

# 泰信基金南丰 2 号 FOF 集合资产管理计划 2023 年第 3 季度报告

2023 年 09 月 30 日

资产管理人：泰信基金管理有限公司

资产托管人：平安银行股份有限公司

报告送出日期：2023 年 10 月 31 日

## § 1 重要提示

资产托管人平安银行股份有限公司根据本资产合同规定，于2023年10月30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，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述。

资产管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用资产，但不保证资产一定盈利。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2023年7月1日起至9月30日。

## § 2 产品概况

资产名称	泰信基金南丰2号FOF集合资产管理计划
备案代码	SVZ381
资产运作起始日	2022年7月20日
存续期限	10年
报告期末资产份额总额	32,397,340.29份
资产管理人	泰信基金管理有限公司
资产托管人	平安银行股份有限公司

## § 3 主要财务指标和净值表现

### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2023年7月1日-2023年9月30日）
1.本期已实现收益	-94,406.78
2.本期利润	767,542.89
3.加权平均份额本期利润	0.0237
4.期末资产净值	34,998,928.83
5.期末份额净值	1.0803

### 3.2 净值表现

阶段（2023年7月1日-2023年9月30日）	净值增长率①	净值增长率标准差②
泰信基金南丰2号FOF集合资产管理计划份额	2.25%	0.05%

## § 4 管理人报告

#### 4.1 投资经理简介

姓名	任本产品的投资经理期限		说明
	任职日期	离任日期	
耿浩然	2022年07月20日	-	会计与金融学硕士。具有九年资本市场投研经验，曾先后任职于国联证券股份有限公司证券研究所及资产管理部，担任策略研究员，FOF投资经理，投资主办等职务。2017年年底加入东吴证券资产管理总部，从事FOF投资和研究工作。2020年加入泰信基金专户投资部，任专户投资部总监助理，现任专户投资部总监，负责专户投资部整体投资运作。
方永存	2022年07月20日	-	注册会计师，复旦大学项目管理硕士，历任山东科瑞控股集团有限公司项目开发部副总经理；上海正泰太阳能科技有限公司总经办总经理助理；上海一磊资产管理有限公司总裁办总裁助理兼项目经理；上海锐懿资产管理有限公司投资管理部投资经理。2020年9月加入泰信基金管理有限公司，历任风险管理部风险管理员，现任专户投资部投资经理。

本报告期本计划投资经理无变动。

#### 4.2 报告期内投资策略和业绩表现说明

##### 4.2.1 报告期内投资策略和运作分析

精选固定收益类、权益类、管理期货类子策略具备超额收益获取能力的资管产品管理人和资管产品。根据市场动态适时调整底层子策略，对底层产品进行优化迭代。

##### 4.2.2 报告期内业绩表现

截至报告期末，泰信基金南丰2号FOF集合资产管理计划份额净值为1.0803元，份额净值增长率为2.25%。

#### 4.3 公平交易专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》（中国证监会公告[2011]18号），公司制定了《公平交易制度》，适用于所有投资品种，以及所有投资管理活动，涵盖授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管

理活动相关的各环节，从研究、投资、交易合规性监控，发现可疑交易立即报告，并由风险管理部负责对公平交易情况进行定期和不定期评估。

公司所有研究成果对公司所管理的所有产品公平开放，投资经理严格遵守公平、公正、独立的原则下达投资指令，所有投资指令在集中交易室集中执行，投资交易过程公平公正，投资交易监控贯穿于整个投资过程。

本报告期内，投资交易监控与价差分析未发现本计划与其他投资组合之间存在利益输送行为，公平交易制度整体执行情况良好。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本计划参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量不存在超过该证券当日成交量5%的情况，亦无其他异常交易行为。

## § 5 投资组合报告

### 5.1 报告期末资产管理计划资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占委托总资产的比例（%）
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	35,080,840.45	99.95
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：权证投资	-	-
	期货投资	-	-
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	银行存款和结算备付金合计	17,080.26	0.05
7	其他资产	-	-

8	合计	35,097,920.71	100.00
---	----	---------------	--------

## 5.2 报告期末按公允价值占资产管理计划资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本计划本报告期末未持有股票。

## 5.3 报告期末按公允价值占资产资产管理计划资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

序号	基金代码	基金名称	数量(股)	公允价值(元)	占资产管理计划资产净值比例(%)
1	SNJ760	富涌谷水滴10号私募证券投资基金	6,849,002.44	8,449,614.31	24.14
2	SSA217	天戈恒羽二号私募证券投资基金	7,684,805.93	8,413,325.53	24.04
3	SVE640	富涌谷溪海1号私募证券投资基金	4,880,212.95	5,738,154.39	16.40
4	SSU114	天戈恒锐17号私募证券投资基金	2,565,331.59	3,449,857.92	9.86
5	SVG992	竹润乐在50号私募证券投资基金	2,529,255.62	2,894,733.06	8.27
6	SGA156	常行2号私募证券投资基金	1,197,326.98	1,427,213.76	4.08
7	SQA243	竹润季添利固定收益1号私募证券投资基金	1,046,736.85	1,344,010.12	3.84
8	SQF262	陶山量化选股1号私募证券投资基金	1,289,062.72	1,292,027.56	3.69
9	SVB648	竹润乐山20号私募证券投资基金	1,036,269.43	1,053,160.62	3.01
10	SQH214	常行7号私募	966,916.46	1,018,743.18	2.91

## 5.4 报告期末按公允价值占资产管理计划资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

报告期末本计划未持有债券。

## 5.5 报告期末按公允价值占资产管理计划资产净值比例大小排名的前五名资产支持证券投资明细

报告期末本计划未持有资产支持证券。

## 5.6 报告期末按公允价值占资产管理计划资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

报告期末本计划未持有权证。

## 5.7 报告期末期货投资情况

报告期末本计划未持有期货。

## 5.8 投资组合报告附注

### 5.8.1 其他资产构成

序号	名称	金额（人民币元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
8	其他	-
9	合计	0.00

### 5.8.2 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末本计划未持有处于转股期的可转换债券。

### 5.8.3 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末本计划投资前十名中不存在流通受限情况。

## 5.9 资产管理计划支付的管理费

单位：人民币元

项目	报告期（2023年7月1日-2023年9月30日）
当期发生的管理费	87,150.61

注：本计划的年固定管理费率为1.00%。固定管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.00\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的固定管理费

E 为前一日的计划财产净值

本计划的固定管理费自资产管理计划成立日起，每日计提，按自然季度支付。

### 5.10 资产管理计划支付的托管费

单位：人民币元

项目	报告期（2023 年 7 月 1 日-2023 年 9 月 30 日）
当期发生的应支付的托管费	1,743.00

注：本计划的年托管费率为 0.02%。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.02\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的托管费

E 为前一日的计划财产净值

本计划的托管费自资产管理计划成立日起，每日计提，按自然季度支付。

### 5.11 资产管理计划的投资顾问费

本计划未发生投资顾问费。

### 5.12 资产管理计划业绩报酬

单位：人民币元

项目	报告期（2023 年 7 月 1 日-2023 年 9 月 30 日）
当期发生的业绩报酬	2,239.84

注：业绩报酬计提日：本计划的业绩报酬计提日为投资者退出日、分红日和计划终止清算时。

业绩报酬的计提，以上一个实际提取到业绩报酬的业绩报酬计提日（以下简称“上一个业绩报酬计提日”，如投资者该笔份额未发生业绩报酬计提，初始募集期认购的，以本集合计划成立日为上一个业绩报酬计提日，存续期内参与的，以确认当日为上一个业绩报酬计提日，下同）至本次业绩报酬计提日的期间为基准。投资者退出时，按照“先进先出”法，分别计算每一笔份额应收的管理人业绩报酬。

本集合计划成立时，业绩报酬计提基准为 6%，管理人可变更业绩报酬计提基准，变更后的业绩报酬计提基准以管理人的公告为准。

在业绩报酬计提日，若投资者在该期间内的实际年化收益率 S 小于或等于业绩报酬计提基准，管理人不计提业绩报酬；若在该期间内的实际年化收益率 S 大于业绩报酬计提基准，管理人将对超过部分收益的【6%】计提业绩报酬，剩余部分归投资者所有。

业绩报酬计算方法如下：

本期实际年化收益率 S	计提比例
-------------	------

S≤业绩报酬计提基准%	0
S>业绩报酬计提基准%	【30】%

业绩报酬计提办法：

$$S = \frac{(C'' - C')}{C} \times \frac{365}{D}$$

$$H = Q \times C \times (S - \text{浮动投顾费计提基准}\%) \times \frac{D}{365} \times 30\%$$

其中：

$C''$ ：在业绩报酬计提日的累计单位净值；

$C'$ ：为上一个业绩报酬计提日本集合计划的累计单位净值；

$C$ ：为上一个业绩报酬计提日本集合计划的单位净值；

$D$ ：为本次计提业绩报酬区间天数，即该投资者上一个业绩报酬计提日至本次业绩报酬计提日的间隔天数；

$H$ ：业绩报酬计提日管理人应计提的业绩报酬；

$Q$ ：业绩报酬计提日投资者退出或持有的单笔份额的数量；

业绩报酬的提取频率不超过6个月一次，因投资者退出资产管理计划，管理人按照资产管理合同的约定提取业绩报酬的，不受上述提取频率的限制。

业绩报酬的支付，由托管人根据管理人发送的业绩报酬划付指令于5个工作日内支付给管理人，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。由于涉及注册登记数据，业绩报酬的计算和复核工作由管理人完成，托管人根据管理人的划款指令进行划款。

业绩报酬计提基准不是预期收益或者保证收益率，不构成管理人、销售机构、托管人对委托财产收益状况的任何承诺和担保，投资者仍可能面临投资收益甚至本金受损的风险。

业绩报酬计提说明

投资者在本集合计划申请退出、分红和本集合计划终止清算时，管理人根据年化收益提取业绩报酬，从投资者退出计划资金款项、分红款项或清算款项中予以扣除。当分红金额不足以扣除业绩报酬时，以分红金额为限进行扣除。

### 5.13 资产管理计划利润分配情况

单位：人民币元

项目	本期 (2023年07月01日至2023年09月30日)
当期发生的收益分配	0.00

注：（一）每份集合计划份额享有同等分配权。

（二）如果投资当期出现净亏损，则不进行收益分配。

（三）收益分配后份额净值不低于本计划初始面值，即收益分配基准日的集合计划份额净值减去每份集合计划的份额收益分配金额后不能低于本计划初始面值 1.0000。

（四）在符合有关集合计划分红条件的前提下，本集合计划每年收益分配次数、收益分配的方式由管理人决定，收益分配间隔不得低于 6 个月。

（五）若集合计划可分配收益大于零，则管理人可将剩余全部可分配收益进行现金分红，具体分配方式以管理人公告为准。但若集合计划可分配收益小于零，则管理人不对集合计划进行收益分配。

（六）收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由委托人承担。

### 5.14 本报告期内无涉及投资者权益的重大关联交易

### 5.15 本报告期关联方参与本资产管理计划的情况

本报告期内本计划资产管理人的从业人员存在参与本资产管理计划的情况，报告期末持有份额共计400,000.00份。

## § 6 资产份额变动

单位：份

项目	泰信基金南丰2号FOF集合资产管理计划
报告期期初资产份额总额	32,249,061.42
报告期期间资产总申购份额	1,931,411.34
报告期期间资产总赎回份额	1,783,132.47
报告期期末资产份额总额	32,397,340.29

泰信基金管理有限公司

2023年10月31日

# 泰信基金南丰 2 号 FOF 集合资产管理计划托管报告

报告期：（2023 年 07 月 01 日—2023 年 09 月 30 日）

## 泰信基金管理有限公司：

根据我行与贵方签署的《泰信基金南丰 2 号 FOF 集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称《资管合同》），我行授权我部对贵方管理的泰信基金南丰 2 号 FOF 集合资产管理计划（以下简称“本计划”）项下的财产进行了托管。现就本报告期（2023 年 07 月 01 日—2023 年 09 月 30 日）托管情况报告如下：

### 一、托管人申明

在本报告期（2023 年 07 月 01 日—2023 年 09 月 30 日）内，我行严格遵守《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》等有关法律法规、资管计划合同的有关规定，完全尽职尽责地履行了应尽的义务，不存在任何损害本计划份额持有人利益的行为。

### 二、托管人对报告期内本计划投资运作等情况说明

报告期（2023 年 07 月 01 日—2023 年 09 月 30 日）内，我行严格遵照《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》等有关法律法规，对本计划的投资运作进行了必要的监督。

### 三、托管人对本报告期管理报告的复核

我行对本报告期（2023 年 07 月 01 日—2023 年 09 月 30 日）贵方提供的管理报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合等数据进行复核一致。

平安银行资产托管事业部

2023 年 10 月 30 日

