

太平洋证券藏金阁 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 01 日-2021 年 12 月 31 日)



管理人：太平洋证券股份有限公司
托管人：南京银行股份有限公司



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	太平洋证券藏金阁 FOF1 号集合资产管理计划
产品类型	混合类
成立日期	2020 年 4 月 10 日
报告期末份额总额	180,291,036.46 份
存续期限	10 年
产品风险等级	R4 中高风险
适合推广对象	风险承受能力评级为 C4 积极型、C5 激进型的普通合格投资者和专业投资者

三、管理人履职报告

（一）投资经理简介

张健，经济学学士，2010 年开始从事证券行业，现任职于太平洋证券股份有限公司资产管理部，任投资经理。

王勇，工学博士，曾在私募、信托等金融机构从事权益类投资工作，2016 年 6 月加入太平洋证券资产管理总部，现任投资经理。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

产品主要投资头部量化私募基金的中证 500 指数增强产品，通过对于市场的走势判断择机用股指期货进行对冲，构建成市场中性加多头的绝对收益策略，同时少量头寸分散投资于转债及高收益债增强组合收益。

报告期内管理人对多家量化私募进行了初步尽调，已投资于因诺、幻方、天算、赫富、启林、龙旗等管理人的私募产品，同时综合各种市场情绪及指标维持一定比例的裸多头寸。

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 1.2643 元，累计单位净值为 1.2643 元，本报告期份额净值增长率为-1.35%。

（二）主要财务指标

日期：2021-10-01~2021-12-31

单位：元

本报告期利润	-2,901,334.02
本报告期末资产净值	227,939,601.23
本报告期末份额净值	1.2643
本报告期末累计份额净值	1.2643
本报告期份额净值增长率	-1.35%

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、若本报告期有多次分红，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

若本报告期只有 1 次分红，本报告期份额净值增长率=(分红前一天份额净值÷本期期初份额净值)×[本期期末份额净值÷(分红前一天份额净值-本期单位份额分红金额)]-1

若本报告期末未分红，本报告期份额净值增长率=本期期末份额净值÷本期期初份额净值-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	负债和所有者权益	期末余额	年初余额
资 产：			负 债：		
银行存款	444,229.08	477,418.80	短期借款	0.00	0.00
结算备付金	4,862,720.00	7,115,700.57	交易性金融负	0.00	0.00
存出保证金	7,251,280.96	68,053.54	债		
交易性金融资产	86,698,575.01	23,510,692.08	衍生金融负债	0.00	0.00
其中：股票投资	1,624,614.47	3,078,319.00	卖出回购金融	0.00	0.00
债券投资	17,423,586.60	7,447,773.00	资产款		
基金投资	67,650,373.94	12,984,600.08	应付证券清算	0.00	0.00
权证投资	0.00	0.00	款		
			应付赎回款	0.00	0.00
			应付管理人报	334,726.64	118,711.58
			酬		
			应付托管费	11,157.54	3,957.05

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	3,282.40	2,994.30
买入返售金融资 产	0.00	0.00	应交税费	10,670.40	28,368.36
应收证券清算款	0.00	0.00	应付利息	0.00	0.00
应收利息	646,809.21	254,262.89	应付利润	0.00	0.00
应收股利	42,461.68	794.86	其他负债	20,000.00	20,000.00
应收申购款	0.00	39,603.96	负债合计	379,836.98	174,031.29
贷款	0.00	0.00			
代理业务资产	0	0	所有者权益:		
融资租赁资产	0.00	0.00	实收基金	180,291,036.46	84,397,447.53
可供出售金融资产	0.00	0.00	资本公积	0.00	0.00
持有至到期投资	0.00	0.00	未分配利润	47,648,564.77	12,190,355.74
长期股权投资	0.00	0.00	所有者权益合 计	227,939,601.23	96,587,803.27
长期应收款	0	0			
其他资产	128,373,362.27	65,295,307.86			
资产总计	228,319,438.21	96,761,834.56	负债和所有 者权益总计	228,319,438.21	96,761,834.56

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	-523,780.05	17,346,253.26
2	1、利息收入	254,141.64	704,358.21
3	其中：存款利息收入	7,206.38	28,442.16
4	债券利息收入	248,044.24	673,693.01
5	资产支持证券利息收入	4,864.13	17,345.01
6	买入返售证券收入	0.00	1,288.87
7	增值税贷款服务抵减	-5,973.11	-16,410.84
8	2、投资收益	3,584,471.15	-10,334,012.18
9	其中：股票投资收益	10,846.25	-320,692.47
10	债券投资收益	524,000.00	1,619,955.15
11	基金投资收益	-3,176.29	170,613.62
12	权证投资收益	0.00	0.00
13	资产支持证券投资收益	110,600.00	160,600.00
14	衍生工具收益	2,710,824.11	-12,329,468.00
15	股利收益	231,377.08	395,452.96
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	-30,473.44
18	3、公允价值变动收益	-14,711,444.54	6,872,445.23

19	4、其他收入	10,349,051.70	20,103,462.00
20	二、费用	2,377,553.97	5,231,198.29
21	1、管理人报酬	334,726.64	968,296.15
22	2、托管费	11,157.54	32,276.55
23	3、销售服务费	0.00	0.00
24	4、交易费用	2,016,610.68	4,184,600.83
25	5、利息支出	0.00	1,769.04
26	其中：卖出回购金融资产支出	0.00	1,769.04
27	6、其他费用	14,342.33	41,300.00
28	7、增值税金及附加税	716.78	2,955.72
29	三、利润总和	-2,901,334.02	12,115,054.97

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	未分配利润	所有者权益
1	一、期初所有者权益（基金净值）	169,942,397.37	47,861,007.50	217,803,404.87	121,017,863.27	30,525,463.30	151,543,326.57
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	-2,901,334.02	-2,901,334.02	0.00	4,175,402.00	4,175,402.00
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）	10,348,639.09	2,688,891.29	13,037,530.38	48,924,534.10	13,160,142.20	62,084,676.30
4	其中：1.基金申购款	16,541,370.09	4,365,263.56	20,906,633.65	68,709,591.92	18,197,417.93	86,907,009.85
5	2.基金赎回款	-6,192,731.00	-1,676,372.27	-7,869,103.27	-19,785,057.82	-5,037,275.73	-24,822,333.55
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）	180,291,036.46	47,648,564.77	227,939,601.23	169,942,397.37	47,861,007.50	217,803,404.87

（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

本报告期末集合计划投资组合情况：

	金额（元）	占总资产比例
股票	1,624,614.47	0.71%
基金	67,650,373.94	29.63%
债券	17,423,586.60	7.63%
理财产品投资	128,373,362.27	56.23%
现金	5,306,949.08	2.32%
其他资产	7,940,551.85	3.48%
资产合计	228,319,438.21	100.00%

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）前五名证券投资明细

序号	证券代码	证券名称	数量（股/张/份）	期末市值（元）	占净值比例（%）
1	SGT978	启林正兴东绣 3 号私募证券投资基金	26,298,551.75	32,291,991.69	14.17
2	XT012	因诺天丰 17 号私募证券投资基金	16,046,557.63	27,036,844.95	11.86
3	SGX346	因诺聚配中证 500 指数增强私募证券投资基金	9,845,855.81	21,355,661.25	9.37
4	003267	新华壹诺宝货币 B	18,000,000.00	18,000,000.00	7.9
5	SLQ914	赫富 500 指数增强八号私募证券投资基金	13,657,909.54	17,827,669.32	7.82
		合计	83,848,874.73	116,512,167.21	52.12

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	169,942,397.37
报告期内集合计划总申购份额	16,541,370.09
报告期内集合计划总赎回份额	6,192,731.00
报告期末集合计划份额总额	180,291,036.46

（四）参与股指期货的有关情况如下：

本报告期内本集合计划参与股指期货的投资损益为 2,710,824.11 元。

截至本报告期末，本集合计划持有 34 手卖出股指期货 IC2201 合约，市值 49,656,040.00 元。

本集合计划投资股指期货的目的为对冲部分市场风险和替代部分股票持仓，没有显著影响本集合计划的风险敞口，符合既定的投资目的。

七、产品运用杠杆情况

截至本报告期末，本集合计划的卖出回购金融资产款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：本集合计划自成立之日起计提托管费。每日应计提的托管费以本集合计划前一日资产净值为基数并按【0.02%】的年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times F \div 365 \text{ (首日按集合计划初始资金金额)}$$

H 为每日应计提的托管费；

E 为前一日计划资产净值(首日按本集合计划初始资金金额)；

F 为本集合计划托管费年费率。

本集合计划的托管费按本集合计划前一日资产净值计算，按日计提，按季支付。由托管人根据与管理人的指令，在每季初的前5个工作日内从本集合计划财产中一次性支付。若因战争、自然灾害等不可抗力或法定节假日致使无法按时支付的，则在不可抗力情形消除后或法定节假日终止后的首个工作日即可支付日支付。本合同终止（包括提前或延期）后，依据清算程序支付托管人尚未支付的托管费。

(二) 管理费：(1) 本集合计划自成立之日起计提管理费。每日应计提的管理费以本集合计划前一日资产净值为基数并按【0.6%】的年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times F \div 365 \text{ (首日按集合计划初始资金金额)}$$

H 为管理人当日计提的管理费；

E 为前一日计划资产净值(首日按本集合计划初始资金金额);

F 为本集合计划管理费年费率。

按本集合计划前一日资产净值计算,按日计提,按季支付。由托管人根据与管理人的指令,在每季初的前5个工作日内从本集合计划财产中一次性支付。若因战争、自然灾害等不可抗力或法定节假日致使无法按时支付的,则在不可抗力情形消除后或节假日终止后的首个工作日支付。本合同终止后,依据清算程序支付管理人尚未支付的管理费。

各方一致同意,管理人有权以管理人网站公告方式下调本集合计划管理费,无需履行合同变更程序,管理人应在管理费率下调前1个工作日在管理人网站进行公告。

九、产品收益分配情况

本报告期内未进行收益分配。

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、管理员工跟投情况

截止至本报告期末管理员工参与本集合资产管理计划的份额为 2,915,944.69 份,管理人将会对该等账户进行监控。

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 28 日

