

**太平洋证券均盈优选 FOF1 号集合资产管理计划**  
**2021 年第 4 季度管理报告**  
(报告期: 2021 年 10 月 1 日-2021 年 12 月 31 日)



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 FOF1 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
存续期限	10 年
产品风险等级	R4 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

投资经理：叶萌；

1、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；

2、学历及兼职情况：会计学本科，无兼职情况；

3、业务经验情况：管理本产品。

## （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、市场情况

2021 年收官，A 股市场整体表现相对较好，上证指数、万得全 A 年线收三连阳，但此期间结构分化非常显著，代表中、小盘风格的中证 1000 指数、中证 500 指数表现最好，分别上涨 20.52%、15.58%，而同期中证 100、上证 50 等大盘指数表现最差，分别下跌 10.55%、10.06%。从行业表现来看，行业间差异化依然很大，以申万行业为例，表现最好的电力设备行业全年上涨 47.86%，同期家用电器行业表现最差，下跌 19.54%。从 A 股市场历年表现来看，大多数年份中行业分化均较为明显，为行业轮动、行业配置策略提供了潜在空间。其中电力设备、有色金属、煤炭、基础化工、钢铁涨幅为前五，而家电、非银金融、房地产、社服、食品饮料位居跌幅榜前五。

### 2、产品配置情况

目前产品仓位并不高，主要看好围绕业绩确定性较强的公司进行配置的全行业基金产品，同时逢低布局明年围绕护城河较高的公司配置的全行业基金产品，以应对当前剧烈波动的市场环境。

### 3、后市展望及明年配置思路



我们一直认为新能源产业链不是简单的周期产品，而是关系到国运的一场能源革命，因此整个产业链是具备高质量成长的长期性，值得我们重点研究和深度挖掘。除了市场上充分演绎的新能源制造行业外，随着绿电占比的不断提升，整个电力系统的改造也将带来新的机会。因此电力系统同样也孕育了较大的结构性机会，我们还将继续围绕双碳背景下的能源革命进行投资机会的发掘，寻找那些围绕这一领域护城河较高的公司进行配置的全行业基金产品。另外我们同样长期看好高端制造和硬科技板块，智能电动汽车在经过渗透率的快速提升之后，智能化也将浪潮来临，在传统燃油油车时代没大机会参与全球产业链的中国供应商，有了弯道超车的机会。

从长期方向来看，我们的 A 股市场处于“美股化”的潮流中：一是经济总量放缓，从而提升结构；二是机构投资者不断壮大，存款向基金搬家趋势不改；三是监管市场化改革，加速市场优胜劣汰；所以，资金对于高 ROE、深护城河、业绩确定性的追逐长期不会改变。

短期来看，一是经济面临一定的增长压力；二是低基数效应消退，非核心的小市值成长公司的业绩相对优势不再延续。所以，明年，我们会以重个股轻行业的思路来进行配置。具体到标的应对方向上，我们会重点挖掘那些在新能源行业、新型电力系统、汽车智能化、医药生物、机场等相关行业的里寻找高 ROE、护城河较深、业绩确定性强企业的全行业基金。

#### 四、托管人履职情况

本托管人依据太平洋证券均盈优选 FOF1 号集合资产管理计划的合同与托管协议，自计划成立日起托管“太平洋证券均盈优选 FOF1 号集合资产管理计划”（以下简称“本计划”）的全部资产。

报告期内，本托管人严格遵守《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》及其他有关法律法规、本计划合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了托管人义务，不存在损害本计划委托人利益的行为。

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、本计划合同和托管协议的规定，对管理人在本计划的投资运作、资产净值的计算、收益的计算、计划费用

开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本计划委托人利益的行为。

本托管人认真复核了本报告期《太平洋证券均盈优选 FOF1 号集合资产管理计划 2021 年第 4 季度管理报告》中的财务指标、净值表现、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，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 2021 年 12 月 31 日，本产品的份额净值为 1.5838 元，份额累计净值为 1.8593 元，本报告期份额净值增长率为-1.64%。

### (二) 主要财务指标

日期：2021-10-01~2021-12-31

单位：元

集合计划本期利润	-1,404,822.70
期末集合计划资产净值	69,040,846.71
本报告期末份额净值	1.5838
本报告期末累计份额净值	1.8593
本报告期份额净值增长率	-1.64%

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：2021-12-31

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	3,569,869.09	922,034.85	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	65,702,539.09	40,070,699.21	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	65,702,539.09	40,070,699.21	应付管理人报酬	204,377.38	195,303.47
权证投资	0.00	0.00	应付托管费	10,218.81	4,665.82
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	0.00	0.00	应付利息	0.00	0.00
应收利息	569.49	246.36	应付利润	0.00	0.00
应收股利	2,465.23	0.00	其他负债	20,000.00	20,000.00
应收申购款	0.00	0.00	负债合计	234,596.19	219,969.29
其他资产	0.00	0.00			
			所有者权益：		
			实收基金	43,591,076.59	29,104,549.86
			未分配利润	25,449,770.12	11,668,461.27
			所有者权益合计	69,040,846.71	40,773,011.13
资产合计	69,275,442.90	40,992,980.42	负债和所有者权益总计	69,275,442.90	40,992,980.42

## 2、经营业绩表

日期：2021 年 10 月~2021 年 12 月

单位：元

序号	项目	本期数	本年累计数
1	一、收入	-647,201.99	7,279,540.31
2	1、利息收入	2,117.64	13,012.03
3	其中：存款利息收入	2,117.64	13,012.03
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	-3,568,566.09	17,557,755.61
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	-3,607,293.21	17,515,311.56
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	38,727.12	42,444.05
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	0.00	0.00
18	3、公允价值变动收益	2,919,246.46	-10,291,227.33
19	4、其他收入	0.00	0.00
20	二、费用	757,620.71	2,162,711.58
21	1、管理人报酬	204,377.38	690,462.05
22	2、托管费	10,218.81	36,551.42
23	3、销售服务费	0.00	0.00
24	4、交易费用	537,982.19	1,419,698.11
25	5、利息支出	0.00	0.00
26	其中：卖出回购金融资产支出	0.00	0.00
27	6、其他费用	5,042.33	16,000.00
28	7、增值税金及附加税	0.00	0.00



29	三、利润总和	-1,404,822.70	5,116,828.73
----	--------	---------------	--------------

### 3、所有者权益变动表

日期：2021 年 10 月~2021 年 12 月

单位：元

序号	项目	本期金额			上期金额		
		实收基金	未分配利润	所有者权益	实收基金	实收基金	未分配利润
1	一、期初所有者权益 (基金净值)	47,200,074.77	28,803,263.90	76,003,338.67	41,834,681.73	26,176,097.97	68,010,779.70
2	二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期净利润)	0.00	-1,404,822.70	-1,404,822.70	0.00	-940,574.74	-940,574.74
3	三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (减少以“-”号填列)	-3,608,998.18	-1,948,671.08	-5,557,669.26	5,365,393.04	3,567,740.67	8,933,133.71
4	其中: 1.基金申购款	6,726,818.37	4,215,167.83	10,941,986.20	12,742,382.99	9,371,708.42	22,114,091.41
5	2.基金赎回款	-10,335,816.55	-6,163,838.91	-16,499,655.46	-7,376,989.95	-5,803,967.75	-13,180,957.70
6	四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动数	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
7	五、期末所有者权益 (基金净值)	43,591,076.59	25,449,770.12	69,040,846.71	47,200,074.77	28,803,263.90	76,003,338.67

#### (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

本集计划管理人精选市场中优秀金融产品，综合考虑投资回报与风险，合理配置不同风格的金融产品。同时根据市场行情变化，动态调整不同产品间



的配置结构，力争提升产品收益。通过对投资对象的风险收益特征分析以及投资特性分析，使用定量分析和定性分析两方面的方法精选符合条件的金融产品进行投资。未投资于管理人或管理人关联方所设立的资产管理产品。

#### (五) 其他(如需说明事项)

本报告期内无其他事项说明。

## 六、投资组合报告

### (一) 投资组合情况

	金额(元)	占总资产比例
股票	-	-
基金	65,702,539.09	94.84%
债券	-	-
权证	-	-
资产支持证券	-	-
理财产品投资	-	-
货币市场工具(票据、CD)	-	-
现金(银行存款及清算备付金)	3,569,869.09	5.15%

注：

- 1、其他资产包括“交易保证金”、“应收利息”等项目。
- 2、因四舍五入原因，以上表格分项数据加总与合计数可能存在尾差。

### (二) 报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标的投资明细

序号	产品代码	产品名称	数量(股/张/份)	期末市值(元)	占净值比例(%)
1	377150	上投摩根健康品质生活混合	2,810,047.42	12,802,295.04	18.54
2	8050	同泰慧择混合 A	9,039,573.20	11,378,110.79	16.48
3	9913	中信保诚成长动力混合 A	5,562,203.54	9,143,706.40	13.24
4	6408	汇添富消费升级混合	2,892,456.92	7,098,089.28	10.28
5	6392	中信保诚创新成长灵活配置混合	1,840,485.62	6,926,299.53	10.03
合计			22,144,766.70	47,348,501.04	68.58

注：

- 1、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。
- 2、因四舍五入原因，以上表格分项数据加总与合计数可能存在尾差。

**(三) 本报告期内份额变动情况如下:**

期初集合计划份额总额	47,200,074.77
报告期内集合计划总申购份额	6,726,818.37
报告期内集合计划总赎回份额	10,335,816.55
报告期末集合计划份额总额	43,591,076.59

**七、产品运用杠杆情况**

截至本报告期末，本集合计划的融入资金余额占本集合计划资产净值的比例为 0%。

**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】%；

(二) 管理费：管理费的年费率为【1】%；

(三) 管理人的业绩报酬：本计划业绩报酬计提基准为【8%】/年，超出业绩报酬计提基准的持有期差额收益按【X%】（具体以管理人官网公告为准，最高不超过 60%）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**

本集合计划投资经理孙梦祎自 2021 年 11 月起因个人原因不再担任本集合计划的投资经理。本集合计划投资经理由叶萌、孙梦祎先生变更为叶萌先生。

**(二) 重大关联交易**

本集合计划在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**

本集合计划在报告期内无涉及影响投资者权益的重大事项。

**十一、管理员工跟投情况**

截至 2021 年 12 月 31 日，太平洋证券均盈优选 FOF1 号产品员工跟投份额共计 3,090,289.31 份，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  
2022 年 1 月 26 日





