

太平洋证券金元宝7号集合资产管理计划

2021年第3季度管理报告

(报告期: 2021年07月01日-2021年09月30日)



管理人: 太平洋证券股份有限公司
托管人: 兴业银行股份有限公司

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	太平洋证券金元宝7号集合资产管理计划
产品类型	固定收益型
成立日期	2018年09月13日
报告期末份额总额	121,517,726.62份
存续期限	10年
产品风险等级	R3 中风险
适合推广对象	适合风险承受能力评级为C3 稳健型、C4 积极型、C5 激进型的合格投资者。

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。

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规定以及本集合计划合同的约定，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

7 月末至 8 月在散点状疫情的反复影响下，国内供需双弱，耐用品消费乏力，社会消费难有显著的改善，消费、价格等明显偏弱，相关隐形疫情管控措施仍在继续，因此，对于 Q4 而言，10 月长假消费不及之前的预期，融资-信贷已经持续回落。

目前能耗双控政策高压依旧存在，电力不足问题暂未得到解决，多省区维持有序限电限产的政策，将继续给企业生产经营带来干扰，工业生产下行压力加大。随着专项债发行节奏加快，有望支撑基建投资阶段性回升，地产投资在严调控下或将平稳回落，制造业投资将延续缓慢修复的势头，整体上看固定资产投资有望保持平稳运行。

随着今年四季度和明年我国经济下行压力持续加大，预计货币政策大概率维持边际宽松，但通胀仍处于高位，短期内货币大幅宽松的可能性不大，宽松时点或有所后移。

在企业盈利回落、通胀维持高位和海外流动性收紧几成定局、国内降息或延后的宏观环境下，预计四季度大类资产配置的关键在于“适当控制风险，挖掘 A 股结构性机会为主”。债市需警惕短期回调风险，但中长期配置价值凸显；对 A 股不必太过消极，性价比逐步凸显，碳中和、新基建、周期等板块跑赢概率可能较大；大宗商品涨价基本确认步入尾声阶段，但要小心出现剧烈波动。

具体到产品配置上，债券仓位基本上以 AAA 地产和 AA 城投为主，加权久期尽量控制在一年左右，产品整体流动性尚可，权益类方面考虑到产品净值的稳定主要配置了类套利指数基金和部分可转债，股票仓位和收益贡献相对较低。

四、托管人履职情况

本托管人依据太平洋证券金元宝 7 号集合资产管理计划的合同与托管协议，自 2021 年 4 月 30 日起托管“太平洋证券金元宝 7 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。

本计划自 2021 年 4 月 30 日起由兴业银行股份有限公司托管，本托管人认真复核了《太平洋证券金元宝 7 号集合资产管理计划 2021 年第 3 季度管理报告》中的部分财务数据，包括期末单位净值、期末资产净值、本期净值增长率、财务报表本期数、投资组合报告及产品运用杠杆情况，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、产品投资表现和财务会计报告

（一）净值表现

截至 2021 年 09 月 30 日，本产品的单位净值为 1.1272 元，累计单位净值为 1.2151 元，本报告期份额净值增长率为 2.87%。

（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	3,334,770.33
期末集合计划资产净值	136,969,028.82
本报告期末份额净值	1.1272

本报告期累计份额净值	1.2152
本报告期份额净值增长率	2.87%

财务指标的计算公式：

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

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

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：2021-09-30

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	1,123,141.19	60,442.76	短期借款	0.00	0.00
结算备付金	1,502,725.71	763,727.50	交易性金融负债	0.00	0.00
存出保证金	4,575.44	32,803.73	衍生金融负债	0.00	0.00
交易性金融资产	145,023,426.85	128,523,513.00	卖出回购金融资产款	13,199,868.00	39,239,607.60
其中：股票投资	1,030,385.31	615,000.00	应付证券清算款	807,364.38	1,461,928.33
债券投资	138,206,881.54	127,831,438.44	应付赎回款	0.00	0.00
基金投资	0.00	77,074.56	应付管理人报酬	342,367.75	184,084.49
权证投资	0.00	0.00	应付托管费	8,653.61	11,505.33
资产支持证券投资	5,786,160.00	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	7,825.77	4,583.68
买入返售金融资产	0.00	0.00	应交税费	165,705.45	97,600.22
应收证券清算款	5,883.58	1,499,766.58	应付利息	-796.21	2,725.73
应收利息	3,855,222.47	4,188,728.11	应付利润	0.00	0.00
应收股利	0.00	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	14,545,946.42	41,022,035.38
其他资产	0.00	0.00			

			所有者权益:		
			实收基金	121,517,726.62	88,831,498.95
			未分配利润	15,451,302.20	5,215,447.35
			所有者权益合计	136,969,028.82	94,046,946.30
资产合计	151,514,975.24	135,068,981.68	负债和所有者权益总计	151,514,975.24	135,068,981.68

2、经营业绩表

日期: 2021年07月~2021年09月

单位: 元

序号	项目	本期数	本年累计数
1	一、收入	3,680,121.43	6,859,262.78
2	1、利息收入	1,555,084.35	3,845,028.04
3	其中: 存款利息收入	5,875.97	18,004.51
4	债券利息收入	1,550,143.94	3,894,512.52
5	资产支持证券利息收入	43,370.76	43,370.76
6	买入返售证券收入	0.00	383.73
7	增值税贷款服务抵减	-44,306.32	-111,243.48
8	2、投资收益	547,017.37	1,513,050.46
9	其中: 股票投资收益	135,085.45	-15,611.55
10	债券投资收益	381,296.25	1,435,931.48
11	基金投资收益	0.00	87,928.71
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	32,309.58	32,309.58
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	-1,673.91	-27,507.76
18	3、公允价值变动收益	1,553,790.64	1,476,955.21
19	4、其他收入	24,229.07	24,229.07
20	二、费用	345,351.10	927,799.97
21	1、管理人报酬	230,764.37	556,733.83
22	2、托管费	8,653.61	28,074.77
23	3、销售服务费	0.00	0.00
24	4、交易费用	14,533.60	35,066.95
25	5、利息支出	65,726.47	246,858.47

26	其中：卖出回购金融资产支出	65,726.47	246,858.47
27	6、其他费用	14,890.37	39,427.36
28	7、增值税金及附加税	10,782.68	21,638.59
29	三、利润总和	3,334,770.33	5,931,462.81

3、所有者权益变动表

日期：2021年07月~2021年09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）	71,917,535.20	6,891,508.87	78,809,044.07	88,831,498.95	6,097,666.90	94,929,165.85
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	3,334,770.33	3,334,770.33	0.00	1,714,472.93	1,714,472.93
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）	49,600,191.42	5,225,023.00	54,825,214.42	-16,913,963.75	-920,630.96	-17,834,594.71
4	其中：1.基金申购款	73,284,053.23	7,985,946.77	81,270,000.00	16,792,758.68	1,527,241.32	18,320,000.00
5	2.基金赎回款	-23,683,861.81	-2,760,923.77	-26,444,785.58	-33,706,722.43	-2,447,872.28	-36,154,594.71
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）	121,517,726.62	15,451,302.20	136,969,028.82	71,917,535.20	6,891,508.87	78,809,044.07

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）	2,625,866.90	1.73%
股票投资	1,030,385.31	0.68%
债券投资	138,206,881.54	91.22%
资产支持证券	5,786,160.00	3.82%
其他资产	3,865,681.49	2.55%
合计	151,514,975.24	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	101800081	18 海国鑫泰 MTN001	80,000.00	7,727,200.00	5.64
2	101900290	19 海国鑫泰 MTN001	70,000.00	6,883,800.00	5.03
3	163373	20 华融 G1	72,630.00	6,830,851.50	4.99
4	149053	20 和佳 S1	60,000.00	5,979,420.00	4.37
5	178625	21 商古 01	50,000.00	5,013,000.00	3.66
	合计			32,434,271.50	23.68

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	71,917,535.20
报告期内集合计划总申购份额	73,284,053.23
报告期内集合计划总赎回份额	23,683,861.81
报告期末集合计划份额总额	121,517,726.62

(四) 参与股指期货的有关情况：

本报告期内，本集合计划未参与股指期货。

七、产品运用杠杆情况

截至本报告期末，本集合计划的融资金额占本集合计划资产净值的比例为9.64%。

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。本计划的托管费按前一日的计划资产净值0.05%的年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 0.05\% \div 365$$

H 为每日应计提的托管费

E 为前一日计划资产净值。（首日按本计划初始资金金额）

本计划的托管费按前一日产品资产净值计算，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个工作日内从集合计划资产中一次性支付。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：

本集合计划自成立之日起计提管理费。本计划的管理费按前一日的计划资产净值 0.8% 的年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 0.8\% \div 365$$

H 为管理人当日计提的管理费

E 为前一日计划资产净值（首日按本计划初始资金金额）

按前一日计划资产净值计算，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个工作日内从集合计划资产中一次性支付。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。产品终止后，依据清算程序支付管理人尚未支付的管理费。

（三）业绩报酬

业绩报酬计提日为收益分配日（但如当次收益分配日与下一次收益分配日间隔时间少于6个月的，则下一次收益分配日不提取业绩报酬，可顺延至再下一次的收益分配日提取；下同）、委托人退出日或本计划终止日（含提前终止）。管理人在符合业绩报酬计提条件时，于业绩报酬计提日提取业绩报酬。

（1）管理人收取业绩报酬的原则

a、按照委托人每笔参与份额分别计算持有期收益率，在符合业绩报酬计提的条件下计提业绩报酬。

b、集合计划收益分配日提取业绩报酬的，业绩报酬从分红资金中扣除。在每笔份额退出日和集合计划终止时提取业绩报酬的，业绩报酬从退出资金中扣除。

c、业绩报酬的提取频率不得超过每6个月一次，但因委托人退出本计划的，管理人按本合同提取业绩报酬的，不受前述提取频率的限制。

(2) 业绩报酬的计提方法

业绩报酬的提取条件和提取比例如下：

若业绩报酬计提日，委托人获得超额收益，则管理人有权以该笔超额收益为基准提取一定比例（X%）作为业绩报酬，其中超额收益为每笔份额持有期收益率高于其基准收益（即按照业绩报酬计提基准计算的收益）的部分。计算方式如下：

在业绩报酬提取日，如果超额收益 ≥ 0 ，则：每笔份额应提取的业绩报酬=该笔份额超额收益*X%

每笔份额超额收益=该笔份额持有期收益-该笔份额基准收益

该笔份额持有期收益=(本次业绩报酬计提日的累计单位净值-上一次业绩报酬计提日的累计单位净值)*该笔份额数

该笔份额的基准收益=业绩报酬计提基准/365*实际运作天数*该笔份额数；

实际运作天数：每笔份额上一业绩报酬计提日（含）到本次业绩报酬计提日（不含）的自然天数；如果不存在上一业绩报酬计提日，对于募集期参与的份额而言其上一个业绩报酬计提日为本集合计划成立日，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。不论上一业绩报酬计提日是否实际提取到业绩报酬，均作为下次业绩报酬计提的起始日。

管理人有权在本集合计划封闭期结束后、下一个开放日前，公布本集合计划的业绩报酬计提基准（K）以及业绩报酬计提比例（X%），具体标准及生效时间以管理人网站公布为准，但业绩报酬计提比例（X%）不得超过 60%。

管理人通过深入分析国内外宏观经济走势、社会资金运动及各项宏观经济政策对金融市场特别是货币市场的影响，密切关注市场资金面松紧变化，把握市场利率走势，合理确定集合计划的规模、投资标的以及业绩报酬计提基准的范围。管理人确定业绩报酬计提基准主要基于集合计划投资的债券回购、债券、货币市场基金等的收益情况估算，但并不是管理人向委托人保证其资产本金不受损失或者保证取得最低收益的承诺，投资风险为委托人自行承担。

(3) 业绩报酬支付

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。若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。当集合计划收益分配日、份额退出日或集合计划终止时，托管人根据管理人的指令将退出净值总额（含业绩报酬和退出费用（如有）或分红金额（含业绩报酬）划拨给注册登记机构，由注册登记机构将业绩报酬和退出费用（如

有)支付给管理人,并将扣除业绩报酬和退出费用(如有)的退出款项转入推广机构在注册登记机构的资金账户。托管人对业绩报酬的计算不承担复核义务和责任。

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

截至本报告期末,管理人有3名员工参与本集合计划,总份额合计为1,159,678.86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

2021年10月22日

10

