

长城严选之宁泉 FOF2 号集合资产管理计划  
2024 年第 1 季度资产管理报告

管理人：长城证券股份有限公司

托管人：国泰君安证券股份有限公司

报告期：2024 年 1 月 1 日 - 2024 年 3 月 31 日

## 第一节 重要提示

本报告依据《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计划运作管理规定》及其他有关规定制作。

本报告由集合资产管理计划管理人编制。管理人保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

本集合资产管理计划托管人国泰君安证券股份有限公司复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容。

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。集合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集合资产管理计划说明书。

本报告相关财务资料未经审计。

本报告中的内容由管理人负责解释。

## 第二节 集合资产管理计划概况

名称	长城严选之宁泉FOF2号集合资产管理计划
代码	C81302
类型(运作方式)	契约型开放式
投资目标	在控制和分散投资组合风险的前提下，力求实现本计划资产长期稳定增值。
投资策略	管理人通过定性分析和定量分析相结合的方式对资产管理产品进行筛选和评价，对资产管理产品层面重点分析产品管理人的投研能力、投资风格、业绩可持续性和风险控制能力，以筛选出符合FOF产品投资标准的优秀资产管理产品。

风险收益特征	本计划属于R4（中高风险）产品，其预期收益和预期风险收益水平属中高等级，适配积极型（C4）及激进型（C5）的普通合格投资者及所有专业投资者。
成立日	2023年4月25日
成立规模	17,500,000.00份
报告期末份额总额	32,657,502.71份
管理人	长城证券股份有限公司 地址：深圳市福田区福田街道金田路2026号能源大厦南塔楼10-19层 邮编：518031 电话：4006666888 传真：（0755）83531612 网址：www.cgws.com
托管人	国泰君安证券股份有限公司 地址：上海市静安区新闻路669号博华广场19楼 邮编：200041 电话：（021）38917599-5 传真：（021）38677819 网址：www.gtja.com

### 第三节 主要财务指标和集合资产管理计划净值表现

#### 一、主要财务指标（单位：人民币元）

期初单位净值	0.9496
期末单位净值	0.9488
期末累计单位净值	0.9488
本期已实现收益	-71,120.32
期末资产净值	30,984,053.88

#### 二、收益分配情况

本报告期内，本集合计划未进行收益分配。

## 第四节 管理人报告

### 一、业绩表现

截至2024年3月31日，本集合计划单位净值为0.9488元。

### 二、投资经理简介

王文光先生，中国人民大学金融学硕士，9年投研工作经验，曾先后在泰康资产、银华基金和华泰证券资管从事研究和投资工作。2021年5月加入长城证券股份有限公司，现任资产管理部总经理助理，投资经理。

彭思宇先生，CFA、FRM，经济学硕士，曾先后就职于国信证券负责从事私募基金评价以及私募种子基金投资业务，以及招商银行总行、招银理财研究部负责公募基金FOF投资研究等工作，后于长城证券资管负责FOF投资研究等工作。

### 三、投资策略回顾

24年Q1，股指市场经历了一场深V型走势，市场季初情绪低迷、经济数据缺乏亮点、中小盘股面临流动性危机，季中迎两市回暖大幅反弹，季末呈现震荡走势、市场交投活跃度上升。本基金分散投资于宁泉5只长期表现优秀的产品中。

### 四、投资展望

后续将保持当前主要持仓。

### 五、集合计划运作合规性声明

本报告期内，集合计划管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《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计划运作管理规定》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集合计划资产，在严格控制风险的基础上，为集合计划持有人谋求最大利益。本集合计划运作合法合规，无损害集合计划持有人利益的行为，本集合计划的投资管理符合有关法规的规定。

### 六、风险控制报告

本报告期内，集合计划管理人通过独立的风险控制部门，加强对集合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。本次风险控制报告综合了集合计划管理人全面自查和合规、风险控制部门日常监控、重点检查的结果。

公司设立资产管理内控部、风险管理部和法律合规部，通过系统监控和现场

检查，对集合资产管理计划的投资风险、契约风险、操作风险、道德风险等进行全面的监督和检查。同时在交易系统中设置各类风控指标进行投资约束，实现交易事前控制，确保集合资产管理计划投资交易行为的合法合规。对日常集合资产管理计划出现的各类问题，风险控制部门及时进行风险提示，提出管理建议，并督促相关部门及时整改。

公司风险管理部、法律合规部对公司各类重要规章制度进行风险评审并参与其业务流程梳理，提出建议，保证业务制度及业务流程的科学、合理，进而规范有序的开展业务。

公司在实行严格的内部风险控制的同时，也接受托管银行、上级监管机构、中介审计机构以及委托人的监督。

在本报告期内，本集合计划管理人对集合计划的管理始终都能按照有关法律法规、公司相关制度和本集合计划说明书的要求进行。本集合计划的投资决策、投资交易程序、投资权限等各方面均符合规定的要求；交易行为合法合规，未出现异常交易、操纵市场的现象；未发现内幕交易的情况；相关的信息披露和财务数据皆真实、完整、准确、及时。

## 第五节 集合计划财务报告

### 一、集合计划资产负债表

编制单位：长城证券

2024 年 3 月 31 日

单位：元

资产	期末余额	上年年末余额	负债和所有者权益	期末余额	上年年末余额
资 产：			负 债：		
银行存款	1,611,743.64	179,483.64	短期借款	0.00	0.00
结算备付金	0.00	0.00	交易性金融负债	0.00	0.00
存出保证金	0.00	0.00	衍生金融负债	0.00	0.00
衍生金融资产	0.00	0.00	卖出回购金融资产款	0.00	0.00
交易性金融资产	29,452,609.53	29,377,153.60	应付清算款	0.00	0.00
买入返售金融资产	0.00	0.00	应付赎回款	0.00	0.00
发放贷款和垫款	0.00	0.00	应付管理人报酬	74,938.94	71,591.98
债权投资	0.00	0.00	应付托管费	749.35	715.99
其他债权投资	0.00	0.00	应付销售服务费	0.00	0.00
应收清算款	0.00	0.00	应付投资顾问费	0.00	0.00
应收利息	0.00	0.00	应交税费	0.00	0.00
应收股利	0.00	0.00	应付利息	0.00	0.00
应收申购款	0.00	0.00	应付利润	0.00	0.00
其他资产	0.00	0.00	其他负债	4,611.00	4,611.00
			负债合计	80,299.29	76,918.97
			所有者权益		
			实收资金	32,657,502.71	31,045,225.19
			其他综合收益	0.00	0.00
			未分配利润	-1,673,448.83	-1,565,506.92
			所有者权益合计	30,984,053.88	29,479,718.27
资产总计	31,064,353.17	29,556,637.24	负债和所有者权益总计	31,064,353.17	29,556,637.24

二、集合计划利润表

编制单位：长城证券

2024 年 1 月 - 2024 年 3 月

单位：元

项目	本期金额	上期金额
一、收入	80,023.90	-972,811.29
1. 利息收入	4,567.97	3,462.84
2. 投资收益（损失以“-”填列）	0.00	0.00
其中：以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益	0.00	0.00
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	75,455.93	-976,274.13
4. 汇兑损益（损失以“-”号填列）	0.00	0.00
5. 其他业务收入	0.00	0.00
二、费用	75,688.29	76,918.97
1. 管理人报酬	74,938.94	71,591.98
2. 托管费	749.35	715.99
3. 销售服务费	0.00	0.00
4. 投资顾问费	0.00	0.00
5. 利息支出	0.00	0.00
其中：卖出回购金融资产利息支出	0.00	0.00
6. 信用减值损失	0.00	0.00
7. 税金及附加	0.00	0.00
8. 其他费用	0.00	4,611.00
三、利润总额	4,335.61	-1,049,730.26
减：所得税费用	0.00	0.00
四、净利润	4,335.61	-1,049,730.26
五、其他综合收益	0.00	0.00
六、综合收益总额	4,335.61	-1,049,730.26

### 三、资产组合情况

项目名称	项目公允价值（元）	占总资产比例
股票	0.00	0.00%
债券	0.00	0.00%
资产支持证券	0.00	0.00%
基金	0.00	0.00%
银行存款及结算备付金合计	1,611,743.64	5.19%
存出保证金	0.00	0.00%
买入返售金融资产	0.00	0.00%
应收证券清算款	0.00	0.00%
应收利息	0.00	0.00%
其他资产	0.00	0.00%
理财产品	29,452,609.53	94.81%
应收基金红利	0.00	0.00%
合计	31,064,353.17	100.00%

### 四、期末公允价值占集合计划资产净值比例大小排序的前十名证券明细

序号	代码	名称	公允价值（元）	占净值比例
1	XY1350	宁泉致远 6 号私募证券投资基金	6,853,380.95	22.12%
2	XY2582	宁泉致远 18 号私募证券投资基金	6,673,999.12	21.54%
3	XY3352	宁泉致远 39 号私募证券投资基金	6,166,767.99	19.90%
4	XY2446	宁泉致远 20 号私募证券投资基金	5,350,386.81	17.27%
5	XY1508	宁泉致远 9 号私募证券投资基金	4,408,074.66	14.23%



### 五、集合计划份额变动

单位：份

期初份额总额	31,045,225.19
红利再投资份额	0.00
报告期间总参与份额	1,612,277.52
报告期间总退出份额	0.00
报告期末份额总额	32,657,502.71

### 第六节 重要事项揭示

1、本集合计划管理人及托管人在本报告期内没有发生涉及本集合计划管理人、财产、托管业务的诉讼事项。

2、本报告期内本集合计划投资经理发生了变更，于 2024 年 3 月 5 日在官网发布了变更公告。

3、本报告期内，本集合计划未发生关联方交易。

4、本集合计划的管理人、托管人涉及托管业务机构及其高级管理人员没有受到任何处罚。

### 第七节 信息披露的查阅方式

#### 一、备查文件

- 1、《长城严选之宁泉 FOF2 号集合资产管理计划合同》；
- 2、《长城严选之宁泉 FOF2 号集合资产管理计划说明书》；
- 3、《长城严选之宁泉 FOF2 号集合资产管理计划风险揭示书》；
- 4、管理人业务资格批件、营业执照。

#### 二、存放地点及查询方式

网址：<http://www.cgws.com>

客户服务电话：400-6666-888

投资者对本报告书如有任何疑问，可咨询管理人长城证券股份有限公司。

