

安信资管同享收益1号集合资产管理计划 2024年第2季度报告

资产管理人:安信证券资产管理有限公司

资产托管人:中信银行股份有限公司杭州分行

§1 重要提示

本报告由集合计划管理人编制。托管人中信银行股份有限公司杭州分行根据本集合资产管理计划合同规定，已复核了本报告中的主要财务指标、报告期内资产管理计划投资收益分配情况、投资组合报告（不包含业绩报酬）、集合计划份额变动情况的财务数据的内容。

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

集合资产管理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资产管理计划合同及风险揭示书。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自2024年04月01日起至2024年06月30日止。

§2 资产管理计划产品概况

资产管理计划全称	安信资管同享收益1号集合资产管理计划
资产管理计划成立日	2023年12月21日
报告期末资产管理计划份额总额	14,415,487.15份
资产管理人	安信证券资产管理有限公司
资产托管人	中信银行股份有限公司杭州分行

§3 主要财务指标和资产管理计划净值表现及业绩表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2024年04月01日-2024年06月30日)
本期已实现收益	-89,188.09
本期利润	-887,450.13
期末资产管理计划资产净值	11,619,736.97
期末资产管理计划份额净值	0.8061

3.2 集合计划成立以来净值变动情况

安信资管同享收益1号集合资产管理计划成立以来净值变动情况
(2023年12月21日-2024年06月30日)



3.3 业绩表现

截至期末，安信资管同享收益1号集合资产管理计划单位净值为0.8061元，累计单位净值0.8061元，集合计划本期单位净值增长率-7.00%。

§4 管理人报告

4.1 投资经理（或投资经理小组）简介

陈霄汉，男，英国华威大学硕士。于2014年5月-2017年4月于华泰期货有限公司担任研究员，2017年4月-2019年4月于红塔红土基金管理有限公司任研究员，2019年5月-2022年11月于联储证券股份有限公司任投资经理。具有多年基金、期货、权益投资研究相关从业经验，对大类资产配置有独到见解，熟悉各类交易投资策略，现任安信证券资产管理有限公司多资产投资部投资经理。

4.2 报告期内本资产管理计划运作合规守信情况说明

本报告期内，集合计划管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《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》及其他相关法律法规的规定，严格执行管理人内部各项管理制度，本着诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用本集合计划资产。

本报告期内，集合计划管理人严格按照有关的法律法规、集合资产管理合同与说明书、与公司相关制度进行投资运作，没有出现重大违法违规行为，投资管理各项业务均符合相关规定。

4.3 报告期内资产管理计划的投资策略和运作分析

1、市场回顾与投资操作

2024年第二季度，沪深300指数下跌2.14%，中证500指数下跌6.5%，创业板指数下跌7.41%。市场经历了较大波动，但结构特征上仍然分化明显，红利风格持续强势，主题和微盘股经过年初迅速反弹后又转为下行，TMT、医药等行业持续偏弱。市场缺乏明确主线，整体处于下行周期，伴随少数板块快速轮动的格局。

截止6月30日，同享收益1号目前权益敞口约99%，其中15.9%为股指期货持仓，其余为采用量化多头策略私募子基金，预计未来将继续维持该配置比例和配置策略。

2、下阶段市场判断与投资展望

我们认为市场在不及预期的年报季后逐渐将进入半年报的博弈行情，海外宏观波动加大，国内宏观波动有望收敛。

本产品将根据市场以及产品开放期流动性情况调整子基金的持仓，力争为产品及投资人创造收益。

4.4 报告期内资产管理计划投资收益分配情况

本报告期内未进行收益分配。

4.5 报告期内资产管理计划关联交易情况

4.5.1 报告期内资产管理计划一般关联交易情况

无

4.5.2 报告期内资产管理计划重大关联交易情况

无

§5 投资组合报告

5.1 期末资产管理计划资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额（元）	占资产管理计划总资产的比例（%）
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	1,007,994.08	8.65
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-

6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	730,823.77	6.27
8	其他各项资产	9,913,894.68	85.08
9	合计	11,652,712.53	100.00

5.2 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	229,449.60
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	17,562.66
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	9,666,882.42
8	合计	9,913,894.68

5.3 报告期末按公允价值占资产管理计划资产净值比例大小排序的前十名公募基金投资明细

序号	名称	基金代码	类型	运作方式	管理人	公允价值(元)	占资产管理计划资产净值比例(%)
1	华泰紫金货币增利A	015649	开放式基金	契约型开放式	华泰证券(上海)资产管理有限公司	1,007,994.08	8.67

5.4 报告期末本资产管理计划投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
IM2409	IM2409	2	1,912,080.00	-107,040.00	-

公允价值变动总额合计（元）	-107,040.00
股指期货投资本期收益（元）	-64,662.16
股指期货投资本期公允价值变动（元）	-89,920.00

5.5 报告期末本资产管理计划投资的私募基金投资明细

序号	名称	运作方式	公允价值（元）	占资产管理计划资产净值比例（%）
1	龙旗股票量化多头6号私募证券投资基金	契约型开放式	2,896,236.77	24.93
2	龙旗锐泰一号私募证券投资基金	契约型开放式	2,629,027.00	22.63
3	龙旗金选股股票量化优选1号私募证券投资基金	契约型开放式	2,071,294.72	17.83
4	龙旗引航者五号私募证券投资基金	契约型开放式	2,070,323.93	17.82

5.6 资产管理计划运用杠杆情况

产品杠杆：本产品为非结构化产品，无产品杠杆。

投资杠杆：截至报告期末，本产品投资杠杆约为100.28%。

5.7 两费及业绩报酬说明

项目	计提方式
管理费	1.00%/年，每日计提，按季支付
托管费	0.02%/年，每日计提，按季支付
业绩报酬	若符合业绩报酬提取条件，管理人于本资产管理计划分红日、投资者退出日和本资产管理计划终止日提取业绩报酬。如果投资者持有每笔资产管理计划份额的区间年化收益率小于【0】%，管理人不提取业绩报酬；如果投资者持有每笔资产管理计划份额的区间年化收益率等于或大于【0】%，管理人将对超过部分的收益提取【3】%作为业绩报酬。

§6 资产管理计划份额变动

6.1 集合计划份额变动情况

单位：份

本报告期期初资产管理计划份额总额	14,871,058.21
本报告期资产管理计划总参与份额	454,959.05
减：本报告期资产管理计划总退出份额	910,530.11
本报告期资产管理计划拆分变动份额	-
本报告期期末资产管理计划份额总额	14,415,487.15

6.2 关联方持有本集合计划份额变动情况

单位：份

期初份额	-
报告期间参与份额	-
红利再投资份额	-
报告期间退出份额	-
报告期末份额	-
期末份额占集合计划总份额的比例	-

注：关联方指本公司董事、监事、从业人员及其配偶、控股股东、实际控制人或者其他关联方。

§7 其他重大事项

本报告期内，本集合资产管理计划没有其他需要披露的重大事项。

§8 查阅方式

投资者可或登录集合计划管理人网站 www.axzqzg.com 查阅，还可拨打本公司客服电话 95517 查询相关信息。

安信证券资产管理有限公司

2024年07月31日