

南方资本恒逸中证 1000 指数增强 1 号集合  
资产管理计划 2024 年 2 季度管理报告

资产管理人：南方资本管理有限公司

资产托管人：华泰证券股份有限公司

# 南方资本恒逸中证 1000 指数增强 1 号集合资产管理计划

## 2024 年 2 季度管理报告

报告区间	2024 年 04 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
管理人	南方资本管理有限公司
托管人	华泰证券股份有限公司
成立日	2022 年 11 月 16 日
存续期限	除发生本合同约定的提前终止情形，本资产管理计划的存续期限自合同生效之日起至原则上投资运行满 5 年后终止。本计划自管理人在其公司网站发布计划成立公告之日，本计划成立，本计划资产管理合同生效。此外，本计划可根据合同相关约定提前终止或展期。

### 1. 投资管理人基本信息

投资管理人名称	南方资本管理有限公司
法定代表人	朱运东
统一社会信用代码	91440300083860822A
注册地址	深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）
联系方式	0755-21912222
联系地址及邮编	深圳市福田区益田路 5999 号基金大厦 39 楼 518017

### 2. 主要财务指标

期末委托资产份额（份）	9,516,051.11
期末资产总值（元）	7,411,457.08
期末资产净值（元）	7,404,210.96
期末份额净值（元）	0.778
期末累计份额净值（元）	0.859

### 3. 管理人履职报告

#### 3.1. 投资经理简介

姓名	职务	任本资产管理计划的投资经理期限		个人简历
		任职日期	离任期限	

张圣生	投资 经理	2023-05-17	-	张圣生先生，FRM，博士，毕业于天津大学，具备基金从业资格，具有三年以上投资管理、投资研究、投资咨询等相关业务经验。历任国信证券金融衍生品部研究员、深交所信息公司数据中心资深研究员、金瑞期货资产管理部投资经理及投研负责人、东莞信托证券投资部资深投资经理。2022 年加入南方资本，任职于投资管理部，现任南方资本管理有限公司投资经理兼投资管理部负责人，近三年未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚，无公募基金基金经理兼任情况。
颜语	投资 经理	2023-05-17	-	颜语先生，美国北卡罗来纳州立大学金融数学硕士研究生，曾就职于中融国际信托资产管理部。2015 年加入南方资本，现就职于投资管理部，具有基金从业资格，近三年未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚。

### 3.2. 管理人对报告期内本资产管理计划投资运作合规守信情况的说明

本报告期内，本资产管理人严格遵守有关法律法规、资产管理合同的规定，勤勉尽责地为本资产管理计划份额持有人谋求最大利益，没有发生损害本资产管理计划份额持有人利益的行为。

本资产管理计划将继续以取信于市场、取信于本资产管理计划份额持有人为宗旨，承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用委托财产，在规范委托财产运作和严格控制投资风险的前提下，努力为本资产管理计划份额持有人谋求最大利益。资产管理计划运作整体合法合规，没有损害委托人利益。资产管理计划的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及资产管理合同的规定。

### 3.3. 投资运作说明

本报告期内，资产管理计划按照既定投资目标进行投资。2024 年第二季度，受国内经

济数据走弱等因素影响，A 股市场未能延续农历新年以来的反弹趋势，进入了调整阶段。大小盘股分化明显，上证 50 及中证 300 指数表现明显好于中证 500 及中证 1000 指数。经过 6 月份的下跌，A 股的高估值压力已进一步释放，在政策利好及资金面支撑下，2024 年下半年指数有望再次迎来上涨。

本计划采取指数增强策略，本季度顺利完成了第三个运作周期的到期结算，并于 6 月 24 日完成了第四个运作周期的建仓。第四个运作周期年化增强收益率基准为 7.6%，预计于 2024 年 12 月 20 日到期。

## 4. 托管人履职报告

### 4.1. 报告期内本资产管理计划托管人合规守信情况的说明

本报告期内，托管人在对本资产管理计划的托管过程中，严格遵守有关法律法规、资产管理合同的规定，不存在损害资产委托人利益的行为，完全尽职尽责地履行了托管人应尽的义务。

### 4.2. 托管人对报告期内本计划投资运作合规守信、财产估值等情况的说明

本报告期内，本计划托管人严格遵守有关法律法规、资产管理合同的规定，对本计划的投资运作进行了监督。对本计划财产估值的计算等方面进行了认真的复核，未发现资产管理人存在损害委托人利益的行为。

### 4.3. 托管人对本报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务数据，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## 5. 资产管理计划投资组合报告

### 5.1. 期末资产组合情况

资产	期末余额（元）	占计划总资产的比例（%）
1. 权益投资		
其中：股票		
2. 固定收益投资		
其中：债券		
资产支持证券		
3. 基金投资	989,189.05	13.35

4. 理财投资-资管产品	4,701,648.65	63.44
5. 贵金属投资		
6. 金融衍生品投资		
7. 买入返售金融资产		
其中：买断式回购的买入返售金融资产		
8. 银行存款和结算备付金合计	932,691.91	12.58
9. 其他各项资产	787,927.47	10.63
10. 合计	7,411,457.08	100.00

注：由于四舍五入的原因，合计项与各分项之和可能存在尾差。

### 5.1.1 报告期末基金投资的股指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
IM2412	中证 1000 股指期货 2412	7	6,564,600.00	-37,200.00	-
公允价值变动总额合计（元）					-37,200.00

## 6. 资产管理计划运用杠杆情况

报告期内，本计划未使用杠杆。

## 7. 费用计提和支付情况

### 7.1 管理费

单位：人民币元

项目	当期
	2024 年 04 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
当期计提的管理费	31,845.16
当期支付的管理费	67,055.31

注：（1）本计划的年固定管理费率为 1.5%，计算方法如下：

第 i 个运作周期中每日应计提的管理费 = 第 i 个运作周期当日计费基准 × 年管理费率 ÷

第  $i$  个运作周期当日计费基准为第  $i-1$  个运作周期到期日的单位净值\*第  $i$  个运作周期内当日资产管理计划存续份额，特别地，但当  $i=1$  时，第  $i-1$  个运作周期到期日的单位净值为 1.000 元。

(2) 本计划的固定管理费自资产管理计划备案通过之日起开始计算，每日计提。

## 7.2 托管费

单位：人民币元

项目	当期 2024 年 04 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
当期计提的托管费	212.70
当期支付的托管费	447.93

注：(1) 资产管理计划财产的年托管费率为 0.01%/年。计算方法如下：

第  $i$  个运作周期中每日应计提的托管费 = 第  $i$  个运作周期当日计费基准  $\times$  年托管费率  $\div$  365

第  $i$  个运作周期当日计费基准为第  $i-1$  个运作周期到期日的单位净值\*第  $i$  个运作周期内当日资产管理计划存续份额，特别地，但当  $i=1$  时，第  $i-1$  个运作周期到期日的单位净值为 1.000 元。

(2) 本计划的托管费自资产管理计划备案通过之日起开始计算，每日计提。

## 7.3 业绩报酬

单位：人民币元

项目	当期 2024 年 04 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
当期计提的业绩报酬	0.00
当期支付的业绩报酬	0.00

本计划第三个运作期已于 2023 年 12 月 18 日起始投资，并将于 2024 年 6 月 21 日到期，第三个运作期业绩报酬计提基准中的年化增强收益率为 5.60%。

本计划第四个运作期已于 2024 年 6 月 24 日起始投资，并将于 2024 年 12 月 20 日到期，第四个运作期业绩报酬计提基准中的年化增强收益率为 7.60%。

注：每个运作周期的最后一日为业绩报酬计提基准日。管理人业绩报酬按每个运作周期单独核算并计提。

在本计划每个运作周期到期日和计划终止日时，管理人按计划份额在该运作周期超过业绩报酬计提基准以上部分计提业绩报酬。任意两次业绩报酬计提间隔不短于六个月。

本计划第  $i$  个运作周期对应的业绩报酬计提基准（年化） $R_i = \max \{ \text{第 } i \text{ 个运作期对应的中证 1000 指数收益率} \div \text{第 } i \text{ 个运作周期对应的投资起始日（含）至第 } i \text{ 个运作周期对应的到期日（不含）的自然日天数} \times 365 + \text{第 } i \text{ 个运作周期对应的年化增强收益率 } E_i - \text{年化税率（如有）， } 0 \}$ ，其中：第  $i$  个运作周期对应的中证 1000 指数收益率 = 中证 1000 指数在第  $i$  个运作周期对应的到期日 13:00-15:00 的算术平均价  $\div$  中证 1000 指数在第  $i$  个运作周期对应的投资起始日特定时间段（各产品会根据投资安排设定该时间段）的算术平均价  $-1$ ；

第  $i$  个运作周期对应的投资起始日特定时间段的算术平均价、年化增强收益率  $E_i$ 、运作周期到期日和投资起始日以管理人公告为准。

第  $i$  个运作周期对应的业绩报酬以本计划第  $i-1$  个运作周期到期日（对于第 1 个运作期即本计划成立日）至第  $i$  个运作周期到期日的投资增值部分高于第  $i$  个运作周期对应的业绩报酬计提基准的部分为基础进行计算，具体计算方法如下：

如  $NAV_i \leq NAV_{i-1}$  管理人不收取当个运作周期对应的业绩报酬；

如  $NAV_i > NAV_{i-1}$ ，第  $i$  个运作期对应的超额收益 =  $\max \{ S_i \times NAV_{i-1} \times [(NAV_i - NAV_{i-1}) / NAV_{i-1} - R_i \times T / 365], 0 \}$

其中：

$S_i$  为第  $i$  个业绩报酬计提基准日的计划份额；

$NAV_i$  为第  $i$  个运作周期到期日扣除业绩报酬前的资产管理计划累计份额净值；

$NAV_{i-1}$  为第  $i-1$  个运作周期到期日（对于首个运作期，第  $i-1$  个业绩报酬计提基准日为计划成立日）的资产管理计划累计份额净值；

$R_i$  为第  $i$  个运作期对应的计划业绩报酬计提基准（年化）；

$T$  为第  $i$  个运作期的实际自然日运作天数。

管理人收取超额收益的【20】%作为业绩报酬，其余部分的超额收益归投资者所有。

## 8. 报告期内资产管理计划投资分配情况

本报告期内，本计划进行了 1 次资金分配，每单位份额分配金额为 0.0137 元。

自本计划成立至本报告期末，本计划共进行了 7 次资金分配，具体如下：

序号	权益登记日	分配日	每单位份额分配金额（元）
1	2022 年 12 月 30 日	2023 年 1 月 3 日	0.0060

2	2023 年 3 月 31 日	2023 年 4 月 3 日	0.0147
3	2023 年 6 月 14 日	2023 年 6 月 15 日	0.0124
4	2023 年 9 月 14 日	2023 年 9 月 15 日	0.0109
5	2023 年 12 月 13 日	2023 年 12 月 14 日	0.0115
6	2024 年 3 月 13 日	2024 年 3 月 14 日	0.0120
7	2024 年 6 月 19 日	2024 年 6 月 20 日	0.0137
合计			0.0812

## 9. 重大事项报告

### 9.1. 报告期内计划的投资经理是否发生变更

报告期间本计划的投资经理未发生变更。

### 9.2. 报告期内关联交易的情况说明

报告期间本计划未发生关联交易。

### 9.3. 其他涉及投资者权益的重大事项

报告期间本计划无其他涉及投资者权益的重大事项。

## 10. 公平交易及异常交易情况

为公平对待所有投资人，切实保护投资人利益，公司严格执行《证券投资基金法》、《基金管理公司子公司管理规定》、《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规及公司内部制度、操作流程的相关规定。

本报告期内，资产管理人严格按照资管合同及相关投资政策的规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用组合资产，在控制风险的基础上，为投资人谋取最大利益，报告期内投资交易工作运作正常，未发生任何违法违规事件，未发现任何异常交易，无损害投资人利益的行为。



## 11. 声明

**11.1 保密要求：**本报告仅供本计划的委托人查阅，本报告中披露的产品净值、投资组合、投资策略等内容属于高度保密的商业信息，未经计划管理人事先书面授权，任何人不得对本报告进行复制或转发（无论是部分或完整地使用）。

**11.2 我公司郑重承诺**报告所提供的内容、数据、报表、附件真实、准确、完整。

南方资本管理有限公司

2024 年 07 月 31 日