

海通期货-海新 1 号集合资产管理计划

2021 年年度资产管理报告

一、集合计划产品概况

集合计划名称:	海通期货-海新 1 号集合资产管理计划
集合计划编号:	SJN538
集合计划管理人:	海通期货股份有限公司
集合计划托管人:	宁波银行股份有限公司
集合计划运作方式:	开放式
成立日期:	2019 年 12 月 27 日
成立规模:	10,300,000.00 元
报告期末份额总额:	228,843,354.62 份
存续期:	10 年
投资目标:	在有效控制风险的前提下，追求委托财产的稳健增值。
风险收益特征:	本资产管理计划预期收益及风险水平高于货币市场基金和债券型基金，详见资产管理合同风险揭示项

二、集合计划主要财务指标和净值表现

主要财务指标:

序号	主要财务指标	本年数
1	集合计划本年利润总额（元）	51,720,080.31
2	期末集合计划资产净值（元）	259,247,507.51
3	期末单位集合计划资产净值（元）	1.1329
4	期末单位集合计划累计资产净值（元）	1.1329

累计净值表现:

序号	主要财务指标	净值增长率
1	当年净值增长率（%）	7.15
2	成立以来净值增长率（%）	13.29

注：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
(当年成立的产品，当年净值增长率=（本年度末累计净值-期初累计净值）/期初累计净值)

成立以来净值增长率=（期末累计净值-期初累计净值）/期初累计净值

三、集合计划份额变动情况（单位：份）

期初总份额	期间参与份额	期间退出份额	期末总份额
710,107,658.24	831,337,703.56	1,312,602,007.18	228,843,354.62

四、集合计划年度财务报表

4.1 资产负债表

单位：人民币元

资产	期末余额	年初余额
资产：		
银行存款	1,966,906.94	9,366,034.66
结算备付金	0.00	0.00
存出保证金	159,166.42	186,870.52
交易性金融资产	269,002,300.00	170,865,600.00
其中：股票投资	0.00	0.00
债券投资	269,002,300.00	170,865,600.00
基金投资	0.00	0.00
权证投资	0.00	0.00
资产支持证券投资	0.00	0.00
	0.00	0.00
衍生金融工具	0.00	0.00
买入返售金融资产	30,800,606.20	564,902,824.93
应收证券清算款	0.00	0.00
应收利息	10,302,838.26	8,345,773.68
应收股利	0.00	0.00
应收申购款	0.00	0.00
其他资产	0.00	0.00
资产合计	312,231,817.82	753,667,103.79

资产负债表（续）

单位：人民币元

负债与持有人权益	期末余额	年初余额
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	52,099,727.00	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	248,324.28	2,472,693.32
应付托管费	24,832.45	44,771.26
应付销售服务费	0.00	0.00
应付投资顾问费	0.00	0.00
应付交易费用	7,812.24	7,762.22
应交税费	580,814.84	311,592.40
应付利息	22,799.50	0.00
应付利润	0.00	0.00
其他负债	0.00	0.00
负债合计	52,984,310.31	2,836,819.20
所有者权益:		
实收基金	228,843,354.62	710,107,658.24
未分配利润	30,404,152.89	40,722,626.35
所有者权益合计	259,247,507.51	750,830,284.59
负债和所有者权益总计	312,231,817.82	753,667,103.79

4.2 利润表

序号	项目	本期数	上年同期数
1	一、收入	53,790,991.15	44,087,384.53
2	1、利息收入	42,657,761.25	43,509,200.03
3	其中：存款利息收入	115,718.49	157,585.76
4	期货保证金利息收入	0.00	0.00
5	债券利息收入	12,463,165.84	14,839,880.54
6	资产支持证券利息收入	0.00	0.00
7	买入返售证券收入	30,078,876.92	28,511,733.73
8	2、投资收益	980,280.00	957,464.50
9	其中：股票投资收益	0.00	0.00
10	债券投资收益	980,280.00	979,288.77
11	基金投资收益	0.00	0.00
12	权证投资收益	0.00	0.00
13	资产支持证券投资收益	0.00	0.00
14	衍生工具收益	0.00	0.00
15	理财产品收益	0.00	0.00
16	股利收益	0.00	0.00

17	个股期权收益	0.00	0.00
18	商品期货期权收益	0.00	0.00
19	(减项)金融商品转让增值税	0.00	-21,824.27
20	3、公允价值变动收益	10,152,949.90	-379,280.00
21	4、其他收入	0.00	0.00
22	二、费用	2,070,910.84	1,756,633.24
23	1、管理人报酬	1,688,661.40	1,449,088.86
24	2、托管费	168,866.22	144,908.76
25	3、销售服务费	0.00	0.00
26	4、交易费用	1,623.17	36,561.73
27	5、利息支出	87,707.71	53,131.32
28	其中：卖出回购金融资产支出	87,707.71	53,131.32
29	6、增值税金附加税	44,867.13	56,042.57
30	7、暂估增值税金附加税	35,185.21	0.00
31	8、其他费用	44,000.00	16,900.00
32	9、投资顾问费用	0.00	0.00
33	三、利润总和	51,720,080.31	42,330,751.29

4.3 所有者权益变动表

项目	本期金额		
	实收基金	未分配利润	所有者权益
一、期初所有者权益(基金净值)	710,107,658.24	40,722,626.35	750,830,284.59
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	0.00	51,720,080.31	51,720,080.31
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(减少以“-”号填列)	-481,264,303.62	-62,038,553.77	-543,302,857.39
其中：1. 基金申购款	831,337,703.56	55,862,296.44	887,200,000.00
2. 基金赎回款	-1,312,602,007.18	-117,900,850.21	-1,430,502,857.39
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动数	0.00	0.00	0.00
五、期末所有者权益(基金净值)	228,843,354.62	30,404,152.89	259,247,507.51

五、集合计划期末投资组合情况（单位：人民元）

序号	项目	金额	占集合计划总资产的比例(%)
1	银行存款	1,966,906.94	0.6300
2	期货清算备付金	0.00	0.0000
3	证券清算备付金	159,166.42	0.0510
4	期货保证金占用	0.00	0.0000
5	股票投资	0.00	0.0000
6	债券投资	269,002,300.00	86.1547
7	基金投资	0.00	0.0000
8	资产支持证券投资	0.00	0.0000
9	买入返售金融资产	30,800,606.20	9.8647
10	其他交易性金融资产	0.00	0.0000
	其中：集合资产管理计划	0.00	0.0000
11	应收利息	10,302,838.26	3.2997
12	其他资产	0.00	0.0000
	资产合计	312,231,817.82	100.0000

六、报告期内集合计划运作情况

(一) 报告期内集合计划支付费用的计提基准、计提方式和支付方式

1. 报告期内本计划共计提管理费 1,688,661.40 元，托管费 168,866.22 元。各项费用的计提基准、计提方式和支付方式详见资产管理合同“资产管理计划的费用与税收”章节。

2. 报告期内本计划共计提管理人业绩报酬 1,903,351.47 元。

注：按照《企业会计准则》和《证券投资基金管理业务指引》，业绩报酬从赎回资金、拟分配利润中扣除的不计入产品利润表。

(二) 报告期内集合计划运用杠杆情况

截至本报告期末，本计划未运用杠杆进行投资运作。

(三) 报告期内集合计划收益分配情况

本计划在本报告期内未进行收益分配。

(四) 报告期内集合计划资产管理人自有资金及关联方资金参与情况

本计划在本报告期内没有管理人自有资金及关联方资金参与。

（五）报告期内集合计划关联交易、预警止损等情况说明

本计划在本报告期内未涉及关联交易，计划份额净值始终高于资管合同中设置的预警线。

（六）报告期内其他涉及投资者权益的重大事项或特别说明

本报告期内本计划未有其他涉及投资者权益的重大事项或特别说明。

七、管理人履职报告

本报告期，海通期货股份有限公司作为海通期货-海新 1 号集合资产管理计划的管理人，严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》、《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业务运作管理规定》以及其它有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用资产管理计划资产，以尽可能减少和分散投资风险、力保资产管理计划资产的安全并谋求资产管理计划资产长期稳定收益为目标，资产管理计划投资组合符合有关法规及资产管理计划合同的规定。

八、托管人履职报告

详见托管人宁波银行股份有限公司出具的托管人履职报告。

九、备查文件目录

（一）备查文件目录

- 1、《海通期货-海新 1 号集合资产管理计划合同》
- 2、《海通期货-海新 1 号集合资产管理计划证券协议》
- 3、集合计划管理人业务资格批件、营业执照。

（二）存放地点

文件存放地点：上海市浦东新区世纪大道 1589 号长泰国际金融大厦 25 层。

网址：<http://www.htfutures.com/>

EMAIL：data_wm@htfutures.com

客服热线：400-820-9133

本报告同时在海通期货股份有限公司官网资产管理板块披露。投资者对本报告书如有任何疑问，可致电或邮件咨询海通期货资产管理部。

海通期货股份有限公司
2022 年 3 月 25 日