理人报酬	17,323.01	26,114.41
其中：固定管理费	17,323.01	26,114.41
业绩报酬	0.00	0.00
2.托管费	5,000.00	5,000.00
3.销售服务费	0.00	0.00
4.外包服务费	5,000.00	5,000.00
5.交易费用	0.00	778.84
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	7,293.12	6,869.54
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	30,153.45	-64,619.49
减：所得税费用	0.00	0.00
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	30,153.45	-64,619.49

备注：2024年12月31日，该产品的暂估业绩报酬金额为0.00元。

6.3 所有者权益变动表

单位：元

项目	本期 (2024-01-01至2024-12-31)		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初余额	1,383,632.20	292,300.38	1,675,932.58
二、本期经营活动产生的资产净值变动数（本期利润）	0.00	30,153.45	30,153.45
三、本期资产份额交易产生的资产净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-649,906.86	-128,774.68	-778,681.54
其中：1.产品申购	0.00	0.00	0.00
2.产品赎回	-649,906.86	-128,774.68	-778,681.54
四、本期向份额持有人分配利润产生的资产净值变动	0.00	0.00	0.00
五、期末余额	733,725.34	193,679.15	927,404.49
项目	上年度可比期间 (2023-01-01至2023-12-31)		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初余额	1,383,632.20	356,919.87	1,740,552.07
二、本期经营活动产生的资产净值变动数（本期利润）	0.00	-64,619.49	-64,619.49
三、本期资产份额交易产生的资产净值变动数（净值减少以“-”号填列）	0.00	0.00	0.00
其中：1.产品申购	0.00	0.00	0.00
2.产品赎回	0.00	0.00	0.00
四、本期向份额持有人分配利润产生的资产净值变动	0.00	0.00	0.00
五、期末余额	1,383,632.20	292,300.38	1,675,932.58

7、期末投资组合情况

7.1 期末资产组合情况

金额单位：元

项目		金额
现金类资产	银行存款	29,382.15
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	
	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）	912,093.31
	其中：货币基金	206,469.90
	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	
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	占资产管理计划 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）	占资产管理计划资产 净值比例（%）
农、林、牧、渔业	0.00	0.00

行业类别	公允价值 (人民币)	占资产管理计划资产净值比例 (%)
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
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

特别提示：托管人已对本报告中基金相关的财务数据进行复核。



国信证券股份有限公司
资产托管业务估值核对章