

大越期货安鑫集合资产管理计划

2024 年第二季季度报告

2024 年 6 月 30 日

资产管理计划托管人：长江证券股份有限公司

资产管理计划管理人：大越期货股份有限公司

报告送出日期：2024 年 7 月 26 日



1、基金基本情况

项目	信息
基金名称	大越期货安鑫集合资产管理计划
基金编码	SADU97
基金管理人	大越期货股份有限公司
基金托管人（如有）	长江证券股份有限公司
投资顾问（如有）	-
基金运作方式	开放式
基金成立日期	2023-12-07
期末基金总份额（万份）/期末基金实缴总额（万元）	96.370633
投资目标	本基金在深入研究的基础上构建投资组合，在严格控制投资风险的前提下，力求实现资产的长期增值。
投资策略	-
业绩比较基准（如有）	-
风险收益特征	中风险

2、基金净值表现

阶段	净值增长率（%）	净值增长率标准差（%）	业绩比较基准收益率（%）	业绩比较基准收益率标准差（%）
当季	14.32	-	-	-
自基金合同生效起至今	62.21	-	-	-

备注：

-

注：净值增长率=（期末累计净值-期初累计净值）/期初累计净值

当季净值增长率=（本季度末累计净值-上季度末累计净值）/上季度末净值

如为分级基金，应按级别分别列示。

表中指标均以不带百分号数值形式填写，请保留至小数点后 2 位。

3、主要财务指标

金额单位：元

项目	2024-04-01	至	2024-06-30	(元)
本期已实现收益	6,033,420.73			
本期利润	6,033,420.73			
期末基金净资产	1,563,196.43			
报告期期末单位净值	1.6221			

备注：

-

注：如为分级基金，应按级别分别列示。

4、投资组合情况

4.1 期末基金资产组合情况

金额单位：元

项目		金额
现金类资产	银行存款	2,084,517.40
境内未上市、未挂牌公司股权投资	股权投资	-
	其中：优先股	-
	其他股权类投资	-
上市公司定向增发投资	上市公司定向增发股票投资	-
新三板投资	新三板挂牌企业投资	-
境内证券投资规模	结算备付金	-
	存出保证金	211.19
	股票投资	-
	债券投资	-
	其中：银行间市场债券	-
	其中：利率债	-
	其中：信用债	-
	资产支持证券	-
	基金投资（公募基金）	-
	其中：货币基金	-
	期货及衍生品交易保证金	-
	买入返售金融资产	-
	其他证券类标的	-
资管计划投资	商业银行理财产品投资	-
	信托计划投资	-
	基金公司及其子公司资产管理计划投资	-
	保险资产管理计划投资	-
	证券公司及其子公司资产管理计划投资	-
	期货公司及其子公司资产管理计划投资	-
	私募基金产品投资	-
	未在协会备案的合伙企业份额	-
另类投资	另类投资	-

境内债权类投资	银行委托贷款规模	-
	信托贷款	-
	应收账款投资	-
	各类受（收）益权投资	-
	票据（承兑汇票等）投资	-
	其他债权投资	-
境外投资	境外投资	-
其他资产	其他资产	-
基金负债情况	债券回购总额	-
	融资、融券总额	-
	其中：融券总额	-
	银行借款总额	-
	其他融资总额	-

4.2.1 报告期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：元

序号	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-

S	综合	-	-
	合计	-	-

备注：

-

4.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
-	-	-
合计	-	-

备注：

-

5、基金份额变动情况

单位：万份/万元

报告期期初基金份额总额	2,420.643380
报告期期间基金总申购份额	1,129.733085
减：报告期期间基金总赎回份额	3,454.005832
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	0.000000
报告期期末基金份额总额	96.370633

备注：

-

注：如为分级基金，应按级别分别列示。

如基金成立日晚于报告期期初，则以基金成立日的基金份额总额作为报告期期初基金份额总额。

6、资产管理计划收益分配情况

注：本报告期内，本计划没有分红。

7、管理人报告

7.1 投资经理简介

姓名	职务	任本计划的投资经理期限		期货从业年限	说明
		任职日期	离任日期		

林洁	投资经理	2023/12/07	-	17	林洁女士具有多年产品及策略研究经验,是资深的财富管理及资产管理人,现任大越期货资产管理部经理兼投资经理,拟任本计划投资经理。
----	------	------------	---	----	--

注:1、此处的任职日期和离任日期均以公告为准。

7.2 管理人对报告期内本计划运作合规守信情况的说明

本报告期内,本计划管理人严格遵守《大越期货安鑫集合资产管理计划》的规定和《中华人民共和国证券投资基金法》等法律、法规和监管部门的相关规定,依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用资产,在认真控制投资风险的基础上,为计划份额持有人谋取最大利益。本报告期内,本计划运作整体合法合规,没有损害计划份额持有人利益。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合同的规定。

7.3 公平交易专项说明

7.3.1 公平交易制度的执行情况

本计划管理人根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》建立并健全了有效的公平交易执行体系,涵盖了研究、授权、投资决策和交易执行等投资管理活动的各个环节,确保公平对待不同投资组合,防范导致不公平交易以及利益输送的异常交易发生。

公司建立了明确的投资决策及授权制度,以科学规范的投资角色体系,采用集中交易管理加强交易执行环节的内部控制,通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现;通过建立层级完备的公司股票池和债券库,完善各类具体资产管理业务组织结构,规范各项业务之间的关系,在保证各项投资组合既具有相对独立性的同时,确保其在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会;通过对异常交易行为的监控、分析评估、监督稽核和信息披露确保公平交易过程和结果的有效监督。

本报告期内，本公司严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，确保本公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行等投资管理活动和环节得到公平对待，各投资组合均严格按照法律、法规和公司制度执行投资交易，本报告期内未发现任何违反公平交易的行为。

7.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

7.4 报告期内计划投资策略和运作分析

2024 年二季度，市场情绪有所波动，国内外风险偏好都冲高回落，但国外股市风险偏好整体依旧强劲。二季度初全球经济数据都呈走强趋势，海外债券收益率走强。此后，通胀预期降温，经济数据开始走软，海外降息周期开启，欧央行开启降息，虽美国经济在全球的优势依旧明显，但美联储降息预期重新回归，债券收益率回落趋势有所显现。国内信贷数据和地产疲软，推动国内降准降息预期高涨，债券收益率继续持续回落。

7.5 报告期内计划持有人数或基金资产净值预警说明

注：本报告期内本计划持有人数未超过 200 人，资产净值未跌破预警线。

8、托管人报告

8.1 报告期内本计划托管人合规守信情况声明

本报告期内，本计划托管人在对大越期货安鑫集合资产管理计划托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和资产管理合同的有关规定，不存在任何损害投资人利益的行为，完全尽职尽责地履行了托管人应尽的义务。

8.2 托管人对报告期内本计划投资运作合规守信、净值计算等情况的说明

本报告期内，大越期货安鑫集合资产管理计划管理人——大越期货安鑫集合资产管理计划基金管理有限公司在该计划的投资运作、净值计算、费用开支等问题上，托管人未发现其存在损害投资人利益的行为。

8.3 托管人对本季度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对大越期货股份有限公司编制和披露的大越期货安鑫集合资产管理计划

季度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

9、资产管理计划管理人运用固有资金投资本基金情况

9.1 资产管理计划管理人持有本计划份额变动情况

单位：万份

报告期期初管理人持有的本计划份额	-
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本计划份额	-
报告期期末持有的本计划份额占计划总份额比例（%）	-

9.2 资产管理计划管理人运用固有资金投资本计划交易明细

注：本报告期内管理人没有运用固有资金投资本计划。

10、影响投资者决策的其他重要信息

10.1 报告期内公司及员工持有计划份额占比情况

注：本计划本报告期内公司及员工持有计划份额占比 0%。

10.2 影响投资者决策的其他重要信息

注：无

11、重大事项

注：本期无重大事项。