

# 太平洋证券金添利 1 号集合资产管理计划

## 2022 年第 3 季度管理报告

(报告期: 2022-07-01~2022-09-30)



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 稳健型、C4 积极型、C5 激进型以及专业投资者

## 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,无兼职情况。
- 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

### 2022年三季度市场回顾

三季度货币宽松，资金利率中枢下行，银行间市场隔夜（R001）和7天质押式回购利率（R007）的均值分别较二季度下行22BPs、23BPs至1.29%、1.62%，银行间质押式回购日均交易量超过6.2万亿元，隔夜质押回购成交量占比超87%。临近季末，因8-9月MLF缩量续作，净回笼中期资金2000亿元叠加跨季影响，9月资金面利率中枢有所反弹，但仍处于历史地位。三季度利率债收益率大幅下行，其中中端下行幅度较大，收益率整体先抑后扬，季初由于疫情反弹及地产断贷影响，市场对经济担忧升温，8月中人民银行降息带动LPR及存款利率下调，市场对货币宽松预期增强。季末由于前期稳增长政策发力，经济及金融数据好于预期，市场宽信用预期升温，同时受到美联储加息影响，中美利差倒挂程度加深，MLF缩量续作，季末货币政策实施谨慎，国内债市承压，收益率反弹。截止三季度末，10年期国债、10年期国开债、3年AAA、3年AA+、3年AA和3年AA-分别下行6BP、12BP、28BP、29BP、29BP和28BP。信用债方面，总体走势和国债类似，收益率下行略多于国债，信用利差进一步走低。

### 2022年四季度市场展望

近期市场受到内外部货币政策不对称、汇率承压以及经济数据回暖影响，货币政策宽松的预期有所降温。9月社融数据表现较好，结构也有所改善，尤其委贷在地产未放松的前提下依旧维持两个月的增长，经济小幅回暖较为明显。随着

前期地产政策频出,预计四季度地产销售将有所回暖,对债市形成压制。四季度,债市下行动力不足,将面临继续窄幅调整的压力。产品配置更多关注于在利率波段中寻找息票反弹的2-3年期高评级资产。

#### 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资产管理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10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2022年09月30日,本产品的单位净值为1.0603元,累计单位净值为1.2843元,本报告期份额净值增长率为1.93%。

##### (二) 主要财务指标

日期:2022-07-01~2022-09-30

单位:元

本报告期利润	3,074,207.73
本报告期末资产净值	176,035,259.43
本报告期末份额净值	1.0603
本报告期末累计份额净值	1.2843
本报告期份额净值增长率	1.93%

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：2022-09-30

单位：元

资产	期末余额	上年年末 余额	负债和所有者权 益	期末余额	上年年末 余额
<b>资 产：</b>			<b>负 债：</b>		
银行存款	21,826.76	84,521.97	短期借款	0.00	0.00
结算备付金	524,185.69	274,625.42	交易性金融负 债	0.00	0.00
存出保证金	4,824.11	1,049.55	衍生金融负债	0.00	0.00
衍生金融资 产	0.00	0.00	卖出回购金融 资产款	4,900,361.55	11,999,880.00
交易性金融 资产	181,048,595.52	79,465,184.60	应付清算款	0.00	0.00
买入返售金 融资产	0.00	0.00	应付赎回款	0.00	0.00
发放贷款和 垫款			应付管理人报 酬	233,162.03	91,020.42
债权投资	0.00	0.00	应付托管费	13,989.77	5,461.24
其他债权投 资			应付销售服务 费	0.00	0.00
应收清算款	0.00	0.00	应付投资顾问 费	0.00	0.00
应收利息	0.00	2,034,079.27	应交税费	397,210.30	176,446.25
应收股利	0.00	0.00	应付利息	0.00	1,815.79
应收申购款	0.00	0.00	应付利润	0.00	0.00
其他资产	0.00	0.00	其他负债	19,449.00	22,557.75
			<b>负债合计</b>	<b>5,564,172.65</b>	<b>12,297,181.45</b>
			所有者权益		
			实收资金	166,018,884.79	68,629,940.07
			其他综合收益		
			未分配利润	10,016,374.64	932,339.29
			<b>所有者权益合计</b>	<b>176,035,259.43</b>	<b>69,562,279.36</b>
<b>资产总计</b>	<b>181,599,432.08</b>	<b>81,859,460.81</b>	<b>负债和所有者权益 总计</b>	<b>181,599,432.08</b>	<b>81,859,460.81</b>

**2、经营业绩表**

日期：2022-07-01~2022-09-30

单位：元

序号	项目	本期金额	上期金额
1	一、收入	3,919,279.65	3,810,379.90
2	1. 利息收入	29,429.33	113,879.80
3	2. 投资收益（损失以“-”填列）	3,514,440.61	2,420,309.44
4	其中：以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益	0.00	0.00
5	3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	375,409.71	1,276,190.66
6	4. 汇兑损益（损失以“-”号填列）	0.00	0.00
7	5. 其他业务收入	0.00	0.00
8	二、费用	845,071.92	259,357.24
9	1. 管理人报酬	759,353.24	211,917.24
10	2. 托管费	13,989.77	12,715.04
11	3. 销售服务费	0.00	0.00
12	4. 投资顾问费	0.00	0.00
13	5. 利息支出	43,881.97	10,800.39
14	其中：卖出回购金融资产利息支出	43,881.97	10,800.39
15	6. 信用减值损失	0.00	0.00
16	7. 税金及附加	13,217.26	13,127.99
17	8. 其他费用	14,629.68	10,796.58
18	三、利润总额	3,074,207.73	3,551,022.66
19	减：所得税费用	—	—
20	四、净利润	3,074,207.73	3,551,022.66
21	五、其他综合收益		
22	六、综合收益总额	3,074,207.73	3,551,022.66

## 3、所有者权益变动表

日期：2022-07-01~2022-09-30

单位：元

序号	项目	本期金额				上期金额			
		实收基金	综合收益	未分配利润	所有者权益合计	实收基金	综合收益	未分配利润	所有者权益合计
1	一、上期期末余额	180,616,872.		7,260,691.07	187,877,563.26	132,569,600.		2,454,930.	135,024,530.17

		19				03		14	
2	加：会计政策变更								
3	前期差错更正								
4	其他								
5	二、本期期初余额	180,616,872.19	7,260,691.07	187,877,563.26	132,569,600.03		2,454,930.14	135,024,530.17	
6	三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-14,597,987.40	2,755,683.57	-11,842,303.83	48,047,272.16		4,805,760.93	52,853,033.09	
7	（一）综合收益总额		3,074,207.73	3,074,207.73			3,551,022.66	3,551,022.66	
8	（二）产品持有人申购和赎回	-14,597,987.40	-318,524.16	-14,916,511.56	48,047,272.16		1,254,738.27	49,302,010.43	
9	其中：1、产品申购	34,729,565.48	1,858,434.52	36,588,000.00	54,239,483.29		1,449,173.71	55,688,657.00	
10	2、产品赎回	-49,327,552.88	-2,176,958.68	-51,504,511.56	-6,192,211.13		-194,435.44	-6,386,646.57	
11	（三）利润分配		0.00	0.00			0.00	0.00	
12	（四）其他综合收益结转留存收益								
13	四、本期期末余额	166,018,884.79	10,016,374.64	176,035,259.43	180,616,872.19		7,260,691.07	187,877,563.26	

**（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）	546,012.45	0.30%

债券投资	181,048,595.52	99.70%
其他资产（交易保证金、应收利息、 应收证券清算款、其他应收款、应收 申购款、买入返售证券等）	4,824.11	0.00%
合计	181,599,432.08	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	167086	20 中荆 01	110,000.00	11,119,900.00	6.32
2	197202	G21 延旅 1	110,000.00	11,090,200.00	6.30
3	194221	22 鹤壁 02	100,000.00	10,103,000.00	5.74
4	167859	20 濮阳 02	100,000.00	10,058,000.00	5.71
5	194805	22 贵溪 01	100,000.00	10,042,000.00	5.70
		合计	520,000.00	52,413,100.00	29.77

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	180,616,872.19
报告期内集合计划总申购份额	34,729,565.48
报告期内集合计划总赎回份额	49,327,552.88
报告期末集合计划份额总额	166,018,884.79

## 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 2.78%。

## 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

本报告期内未进行收益分配,提取业绩报酬金额 526191.21 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、管理人董事、监事、员工及配偶、利害关系人、控股股东、实际控制人或者其他关联方跟投情况

截至 2022 年 09 月 30 日，本集合计划员工及其配偶、利害关系人参与持有份额合计约 4635014.67 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](http://www.tpyzq.com)

太平洋证券股份有限公司

2022年10月27日

