

平安证券尊享量化中性1号集合资产管理计划

2023年四季度资产管理报告

计划管理人：平安证券股份有限公司

计划托管人：平安银行股份有限公司深圳分行

报告期

2023年10月1日-2023年12月31日

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》（以下简称《管理办法》）及其他有关规定制作。

中国证券投资基金业协会对《平安证券尊享量化中性 1 号集合资产管理计划》（以下简称“集合计划”或“本集合计划”）出具了《资产管理计划备案确认函》，但中国证券投资基金业协会对本集合计划做出的任何决定，均不表明中国证券投资基金业协会对本集合计划的风险或收益做出判断或者保证。

管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用本集合计划资产，但不保证本集合计划一定盈利，也不保证最低收益。

托管人于 2024 年 01 月 15 日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。本报告未经审计。

管理人、托管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。

本报告书中的金额单位除特指以外均为人民币元。

本报告起止时间为：2023 年 10 月 1 日-2023 年 12 月 31 日。

一、集合计划简介

集合计划名称:平安证券尊享量化中性 1 号集合资产管理计划

集合计划类型: 集合资产管理计划

集合计划成立日: 2022 年 06 月 10 日

集合计划成立规模(总份额): 28,080,132.50 份

集合计划报告期末计划总份额: 10,089,428.78 份

集合计划存续期: 本集合计划的存续期限为 5 年

集合计划管理人: 平安证券股份有限公司

集合计划托管人: 平安银行股份有限公司深圳分行

二、主要财务指标

（一）主要财务指标

项目	主要财务指标	2023年10月1日-2023年12月31日
1	集合计划本期利润(元)	199,311.03
2	本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额(元)	233,160.52
3	集合计划单位可分配利润(元)	0.0092
4	期末集合计划资产净值(元)	10,285,515.84
5	期末单位集合计划资产净值(元)	1.0194
6	期末单位集合计划累计资产净值(元)	1.0194
7	本期集合计划净值增长率	1.6959%
8	集合计划累计净值增长率	1.9400%

（二）财务指标计算公式

1、单位集合计划期末可供分配净收益=集合计划本期期末未分配利润÷期末集合计划份额

2、期末单位集合计划资产净值=期末集合计划资产净值÷期末集合计划份额

3、期末单位集合计划累计资产净值=期末单位集合计划资产净值+单位集合计划累计分红

4、本期单位集合计划净值增长率=（本期第一次分红前单位集合计划资产净值÷期初单位集合计划资产净值）×（本期第二次分红前单位集合计划资产净值÷本期第一次分红后单位集合计划资产净值）×……×（期末单位集合计划资产净值÷本期最后一次分红后单位集合计划资产净值）-1

5、集合计划单位累计净值增长率=（成立以来第一次分红前单位集合计划资产净值÷成立日日初单位集合计划资产净值）×（成立以来第二次分红前单位集合计划资产净值÷本期第一次分红后单位集合计划资产净值）×……×（期末单

位集合计划资产净值÷本期最后一次分红后单位集合计划资产净值) -1

(三) 分红情况

报告期内, 本集合计划未向投资者分红。

(四) 其他情况

本报告期末, 该资管计划暂估业绩报酬为 40228.84 元。

暂估业绩报酬为假设本基金于本报告期末按照当日的基金份额净值(计提业绩报酬前)清算, 根据基金份额持有人持有的基金份额(包括未到期份额)至该日止持有期间的收益情况估算的业绩报酬。该金额是各基金份额持有人的暂估业绩报酬的合计, 各基金份额持有人实际应承担的业绩报酬金额根据其持有期间的实际收益情况计算确认。暂估管理人报酬与投资者实际承担的管理人报酬可能存在差异。

三、集合资产管理计划管理人报告

（一）业绩表现

截止至 2023 年 12 月 31 日，集合计划单位净值为 1.0194 元，单位累计净值为 1.0194 元，本期单位净值增长率为 1.6959%，集合计划单位累计净值增长率为 1.9400%。

（二）投资经理简介

冯张鹏先生，现任平安证券股份有限公司资产管理事业部量化投资团队执行副总经理，英国帝国理工大学工科博士，控制理论和优化方向；曾任国投安信期货公司资管部量化投资总监，资管业务决策委员会委员；招商证券资产管理（香港）有限公司资管部量化投资总监；光大证券资管部资深基金经理；泰信基金量化投资负责人；英国德意志银行量化分析师。2008 年进入华尔街开始从事投资和研究工作，专注于股票量化对冲，指数增强等量化投资领域。已取得投资经理资格及基金从业资格，无兼职情形，最近三年未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚。

（三）投资经理工作报告

1、2023 年四季度投资回顾：

10 月份市场风格以小盘价值为主，基差有小幅收敛，产品 alpha 收益震荡收正。11 月份市场风格依旧以小盘价值为主，基差有一定波动但整月影响较小，产品 alpha 收益震荡收正。12 月份市场风格由价值和盈利交替轮动，基差有一定扩大，产品 alpha 收益震荡收正。

2、2024 年一季度展望及计划：

年底股市下挫，月末反弹，投资情绪不确定性较高，策略上继续谨慎配置。随着经济自身的修复，经济数据开始边际好转，在政策的积极发力下，资金面数据也有所改善，但情绪偏弱，指数底部对于政策底部可能存在滞后性，需持谨慎态度进行配置。

3、报告期末本资管计划的股指期货交易情况说明

四季度该产品参与股指期货交易，对冲股票多头的市场风险，降低了产品的整体波动，符合产品设立初衷。

4、风险提示：

本计划为混合型产品，主要投资中国 A 股市场股票及股指期货。因：（1）宏观经济形势的变化以及国际经济环境和其他证券市场的变化；（2）证券市场的法律、法规和相关政策、规则发生变化；（3）上市公司所处行业的变化和经营管理等方面的因素变化等都可能引起股票价格的波动，进而引起本产品净值波动。以上列举仅为举例，并未完全涵盖影响股票市场波动的原因，管理人承诺合规、尽责履行管理职责，但并不承诺保证本金安全或收益，请投资者注意风险。

（四）风险控制报告

1、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》及其他相关法律法规的规定，严格执行平安证券内部合规管理制度以及《平安证券尊享量化中性 1 号集合资产管理计划合同》，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长期稳健收益。

本报告期内，本集合计划的交易行为合法合规，未出现异常交易、操纵市场的现象；未发现内幕交易的情况；运作中无违法违规或未履行集合计划合同承诺的行为，无损害集合计划持有人利益的行为；投资管理符合相关法律法规、集合资产管理合同和说明书规定。

2、风险控制报告

本报告期内，平安证券风险管理部门独立地对本集合计划的投资运作进行风险控制和检查，风险管理部采用授权管理、逐日监控、风险分析和绩效评估等多种方式，定期对业务授权、投资交易及制度执行等进行全面细致的审查，对业务中可能出现的问题，及时进行风险揭示，并定期向公司管理层提交风险管理报告。

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、公司相关制度和集合资产管理计划说明书的要求进行。本集合计划持有的证券符合规定的比例要求；相关的信息披露和财务数据皆真实、完整、准确、及时。本次风险控制报告综合了集合计划管理人全面自查和风险管理部日常监控、重点检查的结果。

四、集合资产管理计划财务报告

(一) 集合资产管理计划资产负债表

日期：2023-12-31

单位：元

资产	期末余额	年初余额	负债和所有者权益	期末余额	年初余额
资产：			负债：		
银行存款	1,109,626.28	8,936,058.28	短期借款	0.00	0.00
结算备付金	495,862.08	751,413.84	交易性金融负债	0.00	0.00
存出保证金	906,796.80	3,172,284.00	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	7,823,084.09	23,315,209.05	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	31,442.61	180,839.85
债权投资	0.00	0.00	应付托管费	1,077.24	5,734.35
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	应付交易费用	0.00	0.00
应收利息	0.00	0.00	应付投资顾问费	0.00	0.00
应收股利	0.00	0.00	应交税费	6,333.56	0.00
应收申购款	0.00	0.00	应付利息	0.00	0.00
其他资产	0.00	0.00	应付利润	0.00	0.00
			递延所得税负债	0.00	0.00
			其他负债	11,000.00	12,000.00
			负债合计	49,853.41	198,574.20
			所有者权益：	0.00	0.00
			实收资金	10,089,428.78	36,784,805.33
			其他综合收益	0.00	0.00
			未分配利润	196,087.06	-808,414.36
			所有者权益合计	10,285,515.84	35,976,390.97
资产合计	10,335,369.25	36,174,965.17	负债和所有者权益总计	10,335,369.25	36,174,965.17

(二) 集合资产管理计划经营业绩表

日期: 2023-12-31

单位: 元

序号	项目	本期金额	上期金额
1	一、收入	254,343.10	541,786.18
2	1、利息收入	864.42	927.21
3	2、投资收益（损失以“-”填列）	287,328.17	355,467.37
4	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
5	3、公允价值变动损益（损失以“-”填列）	-33,849.49	185,391.60
6	4、汇兑损益（损失以“-”填列）	0.00	0.00
7	5、其他业务收入	0.00	0.00
8	二、费用	55,032.07	49,171.64
9	1、管理人报酬	41,853.59	46,495.69
10	2、托管费	1,077.24	1,368.31
11	3、销售服务费	0.00	0.00
12	4、投资顾问费	0.00	0.00
13	5、利息支出	0.00	0.00
14	其中：卖出回购金融资产支出	0.00	0.00
15	6、信用减值损失	0.00	0.00
16	7、税金及附加	1,101.24	1,307.64
17	8、其他费用	11,000.00	0.00
18	三、利润总额	199,311.03	492,614.54
19	减：所得税费用	0.00	0.00
20	四、净利润（净亏损以“-”号填列）	199,311.03	492,614.54
21	五、其他综合收益的税后净额	0.00	0.00
22	六、综合收益总额	199,311.03	492,614.54

五、集合资产管理计划投资组合报告

(一) 资产组合情况

项目	期末市值(人民币元)	占总资产比例
银行存款和其他货币资金	1,605,488.36	15.5339%
股票	7,823,084.09	75.6924%
基金	0.00	0.0000%
债券	0.00	0.0000%
资产支持证券	0.00	0.0000%
买入返售金融资产	0.00	0.0000%
其他资产	906,796.80	8.7737%
合计	10,335,369.25	100.00%

注:

- “其他资产”包括“存出保证金”、“应收股利”、“应收利息”、“其他应收款”、“应收申购款”、“应收证券清算款”等项目。
- 因四舍五入原因,资产组合情况中市值占总资产比例的分项之和与合计可能存在尾差。

(二) 集合资产管理计划份额变动

单位:份

期初总份额	本期参与份额	本期退出份额	期末总份额
17,087,060.07	0.00	6,997,631.29	10,089,428.78

(三) 报告期末本计划投资的股指和国债期货持仓和损

益明细

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
IM2401	IM2401	5	-5888000	106840	/
IC2401	IC2401	1	-1087360	4840	/
公允价值变动总额合计(元)					111680.0
本期投资收益(元)					112,160.00
本期公允价值变动(元)					37,960.00

(四) 报告期末本计划杠杆比例

截至2023年四季度,本计划账户总资产10,335,369.25元,净资产10,285,515.84元,杠杆率100.48%(杠杆率=总资产/净资产)。

六、重要事项提示

(一) 报告期需披露的重要事项：

产品名称	披露日期	报告期内已公告如下事项
平安证券尊享量化中性1号集合资产管理计划	2023-11-01	关于平安证券尊享量化多策略1号集合资产管理计划合同变更的公告
平安证券尊享量化中性1号集合资产管理计划	2023-11-30	关于平安证券尊享量化中性1号集合资产管理计划投资经理变更公告

(二) 报告期关联交易相关披露：

- 1、2023年四季度托管费计提额1077.24元，管理费计提额31442.61元，固定业绩报酬计提额10410.98元。支付的管理费、托管费、业绩报酬等费用的计提基准、计提方式和支付方式说明如下：

产品名称	费用类型	计提基准	计提方式			支付方式
			年费率（%）	计提频率	年天数	
平安证券尊享量化中性1号集合资产管理计划	托管费	不涉及	0.03	每日	365	季度支付
平安证券尊享量化中性1号集合资产管理计划	管理费	不涉及	1.8	每日	365	季度支付
平安证券尊享量化中性1号集合资产管理计划	管理费	不涉及	年管理费率将由1.8%调整为0.2%，优惠期自2023年8月15日起2023年11月15日结束，优惠期结束后将恢复至原费率1.8%	每日	365	季度支付

产品名称	费用类型	计提基准	计提方式(按如下比例计提)	支付方式
平安证券尊享量化中性 1 号集合资产管理计划	业绩报酬(如有)	0	0.2	从分红资金、退出资金或清算资金中提取和支付

2、 投资顾问费用信息(如有)

3、 报告期内未发生除上述费用计提以外的关联交易

七、备查文件

（一）备查文件目录

- 1、 中国证券投资基金业协会《资产管理计划备案确认函》（产品编码：SVS461）
- 2、《平安证券尊享量化中性 1 号集合资产管理计划说明书》
- 3、《平安证券尊享量化中性 1 号集合资产管理计划合同》
- 4、《平安证券尊享量化中性 1 号集合资产管理计划托管协议》
- 5、 管理人业务资格批准文件、营业执照

（二）存放地点及查阅方式：

查阅地址：深圳市福田区益田路 5023 号 B 座平安金融中心 25 楼

网址：www.pingan.com

信息披露电话：95511-8

投资者对本报告书如有任何疑问，可咨询管理人平安证券股份有限公司。

平安证券股份有限公司

二〇二四年一月二十九日