

甬证资管季季盈 1 号集合资产管理计划 2022 年度报告

计划管理人：上海甬兴证券资产管理有限公司

计划托管人：上海浦东发展银行股份有限公司上海分行

报告期间：2022 年 1 月 1 日-2022 年 12 月 31 日

目录

重要提示.....	3
一、集合计划产品概况.....	4
(一) 基本资料.....	4
(二) 集合计划管理人.....	4
(三) 集合计划托管人.....	4
(四) 集合计划聘请的会计师事务所.....	4
二、集合计划费用.....	5
三、集合计划管理人履职报告.....	7
(一) 投资经理报告.....	7
(二) 合规风控报告.....	10
四、集合计划托管人履职报告.....	10
五、集合计划主要财务指标和投资表现.....	11
(一) 主要财务指标.....	11
(二) 投资表现.....	11
六、集合计划审计报告.....	12
七、集合计划财务报表.....	15
(一) 资产负债表.....	15
(二) 利润表.....	17
(三) 净资产变动表.....	18
(四) 财务报表附注.....	19
八、集合计划投资组合报告.....	23
(一) 资产组合情况.....	23
(二) 报告期末按市值占集合计划资产净值比例大小排序的前五名证券明细.....	23
(三) 投资组合报告附注.....	23
九、集合计划收益分配情况.....	24
十、集合计划份额变动情况.....	24
十一、集合计划运用杠杆情况.....	24
十二、重大事项提示.....	24
十三、备查文件目录.....	25

重要提示

本报告依据《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》、《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》及其他有关规定由管理人制作。

本报告不构成宣传推介材料、投资建议或保证，所载内容仅供本集合计划投资者参考。

本报告仅披露给本集合计划投资者。非经管理人事前书面同意，任何机构和个人不得传播、复制、删改本报告或引用本报告的全部或部分内容，否则将构成侵权。

托管人上海浦东发展银行股份有限公司上海分行对本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报表、投资组合报告等数据进行了复核。

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，也不保证最低收益。

管理人保证本报告书中所载资料的真实性、准确性和完整性，并对内容的真实性、准确性和完整性承担责任。

本报告经上会会计师事务所（特殊普通合伙）审计。本报告书中的内容由管理人负责解释。

一、集合计划产品概况

（一）基本资料

集合计划名称：甬证资管季季盈 1 号集合资产管理计划

产品编码：SSB611

集合计划成立日：2021 年 7 月 22 日

集合计划存续期：9 年

集合计划成立规模：265,412,122.50 元

集合计划报告期末净资产：409,214,307.75 元

（二）集合计划管理人

机构名称：上海甬兴证券资产管理有限公司

法定代表人：冯恂

通信地址：上海市浦东新区南泉北路 429 号泰康保险大厦 31F

邮政编码：200122

联系电话：021-20587225

（三）集合计划托管人

机构名称：上海浦东发展银行股份有限公司上海分行

法定代表人：汪素南

通信地址：上海市浦东新区浦东南路 588 号

邮政编码：200120

联系电话：021-61618469

（四）集合计划聘请的会计师事务所

机构名称：上会会计师事务所（特殊普通合伙）

法定代表人：张晓荣

通信地址：上海市静安区威海路 755 号 25 层

邮政编码：200020

联系电话：021-52920000

二、集合计划费用

内容要求（资产管理计划支付的管理费、托管费、业绩报酬（如有）等费用，包括计提基准、计提方式和支付方式）

（一）托管费

本资产管理计划的托管费按前一自然日集合计划资产净值的【0.02%】的年费率计提。托管费的计算公式如下：

$$H=E \times 【0.02\%】 \div 365$$

H 为每日应计提的托管费

E 为前一自然日集合计划资产净值

本资产管理计划的托管费自计划成立日的下一个自然日起，每日计提，按自然季支付。在下个自然季度初的第三个工作日，管理人向托管人出具资金划款指令，按照指定的账户路径支付上个季度的托管费。如遇托管账户资金余额不足的，托管人可待托管账户有资金时再划扣。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。若因战争、自然灾害等不可抗力致使无法按时支付的，则在不可抗力情形消除后的首个工作日支付。

（二）管理费

本资产管理计划的管理费按前一自然日集合计划资产净值的【0.3%】的年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 【0.3\%】 \div 365$$

H 为每日应计提的管理费

E 为前一自然日集合计划资产净值

本资产管理计划的管理费自计划成立日的下一个自然日起，每日计提，按自然季支付。在下个自然季度初的第三个工作日，管理人向托管人出具资金划款指令，按照指定的账户路径支付上个季度的管理费。如遇托管账户资金余额不足的，托管人可待托管账户有资金时再划扣。费用划扣后，托管人应向管理人告知管理费支付金额及计算方式，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。若因战争、自然灾害等不可抗力致使无法按时支付的，则在不可抗力情形消除后的

首个工作日支付。产品终止后，依据清算程序支付本资产计划尚未支付的管理费。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

（三）业绩报酬

1、业绩报酬计提原则

（1）按投资者每笔参与份额分别计算年化收益率并计提业绩报酬；

（2）在符合业绩报酬计提条件时，在本集合计划分红权益登记日（具体以届时的分红公告为准，下同）、投资者退出日和本集合计划终止日计提业绩报酬；

（3）在本集合计划分红权益登记日提取业绩报酬的，业绩报酬从分红资金中扣除；

（4）在投资者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中扣除；

（5）在投资者退出或本集合计划终止时，业绩报酬按投资者退出份额或集合计划终止时持有份额计算，如退出份额包括一笔参与份额的一部分，则将该部分参与份额视为一笔参与份额进行核算；

（6）本集合计划业绩报酬提取频率不得超过每6个月一次，因投资者退出本集合计划，管理人按照约定提取业绩报酬的，不受提取频率的限制。本集合计划年化收益率的计算公式如下：

$$R = \frac{P_1 - P_0}{P_0^*} * \frac{365}{N} * 100\%$$

R为集合计划年化收益率；

P_1 为业绩报酬计提日的集合计划单位累计净值；

P_0 为上一个业绩报酬计提日的集合计划单位累计净值；

P_0^* 为上一个业绩报酬计提日的集合计划单位净值；

N为上一个业绩报酬计提日到本次业绩报酬计提日的期间天数；

（2）管理人以超额比例的方式提取业绩报酬，具体计算方法如下：

年化收益率（R）	计提比例	业绩报酬总额（Y）的计提公式
$R \leq \text{【3.8%】}$	0	$Y=0$
$R > \text{【3.8%】}$	【50%】	$Y=A \times (R - \text{【3.8%】}) \times \text{【50%】} \times N/365$

业绩报酬在业绩报酬计提日（如有）计提，由管理人在计提次日向托管人发送业绩报酬划付指令，托管人复核无误后，根据管理人的划付指令从集合计划资产中将计提的业绩报酬划付给管理人。业绩报酬计入管理费，须与产品对应并逐个结算，管理人管理的不同产品之间不得相互串用。如托管人与管理人对业绩报酬金额无法达成一致意见的，以管理人数据为准。若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

业绩报酬计提的详细条款请见本资管计划合同。

三、集合计划管理人履职报告

本报告期内，集合计划管理人严格遵守《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》、《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》及其他法律法规的规定，本着诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运作本集合计划资产，在严格控制风险的基础上，为集合计划投资者谋求合法利益。

（一）投资经理报告

1. 投资经理简介

（1）朱凌燕女士，英国威尔士大学 MBA，具有 16 年证券基金行业从业经历，先后任职于国泰基金管理有限公司、东方财富证券股份有限公司和申港证券股份有限公司，长期从事固定收益投资研究及部门管理工作，对固收市场具备深刻理解，投资风格稳健。

学历：硕士

兼职情况：无

投资管理、投资研究、投资咨询等相关业务经验：有

是否取得基金从业资格：是

最近三年是否被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚：否

（2）张凯翔先生，毕业于上海财经大学，具有 6 年固定收益投资相关经验，先后任职于上海海通证券资产管理有限公司和交银康联资产管理有限公司，长期从事固定收益投资研究工作，投资风格稳健，擅长绝对收益投资策略，对信用债、可转

债投资有深入的理解。

学历：硕士

兼职情况：无

投资管理、投资研究、投资咨询等相关业务经验：有

是否取得基金从业资格：是

最近三年是否被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚：否

2. 年度投资经理工作报告

2022 年债券市场走势一波三折，主要受国内经济稳增长、区域疫情冲击、海外主要经济体无风险利率上行、俄乌冲突等因素的影响。一季度宽货币主导债市行情。1 月份央行下调 MLF 利率 10BP，1 年期 LPR 同步下调 10BP，5 年期 LPR 下调 5BP，债券市场在降息的推动下快速下行，10 年期国债一度向下突破 2.70%。而春节成为了债券市场表现的分水岭，春节后国内稳增长政策逐步发力，公布的 1 月份社融数据大超预期，2 月份 PMI 超出市场预期，全国多地放宽了房地产限购政策，投资者对于“宽信用”的效果的期待大幅抬升。债券市场出现明显调整，10 年期国债收益率一度突破 2.85%，5 年期国债收益率较春节前低点上行约 20BP；二季度疫情反复是主线，利率波动收窄、区间震荡。新冠疫情再一次在我国爆发，吉林省、上海市等地区成为疫情重灾区，疫情的爆发对经济活动造成重大影响，重灾区经济活动按下“暂停键”。疫情发酵叠加跨季后资金面宽松和降准预期升温的影响，10Y 国债利率下行至 2.74%。后续在 3 月通胀数据小幅超预期、中美利差首次倒挂和社融信贷总量超预期等多重利空因素的影响下，10Y 国债利率转为上行。四月末上海疫情拐点隐现，复工复产开始推进，10Y 国债利率收于 2.84%。5 月公布的 4 月经济金融数据均大幅走弱，但 5 年期以上 LPR 再次下降 15bp 至 4.45%，市场对宽信用及稳增长政策抱有信心，利率在 2.80%附近窄幅震荡。五月中旬随着北京疫情再起、宽信用政策尚待观察及美债利率下行等因素影响，10Y 国债利率一周快速下行 9.3BP 至 2.7%。5 月末上海疫情进一步好转，北京疫情波及范围也明显缩小，且 5 月制造业 PMI 线下大幅回升，10Y 国债利率有所上行，月末 10Y 国债利率收于 2.74%。来到 6 月，北上区域陆续解除封控措施，复工复产有序推进，月初 10Y 国债利率稳步上升至 2.78%。后续散点疫情纷扰，金融数据显示信贷结构仍然不佳且美联储加息落地，10Y 国债利率小幅下行至 2.75%并维持窄幅震荡。月末跨半年资金利率上行，叠加债市对

增量财政政策落地有所担忧，月末 10Y 国债利率收于 2.82%；三季度利率先下后上，走出 V 型。三季度债市以 8 月中旬央行下调 OMO 及 MLF 利率为分界点形成了先扬后抑的格局。7 月份国内疫情反复，房地产销售走弱，投资者对经济预期普遍偏悲观，同时同业资金利率创年内新低，推动 10 年期国债利率下行到震荡区间下沿 2.7% 附近，信用债需求旺盛，信用债一级市场火热，经济发达地区城投债券发行利率持续下行。在这种环境下投资者一方面积极挖掘做平曲线的机会增加 3、5 年期利率债的配置另一方面适当拉长信用债投资久期以增厚配置收益，因此 3、5 年期的资产相对跑赢；这种牛市的环境随着 8 月中旬央行下调 OMO 及 MLF 利率 10BP 而达到高潮，降息的明显利好带动 10 年期国债利率向下突破至 2.6% 附近，债市在这一阶段迎来普涨行情；而时间来到 9 月份，债券市场则出现了持续调整。首先，9 月份房地产相关政策频出，在“因城施策”政策的指引下部分地区调降首套房首付比例，下调了房贷和公积金贷款利率水平，相关政策性金融机构也为“保交楼”推出了政策性贷款支持。政策组合拳为稳定房地产市场，改善房地产行业预期提供了良好的支撑；其次，公布的 8 月份金融数据明显好转，企业中长期贷款增幅可观，票据冲量现象显著缓解，“宽信用”进程的推进打压了债券投资者的做多情绪；最后，9 月份下旬债市受到的外部扰动也有所增加。美国通胀水平相对顽固，市场不断提高对美联储的加息节奏和加息空间的预期，美债收益率大幅上升，美元走强人民币对美元汇率破 7，对国内资本市场形成了较大冲击，债券市场也持续走弱。此外，9 月底同业资金利率也因为跨季影响明显抬升，这也是债券市场短端调整的原因之一；四季度利率波动放大，迅速上行。10 月初人民币出现快速贬值，美债利率快速攀升，对我国货币政策的开展形成了一定压力，降准预期落空，MLF 等量平价续作，同业资金利率边际变紧，债券市场进入阴跌行情；进入到 11 月，央行月初重提“管好货币总闸门，实施正常的货币政策”，引发投资者担忧。中旬以后，更为精准的疫情防控措施公布，且房地产政策频出，“第二支箭”、“第三支箭”、“十六条支持房地产发展措施”频繁落地，地产政策底显现，引发市场担忧，利率债出现急促下跌。更为令人担忧的是，债券估值调整引发了理财的净值快速下滑，信用债受限于其流动性出现了“二级折价卖券-估值收益率大幅上行-产品净值大幅下滑-赎回量增加-二级折价卖券”的负反馈循环；进入到 12 月份，债券市场尤其是信用债因为理财赎回压力和同业资金跨年流动性压力二次杀跌，信用利差继续走阔，直到年前最后一周，随着同业资金

利率的回落而终于开始反弹。

总体来说，我们又经历了波折的一年，面对多变的市场我们保持了一贯的投资风格，坚持自上而下的投资理念，严格把控每一个资产的风险关，严肃衡量每一笔投资的性价比，保证了产品的平稳运行。

（二）合规风控报告

本报告期内，集合计划管理人通过合规、风险管理部门和岗位，运用系统监控和人工检查等方式，对本集合计划运作进行全面的监督和检查。集合计划管理人审慎评估和控制本集合计划的各类风险，对风险情况进行全程监控与有效管理，通过在交易系统中对各类风险指标进行限制，实现投资、交易的事前、事中风险控制，同时对产品进行事后风险监控。

公司在实施严格的内部风险控制的同时，也接受托管银行、上级监管机构、中介审计机构以及投资者的监督。

经审慎核查，本报告期内，集合计划管理人履职符合有关法律法规和公司制度的规定，投资决策、投资交易程序、投资权限等方面均符合规定的要求。本集合计划运作合法合规，无损害投资者利益的行为，未出现有可能导致不公平交易或利益输送的异常交易情况。

四、集合计划托管人履职报告

本报告期内，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对甬证资管季季盈 1 号集合资产管理计划的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、资产管理合同的规定，不存在损害资产份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了资产托管人应尽的义务。

本报告期内，本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、资产管理合同的规定，对甬证资管季季盈 1 号集合资产管理计划的投资运作进行了监督，对资产管理计划资产净值的计算、资产管理计划份额申购赎回价格的计算以及资产管理计划费用开支等方面进行了认真的复核，未发现资产管理人存在损害资产份额持有人利益的行为。

本报告期内，上海甬兴证券资产管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的集合计划主要财务指标和投资表现、集合计划财务报表、集合计划投资组合报告、集合计划收益分配情况、集合计划份额变动情况内容中的财务数据真实、准确、完整。

五、集合计划主要财务指标和投资表现

（一）主要财务指标

单位：人民币元

	主要财务指标	2022 年 1 月 1 日-2022 年 12 月 31 日
1	期初单位集合计划资产净值	1.0208
2	期末单位集合计划资产净值	1.0365
3	期末单位集合计划累计资产净值	1.0565
4	期末集合计划资产净值	409,214,307.75
5	本期集合计划利润	13,776,011.40
	其中：本期公允价值变动损益	-5,842,020.00
6	本期集合计划单位净值增长率%	1.54
7	集合计划累计单位净值增长率%	3.50

（二）投资表现

截止到 2022 年 12 月 31 日，本集合计划单位净值为 1.0365 元，本期净值增长率为 1.54%，集合计划单位累计资产净值为 1.0565 元，累计净值增长率为 3.50%。

六、集合计划审计报告

审计报告

上会师报字(2023)第 4000 号

甬证资管季季盈 1 号集合资产管理计划全体份额持有人：

一、审计意见

我们审计了甬证资管季季盈 1 号集合资产管理计划(“季季盈 1 号集合计划”)财务报表，包括 2022 年 12 月 31 日的资产负债表，2022 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。

我们认为，后附季季盈 1 号集合计划的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》、《甬证资管季季盈 1 号集合资产管理计划资产管理合同》以及中国证券监督管理委员会和中国证券业协会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，公允反映了季季盈 1 号集合计划 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和净资产变动情况。

二、形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于季季盈 1 号集合计划，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

三、其他事项

我们提醒财务报表使用者关注后附财务报表附注中对编制基础的说明。同时该财务报表系季季盈 1 号集合计划管理人（以下简称“管理人”）根据《甬证资管季季盈 1 号集合资产管理计划资产管理合同》的规定为其集合计划份额持有人编制的，因此财务报表可能不适用于其他用途。本报告仅供管理人提供季季盈 1 号集合计划份

额持有人和向中国证券监督管理委员会及其派出机构报送使用，不得用于其他目的。

四、其他信息

管理人对其他信息负责。其他信息包括季季盈 1 号集合计划 2022 年度资产管理报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。

我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。

结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。

基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。

五、管理人对财务报表的责任

管理人负责按照企业会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》、《甬证资管季季盈 1 号集合资产管理计划资产管理合同》以及中国证券监督管理委员会和中国证券业协会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时，管理人负责评估季季盈 1 号集合计划的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项，并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。

六、注册会计师对财务报表审计的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

1、识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

2、了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

3、评价管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

4、对管理人使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对季季盈 1 号集合计划持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致季季盈 1 号集合计划不能持续经营。

5、评价财务报表的总体列报、结构和内容（包括披露），并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与管理人就季季盈 1 号集合计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

上会会计师事务所（特殊普通合伙）

中国注册会计师

中国注册会计师

中国 上海

二〇二三年四月十一日

七、集合计划财务报表

(一) 资产负债表

甬证资管季季盈 1 号集合资产管理计划

资产负债表

2022 年 12 月 31 日

编制单位：甬证资管季季盈 1 号集合资产管理计划

金额单位：人民币元

资产	行次	注释号	期末余额	上年年末余额
资产：				
货币资金	1	1	273,902.18	420,343.09
结算备付金	2	2	778,829.24	265,548.54
存出保证金	3	3	2,912.04	1,468.80
衍生金融资产	4		-	-
应收清算款	5		-	-
应收利息	6	4	-	4,797,973.10
应收股利	7		-	-
应收申购款	8		-	-
买入返售金融资产	9	5	112,113,938.35	85,815,000.00
发放贷款和垫款	10		-	-
交易性金融资产	11	6	347,547,635.62	211,506,800.00
其中：股票投资	12		-	-
基金投资	13		-	-
债券投资	14		347,547,635.62	211,506,800.00
资产支持证券投资	15		-	-
贵金属投资	16		-	-
其他投资	17		-	-
债权投资	18		-	-
其他债权投资	19		-	-
其他权益工具投资	20		-	-
长期股权投资	21		-	-
其他资产	22		-	-
资产总计	23		460,717,217.43	302,807,133.53

甬证资管季季盈 1 号集合资产管理计划 资产负债表

2022 年 12 月 31 日

编制单位：甬证资管季季盈 1 号集合资产管理计划

金额单位：人民币元

负债与净资产	行次	注释号	期末余额	上年年末余额
负债：				
短期借款	24		-	-
交易性金融负债	25		-	-
衍生金融负债	26		-	-
卖出回购金融资产款	27	7	51,030,431.91	48,704,326.93
应付管理人报酬	28	8	360,801.64	196,941.62
应付托管费	29	9	24,053.42	13,129.45
应付销售服务费	30		-	-
应付投资顾问费	31		-	-
应交税费	32	10	57,949.05	39,030.78
应付清算款	33		-	-
应付赎回款	34		-	-
应付利息	35	11	-	74,531.94
应付利润	36		-	-
其他负债	37	12	29,673.66	33,071.38
负债合计	38		51,502,909.68	49,061,032.10
净资产：				
实收资金	39	13	394,792,284.64	248,584,290.56
其他综合收益	40		-	-
未分配利润	41	14	14,422,023.11	5,161,810.87
净资产合计	42		409,214,307.75	253,746,101.43
负债及净资产总计	43		460,717,217.43	302,807,133.53

注：报告截止日计划单位净值 1.0365 元，计划份额总额 394,792,284.64 份。

(二) 利润表**甬证资管季季盈 1 号集合资产管理计划****利润表**

2022 年度

编制单位：甬证资管季季盈 1 号集合资产管理计划

金额单位：人民币元

项目	行次	注释号	本期金额	上期金额
一、营业总收入	1		18,130,207.80	6,412,651.68
利息收入	2	15	3,987,692.22	5,520,892.49
投资收益（损失以“-”填列）	3	16	19,984,535.58	227,139.19
其中：以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益	4		-	-
公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	5	17	-5,842,020.00	664,620.00
汇兑收益（损失以“-”填列）	6		-	-
其他收入（损失以“-”号填列）	7		-	-
二、营业总支出	8		4,354,196.40	1,033,589.23
管理人报酬	9	18	2,805,862.96	350,191.61
其中：暂估管理人报酬	10		-	-
托管费	11	19	88,015.47	23,346.13
销售服务费	12		-	-
投资顾问费	13		-	-
利息支出	14	20	1,319,943.84	607,165.58
信用减值损失	15		-	-
税金及附加	16	21	87,174.13	
其他费用	17	22	53,200.00	52,885.91
三、利润总额	18		13,776,011.40	5,379,062.45
减：所得税费用	19		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	20		13,776,011.40	5,379,062.45
五、其他综合收益的税后净额	21			
六、综合收益总额	22		13,776,011.40	5,379,062.45

(三) 净资产变动表

甬证资管季盈 1 号集合资产管理计划
净资产变动表

2022 年度

编制单位：甬证资管季盈 1 号集合资产管理计划

金额单位：人民币元

项目	本年金额				上年金额			
	实收资金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计	实收资金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上年年末余额	248,584,290.56	-	5,161,810.87	253,746,101.43	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-	-	-	-
二、本年年初余额	248,584,290.56	-	5,161,810.87	253,746,101.43	-	-	-	-
三、本年增减变动额（减少以“-”号填列）	146,207,994.08	-	9,260,212.24	155,468,206.32	248,584,290.56	-	5,161,810.87	253,746,101.43
（一）综合收益总额	-	-	13,776,011.40	13,776,011.40	-	-	5,379,062.45	5,379,062.45
（二）产品持有人申购和赎回	146,207,994.08	-	455,886.63	146,663,880.71	248,584,290.56	-	-217,251.58	248,367,038.98
其中：产品申购	557,175,897.03	-	17,201,655.97	574,377,553.00	284,511,579.26	-	250,543.24	284,762,122.50
产品赎回	-410,967,902.95	-	-16,745,769.34	-427,713,672.29	-35,927,288.70	-	-467,794.82	-36,395,083.52
（三）利润分配	-	-	-4,971,685.79	-4,971,685.79	-	-	-	-
（四）其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-	-	-	-	-
四、本年年末余额	394,792,284.64	-	14,422,023.11	409,214,307.75	248,584,290.56	-	5,161,810.87	253,746,101.43

（四）财务报表附注

1、货币资金

存放地	期末余额	上年年末余额
上海浦东发展银行上海分行第一营业部	273,902.18	420,343.09
其中：应收利息	2,009.69	-

2、结算备付金

存放地	期末余额	上年年末余额
上交所	755,536.84	265,548.54
其中：应收利息	373.78	-
深交所	23,292.40	-
其中：应收利息	11.55	-
合计	778,829.24	265,548.54

3、存出保证金

存放地	期末余额	上年年末余额
上交所交易保证金	2,538.06	1,468.80
其中：应收利息	1.21	-
深交所交易保证金	373.98	-
其中：应收利息	0.22	-
合计	2,912.04	1,468.80

4、应收利息

项目	期末余额	上年年末余额
债券利息	-	4,636,208.23
回购利息	-	161,543.06
结算备付金利息	-	131.45
活期存款利息	-	89.59
存出保证金利息	-	0.77
合计	-	4,797,973.10

5、买入返售金融资产

项目	期末余额	上年年末余额
上交所债券质押式协议回购	112,113,938.35	85,815,000.00
其中：应收利息	148,938.35	-

6、交易性金融资产

项目	期末余额	上年年末余额
债券投资	347,547,635.62	211,506,800.00
其中：应收利息	8,091,635.62	-

7、卖出回购金融资产

项目	期末余额	上年年末余额
银行间质押式回购	30,017,199.04	48,704,326.93
上交所质押式回购	<u>21,013,232.87</u>	-
合计	<u>51,030,431.91</u>	<u>48,704,326.93</u>
其中：应付利息	30,676.91	-

8、应付管理人报酬

项目	期末余额	上年年末余额
管理费	360,801.64	196,941.62

9、应付托管费

项目	期末余额	上年年末余额
上海浦东发展银行股份有限公司上海分行	24,053.42	13,129.45

10、应交税费

项目	期末余额	上年年末余额
增值税	51,740.22	34,848.91
城建税	3,621.82	2,439.42
教育税及附加	1,552.21	1,045.47
地方教育税及附加	<u>1,034.80</u>	<u>696.98</u>
合计	<u>57,949.05</u>	<u>39,030.78</u>

11、应付利息

项目	期末余额	上年年末余额
卖出回购利息支出	-	74,531.94

12、其他负债

项目	期末余额	上年年末余额
审计费	16,000.00	16,000.00
账户维护费	9,300.00	9,300.00
应付交易费用	<u>4,373.66</u>	<u>7,771.38</u>
合计	<u>29,673.66</u>	<u>33,071.38</u>

13、实收资金

项目	计划份额
上年年末金额	248,584,290.56
本年申购	557,175,897.03
本年赎回	-410,967,902.95
期末金额	394,792,284.64

注：集合计划本期成立业经上会会计师事务所(特殊普通合伙)审验，并出具上会师报字(2021)第 8310 号验资报告确认。

14、未分配利润

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年年末余额	4,510,480.95	651,329.92	5,161,810.87
本期净利润	19,618,031.40	-5,842,020.00	13,776,011.40
本期计划份额交易产生的变动数	-845,707.54	1,301,594.17	455,886.63
其中：计划申购款	13,431,378.10	3,770,277.87	17,201,655.97
计划赎回款	-14,277,085.64	-2,468,683.70	-16,745,769.34
本期已分配利润	-4,971,685.79	-	-4,971,685.79
其他	-	-	-
期末余额	18,311,119.02	-3,889,095.91	14,422,023.11

15、利息收入

项目	本期金额	上期金额
存款利息收入	50,869.53	17,004.96
其中：活期存款利息收入	46,266.17	15,137.90
备付金利息收入	4,568.00	1,858.65
保证金利息收入	35.36	8.41
债券利息收入	-	3,810,953.44
买入返售金融资产利息收入	4,062,227.61	1,858,050.72
减：利息收入增值税	125,404.92	165,116.63
合计	3,987,692.22	5,520,892.49

16、投资收益

项目	本期金额	上期金额
基金红利收益	-	181,497.83
债券投资收益	20,589,925.45	54,480.00
减：投资收益增值税	601,046.15	8,838.64
交易费用	4,343.72	
合计	19,984,535.58	227,139.19

17、公允价值变动收益

项目	本期金额	上期金额
债券投资	-5,842,020.00	664,620.00

18、管理人报酬

项目	本期金额	上期金额
业绩报酬	1,485,631.25	-
管理费	1,320,231.71	350,191.61
暂估管理人报酬	0.00	
合计	2,805,862.96	350,191.61

附注：

- (1) 业绩报酬的确定方法：详见六（2）资产管理计划管理人管理费的计算标准及金额；
- (2) 截至 2022 年 12 月 31 日，本计划暂估业绩报酬【0.00】元，业绩报酬计提日本计划单位累计净值待实际当天确认，此暂估业绩报酬与投资人实际承担的业绩报酬存在差异，实际业绩报酬以业绩报酬计提日计算为准。

19、托管费

托管人名称	本期金额	上期金额
上海浦东发展银行股份有限公司上海分行	88,015.47	23,346.13

20、利息支出

项目	本期金额	上期金额
卖出回购利息支出	1,319,943.84	607,165.58

21、税金及附加

项目	本期金额	上期金额
城建税附加	50,851.58	0.00
教育税附加	21,793.53	0.00
地方教育税附加	14,529.02	0.00
合计	87,174.13	0.00

22、其他费用

项目	本期金额	上期金额
审计费	16,000.00	16,000.00
账户维护费	37,200.00	12,400.00
税费		20,874.63
交易费用		3,211.28
其他	=	400.00
合计	53,200.00	52,885.91

八、集合计划投资组合报告

（一）资产组合情况

日期：2022-12-31

序号	项目	金额（元）	占总资产的比例（%）
1	权益投资		
	其中：股票		
	基金		
2	固定收益投资	347,547,635.62	75.44
	其中：债券	347,547,635.62	75.44
	资产支持证券		
3	金融衍生品投资		
4	买入返售金融资产	112,113,938.35	24.33
	其中：买断式回购的买入返售金融资产		
5	银行存款和结算备付金合计	1,052,731.42	0.23
6	其他资产	2,912.04	0.00
7	合计	460,717,217.43	100.00

注：因四舍五入原因，分项占比之和与合计数可能存在尾差。

（二）报告期末按市值占集合计划资产净值比例大小排序的前五名证券明细

证券代码	证券名称	数量（张）	市值（元）	占组合净值比例（%）
012281849	22 牛首山 SCP001	300,000.00	30,533,260.27	7.46
197043	21 兴港 03	300,000.00	30,345,049.31	7.42
102000779	20 西安高新 MTN004	300,000.00	30,058,980.82	7.35
102100053	21 常德经建 MTN001	200,000.00	20,919,945.21	5.11
177725	21 上城 02	200,000.00	20,802,356.16	5.08

（三）投资组合报告附注

本集合计划投资的前五名证券中，发行主体在本报告期内未被证监会及派出机构公开立案调查，在本报告编制日前一年内未受到证监会及派出机构的公开谴责、处罚。

九、集合计划收益分配情况

本集合计划每单位份额分红 0.02 元，权益登记日为 2022 年 2 月 10 日，红利下发日为 2022 年 2 月 11 日，本次收益分配全部为现金分红，红利总额为 4,971,685.79 元，计提业绩报为 905,021.76 元，实际红利金额为 4,066,664.03 元。

十、集合计划份额变动情况

期初总份额（份）	本期参与份额（份）	本期退出份额（份）	期末总份额（份）
248,584,290.56	557,175,897.03	410,967,902.95	394,792,284.64

十一、集合计划运用杠杆情况

本报告期末，本计划因从事证券交易所、银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 51,030,431.91 元。

十二、重大事项提示

（一）本报告期内，本资产管理计划的投资经理没有发生变更。

（二）在本报告期内，本集合计划管理人及托管人没有发生涉及本集合计划管理人、财产、托管业务的诉讼事项。

（三）在本报告期内，本集合计划管理人、托管人办公地址没有发生变更。

（四）在本报告期内，冯恂女士任本集合计划管理人上海甬兴证券资产管理有限公司总经理。根据《公司章程》规定，公司总经理为公司的法定代表人。本报告期内，公司完成法定代表人的工商变更登记工作，并取得上海市市场监督管理局换发的《营业执照》和中国证监会换发的《经营证券期货业务许可证》，公司法定代表人已变更登记为冯恂女士。

（五）在本报告期内，本集合计划的管理人、托管人涉及托管业务机构及其高级管理人员没有因为不当履行管理人、托管人职责受到监管部门的处罚。

（六）本报告期内，本集合计划投资于管理人及管理人关联方设立的资产管理产品的情况：无。

（七）本报告期内，本集合计划投资于本机构、托管人及前述机构的控股股东、实际控制人或者其他关联方发行的证券或者承销期内承销的证券的情况：无。

（八）本报告期末，本集合计划规模（含利息转份额）共计 39479.23 万份，参与投资者 35 个，其中个人投资者 29 个，机构投资者 3 个，产品投资者 3 个。截至本报告期末，管理人自有资金认购本集合计划份额 5713.89 万份（含利息转份额），占总份额比例为 14.47%；管理人从业人员及其配偶认购份额 471.32 万份（含利息转份额）；管理人董事、监事、控股股东、实际控制人或者其他关联方认购份额 14627.66 万份（含利息转份额），占总份额比例为 37.05%。

（九）本报告期内，经与托管人协商同意，2023 年 1 月 28 日通过官网公告征求投资者意见，拟就《甬证资管季季盈 1 号集合资产管理计划资产管理合同》及说明书中开放期、业绩报酬、分红、信披、费用等条款进行修改。2 月 10 日上述变更生效，并于 2022 年 2 月 25 日获得中国证券投资基金业协会审核通过。经与托管人协商一致，2023 年 6 月 20 日通过官网公告征求投资者意见，拟就《甬证资管季季盈 1 号集合资产管理计划资产管理合同》中临时开放期、自有资金参与退出等条款进行修订。6 月 28 日上述变更生效，并于 2022 年 7 月 5 日获得中国证券投资基金业协会审核通过。

公司

十三、备查文件目录

（一）本集合计划备查文件目录

1. 《甬证资管季季盈 1 号集合资产管理计划计划说明书》
2. 《甬证资管季季盈 1 号集合资产管理计划资产管理合同》
3. 《甬证资管季季盈 1 号集合资产管理计划托管协议》
4. 《甬证资管季季盈 1 号集合资产管理计划验资报告》
5. 管理人业务资格批复、营业执照

（二）查阅方式

网址：<http://www.yxzqzg.com/>

信息披露电话：400-916-0666 转 8

投资者对本报告书有任何疑问，可咨询管理人上海甬兴证券资产管理有限公司。

上海甬兴证券资产管理有限公司

2023 年 4 月 21 日



