

海通期货-步步盈高收益债 1 号集合资产管理计划

2023 年第 3 季度资产管理报告

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：	49,670,150.92 份
报告期：	2023 年 7 月 1 日至 2023 年 9 月 30 日
报告期末份额总额：	198,466,056.30 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	本期数
1	集合计划本期利润总额（元）	5,165,558.71
2	期末集合计划资产净值（元）	230,167,418.85
3	期末单位集合计划资产净值（元）	1.1597
4	期末单位集合计划累计资产净值（元）	1.3397

累计净值表现：

序号	主要财务指标	净值增长率
1	当季净值增长率（%）	3.66
2	对比去年同期净值增长率（%）	14.22

注：当季净值增长率=（本季度末累计净值-上季度末累计净值）/上季度末累计净值
对比去年同期净值增长率=（本季度末累计净值-去年同期累计净值）/去年同期累计净值
（成立小于 1 年的产品，对比去年同期净值增长率为“-”）

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
167,198,921.81	32,267,153.93	1,000,019.44	198,466,056.30

四、集合计划期末投资组合情况

序号	项目	金额	占集合计划总资产的比例（%）
1	银行存款	5,124,804.57	1.8940
2	期货清算备付金	0.00	0.0000
3	证券清算备付金	348,234.94	0.1287
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	265,102,062.96	97.9773
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	0.00	0.0000
10	集合资产管理计划	0.00	0.0000
11	应收利息	0.00	0.0000
12	其他资产	0.00	0.0000
	资产合计	270,575,102.47	100.0000

五、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 273,927.64 元，托管费 5,478.59 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 3,455,474.75 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，本计划持有银行间质押式回购 39,517,388.01 元，占本计划净资产 17.17%。

截至本报告期末，本计划的杠杆比例为 117.56%，杠杆比例符合相应法规要求。

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 22 进行收益分配，派发现金红利 8,320,343.36 元，单位分红金额 0.06 元。

（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，本计划管理人或其母公司的关键管理人员及与其关系密切的家庭成员共持有份额为 880,000 份，占本计划总份额 0.44%；本计划期货从业人员参与本计划的份额为 4,107,193.05 份，占本计划总份额 2.07%，符合相关法规规定。

（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。

六、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。

七、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。

八、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协议》
- 3、《海通期货-步步盈高收益债 1 号集合资产管理计划期货备忘录》
- 4、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：上海市浦东新区杨高南路 799 号 12 楼海通期货。

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

2023 年 10 月 17 日

