

上海东亚期货有限公司-沅利二号集合
资产管理计划资产管理季度报告
2023 年 3 季度管理报告

资产管理人：上海东亚期货有限公司

资产托管人：宁波银行股份有限公司

报告生成日：2023 年 10 月

重要提示

本报告书中的内容由资产管理计划管理人负责编制。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。

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资产管理计划说明书。

本报告相关财务资料未经审计。本报告书中的金额单位除特指外均为人民币元

本报告起止时间：2023 年 7 月-2023 年 9 月

一、资产管理计划介绍

（一）基本资料

产品名称：上海东亚期货有限公司-沅利二号集合资产管理计划

产品编码：STX833

计划类型：固定收益类资产管理计划

实收资本：59709494.58

资管计划期限：120 月

管理人：上海东亚期货有限公司

托管人：宁波银行股份有限公司

投资经理：李承康

（二）管理人资料

管理人：上海东亚期货有限公司

住所地：上海市虹口区东大名路 1089 号 26 层 2601-2608 单元

联系方式：021-55275088

网站：<http://www.eafutures.com/>

二、主要产品指数

(一) 主要产品指数

单位：人民币元

序号	主要产品指数	2023 年 7 月 1 日 - 2023 年 9 月 30 日
1	本期已实现收益	1,484,281.56
2	本期利润总额	1,691,553.59
3	期末资产净值	61,589,223.05
4	期末单位资产净值	1.0315
5	期末单位累计资产净值	1.0315
6	本期单位净值增长率	2.8005%
7	累计单位净值增长率	3.15%

注：1、本期单位净值增长率=（期末累计单位净值-期初累计单位净值）/期初累计单位净值

2、累计单位净值增长率=（期末累计单位净值-成立日单位净值）/成立日单位净值

(二) 产品指数计算公式

- 1、单位资产净值= 期末资产净值÷计划份额
- 2、单位净值增长率=（期末单位累计资产净值-期初单位资产累计净值）÷期初单位资产净值
- 3、累计单位净值增长率=（期末单位资产累计净值-成立日单位净值）÷成立日单位净值

(三) 费用计提标准、计提方法和支付方式

- 1、托管费
本集合计划自成立之日起计提托管费。本集合计划的托管费按前一日计划资产净值【0.03】%的年费率计算，计算方法如下：
$$H = E \times 【0.03】\% \div \text{当年实际天数}$$

H 为每日应计提的集合计划托管费

E 为前一日集合计划资产净值，成立日首日按照成立规模计算。

集合计划托管费自本集合计划成立日（含）起，每日计提，逐日累计至每个自然月末，按月支付。经管理人与托管人核对一致后，由托管人按照管理人指令于次月首日起 5 个工作日内从集合计划资产一次性支付给托管人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

托管人指定收取托管费的银行账户为：

户名：资产托管费待划转

开户行：宁波银行股份有限公司

账号：11070126102000013

2、管理费

本集合计划自成立之日起计提管理费。本集合计划的管理费按前一日集合计划资产净值的【0.6%】年费率计提，计算方法如下：

$G = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年实际天数}$

G 为每日应计提的集合计划管理费

E 为前一日集合计划资产净值，成立日首日按照成立规模计算。

集合计划管理费自本集合计划成立日（含）起，每日计提，逐日累计至每个自然月末，按月支付。经集合计划管理人与集合计划托管人核对一致后，由集合计划托管人按照管理人指令于次月首日起 5 个工作日内从集合计划资产中一次性支付给集合计划管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

管理人指定收取管理费的银行账户为：

户名：上海东亚期货有限公司

账号：310066056010020008831

开户行：交通银行上海期货大厦支行

3、业绩报酬

本计划不设业绩报酬。

4、运营服务费

本资产管理计划份额登记、估值核算等运营服务费率为【0.03】%，计算方法如下：

$$H=E \times 【0.03】 \% \div N$$

H: 每日应计提的运营服务费

E: 前一日资产管理计划资产净值

N: 当年实际天数

本资产管理计划的运营服务费自计划成立日起, 每日计提, 按自然月支付给运营服务机构。由资产管理人于本计划成立之日的次月起, 每月首日起 5 个工作日内向资产托管人发送资产管理计划运营服务费划付指令, 经资产托管人复核后从资产管理计划资产中支付给运营服务机构。

运营服务商指定收取服务费的银行账户为:

户名: 基金业务外包收入待划转

开户行: 宁波银行股份有限公司

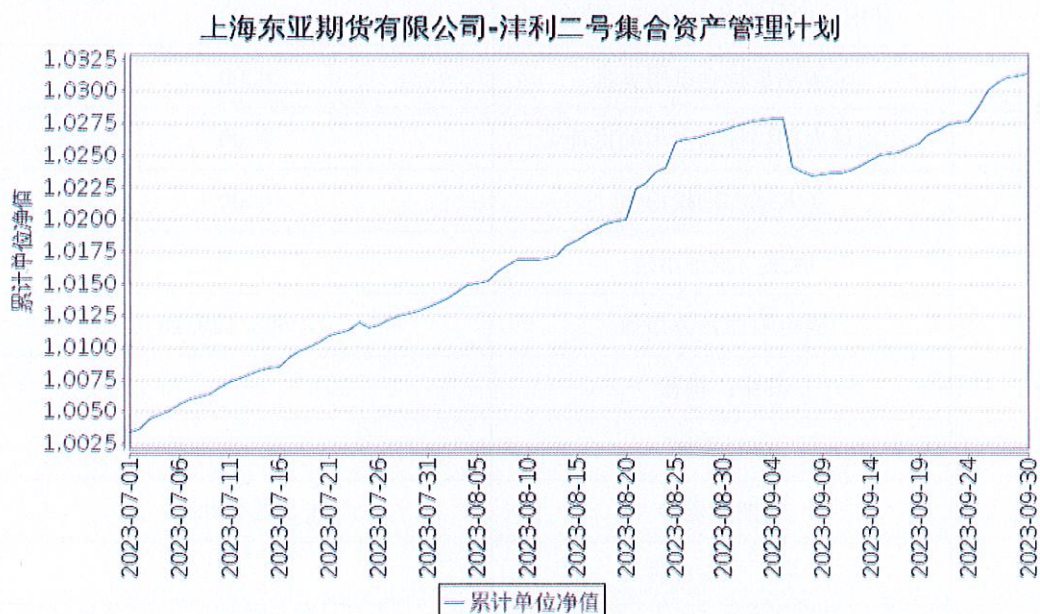
账号: 11070126102000021

三、管理人报告

(一) 业绩表现

截止 2023 年 9 月 30 日, 资产管理计划单位净值为: 1.0315, 本期净值增长率为: 2.8005%。

(如图)



（二）投资经理简介

本委托资产投资经理为李承康，现担任上海东亚期货资产管理部投资经理。期货从业资格证号:F3107186，基金从业资格证号:P1065132100002。复旦大学国际经济与贸易本科学历，历任上海昊达投资咨询有限公司法人代表兼执行董事，浙江捷荆资产管理有限公司法定代表人、总经理。多年从事金融投资行业，具有丰富的资产管理和投研经验。尤其擅长固定收益类债券的研究和投资，长期深入跟踪宏观经济数据，有较强的行业分析及判断能力和投资风险发现及防控能力。结合量化分析，对债券交易相关的各类资产品种的周期性波动规律有着较深的理解和丰富的交易经验。

（三）投资报告数据（截止 2023 年 9 月 30 日）

投资与 盈亏	可用货币资金（账面上未被占用的、可自由使用的货币资金）	1,935,805.62
	各类备付金及用于清算的款项	18,027,999.54
	债券逆回购融出资金余额（仅限交易所或银行间市场进行的债券回购交易）	-
	期货持仓占用资金	0.00
	其中：商品期货持仓占用资金	0.00
	金融期货持仓占用资金	0.00
	卖出场内期权持仓占用的保证金	0.00
	买入场内期权市值	0.00
	股票与权证市值	-
	固定收益证券市值	44,605,129.16
	其中：国债	-
	央行票据	-
	短期融资券	3,310,830.16
	资产支持证券	-
	其他固定收益证券	0.00

公开募集证券投资基金	0.00
其中：用于股票期权备兑开仓或冲抵持仓保证金的ETF	0.00
集合资产管理计划（证券、基金、期货公司发行的私募类产品）	0.00
大宗商品现货相关投资	0.00
其他资产	1,948,391.68
投资于其他资产的情况说明	0.00
资产小计	66,517,326.00
卖出场内期权市值	0.00
债券正回购融入资金余额（仅限交易所或银行间市场进行的债券回购交易）	4,842,372.74
已计提但尚未支付的各类应付款项	85,730.21
其他负债	0.00
其他融资情况说明	0.00
负债小计	4,928,102.95
产品净资产	61,589,223.05

（四）投资组合情况

1、期末基金资产组合情况

序号	项目	金额	占总资产的比例（%）
		人民币	
1	权益投资	-	-
	其中：普通股	-	-
	存托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	44,605,129.16	67.06
	其中：债券	44,605,129.16	67.06
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-

	其中： 远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	19,963,805.16	30.01
8	其他资产	1,948,391.68	2.93
	合计	66,517,326.00	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

注：无。

3、报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

注：无。

（五）基金份额变动情况

单位：份

报告期期初委托资产份额	62,213,167.40
报告期期间基金总申购份额	496,327.18
减：报告期期间基金总赎回份额	3,000,000.00
报告期期间基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列)	-
报告期期末基金份额总额	59,709,494.58

（六）投资收益分配情况

本报告期内，本计划未实施利润分配。

（七）运用杠杆情况

报告期末资管计划资产净值 61,589,223.05 元, 资产总值 66,517,326.00 元, 杠杆比率 108%。

四、风险控制报告

1、资产管理计划运作合规性声明

本报告期内, 管理人严格遵守《期货公司资产管理业务试点办法》、《期货公司资产管理业务管理规则(试行)》、《私募投资基金监督管理暂行办法》、《期货公司资产管理合同指引》及其他法律法规的规定, 本着诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用本资产管理计划资产, 在严格控制风险的基础上, 为本计划持有人谋求较大利益。本报告期内, 本计划运作合法合规, 无损害计划持有人利益的行为, 本计划的投资管理符合有关法规的规定。

2、风险控制报告

本报告期内, 本计划管理人通过独立的风险控制部门, 加强对资产管理业务风险的事前分析、事中监控和事后评估, 并提出风险控制措施。在报告期内, 本计划触及净值预警线, 未发生追保、强平等情况。

五、托管人履职报告

本报告期内, 本托管人在上海东亚期货有限公司-沅利二号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》、《上海东亚期货有限公司-沅利二号集合资产管理计划资产管理合同》和其他有关规定, 不存在损害委托人利益的行为, 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、《上海东亚期货有限公司-沅利二号集合资产管理计划资产管理合同》和其他有关规定, 对委托资产的投资运作方面进行了监督, 未发现管理人有损害委托人利益的行为。

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。

六、重大事项报告

- （一）本计划管理人在本报告期内没有发生涉及本计划管理人、财产业务的诉讼事项。
- （二）本计划管理人办公地址没有发生变更。
- （三）本报告期内计划的投资组合策略没有发生重大改变。
- （四）本计划的管理人其高级管理人员没有受到任何处罚
- （五）本报告期内，投资经理未发生变更。

上海东亚期货有限公司资产管理部

2023 年 10 月

