申万宏源淳丰优选2号集合资产管理计划

2024年第1季度报告

重要提示

本报告由申万宏源淳丰优选2号集合资产管理计划（以下称“本集合计划”）管理人申万宏源证券资产管理有限公司（以下称“申万宏源资管”）编制，本集合计划托管人已复核了本报告中的主要财务指标、净值表现、投资组合、收益分配情况内容。

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。

管理人保证本报告书中所载资料的真实性、准确性。

托管人认为复核内容不存在虚假记载、误导性陈述。

本报告书中的内容由管理人负责解释。

本季度报告相关财务资料未经审计。

本季度报告报告期间：2024年01月01日－2024年03月31日

一、集合计划概况

产品名称：	申万宏源淳丰优选2号集合资产管理计划
产品类型：	固定收益
成立日期：	2023年05月26日
到期日期：	2031年05月26日
存续期：	8年
管理人：	申万宏源证券资产管理有限公司
托管人：	南京银行股份有限公司
注册登记机构：	申万宏源证券资产管理有限公司

二、集合计划管理人履职报告

（一）集合计划投资经理简介

孙生，毕业于英国伦敦政治经济学院，取得硕士学位，曾先后担任申万宏源证券量化风险经理、东方证券FICC业务风险经理、兴证资管结构金融投资。2021年8月至2023年9月就职于申万宏源证券有限公司资产管理事业部。2023年10月至今就职于申万宏源证券资产管理有限公司，任投资经理，参与了淳丰尊享系列、淳丰鑫享系列、沪甄优选系列产品等的投资工作。不存在其他兼职情况。该投资经理已取得基金从业资格，证书编号为：A20220408001426，且最近三年无被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚的经历。

（二）集合计划投资经理工作报告

（1）投资运作情况回顾

淳丰优选2号于2023年6月1日进行了看涨自动赎回期权的交易，挂钩中证1000指数，期初观察日为2023年6月1日。截至2024年3月31日，产品挂钩标的指数在运作期内未能在敲出观察日敲出。

（2）市场展望和投资策略

目前中证1000指数估值分位数仍处于历史较低分位数，我们维持2024年A股所处的宏观经济周期及政策环境相较2023年明显改善的判断，认为后续中证1000指数短期虽存在波动，但中期有望震荡反弹。

（三）集合计划运作合规性声明

本报告期内，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计划资产，在严格控制风险的基础上，为计划持有人谋求最大利益。本计划运作合法合规，无损害计划持有人利益的行为，本计

划的投资管理符合有关法规的规定。

（四）风险控制报告

本报告期内，集合计划管理人根据监管要求及公司整体的风险偏好、风险容忍度、风险限额等开展资产管理业务，并通过设立独立的风险控制部门对业务开展过程中的有关风险进行监测，定期或不定期向公司层级的风险管理部门进行风险控制报告。投资经理对所管理产品的持仓风险进行识别和分析，对所发现的风险信息向部门负责人及风险控制部门报告，若涉及信用风险的同步向信评部门报告。公司层级的风险管理部门将资产管理业务纳入公司整体风险管理框架，对资产管理业务风险进行独立再监控，对资产管理业务中存在的与监管要求及公司风险政策、风险偏好、风险容忍度、风险限额等不符的情况进行风险揭示，并向公司领导进行风险控制报告。

三、集合计划托管人履职情况

托管人已对本集合计划出具了《季度托管报告》，报告期托管人履职报告详见附件《季度托管报告》。

四、集合计划投资报告

（一）本集合计划业绩表现

截止2024年03月31日，集合计划单位净值为0.9973元，累计单位净值为0.9973元，报告期内累计净值增长率为0.07%，单位净值增长率为0.07%。

注1：累计净值增长率的计算公式如下：累计净值增长率=累计单位净值（期末/期初）-1 不跨期 期初=报告开始日-1 跨期=成立日

注2：本期单位基金净值增长率的计算公式如下：本期单位基金净值增长率=（本期第一次分红或扩募前单位基金资产净值÷期初单位基金资产净值）×（本期第二次分红或扩募前单位基金资产净值÷本期第一次分红或扩募后单位基金资产净值）×…… ×（期末单位基金资产净值÷本期最后一次分红或扩募后单位基金资产净值）-1

（二）主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2024年01月01日－2024年03月31日）
1.本期已实现收益	376,201.55
2.本期利润	37,789.62
3.期末资产净值	60,993,177.17
4.期末资产总值	62,679,748.44
5.期末单位净值	0.9973
6.期末单位累计净值	0.9973

注1：本期已实现收益指本集合计划本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

注2：所述业绩指标不包括持有人认（申）购及赎回费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

（三）管理人提取业绩报酬情况

本报告期内提取业绩报酬0.00元。

五、集合计划投资组合报告（截止 2024 年 03 月 31 日）

（一）资产组合情况

单位：元

项 目	期末市值	占期末总资产比例
银行存款	7,028.26	0.01%
结算备付金	0.00	0.00%
存出保证金	1,655,844.16	2.64%
证券清算款	0.00	0.00%
应收申购款	0.00	0.00%
股票投资	0.00	0.00%
债券投资	0.00	0.00%

权证投资	0.00	0.00%
基金投资	0.00	0.00%
买入返售金融资产	0.00	0.00%
其他资产	61,016,876.02	97.35%
合计	62,679,748.44	100%

注1：“其他资产”包括、“应收红利”、“应收利息” 、“其他应收款”等项目。

注2：因四舍五入，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

（二）股票持仓前五名明细

证券代码	证券名称	数量（股）	市值（元）	占资产净值比例
无	无	无	无	无

（三）债券持仓前五名明细

证券代码	证券名称	数量（份）	市值（元）	占资产净值比例
无	无	无	无	无

（四）基金持仓前五名明细

证券代码	证券名称	数量（份）	市值（元）	占资产净值比例
无	无	无	无	无

六、集合计划运用杠杆情况

（1）本报告期内期初杠杆率为0.00%，期末杠杆率为0.00%，报告期内杠杆率控制符合《产品合同》的约定。

其中，杠杆率等于正回购市值金额除以净资产市值金额。

（2）本产品投资不涉及股指期货。

（3）本产品投资不涉及国债期货。

七、资产管理计划支付的管理费、托管费、业绩报酬（如有）等费用的计提基准、计提方式和支付方式

1、集合计划管理费

本集合计划的固定年管理费率按不低于集合计划资产净值的【0.3】%年费率计提，具体以初始募集公告为准。自资产管理计划合同生效日起，每日计提，按季即于下一季度月初的前五个工作日内，由托管人按照管理人出具的付费指令支付，从资产管理计划财产中支付给管理人，若支付日银行托管账户无足够的资金余额，则顺延至下一工作日支付。固定管理费计算方法如下：

M=E×固定年管理费率÷当年实际天数

M为每日应计提的固定管理费，E为前一日的集合计划资产净值。

管理人将按照法律法规及自律组织的规定设置管理费（含业绩报酬）的收取比例上限，具体以管理人公告为准，并及时告知托管人。

2、集合计划托管费

本计划的年托管费率为【0.01】%，托管费的计算方法如下：

H＝E×【0.01】%÷当年实际天数

H为每日应计提的托管费

E为前一日的集合计划资产净值

本计划的托管费自资产管理计划合同生效日起，每日计提，按季即于下一季度月初的前五个工作日内，由托管人按照管理人出具的付费指令支付，从资产管理计划财产中支付给托管人，若支付日银行托管账户无足够的资金余额，则顺延至下一工作日支付。

托管人指定收取托管费的银行账户为：

户　　名：境内外资产托管费收入

账　　号：NJ120100

开户银行：南京银行

3、集合计划业绩报酬

管理人将在业绩报酬计提日针对委托人每笔份额分别核算其业绩报酬核算期，并根据《产品合同》业绩报酬条款约定计提业绩报酬。

八、集合计划投资收益分配情况

报告期内，本资管计划未进行收益分配。

九、投资经理变更、重大关联交易等涉及投资者权益的重大事项

1、报告期内本资管计划投资经理未发生变更。

2、本报告期内本计划未发生重大关联交易。

交易对手	交易标的	买入/卖出	交易数量	交易金额	交易时间	关联关系
-	-	-	-	-	-	-

3、本报告期内本计划未发生一般关联交易。

交易对手	交易标的	买入/卖出	交易数量	交易金额	交易时间	关联关系
-	-	-	-	-	-	-

4、本产品非FOF产品，不涉及FOF产品相关信息披露。

5、本报告期内已报告的重大事项

管理人于本报告期内在管理人网站披露了《申万宏源证券资产管理有限公司关联方公告》。

十、其他信息披露事项

1、截止本报告期末，本集合计划涉及非标资产投资，具体投资情况如下：

标的类型	项目名称	净值（元）	占资产净值比例
私募资管产品	永诚资产永盈安享1号资产管理产品	14,910,966.75	24.45%
私募资管产品	永诚资产永盈安享2号资产管理产品	14,727,983.58	24.15%
私募资管产品	新华资产-明淼九号资产管理产品	10,469,607.75	17.17%
私募资管产品	新华资产-明淼七号资产管理产品	10,466,054.02	17.16%
私募资管产品	华安财保资管安源5号集合资产管理产品	10,442,263.92	17.12%
非标商品及金融衍生品	申万宏源淳丰优选2号兴业证券期权20230601	75,404.07	0.12%

十一、信息披露的查阅方式

网址：www.swhyzcgl.com

信息披露电话：95523/4008895523

投资者对本报告书如有任何疑问，可咨询管理人申万宏源证券资产管理有限公司。

管理人：申万宏源证券资产管理有限公司

2024年04月23日