

海通期货-步步盈高收益债 1 号集合资产管理计划

2023 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-步步盈高收益债 1 号集合资产管理计划
集合计划编号:	STM694
集合计划管理人:	海通期货股份有限公司
集合计划托管人:	招商银行股份有限公司上海分行
集合计划运作方式:	开放式
成立日期:	2021 年 12 月 16 日
成立规模:	49,670,000.00 份
报告期末份额总额:	225,546,175.17 份
存续期:	5 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:	本计划为【R4】风险等级的产品。

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)	30,104,869.13
2	期末集合计划资产净值(元)	277,572,507.09
3	期末单位集合计划资产净值(元)	1.2307
4	期末单位集合计划累计资产净值(元)	1.4107

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(%)	19.58
2	成立以来净值增长率(%)	41.07

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
21,824,963.68	228,040,239.12	-24,319,027.63	225,546,175.17

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：		
货币资金	1,224,804.92	1,389,130.85
结算备付金	0.00	0.00
存出保证金	6,410,192.19	333,263.62
衍生金融资产	0.00	0.00
应收清算款	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
买入返售金融资产	0.00	0.00
发放贷款和垫款	0.00	0.00
交易性金融资产	319,688,773.85	24,802,871.23
债权投资	0.00	0.00
其他债权投资	0.00	0.00
其他权益工具投资	0.00	0.00
长期股权投资	0.00	0.00
其他资产	0.00	0.00
资产总计	327,323,770.96	26,525,265.70

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	48,450,400.50	2,402,557.00
应付管理人报酬	313,079.63	901,327.04
应付托管费	6,261.55	1,266.61
应付销售服务费	0.00	0.00
应付投资顾问费	0.00	0.00
应交税费	980,084.69	93,272.34
应付清算款	0.00	0.00
应付赎回款	0.00	0.00
应付利息	0.00	0.00
应付利润	0.00	0.00
其他负债	1,437.50	0.00
负债合计	49,751,263.87	3,398,422.99
净资产：		
实收资金	225,546,175.17	21,824,963.68
其他综合收益	0.00	0.00
未分配利润	52,026,331.92	1,301,879.03
净资产合计	277,572,507.09	23,126,842.71
负债和净资产总计	327,323,770.96	26,525,265.70

4.2 利润表

单位：人民币元

序号	项目	本期数	上年同期数
1	一、营业总收入	35,857,217.10	6,120,802.43
2	利息收入	19,149.72	51,465.71
3	投资收益（损失以“-”填列）	17,709,249.16	8,007,618.28
4	其中：以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益	0.00	0.00
5	公允价值变动收益（损失以“-”填列）	18,128,818.22	-1,938,281.56
6	汇兑损益（损失以“-”填列）	0.00	0.00
7	其他业务收入	0.00	0.00
8	二、营业总支出	5,752,347.97	1,271,260.17
9	管理人报酬	4,714,619.20	1,100,039.18
10	其中：暂估管理人报酬	0.00	0.00
11	托管费	16,652.97	5,240.82
12	销售服务费	0.00	0.00
13	投资顾问费	0.00	0.00
14	利息支出	887,947.77	148,440.88
15	信用减值损失	0.00	0.00
16	税金及附加	115,094.43	17,539.29

17	其他费用	18,033.60	0.00
18	三、利润总额	30,104,869.13	4,849,542.26
19	减：所得税费用	-	-
20	四、净利润（净亏损以“-”号填列）	30,104,869.13	4,849,542.26
21	五、其他综合收益的税后净额	0.00	0.00
22	六、综合收益总额	30,104,869.13	4,849,542.26

4.3 净资产变动表

项目	本期金额			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末余额	21,824,963.68	0.00	1,301,879.03	23,126,842.71
加：会计政策变更	0.00	0.00	0.00	0.00
前期差错更正	0.00	0.00	0.00	0.00
其他	0.00	0.00	0.00	0.00
二、本期期初余额	21,824,963.68	0.00	1,301,879.03	23,126,842.71
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	203,721,211.49	0.00	50,724,452.89	254,445,664.38
（一）综合收益总额	0.00	0.00	30,104,869.13	30,104,869.13
（二）产品持有人申购和赎回	203,721,211.49	0.00	28,939,927.12	232,661,138.61
其中：产品申购	228,040,239.12	0.00	31,859,760.88	259,900,000.00
产品赎回	-24,319,027.63	0.00	-2,919,833.76	-27,238,861.39
（三）利润分配	0.00	0.00	-8,320,343.36	-8,320,343.36
（四）其他综合收益结转留存收益	0.00	0.00	0.00	0.00
四、本期期末余额	225,546,175.17	0.00	52,026,331.92	277,572,507.09

五、集合计划期末投资组合情况（单位：人民币元）

序号	项目	金额	占集合计划总资产的比例（%）
1	银行存款	1,224,804.92	0.37
2	期货清算备付金	0.00	0.00
3	个股期权清算备付金	0.00	0.00
4	证券清算备付金	6,410,192.19	1.96
5	期货保证金占用	0.00	0.00
6	股票投资	0.00	0.00
7	债券投资	319,688,773.85	97.67
8	基金投资	0.00	0.00
9	资产支持证券投资	0.00	0.00

10	买入返售金融资产	0.00	0.00
11	其他交易性金融资产	0.00	0.00
	其中：私募理财产品	0.00	0.00
12	应收利息	0.00	0.00
13	其他资产	0.00	0.00
	资产合计	327,323,770.96	100.00

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

报告期内本计划共计提管理费 832,654.20 元, 托管费 16,652.97 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。

报告期内本计划共计提业绩报酬 3,881,965.00 元。

注：根据《企业会计准则》和《资产管理产品相关会计处理规定》，资产管理产品当期发生的各项费用已按照权责发生制原则计入利润表。

（二）报告期内集合计划运用杠杆情况

截至本报告期末，本计划持有债券正回购合计市值 48,450,400.50 元，占净值 17.46%，杠杆比例为 117.92%。

注：杠杆比例=总资产/净资产*100

（三）报告期内集合计划收益分配情况

本计划于 2023 年 9 月 25 日进行分红，单位分红金额 0.0600 元。本次分红派发现金红利 8,320,343.36 元，再投资份额 0.00 份。

（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

截至本报告期末，本计划从业人员及配偶持有份额 4,191,745.35 份，持有份额占比 1.86%。

（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-步步盈高收益债 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

详见托管人招商银行股份有限公司上海分行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-步步盈高收益债 1 号集合资产管理计划合同》
- 2、《海通期货-步步盈高收益债 1 号集合资产管理计划证券经纪操作协议》
- 3、资产管理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：上海市浦东新区杨高南路 799 号陆家嘴世纪金融广场 3 号楼 12 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
2024 年 04 月 17 日

