

太平洋证券均盈优选 FOF1 号集合资产管理计划
2021 年第 3 季度管理报告
(报告期: 2021 年 7 月 1 日-2021 年 9 月 30 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

投资经理一：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。

投资经理二：孙梦祎；

1、从业简历：先后任职于财通证券股份有限公司资产管理部投资经理助理；东证融汇证券资产管理公司高级经理，从事研究投资工作；大同证券有限责任公司资产管理部产业投资经理；现任太平洋证券股份有限公司资产管理部投资经理。

2、学历及兼职情况：金融学会计学双学士，经济学硕士，无兼职情况。

3、业务经验情况：5 年证券公司资产管理从业经历。

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、2021 年第 3 季度市场回顾

纵观 A 股市场季度的整体表现，走势表现分化严重。主要体现在以新能源为龙头代表“宁组合”先涨后跌，整体持平；以消费医药为代表的“茅指数”大幅下跌；以煤炭、钢铁、化工、有色为代表的传统周期板块则大幅上涨。统计主要指数上证 50 指数、中证 500 指数、创业板指数三季度收益分别为-10.1%、8.4%、-7.75%，分化明显。影响市场剧烈分化的原因总结如下：

第一个是市场基本面方向（1）经济增长方面，外需依然强劲，但内需开始回落，各项经济数据持续低于预期；（2）产业方面，地产降温导致部分企业陷入流动性困境，但新能源和低碳经济方兴未艾；第二个方面是市场流动性依然充裕，资金价格保持低位，社会财富积极寻找房地产之外的配置资产，导致股市成交在三季度多数时候处于极端火热状态，市场在万亿成交以上维持的天数已经达到 46 天，超过 2015 年上半年的水平。

2、4 季度市场展望及投资思路

展望四季度，仍然较为乐观，指数也具有一定的上行空间。主要基于以下：一，整体流动性仍有望保持宽松；二，A 股整体的估值处于相对中位数。对于后市行业的看法观点如下：

一，“碳中和”背景下资源品价格的上涨。碳中和的中长期目标，叠加疫情对供应链的冲击，使得有效的利用资源变得格外重要。换句话说，碳中和从总量上限制了资源供给量，并使中游制造业面临一定的成本上升压力，这个过程对于行业格局和周期波动会带来一定影响，具备吸收、转化成本压力的高能效公司将胜出。

二，消费、医药等长周期回报相对稳定可观的板块。在这些领域，今年的政策变化比较多，相关公司股价调整也非常剧烈。我们认为市场对其利空的反应比较充分，一旦相关公司盈利底和政策底得以确认，则是非常好的中长期布局时点。

三，科技类板块。对于此，整体肯定是看好，关键是选择细分领域。目前我们主要关注两个方向：半导体产业的突破、汽车智能化。这些方向要么是补足我们技术上的短板，要么是带来广阔的增量需求的高景气领域。对于这些板块，我们会更加注重产业成长的逻辑，对于优质公司可以接受更高的估值容忍度。

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 3 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 9 月 30 日，本产品的份额净值为 1.6102 元，份额累计净值为 1.8857 元，本报告期份额净值增长率为-0.95%。

（二）主要财务指标

日期：2021-07-01~2021-09-30

单位：元

集合计划本期利润	-940,574.74
期末集合计划资产净值	76,003,338.67
本报告期末份额净值	1.6102
本报告期末累计份额净值	1.8857
本报告期份额净值增长率	-0.95%

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：2021-9-30

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	5,616,501.44	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	71,043,504.89	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	71,043,504.89	40,070,699.21	应付管理人报酬	629,968.26	195,303.47
权证投资	0.00	0.00	应付托管费	12,364.08	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	227.49	246.36	应付利润	0.00	0.00
应收股利	394.86	0.00	其他负债	14,957.67	20,000.00
应收申购款	0.00	0.00	负债合计	657,290.01	219,969.29
其他资产	0.00	0.00			
			所有者权益：		
			实收基金	47,200,074.77	29,104,549.86
			未分配利润	28,803,263.90	11,668,461.27
			所有者权益合计	76,003,338.67	40,773,011.13

资产合计	76,660,628.68	40,992,980.42	负债和所有者权益总计	76,660,628.68	40,992,980.42
------	---------------	---------------	------------	---------------	---------------

2、经营业绩表

日期：2021 年 7 月~2021 年 9 月

单位：元

序号	项目	本期数	本年累计数
1	一、收入	-243,377.60	7,926,742.30
2	1、利息收入	940.02	10,894.39
3	其中：存款利息收入	940.02	10,894.39
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	18,789,414.50	21,126,321.70
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	18,789,019.64	21,122,604.77
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	394.86	3,716.93
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	-19,033,732.12	-13,210,473.79
19	4、其他收入	0.00	0.00
20	二、费用	697,197.14	1,405,090.87
21	1、管理人报酬	206,713.86	486,084.67
22	2、托管费	12,364.08	26,332.61

23	3、销售服务费	0.00	0.00
24	4、交易费用	473,078.52	881,715.92
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	5,040.68	10,957.67
28	7、增值税金及附加税	0.00	0.00
29	三、利润总和	-940,574.74	6,521,651.43

3、所有者权益变动表

日期：2021 年 7 月~2021 年 9 月

单位：元

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
一、期初所有者权益 (基金净值)	41,834,681.73	26,176,097.97	68,010,779.70	36,563,669.72	13,990,396.24	50,554,065.96
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期净利润)	0.00	-940,574.74	-940,574.74	0.00	9,607,362.24	9,607,362.24
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)	5,365,393.04	3,567,740.67	8,933,133.71	5,271,012.01	2,578,339.49	7,849,351.50
其中：1.基金申购款	12,742,382.99	9,371,708.42	22,114,091.41	8,713,599.84	4,437,442.92	13,151,042.76
2.基金赎回款	-7,376,989.95	-5,803,967.75	-13,180,957.70	-3,442,587.83	-1,859,103.43	-5,301,691.26

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
五、期末所有者权益（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

（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

本集合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
银行存款和清算备付金合计	5,616,501.44	7.33%
理财产品	-	-
基金投资	71,043,504.89	92.67%
其他资产	622.35	
合计	76,660,628.68	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）本报告期内份额变动情况如下：

期初集合计划份额总额	41,834,681.73
------------	---------------

报告期内集合计划总申购份额	12,742,382.99
报告期内集合计划总赎回份额	7,376,989.95
报告期末集合计划份额总额	47,200,074.77

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【20%】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，因客户退出提取业绩报酬 155,927.57 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无投资经理变更情形。

(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 9 月 30 日，太平洋证券均盈优选 FOF1 号产品共有八名太平洋证券股份有限公司员工跟投，跟投份额余额共计 4,291,918.23 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

太平洋证券股份有限公司
2021 年 9 月 30 日

