

# 金信期货未来2号集合资产管理计划

## 2021年2季度报告



基金管理人：金信期货有限公司

基金托管人：国泰君安证券股份有限公司

## 1、基金基本情况

项目	信息
基金名称	金信期货未来2号集合资产管理计划
基金编码	SLC939
基金管理人	金信期货有限公司
基金托管人(如有)	国泰君安证券股份有限公司
投资顾问(如有)	
基金运作方式	开放式
基金成立日期	2020-08-31
报告期末基金份额总额(份)	10,000,000.00

## 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	-0.21	-	-	-
自基金合同生效起至今	-5.50	-	-	-

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）/上季度末累计净值

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	2021-04-01	至	2021-06-30	(元)
本期已实现收益				-23,210.85
本期利润				-22,365.77
期末基金资产净值				9,445,926.78
期末基金份额净值				0.945

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

序号	项目	金额	占基金总资产
----	----	----	--------

		人民币	的比例(%)
1	权益投资	0.00	0.00
	其中：普通股	0.00	0.00
	存托凭证	0.00	0.00
2	基金投资	0.00	0.00
3	固定收益投资	0.00	0.00
	其中：债券	0.00	0.00
	资产支持证券	0.00	0.00
4	金融衍生品投资	0.00	0.00
	其中：远期	0.00	0.00
	期货	0.00	0.00
	期权	0.00	0.00
	权证	0.00	0.00
5	买入返售金融资产	0.00	0.00
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	0.00	0.00
6	货币市场工具	0.00	0.00
7	银行存款和结算备付金合计	9,470,102.33	100.00
8	其他	395.76	0.00
	合计	9,470,498.09	100.00

注：

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

本报“其他”项中列示的主要包括期货交易保证金、各类应收款等，具体情况见《其他资产构成报表》。

## 4.2、报告期末按行业分类的股票投资组合

### 4.2.1、报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	0.00	0.00
B	采矿业	0.00	0.00
C	制造业	0.00	0.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	0.00	0.00
E	建筑业	0.00	0.00
F	批发和零售业	0.00	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	0.00	0.00
H	住宿和餐饮业	0.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术	0.00	0.00

	技术服务业		
J	金融业	0.00	0.00
K	房地产业	0.00	0.00
L	租赁和商务服务业	0.00	0.00
M	科学研究和技术服务业	0.00	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	0.00	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	0.00	0.00
P	教育	0.00	0.00
Q	卫生和社会工作	0.00	0.00
R	文化、体育和娱乐业	0.00	0.00
S	综合	0.00	0.00
	合计	0.00	0.00

注：

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

#### 4.2.2、报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

金额单位：元

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例(%)
基础材料	0.00	0.00
消费者非必需品	0.00	0.00
消费者常用品	0.00	0.00
能源	0.00	0.00
金融	0.00	0.00
医疗保健	0.00	0.00
工业	0.00	0.00
信息技术	0.00	0.00
电信服务	0.00	0.00
公用事业	0.00	0.00
房地产	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：

以上分类采用全球行业标准 (GICS)。

## 5、基金份额变动情况

单位：份

报告期期初基金份额总额	10,000,000.00
-------------	---------------

报告期期间基金总申购份额	0.00
减：报告期期间基金总赎回份额	0.00
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	0.00
报告期期末基金份额总额	10,000,000.00

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、管理人报告

### 6.1 报告期内基金运作合规守信情况

报告期内，本基金投资运作符合基金合同的约定。

### 6.2 报告期内基金估值程序

管理人负责对委托财产进行估值、计算计划资产净值，并负责与托管人进行核对。管理人作为本委托财产的会计主体，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致意见，由此造成的后果由管理人承担。

在法律法规和中国证监会允许的情况下，管理人与托管人可以各自委托第三方机构进行计划资产估值，但不改变管理人与托管人对计划资产估值各自承担的责任。

### 6.3 报告期内基金运作情况和运用杠杆情况

二季度，随着疫苗大范围接种对经济复苏起到重要支撑作用，加上各国政府维持采取宽松的货币和财政政策，全球经济仍处于加速复苏中，欧美地区经济复苏较快。全球主要经济体经济周期性恢复的高点在逐步接近，而后疫情时代经济增长的中枢或许会显著低于疫情之前，同时价格上升的短期压力缓解。国内方面，经济延续复苏，但复苏速度正在减缓，经济或将在二季度见顶，全年季度增速呈前高后低的态势。目前经济动能正处于换挡期，出口、地产投资拉动作用正在减慢，消费、制造业投资继续缓慢修复，正成为经济新的拉动力。央行货币政策委员会的表态延续了一季度的基调，货币政策维持中性偏松的格局。这一宏观环境意味着全球利率的中枢下移或许在长时间内维持，这使得商品市场整体以高位震荡寻顶为主。

本季度内，我们继续以商品期货交易为主，采用多品种对冲套利与主观趋势交易相结合的交易策略。大部分时间对方向不明朗的持仓继续进行锁定，避免了后期较大的逆势波动。因当全球疫后复苏顶部的临近标志着本轮商品牛市接近尾声，后续投资机会不明朗趋向增大，我们在6月底对产品持仓进行了全部平仓，提前结束投资并进行清算。该产品截止最后累计净值收益为-5.5%。

本报告期未使用任何杠杆。

### 6.4 报告期内投资收益分配和损失承担情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

## 6.5 托管人意见

本报告期内，托管人根据《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》及其他相关法律法规的规定和合同的约定，对本管理人编制的定期报告进行如下复核确认：

报告期内，托管人对管理人所编制的本报告中的财务数据进行了复核，确认所复核内容准确。

报告期内，托管人依据基金合同约定对本资管计划投资运作情况进行了监督，未发现不符合合同约定的情况。

信息披露报告是否经托管机构复核：是

## 附：其他资产构成报表

金额单位：元

序号	名称	金额
1	交易保证金	0.00
1.1	其中：期货交易保证金	0.00
2	应收证券清算款	0.00
3	应收股利	0.00
4	应收基金红利	0.00
5	应收利息	395.76
6	应收申购款	0.00
7	其他应收款	0.00
8	待摊费用	0.00
9	其他	0.00
10	合计	395.76

