

太平洋证券金添利 1 号集合资产管理计划

2021 年第 4 季度管理报告

(报告期: 2021-10-01~2021-12-31)



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: 中国工商银行股份有限公司上海分行



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	太平洋证券金添利 1 号集合资产管理计划
产品类型	固定收益类
成立日期	2018 年 5 月 25 日
存续期限	10 年
产品风险等级	R2 中低风险
适合推广对象	合格投资者中风险承受能力评级为 C2 谨慎型、C3 稳健性、C4 积极型、C5 激进型普通投资者及专业投资者。

三、管理人履职报告

(一) 投资经理简介

- 1、姓名:曹婕
- 2、从业简历:2014 年 9 月加入太平洋证券资产管理总部,现任投资经理。
- 3、学历及兼职情况:硕士研究生
- 4、业务经验情况:具有丰富的债券交易和投资经验。

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

宏观方面，年末生产端略有向好，结构上，供给约束基本缓解，采矿业增加值同比显著好于年中，原煤产量恢复至正常水平；上下游继续分化，上游生产仍低位徘徊，下游生产基本平稳但未来仍有隐忧，总体来看实质性的改善尚未实现。投资端，固定资产投资增速略低于预期，地产融资在政策呵护下略有所恢复，但房价下跌引发需求转弱；基建投资回落可能受北方天气寒冷影响，预计年初大概率反弹，制造业也有所改善。社零增速有所回落，主要受餐饮、通信电子和家电三类消费拖累，但在必选消费和汽车拉动下，总体表现好于市场预期，短期消费修复弹性可能不大。

利率债方面，截至21年末，国债1年期收益率较2020年末下行12BPs，3-5年期下行27-28BPs，7-10年期下行33-34BPs，下行幅度相对较大。国开债1年期下行12BPs，幅度相对较小，3年和7年期下行34-38BPs，5年和10年期下行41-44BPs，幅度相对较大。整体上，政策债的市场表现好于国债。2021年债券收益率整体呈震荡下行态势，一方面由于国内疫情反复点状爆发，市场担忧破坏经济复苏，避险情绪升温。另一方面我国经济增速出现明显下滑，一季度GDP同比增速高达18.3%，二季度放缓至7.9%，三季度下滑至4.9%。尤其9-10月的官方制造业PMI均跌破50荣枯线，显示经济下行压力较大，基本面走弱。在政府稳价保供政策的作用下，大宗商品价格冲高回落，市场通胀担忧缓解。同时央行货币政策稳中偏松，7月和12月两次全面降准，推升市场宽松预期，提振债

市做多情绪。上述因素共同推动利率债收益率大幅下行。

未来配置方向，当前资金依然相对拥挤，资产荒下信用债尤其城投债收益挖掘手段是个关注方向，“中部六省”依然是挖掘重点，可以适当下沉。关注加担保城投债。

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 2022 年 1 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 2021 年 12 月 31 日，本产品的单位净值为 1.0136 元，累计单位净值为 1.2195 元，本报告期份额净值增长率为 1.50%。

(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	1,078,195.55
期末集合计划资产净值	69,562,279.36
本报告期末份额净值	1.0136
本报告期末累计份额净值	1.2195
本报告期集合计划份额净值增长率	1.50%

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：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	84,521.97	5,188,896.87	短期借款	0.00	0.00
结算备付金	274,625.42	1,277,775.39	交易性金融负债	0.00	0.00
存出保证金	1,049.55	5,783.53	衍生金融负债	0.00	0.00
交易性金融资产	79,465,184.60	115,938,730.00	卖出回购金融资产款	11,999,880.00	11,699,883.00
其中：股票投资	0.00	0.00	应付证券清算款	0.00	5,108,100.82
债券投资	79,465,184.60	115,938,730.00	应付赎回款	0.00	0.00
基金投资	0.00	0.00	应付管理人报酬	91,020.42	173,824.21
权证投资	0.00	0.00	应付托管费	5,461.24	10,429.45
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	2,557.75	11,633.04
买入返售金融资产	0.00	0.00	应交税费	176,446.25	241,062.53
应收证券清算款	0.00	0.00	应付利息	1,815.79	-6,201.61
应收利息	2,034,079.27	3,604,837.56	应付利润	0.00	0.00
应收股利	0.00	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	12,297,181.45	17,258,731.44
其他资产	0.00	0.00			
			所有者权益：		
			实收基金	68,629,940.07	107,184,714.12
			未分配利润	932,339.2	1,572,577

				9	.79
			所有者权益 合计	69,562,27 9.36	108,757,2 91.91
资产合计	81,859,46 0.81	126,016,0 23.35	负债和所有者 权益总计	81,859,46 0.81	126,016,0 23.35

2、经营业绩表

日期：2021-10-01~2021-12-31

单位：元

序号	项目	本期数	本年累计数
1	一、收入	1,223,039.34	5,710,864.77
2	1、利息收入	1,021,532.92	5,152,945.43
3	其中：存款利息收入	2,053.29	13,537.19
4	债券利息收入	1,023,311.53	5,161,109.02
5	资产支持证券利息收入	0.00	0.00
6	买入返售证券收入	22,722.35	117,101.90
7	增值税贷款服务抵减	-26,554.25	-138,802.68
8	2、投资收益	3,248.83	573,875.44
9	其中：股票投资收益	0.00	0.00
10	债券投资收益	3,346.29	581,455.39
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	0.00	0.00
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	-97.46	-7,579.95
18	3、公允价值变动收益	198,257.59	-15,956.10
19	4、其他收入	0.00	0.00
20	二、费用	144,843.79	759,613.54
21	1、管理人报酬	91,020.42	441,211.99
22	2、托管费	5,461.24	26,472.69
23	3、销售服务费	0.00	0.00
24	4、交易费用	174.32	1,113.35
25	5、利息支出	29,494.56	218,526.73
26	其中：卖出回购金融资产支出	29,494.56	218,526.73
27	6、其他费用	14,781.33	54,780.38
28	7、增值税金及附加税	3,911.92	17,508.40
29	三、利润总和	1,078,195.55	4,951,251.23

3、所有者权益变动表

日期：2021-10-01~2021-12-31

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	未分配利润	所有者权益
1	一、期初所有者权益（基金净值）	72,958,556.01	569,522.21	73,528,078.22	89,892,590.70	971,228.70	90,863,819.40
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	1,078,195.55	1,078,195.55	0.00	1,299,879.89	1,299,879.89
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）	-4,328,615.94	-15,378.47	-4,343,994.41	-16,934,034.69	-371,586.38	-17,305,621.07
4	其中：1.基金申购款	4,884,413.76	51,876.65	4,936,290.41	12,652,770.39	199,438.97	12,852,209.36
5	2.基金赎回款	-9,213,029.70	-67,255.12	-9,280,284.82	-29,586,805.08	-571,025.35	-30,157,830.43
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	-700,000.00	-700,000.00	0.00	-1,330,000.00	-1,330,000.00
7	五、期末所有者权益（基金净值）	68,629,940.07	932,339.29	69,562,279.36	72,958,556.01	569,522.21	73,528,078.22

（四）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
现金（银行存款及清算备付金）	359,147.39	0.44%
债券投资	79,465,184.60	97.08%

其他资产	2,035,128.82	2.49%
合计	81,859,460.81	100.00%

注：（1）其他资产包括“交易保证金”、“应收利息”等项目。

（2）由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

（二）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	155339	19 中产 01	101,730.00	10,073,304.60	14.48%
2	122457	15 新金债	100,000.00	10,000,000.00	14.38%
3	167859	20 濮阳 02	100,000.00	10,000,000.00	14.38%
4	150733	18 景旅 01	100,000.00	9,998,200.00	14.37%
5	166027	20 聊城 01	100,000.00	9,862,100.00	14.18%
		合计	501,730.00	49,933,604.60	71.78%

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）由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

（三）本报告期内份额变动情况如下：

期初集合计划份额总额	72,958,556.01
报告期内集合计划总申购份额	4,884,413.76
报告期内集合计划总赎回份额	9,213,029.70
报告期末集合计划份额总额	68,629,940.07

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：

本集合计划托管费按前一日集合计划资产净值的0.03%年费率计提，计算方法如下：

$$T = E \times 0.03\% \div 365$$

T为每日应计提的集合计划托管费

E为前一日集合计划资产净值（首日按本计划初始资金金额）

托管费每日计提，按季支付，由托管人根据与管理人核对一致的财务数据，自动在每季初5个工作日内按照指定的账户路径进行资金支付，管理人无需再出具资金划款指令。费用自动扣划后，管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。若遇法定节假日，休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

（二）管理费：

本集合计划管理费按前一日集合计划资产净值的0.50%年费率计提，计算方法如下：

$$G=E \times 0.50\% \div 365$$

G为每日应计提的集合计划管理费

E为前一日集合计划资产净值（首日按本计划初始资金金额）

管理费每日计提，按自然季度支付，由管理人向托管人发送集合计划管理费划付指令，托管人复核后于5个工作日内从集合计划中支付给管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法支付时，顺延至最近可支付日支付。

（三）管理人的业绩报酬

1、业绩报酬计算方法

$R \leq r_i$ ，管理人业绩报酬=0；

$r_i < R$ ，管理人提取超额部分的60%作为管理人业绩报酬，余下40%归份额持有委托人享有。

其中，R为委托人每笔份额持有期年化收益率； r_i 以管理人公告为准。业绩报酬计提基准变更频率不得超过每6个月一次。业绩报酬计提基准测算依据和测算过程等信息将在管理人网站公告中明确。

业绩报酬计提基准仅供委托人参考，不构成管理人对委托人保本保收益承诺。

$$R = \frac{(P_1 - P_0)}{P_0} \times \frac{365}{D} \times 100\%$$

P_1 为本次业绩报酬计提日的计划单位累计净值；

P_0 为上一个业绩报酬计提日（本次业绩报酬计提起始日）的计划单位累计净值；

P_0^* 为上一个业绩报酬计提日的计划单位净值；

D 表示上一个业绩报酬计提日（含）到本次业绩报酬计提日（不含）的实际天数，其中上一个业绩报酬计提日不存在的，对募集期参与的份额而言，其上一个业绩报酬计提日为成立日；对于存续期参与的份额而言，其上一个业绩报酬计提日为其参与申请日。若按以上业绩报酬计提原则，管理人于某个业绩报酬计提日未实际计提业绩报酬（即该日业绩报酬为0），则该日仍然算作下次业绩报酬计提起始日。

管理人业绩报酬计提如下：

持有期年化收益率 (R)	计提比例	业绩报酬 (Y) 的计提公式
$R \leq r_i$	0	$Y=0$
$R > r_i$	60%	$Y=A \times (R-r_i) \times 60\% \times D \div 365$

Y = 业绩报酬；

A = 每笔份额在上一个业绩报酬计提日的资产净值 = 每笔份额 * 上一个业绩报酬计提日的计划单位净值。

2、业绩报酬计提

(1) 按委托人每笔参与份额分别计算期间年化收益率并计提业绩报酬。

(2) 业绩报酬计提日为本集合计划收益分配日（以管理人的分红公告为准）、委托人退出日或计划终止日。

(3) 在委托人退出或本集合计划终止时提取业绩报酬的，业绩报酬从退出资金或清算资金中扣除。在本集合计划收益分配日提取业绩报酬的，业绩报酬从分红款中扣除。

(4) 在委托人退出或计划终止时，业绩报酬按委托人退出份额或计划终止时持有份额计算。如退出份额为一笔参与份额的一部分，则将该退出份额单独核算业绩报酬，而该笔参与的剩余部分不受影响。

(5) 管理人业绩报酬提取频率不得超过每6个月一次。但因投资者退出集合计划提取业绩报酬的，不受前述提取频率的限制。

3、业绩报酬支付

业绩报酬由管理人计算，支付业绩报酬时由管理人向托管人发送业绩报酬划付指令，托管人于5个工作日内将业绩报酬划拨给管理人。托管人对业绩报酬金额不承担复核义务和责任

(四) 认购费

认购/申购费：0。

(五) 退出费

(1) 退出费用

持有期 (P)	P < 90 天	P ≥ 90 天
退出费率	0.5%/笔	0

(2) 退出金额的计算

退出金额 = [申请退出份额 × 申请退出日集合计划单位净值 - 业绩报酬 (如有)] × (1 - 退出费率 (如有))

退出金额的计算结果保留到小数点后两位，小数点后第三位四舍五入，由此产生的差额部分计入集合计划资产损益。

退出申请日 (T 日) 的每份额净值在当日收市后计算，并在 T+1 日通告。遇不可抗力，可适当延迟计算或通告。

九、产品收益分配情况

本报告期内进行收益分配，金额为 700000 元，提取业绩报酬金额 10525.44 元。

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、管理人工跟投情况

截至2021年12月31日，本集合计划有1名员工参与，持有份额为312,916.22份，管理人会对本集合计划账户进行监控。

十二、信息披露的查询方式

公司网址：www.tpyzq.com

太平洋证券股份有限公司

2022年1月25日

