

资产管理年报

大越期货

2021.4.28

2020 年



一、资产管理业务总体情况

（一）资产管理计划整体情况

1. 截至报告期末，我公司已备案且在运作过程中的资产管理计划基本情况如下：

序号	类型	类别	名称
1	管理型	商品及金融衍生品类	大越期货1号资产管理计划
2	管理型	商品及金融衍生品类	大越期货宏观对冲一号资产管理计划
3	管理型	商品及金融衍生品类	大越期货海赢一号集合资产管理计划

2. 本报告期内，我公司共终止1只资产管理计划。

序号	类型	名称	终止原因
1	管理型	大越期货宏观对冲二号资产管理计划	持续五个工作日投资者少于2人

3. 本报告期内，我公司未发行新资产管理计划。

（二）规模、收入情况

1. 截至报告期内，我公司已备案且在运作过程中的资产管理计划的规模情况如下：

单位：元

大越期货股份有限公司资管产品的资产配置净值表				
资管计划名称	大越期货1号资产管理计划	大越期货宏观对冲一号资产管理计划	大越期货宏观对冲二号资产管理计划	大越期货海赢一号集合资产管理计划
本期初资产	33389554.19	20808905.50	8700000.00	20000000.00
本期新募集受托资金	0.00	0.00	0.00	0.00
本期赎回的受托资金	16191534.19	13158077.50	8700000.00	11400000.00
本期末受托资金	17198020.00	7650828.00	0.00	8600000.00
可用货币资金	6691555.06	5741718.51	0.00	2931794.57

期货持仓占用资金	1319882.00	646782.70	0.00	670514.95
商品	1319882.00	646782.70	0.00	670514.95
金融	0.00	0.00	0.00	0.00
股票与权证市值	818341.00	0.00	0.00	453770.00
场内期权市值	0.00	0.00	0.00	0.00
固定收益证券市值	575988.80	0.00	0.00	0.00
公开募集证券投资基金	8124723.59	0.00	0.00	5201877.27
其他投资	0.00	0.00	0.00	0.00
应收利息	148431.70	0.22	0.00	19847.81
本期末资产	17678922.15	6388501.43	0.00	9277804.60
负债小计	38376.13	31794.56	0.00	138537.58
本期末净资产	17640546.02	6356706.87	0.00	9139267.02
本期末净值	1.0257	0.8309	0.8470	1.0627
本期末累积净值	1.5828	1.1043	1.0040	1.2310

2. 本报告期内，我公司资产管理业务的收入为 1369381.24 元，其中管理费收入为 893047.29 元，业绩报酬收入为 476333.95 元。

二、风险管理与内部控制情况

（一）业务运营

我公司已制定资管业务相关规章制度，能够覆盖资产管理业务的投资、交易、会计核算以及信息披露等各个环节，为资产管理业务的合法合规开展提供了制度基础。

本报告期内，我公司资产管理业务在开展过程中，各项相关规章制度均得到了有效实施。

（二）业务隔离

我公司根据《大越期货股份有限公司资管业务隔离墙制度》，资

产管理业务和其他业务，在场地、账户、资金、信息等方面相分离。此外，不同投资经理管理的资产管理计划相互隔离，切实有效的防范内幕交易、利用未公开信息交易、利益冲突和利益输送。

本报告期内，我公司严格按照业务隔离机制管理资产管理业务和其他业务，不存在利益冲突、利益输送等情况。

（三）投资决策

对于资管投资，我公司根据《大越期货股份有限公司资产管理业务投资决策制度》，实行资产管理业务评审委员会负责制，负责审批公司资产管理业务发展战略和规划，审核资产管理业务投资所涉及的重大事项等，投资经理在其授权范围内根据评审委员会决议、风控标准进行投资运作。

本报告期内，我公司资产管理业务各项投资决策均严格按照法律、行政法规、中国证监会的规定以及相应资产管理合同约定执行，不存在违法违规违约的情况。

（四）风险管理

我公司已制定《大越期货股份有限公司资产管理业务流动性风险管理制度》、《大越期货股份有限公司资管业务突发事件危机处理制度》、《大越期货股份有限公司资管业务风险控制制度》等规章制度，对各类风险的控制措施进行了规定。同时，根据监管要求，对资管业务进行压力测试。

本报告期内，大越期货1号资产管理计划于2020年3月16日结算后，经公司初步核算，本计划净值为0.8487，跌破合同约定的预警线。根据合同约定，2020年3月17日，公司通过短信方式向本计划客户发送预警短信，并于2020年3月18日报送中国证监会浙江监管局和中国证券投资基金业协会。截止2020年12月31日，公司未接到本计划客户投诉信息；大越期货宏观对冲一号资产管理计划于2020年3月12日结算后，经公司初步核算，本计划净值为0.8438，跌破合同约定的预警线。根据合同约定，2020年3月13日，公司通过短信方式向本计划客户发送预警短信，并于2020年3月17日报送中国证监会浙江监管局和中国证券投资基金业协会。截止2020年12月31日，公司未接到本计划客户投诉信息；大越期货宏观对冲二号资产管理计划于2020年3月13日结算后，经公司初步核算，本计划净值为0.8440，跌破合同约定的预警线。根据合同约定，2020年3月16日，公司通过短信方式向本计划客户发送预警短信，并于2020年3月17日报送中国证监会浙江监管局和中国证券投资基金业协会。本产品已于2020年12月18日提前终止，公司未接到本计划客户投诉信息。

（五）交易管理

我公司已制定《大越期货股份有限公司资管业务公平交易制度》、《大越期货股份有限公司资管业务异常交易日常监控与报告制度》，保证公平交易原则的实现，不得开展可能导致不公平交易和利益输送

的交易行为。

本报告期内，我公司在资产管理计划的投资过程中严格执行公司公平交易制度，交易中也严格遵循公平交易的原则，对管理的各个资产管理计划、资产管理计划投资之间没有差别对待。

本报告期内，我公司资产管理业务不存在交易价格异常行为。

本报告期内，我公司资产管理业务未发生关联交易行为。

（六）人员管理

1. 本报告期内，我公司资产管理业务投资经理、交易执行和风险控制均为专人专岗，不存在兼任的情况。

2. 我公司已实行资产管理业务收入递延，进一步完善长效激励约束机制，且不存在以人员挂靠、业务包干等方式从事资产管理业务的情况。

3. 本报告期内，我公司投资经理没有变动。

（七）第三方机构管理

我公司已制定《大越期货股份有限公司资管业务计划销售机构遴选机制》、《投资顾问尽职调查问卷》、《资管部投资顾问审批意见表》，明确销售机构和投资顾问的准入标准和程序，对相关机构资质条件、专业服务能力和风险管理制度等进行尽职调查，确保其符合法规规定。

本报告期内，我公司资产管理业务无聘请投资顾问的情况；

大越期货海赢一号集合资产管理计划聘请海通证券股份有限公司为代销机构，其他产品均无聘请销售机构的情况。

（八）业务销售和客户服务

我公司根据《大越期货股份有限公司资产管理业务销售流程》、《大越期货股份有限公司资管业务投资者适当性评估制度》，在销售、客户选择上做到不公开宣传，将合适的产品推荐给合格的客户，确保其符合法规规定。

我公司根据《大越期货股份有限公司资管业务客户投诉处理制度》，做好客户维护工作。

本报告期内，我公司无接到客户投诉。

（九）风险资本准备

我公司已根据《证券期货经营机构资产管理业务管理办法》第七十条的规定，按照行业管理，计提风险准备。

三、审计情况

我公司已根据《证券期货经营机构资产管理业务管理办法》第五十二条的规定，聘请天职国际会计师事务所对大越期货海赢一号集合资产管理计划进行审计，并出具审计报告。

我公司已根据《证券期货经营机构资产管理业务管理办法》第七十四条的规，聘请天健会计师事务所（特殊普通合伙）对资

管业务的内部控制进行审计，相关内容在《关于大越期货股份有限公司内部控制的鉴证报告》中体现。

四、其他需要说明的情况

无。

四、负责人签字

合规负责人签字：

余晓青

风控负责人签字：

余晓青

总经理签字：

张华

大越期货股份有限公司

2021年4月28日

