

海通期货金玉兰一期 FOF 集合资产管理计划

2024 年第 2 季度资产管理报告

一、集合计划产品概况

集合计划名称:	海通期货金玉兰一期 FOF 集合资产管理计划
集合计划编号:	SZD675
集合计划管理人:	海通期货股份有限公司
集合计划托管人:	华泰证券股份有限公司
集合计划运作方式:	开放式
成立日期:	2023 年 2 月 27 日
成立规模:	25,000,000.00 份
报告期:	2024 年 4 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
报告期末份额总额:	147,489,672.16 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:	本计划为【R3】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	本期数
1	集合计划本期利润总额(元)	1,568,727.57
2	期末集合计划资产净值(元)	158,106,594.51
3	期末单位集合计划资产净值(元)	1.0720
4	期末单位集合计划累计资产净值(元)	1.0720

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(%)	1.11
2	对比去年同期净值增长率(%)	5.50

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

(成立少于1年的产品，暂不计算对比去年同期净值增长率)

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
125,184,433.67	35,569,616.51	13,264,378.02	147,489,672.16

四、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	13,464,710.02	8.51
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	519,621.39	0.33
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	0.00	0.00
8	基金投资	13,257,279.45	8.37
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	集合资产管理计划	130,056,540.02	82.16
12	应收利息	0.00	0.00
13	其他资产	1,002,800.00	0.63
	资产合计	158,300,950.88	100.00

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

报告期内本计划共计提管理费 177,619.57 元,托管费 7,104.74 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 6,174.19 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，本计划未运用杠杆进行投资运作。

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

截至本报告期末，本计划未有资产管理人及关联方资金参与。

（五）报告期内集合计划关联交易、预警止损等情况说明

1. 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。

2. 本报告期内本计划涉及关联交易如下：

1) 截至本报告期末，本计划持有私募资产管理产品 SZJ484【海通期货周周盈3号集合资产管理计划】的份额为7,899,753.25份，市值为8,746,606.80元，占本计划总净值5.53%。该基金的管理人为海通期货股份有限公司，系本计划管理人关联方。

2) 截至本报告期末，本计划持有私募资产管理产品 SZJ481【海通期货周周盈2号集合资产管理计划】的份额为8,820,122.39份，市值为9,793,863.90元，占本计划总净值6.19%。该基金的管理人为海通期货股份有限公司，系本计划管理人关联方。

3) 截至本报告期末，本计划持有私募资产管理产品 SZF933【海通期货套利1号集合资产管理计划】的份额为2,001,800.54份，市值为2,190,370.15元，占本计划总净值1.39%。该基金的管理人为海通期货股份有限公司，系本计划管理人关联方。

4) 截至本报告期末，本计划持有私募资产管理产品 SZD680【海通期货-海新3号集合资产管理计划】的份额为16,481,714.14份，市值为19,056,157.89元，占本计划总净值12.05%。该基金的管理人为海通期货股份有限公司，系本计划管理人关联方。

5) 截至本报告期末，本计划持有私募资产管理产品 SXN870【海通期货-海新2号集合资产管理计划】的份额为18,080,010.18份，市值为24,236,253.65元，占本计划总净值15.33%。该基金的管理人为海通期货股份有限公司，系本计划管理人关联方。

6) 截至本报告期末，本计划持有私募资产管理产品 SXG709【海通期货-钰润一号集合资产管理计划】的份额为1,802,288.91份，市值为2,076,417.05元，占本计划总净值1.31%。该基金的管理人为海通期货股份有限公司，系本计划管理人关联方。

7) 截至本报告期末，本计划持有私募资产管理产品 SVY499【海通期货-量化CTA1号集合资产管理计划】的份额为1,131,093.77份，市值为945,933.72元，占本计划总净值0.60%。该基金的管理人为海通期货股份有限公司，系本计划管理人关联方。

8) 截至本报告期末，本计划持有私募资产管理产品 SJU304【海通期货-乾坤1号集合资产管理计划】的份额为12,241,767.69份，市值为17,517,969.56

元，占本计划总净值 11.08%。该基金的管理人为海通期货股份有限公司，系本计划管理人关联方。

（六）报告期内其他涉及投资者权益的重大事项或特别说明

由于本计划采用 FOF 策略，不直接投资股票或债券，而以基金组合为投资标的，通过不同策略基金的组合，进行差异化配置，发挥组合优势，分散投资风险，以获得稳定的收益为目标。为保证本计划估值的公允、合理，管理人对本计划进行估值时采用扣减下层基金的预估业绩报酬的机制。相应的，本期报告中涉及的所有净值数据和财务数据已扣除了下层基金的预估业绩报酬。

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金玉兰一期 FOF 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

详见托管人华泰证券股份有限公司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、《海通期货金玉兰一期 FOF 集合资产管理计划合同》
- 2、《海通期货金玉兰一期 FOF 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07月09日

