

东方财富证券双享 FOF 集合资产管理计划

2024 年度 2 季度管理报告

管理人：东方财富证券股份有限公司

托管人：宁波银行股份有限公司

2024 年 07 月

一、重要提示

集合计划管理人保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

集合计划托管人于 2024 年 7 月 15 日复核了本报告中的财务指标和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

集合计划管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用集合计划资产，但不保证集合计划一定盈利。

集合计划的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本集合计划的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 4 月 1 日起 2024 年 6 月 30 日止。

二、集合资产管理计划概况

(一) 名称：东方财富证券双享 FOF 集合资产管理计划（以下简称“本计划”、“资管计划”）

(二) 产品类型：混合类

(三) 产品成立日：2021-12-28

(四) 存续期限：10[年]

(五) 管理人：东方财富证券股份有限公司

(六) 托管人：宁波银行股份有限公司

三、管理人履职报告

(一) 投资经理简介

袁继飞，男，同济大学软件与理论硕士，历任长江证券研究所金融工程分析师，歌斐诺宝量化投资部基金经理，珠池资产量化投资部基金经理、副总监。现任东方财富证券资产管理总部 FOF 投资主管。

(二) 投资经理工作报告

二季度,权益市场整体下行,特别是小盘股下跌明显。市场成交也逐步萎缩,严重影响了交易类型策略获取收益的能力,特别是量化类策略。在没有明显外部增量资金的情况下,市场在底部的低迷可能会持续一段时间,各种策略的收益获取相比去年都有明显的减弱。商品市场震荡更大一些,在某些品种上产生了趋势,比如黄金等,但是更多品种依然处于低波动震荡行情中。

展望三季度,权益市场下行风险可能在一定程度上可控,但快速反转的概率或许不大。这种情况下,适合逢低适当加仓。量化类策略可能随着监管的逐渐明朗,或许会迎来适当反弹。商品类策略依然需要等待,也是个布局窗口期。

(三) 管理人对报告期内本计划运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本计划管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、中国证监会和《东方财富证券双享 FOF 集合资产管理计划管理合同》的规定,本着诚实守信、审慎尽责、谨慎勤勉的原则管理和运用本计划资产,在严格控制风险的基础上,为本计划份额持有人谋求最大利益。本报告期内,本计划运作整体合法合规,没有损害份额持有人利益。本计划的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及资产管理合同的规定。

(四) 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

1、公平交易制度和控制方法

本计划管理人根据《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》以及有关法律法规的规定,建立了公平交易制度及异常交易监控机制,公平对待所管理的不同资产,对投资交易行为进行监控、分析、评估、核查,监督投资交易的过程和结果。

2、公平交易制度的执行情况

本报告期内,本计划管理人严格执行《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》以及有关法律法规的规定,完善相应制度及流程,通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行,公平对待所管理的所有资管计划。

3、异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本计划存在异常交易行为。

四、托管人履职报告

本报告期内，本托管人在东方财富证券双享 FOF 集合资产管理计划的托管过程中，严格遵守《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》、《东方财富证券双享 FOF 集合资产管理计划管理合同》、《东方财富证券双享 FOF 集合资产管理计划托管协议》和其他有关规定，不存在损害投资者利益的行为，完全尽职尽责地履行了托管人应尽的义务。

本报告期内，本托管人按照国家有关规定、《东方财富证券双享 FOF 集合资产管理计划管理合同》、《东方财富证券双享 FOF 集合资产管理计划托管协议》和其他有关规定，对受托资产的投资运作方面进行了监督，未发现管理人有损害投资者利益的行为。

本报告期内，本集合计划未实施利润分配。

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

五、主要财务指标和集合计划投资表现情况

下述集合计划业绩指标不包括持有人认购或交易集合计划的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

| 主要财务指标 | | 单位：人民币元 |
|----------------------|-------------|---------|
| 主要财务指标 | 本期间 | |
| 本期利润扣除本期公允价值变动损益后的净额 | -101,481.90 | |
| 本期利润 | -466,950.44 | |
| 其中：本期公允价值变动损益 | -365,468.54 | |
| 加权平均份额本期利润 | -0.0465 | |
| 加权平均净值利润率 | -4.7168% | |
| 本期单位净值增长率 | -5.1152% | |
| 期末可分配利润 | -573,274.21 | |
| 期末可供分配份额利润 | -0.0614 | |

| | |
|-----------|--------------|
| 期末资产净值 | 8,761,904.13 |
| 期末单位资产净值 | 0.9386 |
| 单位累计净值增长率 | -6.1400% |

截至 2024 年 6 月 30 日，本计划单位净值为 0.9386 元。

六、集合计划投资组合报告

(一) 报告期末集合计划资产组合情况

单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|--------------|---------------|
| 1 | 权益投资 | 630,704.20 | 7.17 |
| | 其中：股票 | | |
| | 基金 | 630,704.20 | 7.17 |
| 2 | 固定收益投资 | | |
| | 其中：债券 | | |
| | 资产支持证券 | | |
| 3 | 金融衍生品投资 | | |
| 4 | 买入返售金融资产 | | |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | | |
| 5 | 银行存款和结算备付金合计 | 1,415,450.65 | 16.10 |
| 6 | 其他资产 | 6,744,295.75 | 76.72 |
| 7 | 合计 | 8,790,450.60 | 100.00 |

注：因四舍五入，期末市值占期末总资产比例的分项之和与合计可能有尾差。

(二) 投资组合报告附注

1、报告期内集合计划投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查的，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的。

2、集合计划投资的前十名证券均在集合计划合同规定可投资证券库之内。

七、财务会计报告

(一) 集合计划资产负债表

单位：人民币元

| 资产 | 期末余额 | 上年年末余额 |
|----|------|--------|
|----|------|--------|

| | | |
|-------------|---------------------|----------------------|
| 资 产： | | |
| 货币资金 | 1,068,228.04 | 1,351,099.87 |
| 结算备付金 | 347,222.61 | 7,953.18 |
| 存出保证金 | 609,105.14 | 3,434.16 |
| 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 | | |
| 交易性金融资产 | 6,765,894.81 | 14,363,420.12 |
| 债权投资 | 0.00 | 0.00 |
| 其他债权投资 | | |
| 其他权益工具投资 | | |
| 长期股权投资 | 0.00 | 0.00 |
| 其他资产 | 0.00 | 0.00 |
| 资产总计 | 8,790,450.60 | 15,725,907.33 |

集合计划资产负债表（续）

单位：人民币元

| 负债和净资产 | 期末余额 | 上年年末余额 |
|-----------------|---------------------|----------------------|
| 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 | 0.00 | 0.00 |
| 应付管理人报酬 | 24,697.31 | 45,734.61 |
| 应付托管费 | 493.93 | 914.73 |
| 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 | 73.11 | 0.00 |
| 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 | 3,282.12 | 5,425.40 |
| 负债合计 | 28,546.47 | 52,074.74 |
| 净资产： | | |
| 实收资金 | 9,335,178.34 | 15,592,318.30 |
| 其他综合收益 | | |
| 未分配利润 | -573,274.21 | 81,514.29 |
| 净资产合计 | 8,761,904.13 | 15,673,832.59 |
| 负债和净资产总计 | 8,790,450.60 | 15,725,907.33 |

(二) 集合计划经营业绩表

单位：人民币

元

| 项目 | 本期金额 | 上期金额 |
|--------------------------|-------------|-------------|
| 一、营业总收入 | -440,259.87 | -182,264.52 |
| 利息收入 | 2,294.38 | 1,390.90 |
| 投资收益（损失以“-”填列） | -77,085.71 | 595,700.05 |
| 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 |
| 公允价值变动收益（损失以“-”填列） | -365,468.54 | -779,355.47 |
| 汇兑损益（损失以“-”填列） | 0.00 | 0.00 |
| 其他业务收入 | 0.00 | 0.00 |
| 二、营业总支出 | 26,690.57 | 35,582.47 |
| 管理人报酬 | 24,697.31 | 33,145.64 |
| 其中：暂估管理人报酬 | 0.00 | 0.00 |
| 托管费 | 493.93 | 662.93 |
| 销售服务费 | 0.00 | 0.00 |
| 投资顾问费 | 0.00 | 0.00 |
| 利息支出 | 0.00 | 0.00 |
| 信用减值损失 | 0.00 | 0.00 |
| 税金及附加 | 7.84 | 282.41 |
| 其他费用 | 1,491.49 | 1,491.49 |
| 三、利润总额 | -466,950.44 | -217,846.99 |
| 减：所得税费用 | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | -466,950.44 | -217,846.99 |
| 五、其他综合收益的税后净额 | | |
| 六、综合收益总额 | -466,950.44 | -217,846.99 |

八、投资收益分配情况

本报告期内，未发生投资收益分配情况。

九、管理费、托管费、业绩报酬（如有）的计提基准、计提方式和支付方式

本报告期间，本计划的管理费、托管费、业绩报酬（如有）的计提基准、计提方式和支付方式均按资产管理合同的约定执行，未发生变化。

十、投资经理变更、重大关联交易等涉及投资者权益的重大事项的说明

（一）投资经理变更情况

本报告期内，未发生投资经理变更情况。

（二）重大关联交易情况

本报告期内，未发生重大关联交易。

（三）其它涉及投资者权益的重大事项情况

本报告期内，有管理人从业人员参与了本计划，详见 2024 年 5 月 15 日披露的《东方财富证券双享 FOF 集合资产管理计划关于管理人从业人员参与的公告》。

十一、备查文件目录

（一）备查文件目录

- 1、备案确认函；
- 2、《东方财富证券双享 FOF 集合资产管理计划资产管理合同》；
- 3、《东方财富证券双享 FOF 集合资产管理计划托管协议》；
- 4、《东方财富证券双享 FOF 集合资产管理计划说明书》；
- 5、合规审查意见；
- 6、集合计划管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、集合计划托管人业务资格批件、营业执照。

（二）存放地点

文件存放地点：上海市徐汇区宛平南路 88 号金座

信息披露网址：<http://www.18.cn/>

信息披露电话：95357

投资者对本报告书如有任何疑问，可咨询管理人东方财富证券股份有限公司。

