

太平洋证券金元宝 10 号集合资产管理计划

2018 年第 3 季度管理报告

一、重要提示

集合计划管理人保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

集合计划托管人复核了本报告中的财务指标和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

集合计划管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用集合计划资产，但不保证集合计划一定盈利。

集合计划的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本集合计划的合同、说明书等。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2018 年 7 月 1 日起至 2018 年 9 月 30 日止。

二、集合计划产品概况

集合计划名称:	太平洋证券金元宝 10 号集合资产管理计划
成立日期:	2018 年 5 月 23 日
成立规模:	32,784,101.28 元
存续期:	无固定期限
集合计划管理人:	太平洋证券股份有限公司
集合计划托管人:	兴业银行股份有限公司

二、主要财务指标和集合计划份额变动

下述集合计划业绩指标不包括持有人认购或交易集合计划的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。



(一) 主要财务指标

日期：2018-07-01~2018-09-30

单位：元

集合计划本期利润	2,371,204.56
期末集合计划资产净值	34,422,056.18
期末单位集合计划份额净值	1.0830
期末单位集合计划份额累计净值	1.0830
本期集合计划净值增长率	7.40%
集合计划累计净值增长率	8.30%

(二) 财务指标的计算公式

注：主要财务指标的计算公式

(1) 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

(2) 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

(3) 本期集合计划净值增长率 = $\frac{(\text{分红前一天单位净值} / \text{期初单位净值}) \times (\text{期末单位净值})}{(\text{分红前一天单位净值} - \text{分红金额})} - 1$

(4) 集合计划累计净值增长率 = $(\text{第一次分红后单位集合计划资产净值增长率} + 1) \times (\text{第二次分红后单位集合计划资产净值增长率} + 1) \times \dots \times (\text{最后一次分红后单位集合计划资产净值增长率} + 1) - 1$

(三) 开放式集合计划份额变动

期初集合计划份额总额	31,784,050.88
报告期内集合计划总申购份额	0
报告期内集合计划总赎回份额	0
报告期末集合计划份额总额	31,784,050.88

(四) 收益分配及业绩报酬提取情况

本报告期内未进行收益分配及提取业绩报酬。

四、管理人报告

（一）投资主办简介

张健，多年从事股票、基金、期货等多个领域投资研究，善于寻找市场中低风险投资机会，并能够熟练使用资本市场各类投资工具进行套利交易，将长线价值投资和短线波段操作相结合，规避系统性风险，在保证本金相对安全的基础上博取高额收益。

（二）投资主办工作报告

三季度，市场主体融资渠道收缩，尤其是民企普遍融资较难，大股东股票质押爆仓及上市公司为主体的债务违约或延期屡见不鲜，叠加交易所债流动性等因素，二级市场交易价格大幅下跌，收益率大幅上行，加大了产品净值波动，产品债券配置久期较短主要是以持有至到期为目的，短期波动对长期收益影响较小；股票市场在中美贸易战及金融去杠杆的大背景下，市场风险偏好大幅下降，市场估值进一步下杀，三季度上证综指屡创新低，大多数板块指数不断创低，具有一定的配置价值，产品结合市场情况配置了券商等指数基金，同时也配置了部分要约收购的新华百货、中关村等题材性股票。

展望四季度，产品将继续保持稳健操作，对于信用债深入分析并及时跟踪调研，目前产品持仓债券久期较短，大多在年底前到期，产品继续以配置短久期上市公司债为主要策略，同时股市大幅下跌部分板块估值已具备较好的配置价值，将结合股票市场走势择机配置部分权益类仓位增加组合弹性博取收益。

（三）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》、《证券公司客户资产管理业务管理办法》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最大利益。本报告期内，本集合计划运作合法合规，无损害集合计划持有人利益的行为，本集合计划的投资管理符合有关法规的规定。

2、风险控制报告

本报告期内，集合计划管理人加强对集合资产管理业务风险的事前分析、事中监控和事后评估，并提出风险控制措施。

本集合计划管理人的风险控制工作主要通过资产管理业务部门内控和公司合规部与风险管理部外部监控来进行。为加强资产管理业务的风险管理，资产管理总部作为资产管理业务的一线部门，全面负责资产管理业务的内部风险控制管理，内容包括集合计划的风险识别、风险监测、风险评估和风险应对等。公司风险管理部作为公司层面的中台部门，全面负责市场风险的揭示及管理，采用逐日监控以及定期与不定期检查等多种方法对集合计划的管理运作进行风险控制。公司合规部定期与不定期对业务开展的合规性进行全面检查。

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。本集合计划的投资决策、投资交易程序、投资权限等各方面均符合规定的要求；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；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。

五、集合计划财务报告

（一）集合计划财务报表

1、集合计划资产负债表

日期：2018年9月30日

单位：元

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	678,822.59	0.00	短期借款	0.00	0.00
结算备付金	487,311.44	0.00	交易性金融负债	0.00	0.00
存出保证金	15,283.13	0.00	衍生金融负债	0.00	0.00
交易性金融资产	42,108,914.73	0.00	卖出回购金融资产款	10,749,892.50	0.00
其中：股票投资	6,534,800.00	0.00	应付证券清算款	590,575.21	0.00
债券投资	33,211,977.54	0.00	应付赎回款	0.00	0.00
基金投资	2,362,137.19	0.00	应付管理人报酬	132,159.88	0.00
权证投资	0.00	0.00	应付托管费	4,130.03	0.00
资产支持证券	0.00	0.00	应付销售服务费	0.00	0.00
投资					
衍生金融工具	0.00	0.00	应付交易费用	129,001.65	0.00

买入返售金融资产	300,003.00	0.00	应交税费	86,487.11	0.00
应收证券清算款	0.00	0.00	应付利息	9,590.64	0.00
应收利息	1,548,244.72	0.00	应付利润	0.00	0.00
应收股利	0.00	0.00	其他负债	14,686.41	0.00
应收申购款	0.00	0.00	负债合计	11,716,523.43	0.00
其他资产	1,000,000.00	0.00			
			所有者权益:		
			实收基金	31,784,050.88	0.00
			未分配利润	2,638,005.30	0.00
			所有者权益合计	34,422,056.18	0.00
资产合计	46,138,579.61	0.00	负债和所有者权益总计	46,138,579.61	0.00

2、集合计划经营业绩表

日期：2018年7月1日~2018年9月30日

单位：元

序号	项目	本期数	本年累计数
1	一、收入	2,750,289.94	3,188,450.84
2	1、利息收入	574,743.41	680,442.22
3	其中：存款利息收入	3,666.10	9,941.13
4	债券利息收入	588,201.26	690,340.98
5	资产支持证券利息收入	0.00	0.00
6	买入返售证券收入	0.00	266.85
7	增值税贷款服务抵减	-17,123.95	-20,106.74
8	2、投资收益	1,068,857.35	944,764.31
9	其中：股票投资收益	207,237.35	207,237.35
10	债券投资收益	668,651.40	668,651.40
11	基金投资收益	208,538.60	22,375.20
12	权证投资收益	0.00	0.00
13	资产支持证券投资收益	0.00	0.00
14	衍生工具收益	0.00	0.00
15	股利收益	0.00	62,070.36
16	个股期权收益	0.00	0.00
17	投资收益-差价收入增值税抵减	-15,570.00	-15,570.00
18	3、公允价值变动收益	1,106,689.18	1,563,244.31
19	4、其他收入	0.00	0.00
20	二、费用	379,085.38	550,445.54
21	1、管理人报酬	132,159.88	186,965.37

22	2、托管费	4,130.03	5,842.71
23	3、销售服务费	0.00	0.00
24	4、交易费用	137,174.32	226,580.64
25	5、利息支出	86,699.47	105,811.51
26	其中：卖出回购金融资产支出	86,699.47	105,811.51
27	6、其他费用	10,344.12	15,336.41
28	7、增值税金及附加税	8,577.56	9,908.90
29	三、利润总和	2,371,204.56	2,638,005.30

(二) 集合计划投资组合报告

1、报告期末集合计划资产组合情况

	金额（元）	占总资产比例
银行存款和清算备付金合计	1,166,134.03	2.53%
股票投资	6,534,800.00	14.16%
基金投资	2,362,137.19	5.12%
债券投资	33,211,977.54	71.98%
其他资产	2,863,530.85	6.21%
合计	46,138,579.61	100.00%

注：其他资产包括“交易保证金”、“应收利息”等项目。

2、告期末按市值占集合计划资产净值比例大小排序的前五名证券

明细

序号	证券代码	证券名称	数量（股/张）	期末市值（元）	占净值比例
1	136081	15 广汇 01	100,100.00	9,929,920.00	28.85%
2	112287	15 海投债	70,000.00	6,979,000.00	20.27%
3	112193	13 美邦 01	55,001.00	5,467,099.40	15.88%
4	136023	15 当代债	41,000.00	4,083,600.00	11.86%
5	002193	山东如意	260,000.00	3,504,800.00	10.18%
		合计		29,964,419.40	87.04%

六、备查文件目录

(一) 备查文件目录

- 1、《太平洋证券金元宝 10 号集合资产管理合同》；
- 2、《太平洋证券金元宝 10 号集合资产管理计划说明书》；
- 3、《太平洋证券金元宝 10 号集合资产管理计划风险揭示书》；
- 4、集合计划管理人业务资格批件、营业执照。

(二) 存放地点

文件存放地点：北京市西城区北展北街 9 号华远企业号 D 座太平洋证券资产管理总部

网址：www.tpyzq.com

联系人：徐欢

EMAIL：xuhuan@tpyzq.com.cn

投资者对本报告书如有任何疑问，可咨询管理人太平洋证券股份有限公司。

太平洋证券股份有限公司

2018 年 10 月 15 日





六.四.六