

# 太平洋证券均盈优选 1 号集合资产管理计划

## 2019 年第 3 季度管理报告

(报告期: 2019 年 7 月 1 日-2019 年 9 月 30 日)



**太平洋证券股份有限公司**  
THE PACIFIC SECURITIES CO., LTD



管理人: 太平洋证券股份有限公司

托管人: 国泰君安股份有限公司

## 一、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》)、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》(以下简称《运作管理规定》)、《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》(以下简称《指导意见》)及其他有关规定制作。

本报告并非宣传推介材料,所载内容仅供本集合计划客户参考。任何人不得对本报告进行任何形式的发布、复制或删改,否则将构成侵权。

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,保证报告内容的真实性、准确性和完整性。

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。本集合计划的过往业绩及净值高低并不预示其未来业绩表现,管理人管理的其他产品的业绩也不构成本集合计划业绩表现的保证。

本报告中财务资料未经审计。本报告中的内容由管理人负责解释。

## 二、产品概况

产品名称	太平洋证券均盈优选 1 号集合资产管理计划
产品类型	混合类
成立日期	2018 年 9 月 18 日
成立规模	3340 万元
存续期限	10 年
产品风险等级	中高风险
适合推广对象	C4 积极型、C5 激进型

## 三、管理人履职报告

### (一) 投资经理简介

1、姓名:叶萌;

2、从业简历:曾先后任职于上海沃胜资产管理有限公司投资总监助理;东北证券股份有限公司资产管理总部高级经理,东证融汇证券资产管理公司高级经理,从事研究投资工作;

3、学历及兼职情况：会计学本科，无兼职情况；

4、业务经验情况：管理本产品。

本集合计划投资经理已取得基金从业资格，最近三年未被监管机构采取重大行政措施、行政处罚。

## （二）管理人履职情况

·管理人在本报告期内严格依据法律法规、合同的约定，遵循自愿、公平、诚实信用和客户利益至上原则，恪尽职守、勤勉尽责地履行管理人各项合同义务。

管理人本着诚实信用、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，为本集合计划持有人谋求最大利益。本集合计划运作合法合规，无损害持有人利益的行为。

## （三）报告期内投资经理工作报告

### 1、2019 年 3 季度市场回顾

2019 年三季度，市场窄幅震荡态势。在科技成长股带领下，创业板指数累计上涨 7.68%居首；主板市场表现较弱，上证综指累计跌 2.47%。成交量看，三季度，A 股成交额逐月回升，9 月两市日均成交额约 5654 亿元，环比增近三成。外资进入看，三季度，代表外资的北上资金持续涌入 A 股市场。其中，9 月份净流入 647 亿元，创历史单月最高纪录。分板块来看，三季度，信息技术板块表现强劲，累计上涨 9.82%居首，医疗保健、日常消费紧随其后，板块涨幅分别为 6.25%、2.23%；能源行业表现垫底，累计下跌 6.43%。

### 2、2019 年 4 季度市场展望

今年以来表现较好的行业主要集中在消费、科技两大领域，消费及科技占优的长期逻辑：（1）在经济增长中枢面临逐步放缓、经济结构正在转型、无风险利率中枢向下的宏观背景下，投资对于经济的贡献率下降，投资占 GDP 的比重会逐步下降，消费对于经济的贡献率提升，消费龙头公司持续受益于消费升级趋势以及集中度提升，业绩能够维持稳定增长，因此在目前“资产荒”的宏观背景下显现出一定的稀缺性，享受“确定性”估值溢价。（2）经济结构转型，由过往投资转向消费及技术推动，科技股龙头公司受益于 5G 产业周期及其应用，比如 5G



网络建设给 PCB 行业带来了量价齐升，迎来了景气周期。

在四季度，我们围绕的标的产品还将会是以周期属性较弱的、逆周期调节的行业为主的基金。

#### 四、托管人履职情况

托管人在本报告期内严格遵守《管理办法》、《运作管理规定》和《指导意见》等有关法律法规规定并按照本集合计划合同和托管协议的约定，诚信、尽责地履行了托管人义务，不存在损害本集合计划投资者利益的行为。

托管人于 2019 年 10 月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。

#### 五、产品投资表现

##### (一) 净值表现

截至 2019 年 9 月 30 日，本产品的单位净值为 1.1549，累计单位净值为 1.1549，本报告期份额净值增长率为 5.62%。

##### (二) 主要财务指标

日期：2019-07-01~2019-09-30

单位：元

本报告期利润	2,054,125.56
本报告期末资产净值	38,577,112.66
本报告期末份额净值	1.1549
本报告期末累计份额净值	1.1549
本报告期份额净值增长率	5.62%

财务指标的计算公式：

- 1、本报告期末份额净值=期末本集合计划资产净值÷期末本集合计划份额
- 2、本报告期末累计份额净值=期末本集合计划份额净值+每份本集合计划份额累计分红
- 3、本报告期本集合计划份额净值增长率=(本期第一次分红前一天份额净值÷本期期初份额净值)×{本期第二次分红前一天份额净值÷(本期第一次分红前一天份额净值-本期第一次单位份额分红金额)} ×……×{本期期末份额净值÷(本期最后一次分红前一天份额净值-本期最后一次单位份额分红金额)}-1

## (三) 财务报表

## 1、资产负债表

日期：2019-09-30

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	491.32	2,812.34	短期借款	0.00	0.00
结算备付金	0.00	0.00	交易性金融 负债	0.00	0.00
存出保证金	0.00	0.00	衍生金融负 债	0.00	0.00
交易性金融资产	12,735,19 9.00	6,987,199. 00	卖出回购金融 资产款	0.00	0.00
其中：股票投资	0.00	0.00	应付证券清 算款	0.00	0.00
债券投资	0.00	0.00	应付赎回款	0.00	0.00
基金投资	12,735,19 9.00	6,987,199. 00	应付管理人 报酬	95,289.12	82,506.81
权证投资	0.00	0.00	应付托管费	17,321.28	4,125.32
资产支持证 券投资	0.00	0.00	应付销售服 务费	0.00	0.00
衍生金融工具	0.00	0.00	应付交易费 用	0.00	0.00
买入返售金融资 产	0.00	0.00	应交税费	0.00	0.00
应收证券清算款	4,378,800. 00	0.00	应付利息	0.00	0.00
应收利息	834.82	0.66	应付利润	0.00	0.00
应收股利	214,971.9 4	76,890.15	其他负债	18,697.77	25,000.00
应收申购款	0.00	0.00	负债合计	131,308.1 7	111,632.1 3
其他资产	21,378,12 3.75	24,637,06 7.57			
			所有者权益：		
			实收基金	33,402,31 6.53	33,402,31 6.53
			未分配利润	5,174,796. 13	-1,809,978 .94
			所有者权益	38,577,11	31,592,33



			合计	2.66	7.59
资产合计	38,708,420.83	31,703,969.72	负债和所有者权益总计	38,708,420.83	31,703,969.72

## 2、经营业绩表

日期：2019年07月~2019年09月

单位：元

序号	项目	本期数	本年累计数
1	一、收入	2,173,037.04	7,290,663.72
2	1、利息收入	1,244.35	1,300.56
3	其中：存款利息收入	1,244.35	1,300.56
4	债券利息收入	0.00	0.00
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	0.00
7	增值税贷款服务抵减	0.00	0.00
8	2、投资收益	1,751,790.48	1,848,306.98
9	其中：股票投资收益	0.00	0.00
10	债券投资收益	0.00	0.00
11	基金投资收益	0.00	0.00
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	45,087.40	141,603.90
16	个股期权收益	0.00	0.00
17	理财产品差异	1,706,703.08	1,706,703.08
18	投资收益-差价收入增值税抵减	0.00	0.00
19	3、公允价值变动收益	420,002.21	5,441,056.18
20	4、其他收入	0.00	0.00
21	二、费用	118,911.48	305,888.65
22	1、管理人报酬	95,289.12	268,222.85
23	2、托管费	17,321.28	25,968.03
24	3、销售服务费	0.00	0.00
25	4、交易费用	0.00	0.00
26	5、利息支出	0.00	0.00
27	其中：卖出回购金融资产支出	0.00	0.00

28	6、其他费用	6,301.08	11,697.77
29	7、增值税金及附加税	0.00	0.00
30	三、利润总和	2,054,125.56	6,984,775.07

#### (四) 管理人遴选产品策略及投资管理人及管理人关联方所设立的资产管理产品的情况

管理人恪尽职守，本着公平、公正原则，综合考虑所投产品的历史业绩等情况，为客户挑选优质股票多头策略私募基金公司，投资于其管理的私募基金产品（详见第五点第（二）款投资明细表），未投资于管理人或管理人关联方所设立的资产管理产品。

## 六、投资组合报告

### (一) 投资组合情况

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	491.32	0
理财产品	21,378,123.75	55.23%
基金投资	12,735,199.00	32.90%
其他资产	4,594,606.76	11.87%
合计	38,708,420.83	100.00%

注：其他资产包括“交易保证金”、“应收利息”等项目。

### (二) 投资组合平均剩余期限

无

### (三) 前五名证券投资明细

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	JLWJ01	深国投·景林稳健证券投资集合资金信托计划	8,863.20	12,393,855.72	32.13%
2	ZXSY03	尊享收益98号私募证券投资基金	5,608,157.32	8,984,268.03	23.29%
3	000725	大成添利宝货币B	6,680,199.00	6,680,199.00	17.32%
4	004167	安信活期宝货币B	6,055,000.00	6,055,000.00	15.70%



5				
		合计	34,113,322.75	88.43%

注：排序口径为报告期末按市值占本集合计划资产净值比例大小排序。

(四) 本报告期内份额变动情况如下：

期初集合计划份额总额	263,211,983.30
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	263,211,983.30

### 八、产品费用计提基准、计提方式和支付方式

(一) 托管费：托管费的年费率为【0.05】%；每日计提，按季支付。

(二) 管理费：管理费的年费率为【1】%；每日计提，按季支付。

(三) 管理人的业绩报酬：本计划业绩报酬计提基准为【8%】/年，在每笔份额退出日、收益分配基准日或计划终止日，对超出业绩报酬计提基准的持有期差额收益管理人按【10%】比例进行计提。

### 九、产品收益分配情况

本报告期内未进行收益分配，未提取业绩报酬。

### 十、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

(一) 投资经理变更

本集合计划在报告期内未发生投资经理变更。

(二) 重大关联交易

本报告期内无重大关联交易。

(三) 其他涉及影响投资者权益的重大事项

本报告期内无其他涉及影响投资者权益的重大事项。



### 十一、管理人员工跟投情况

截至 2019 年 6 月 30 日，太平洋证券均盈优选 1 号产品共有 2 名太平洋证券股份有限公司员工跟投，跟投份额余额共计 2,500,346.73，跟投份额市值共计 2,887,150.37 元，管理人会对本集合计划账户进行持续监控。

### 十二、信息披露的查询方式

公司网址：[www.tpyzq.com](http://www.tpyzq.com)

太平洋证券股份有限公司

2019 年 10 月 14 日

