

方正证券中证 500 指数量化增强集合资产管理计划

2022 年第 4 季度资产管理报告

重要提示

本报告依据《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》（以下简称《指导意见》）、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》（以下简称《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》（以下简称《运作规定》）及其他有关规定制作。

管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用方正证券中证 500 指数量化增强集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”、“集合计划”、“本计划”）资产，但不保证本集合计划一定盈利，也不保证最低收益。

集合计划托管人招商银行股份有限公司武汉分行对本报告中的主要财务指标、净值表现、投资组合报告等数据进行了复核。本报告未经审计。如无特别说明，本报告中的金额单位为人民币元。

管理人保证本报告书中所载资料的真实性、准确性和完整性。

本报告书中的内容由管理人负责解释。

本报告期起止时间：2022 年 10 月 1 日—2022 年 12 月 31 日。

一、集合计划简介

名称：方正证券中证 500 指数量化增强集合资产管理计划

简称：中证 500 指数量化增强

集合计划编码：SJD456

运作方式：开放式



在本报告期内，集合计划的投资范围、投资比例及运作情况符合有关法律法规及合同的规定，未出现违反相关规定的状况，也未发生损害本集合计划委托人利益的行为。

四、集合计划托管人履职报告

托管人声明：招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在对方正证券中证 500 指数量化增强集合资产管理计划托管的过程中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

五、集合计划投资组合报告

1、资产负债表

资产	期末余额	年初余额	负债与持有人权益	期末余额	年初余额
资 产：			负 债：		
银行存款	161,192.66	2,701,586.50	短期借款	0.00	0.00
清算备付金	520,960.03	1,358,890.47	交易性金融负债	0.00	0.00
存出保证金	410,084.07	780,255.45	衍生金融负债	103,920.00	-35,790.00
交易性金融资产	9,788,276.39	14,559,278.24	卖出回购金融资产款	0.00	0.00
其中：股票投资	8,474,925.29	14,559,278.24	应付证券清算款	86,019.93	140,782.45
债券投资	0.00	0.00	应付赎回款	0.00	0.00
基金投资	1,313,351.10	0.00	应付管理人报酬	28,919.42	56,274.60
权证投资	0.00	0.00	应付托管费	1,156.81	2,250.93
资产支持证券投资	0.00	0.00	应付销售服务费	0.00	0.00
衍生金融工具	0.00	0.00	应付交易费用	8,945.71	29,297.95
买入返售金融资产	0.00	0.00	应交税费	0.00	0.00
应收证券清算款	52,958.38	119,689.72	应付利息	0.00	0.00

应收利息	0.00	633.75	应付利润	0.00	0.00
应收股利	12,534.10	0.00	其他负债	4,000.00	4,000.00
应收申购款	0.00	0.00	负债合计	232,961.87	196,815.93
其他资产	0.00	0.00			
			所有者权益:		
			实收基金	7,712,654.47	12,652,140.89
			未分配利润	3,104,309.29	6,635,587.31
			所有者权益合计	10,816,963.76	19,287,728.20
资产合计	10,946,005.63	19,520,334.13	负债和所有者权益总计	10,946,005.63	19,520,334.13

2、按市值占净值比例大小排序的前五名股票明细

序号	股票名称	期末市值（元）	占资产净值的比例
1	财通证券	69,776.00	0.6451%
2	航发控制	64,100.00	0.5926%
3	航天电子	61,200.00	0.5658%
4	厦门钨业	60,605.00	0.5603%
5	昭衍新药	58,410.00	0.5400%

3、按市值占净值比例大小排序的前五名债券明细
无。

4、按市值占净值比例大小排序的前五名基金明细

序号	基金名称	期末市值（元）	占资产净值的比例
1	银华日利	731,109.60	6.7589%
2	转债ETF	582,241.50	5.3827%
3	-	-	-
4	-	-	-

5	-	-	-
---	---	---	---

5、按市值占净值比例大小排序的前五名资产支持证券明细

无。

六、管理人董事、监事、从业人员及其配偶参与情况

2022 年 12 月 31 日管理员工持有本计划份额的情况		
序号	持有份额总数（份）	占资管计划份额比例（%）
1	957,631.14	12.42%
2022 年 12 月 31 日管理员工配偶持有本计划份额的情况		
2	0.00	0.00%
2022 年 12 月 31 日管理人董事、监事持有本计划份额的情况		
3	0.00	0.00%

七、管理费、托管费、业绩报酬的计提基准、计提方式和支付方式

（一）管理费

计提基准	本集合计划管理费按前一日集合计划资产净值的 1.00% 年费率计提。
计提方式	管理人的管理费每日计提。
支付方式	本集合计划成立后每个自然季度支付一次，经管理人与托管人双方核对无误后，由托管人于本集合计划每个自然季度起 10 个工作日内依据管理人的划款指令从本集合计划资产中一次性支付给管理人，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

（二）托管费

计提基准	本集合计划托管费按前一日集合计划资产净值的 0.04% 年费率计提。
计提方式	集合计划托管费每日计提。
支付方式	集合计划托管费每日计提，逐日累计至本集合计划成立后每个自然季度支付一次。经管理人与托管人双方核对无误后，由托管人于本集合计划每个自然季度起 10 个工作日内依据管理人的划款指令将上一季度计提的托管费从集合计划资产中一次性支付给托管人，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

(三) 业绩报酬

计提基准	本集合计划不收取业绩报酬。
计提方式	无。
支付方式	无。

八、涉及投资者权益的重大事项

1	投资经理变更情况	本报告期内，陈潇于 2022 年 10 月 27 日起担任本集合计划投资经理。 本报告期内，巩书欣于 2022 年 11 月 9 日起不再担任本集合计划投资经理。
2	重大关联交易情况	无。
3	报告期内其他事项说明	自 2022 年 12 月 13 日起，我公司资产管理分公司总经理由高贵鑫先生变更为李正红先生。高贵鑫先生自同日起不再担任上述职务。

九、备查文件目录

（一）本集合计划备查文件目录

- 1、《方正证券中证 500 指数量化增强集合资产管理计划资产管理合同》
- 2、《方正证券中证 500 指数量化增强集合资产管理计划说明书》
- 3、《方正证券中证 500 指数量化增强集合资产管理计划托管协议》
- 4、管理人业务资格批件、营业执照

（二）查阅方式

网址：<http://www.foundersc.com>

公司客服电话：95571

公司地址：北京市朝阳区朝阳门南大街 10 号兆泰国际中心 A 座 18 层

投资者对本报告书如有任何疑问，可咨询方正证券股份有限公司。

