

# 太平洋证券稳健增强2号集合资产管理计划

## 2023年第一季度管理报告

(报告期: 2023年1月1日-2023年3月31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	太平洋证券稳健增强2号集合资产管理计划
产品类型	固定收益类
成立日期	2019年4月24日
成立规模	56,370,920.30元
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 激进型投资者

## 三、管理人履职报告

### (一) 投资经理简介

1、姓名:梁艳(证书编号:S1190818050001)

从业简历:曾任职大公国际信用分析师,2015年3月入职太平洋证券资产管理总部,历任研究员、研究主管,现任投资经理。

学历及兼职情况：西安交通大学金融学学士，澳大利亚新南威尔士大学商科硕士，基金管理和会计学方向。无兼职情况。

2、姓名：潘扬（证书编号 S1190819040002）

从业简历：曾任职于中国邮政储蓄银行总行资产管理部，从事理财产品投资管理等工作，2017年12月加入太平洋证券股份有限公司资产管理总部任投资经理。

学历及兼职情况：毕业于北京大学，软件工程硕士。无兼职情况。

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

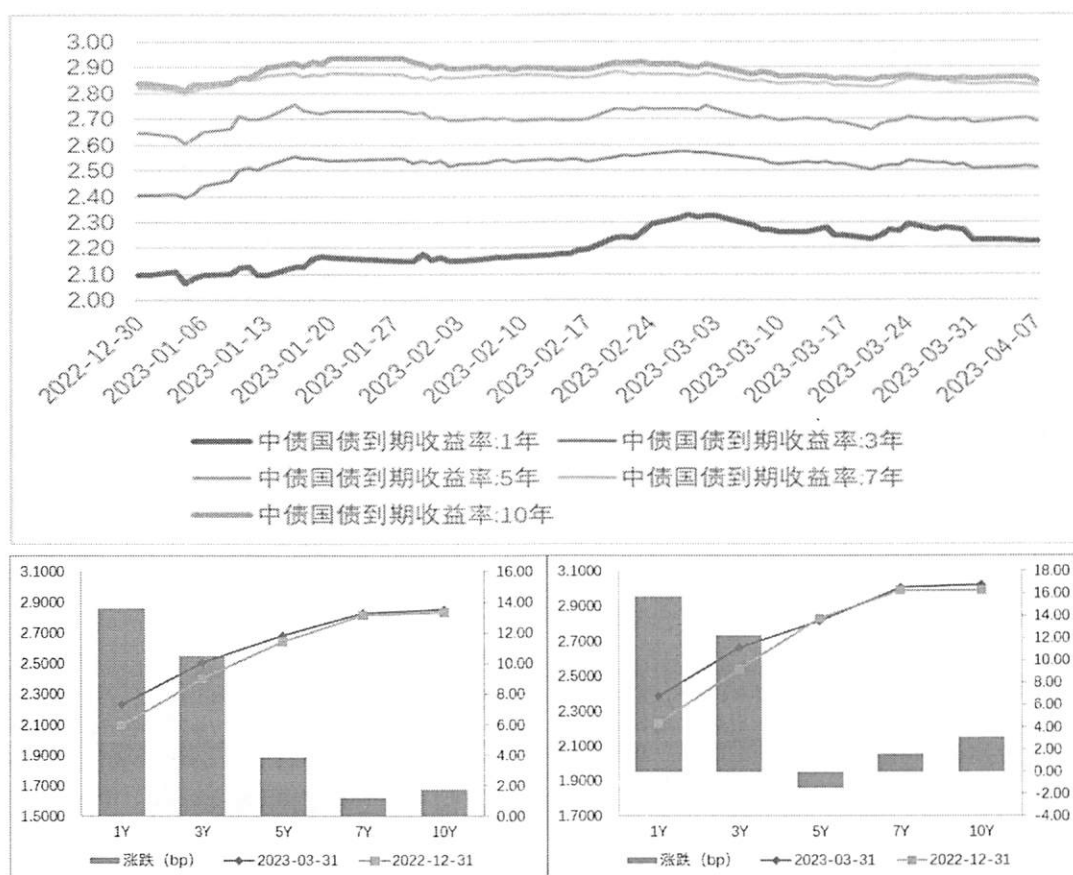
管理人在本报告期内严格依据法律法规、合同的约定，遵循自愿、公平、诚实信用和客户利益至上原则，恪尽职守、勤勉尽责地履行管理人各项合同义务。

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、2023年1季度市场回顾

一季度利率经历了先上后下的过程。利率的低点多出现在年初，而利率的高点则多出现在2月末到3月初。整体处于窄幅波动状态，1年国债的波动区间在2.07-2.33%，10年国债在2.81-2.93%。经济方面，从年初的强复苏预期，过渡到3月的温和复苏预期。一季度债市受资金利率波动的扰动较大，一方面是银行主动调整配置行为，另一方面则主要是缴税的超季节性波动。一季度短端利率两轮上行，而长债利率上行比短端更早，下行也相对更早。



信用债方面，一季度信用债大幅回暖，信用利差经历了1~2月各评级均修复，3月低评级继续修复而中高评级信用利差小幅走扩的过程。1-2月，流动性高度依赖央行投放资金，资金利率中枢抬升、波动加大，利率上行。而信用债由于经历了2022年11-12月的超调，各评级各期限收益率大多下行，信用利差迎来了修复式压缩行情。到了3月，流动性回归自发平衡状态，利率下行，信用债收益率随之继续下行，但信用利差出现分化，城投债AAA、AA+各期限信用利差大多走扩1-8bp，AA3Y和AA(2)1Y、3Y信用利差仍收窄24-27bp。其背后的原因，中高评级经历了1-2月的修复，信用利差已经压缩至25%-30%分位数，进一步压缩的空间较小；而低评级由于前期超调较多，2月末信用利差分位数仍高于50%，3月继续修复。

股市方面，2023年一季度，在经济基本面强复苏预期与弱现实交织影响下，A股市场震荡上行，其中上证综指当季上涨5.94%，深证成指上涨6.45%，创业板指上涨2.25%。在此过程中市场演绎了风格分化的结构性行情：以沪深300指数为代表的核心资产一度表现强势，但春节后市场又开始担忧经济复苏力度，因此与经济复苏相关性较高的板块调整较多，而TMT相关板块在人工智能概念引

领下异军突起，大幅领涨市场。

本产品稳健贯彻以绝对收益业绩基准为锚的多资产多策略配置思路，利用行业周期错配和多策略轮动平滑波动，实现了产品风险与收益的优化配置。在行业上，我们评估了经济阶段性复苏力度，降低了与经济复苏相关性较高的金融、消费、旅游出行等行业配置仓位，提高了正向预期差概率更大的科技相关行业配置仓位。

## 2、2023 年 2 季度市场展望

近期市场到了一个下行乏力同时担忧市场转向的纠结状态，信用债和利率债的表现分化比较明显，短债无论是一二级均快速下行。进入二季度，温和复苏预期可能面临阶段扰动、资金利率的特殊时点波动也在所难免、叠加理财流入债市资金可能减少，债市的操作难度加大。二季度或面临市场分歧加大的过程，长端利率走势可能偏纠结，信用债行情或面临兑现浮盈的压力。资金面仍然是边际收紧的状态，季末资金紧张的状态频发，二季末乃至下半年均需注意资金面的变化。短久期高票息资产对产品来说仍然是性价比高且比较安全的选择，子公司城投债仍可挖掘，拉久期则重点选择担保债品种。

股市方面，展望 2023 年第二季度，经济复苏继续推进，但复苏压力仍在，我们首先会关注经济复苏的数据，从而保持对经济复苏的动态评估。如果经济复苏相对好于预期，相关行业有修复的机会。政策方面，在强调着力扩大国内需求，加快建设现代化产业体系的基调下，当前仍然是新旧动能并重的局面，整体偏向新经济动能。因此，在经济复苏未能超预期的大背景下，如果人工智能发展进程超预期，则整个数字经济发展有望加速，看好科技板块成为下一阶段的主线，上限较高，机会大于风险。

我们在投资思路，坚持以性价比为主的多资产多策略配置理念，一方面将重点关注科技行业发展过程当中关键变化所带来的投资机会，另一方面将深度挖掘有潜力和性价比的价值型个股进行配置。

## 四、托管人履职情况

托管人依据太平洋证券稳健增强 2 号集合资产管理计划的资产管理合同与托管协议，自计划成立日起托管“太平洋证券稳健增强 2 号集合资产管理计划”

(以下简称“本计划”)的全部资产。

本报告期内,托管人严格遵守《管理办法》、《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。

本报告期内,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。

托管人认真复核了本报告期《太平洋证券稳健增强 2 号集合资产管理计划 2023 年第一季度管理报告》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 2023 年 3 月 31 日,本产品的单位净值为 1.0754 元,累计单位净值为 1.3237 元,本报告期份额净值增长率为 2.51%。

### (二) 主要财务指标

日期: 2023-01-01~2023-03-31

单位: 元

本报告期利润	2,727,968.18
本报告期末资产净值	113,763,328.74
本报告期末份额净值	1.0754
本报告期末累计份额净值	1.3237
本报告期份额净值增长率	2.51%

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

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: 2023-3-31

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
资产:			负债:		
银行存款	33,073.99	870,633.17	短期借款	0.00	0.00
结算备付金	4,898,240.11	4,675,692.97	交易性金融负债	0.00	0.00
存出保证金	9,361.41	11,994.86	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	12,995,942.39	9,297,174.85
交易性金融资产	122,125,500.67	109,223,895.86	应付清算款	105,760.41	5,371.29
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	136,122.77	408,760.36
债权投资	0.00	0.00	应付托管费	8,167.35	8,075.51
其他债权投资			应付销售服务费	0.00	0.00
应收清算款	131,267.28	47,179.06	应付投资顾问费	0.00	0.00
应收利息	47.39	0.00	应交税费	158,809.35	91,329.53
应收股利	0.00	0.00	应付利息	0.00	0.00
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	29,359.84	23,323.82
			负债合计	13,434,162.11	9,834,035.36
			所有者权益		
			实收资金	105,782,989.83	100,078,502.80
			其他综合收益		
			未分配利润	7,980,338.91	4,916,857.76
			所有者权益合计	113,763,328.74	104,995,360.56
资产总计	127,197,490.85	114,829,395.92	负债和所有者权益总计	127,197,490.85	114,829,395.92

#### 2、经营业绩表

日期: 2023-01-01~2023-03-31

单位: 元

序号	项目	本期金额	上期金额
1	一、收入	3,043,519.16	477,617.04
2	1. 利息收入	4,662.30	4,760.21
3	2. 投资收益(损失以“-”填列)	2,212,454.89	2,182,767.64
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）	826,401.97	-1,709,910.81
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	315,550.98	664,633.30
9	1. 管理人报酬	136,122.77	587,127.46
10	2. 托管费	8,167.35	8,075.51
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	147,374.27	56,490.80
14	其中：卖出回购金融资产利息支出	147,374.27	56,490.80
15	6. 信用减值损失	0.00	0.00
16	7. 税金及附加	11,737.13	-1,802.80
17	8. 其他费用	12,149.46	14,742.33
18	三、利润总额	2,727,968.18	-187,016.26
19	减：所得税费用	—	—
20	四、净利润	2,727,968.18	-187,016.26
21	五、其他综合收益		
22	六、综合收益总额	2,727,968.18	-187,016.26

## 3、所有者权益变动表

日期：2023-01-01~2023-03-31

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	100,07 8,502.8 0		4,916, 857.7 6	104,995, 360.56	101,62 5,209.4 9		11,333 ,210.8 0	112,958, 420.29
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	100,07 8,502.8 0		4,916, 857.7 6	104,995, 360.56	101,62 5,209.4 9		11,333 ,210.8 0	112,958, 420.29
6	三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	5,704,4 87.03		3,063, 481.1 5	8,767,96 8.18	-1,546, 706.69		-6,416, 353.04	-7,963,0 59.73
7	（一）综合收益总额			2,727, 968.1 8	2,727,96 8.18			-187,0 16.26	-187,016 .26
8	（二）产品持有人	5,704,4		335,5	6,040,00	-1,546,		-188,5	-1,735,3



	申购和赎回	87.03		12.97	0.00	706.69		93.70	00.39
9	其中：1、产品申购	5,704,487.03		335,512.97	6,040,000.00	18,561,225.86		1,919,311.14	20,480,537.00
10	2、产品赎回	0.00		0.00	0.00	-20,107,932.55		-2,107,904.84	-22,215,837.39
11	(三) 利润分配			0.00	0.00			-6,040,743.08	-6,040,743.08
12	(四) 其他综合收益结转留存收益								
13	四、本期期末余额	105,782,989.83		7,980,338.91	113,763,328.74	100,078,502.80		4,916,857.76	104,995,360.56

(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
股票	3,038,119.16	2.39%
现金 (银行存款及清算备付金)	4,931,314.10	3.88%
债券投资	119,087,381.51	93.62%
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)	140,676.08	0.11%
资产合计	127,197,490.85	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)	期末市值 (元)	占净值比例 (%)
1	102101750	21 景德城投 MTN001	100,000.00	10,403,728.77	9.15
2	185944	22 兴投 07	100,000.00	10,090,578.08	8.87
3	102101432	21 西宁城投 MTN002	80,000.00	8,187,791.78	7.20
4	112515	17 昆投 01	60,000.00	6,283,334.79	5.52
5	114019	22 运投 D1	50,000.00	5,139,020.55	4.52
	合计		390,000.00	40,104,453.97	35.25

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	100,078,502.80
报告期内集合计划总申购份额	5,704,487.03
报告期内集合计划总赎回份额	0
报告期末集合计划份额总额	105,782,989.83

## (四) 参与股指期货、国债期货的有关情况:

本报告期内本集合计划参与股指期货的投资损益为-142,620.00元。

截至本报告期末,本集合计划未持有股指期货合约。

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,没有明显提高本集合计划的整体风险,符合既定的投资目的。

本报告期内本集合计划未参与国债期货的投资。

## 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11.42%。

## 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0.03%的年费率计提,计算方法如下:

$$H = E \times 0.03\% \div 365;$$

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);

托管费每日计提,按季支付。由管理人向托管人发送托管费划款指令,托管人于次季首日起5个工作日内从计划资产中一次性支付给托管人,若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。

## (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0.50%的年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% \div 365;$$

H 为每日应计提的管理费；

E 为前一日计划资产净值（首日按本计划初始资金金额）；

管理费每日计提，按季支付。由管理人向托管人发送管理费划款指令，托管人于次季首日起5个工作日内从计划资产中一次性支付给管理人，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。若资产管理计划剩余的现金类资产不足以支付管理费，则可顺延至下个季度支付，如仍不足以支付的，则可延期至资产管理计划到期清算时支付。

### （三）管理人的业绩报酬

#### 1、管理人收取业绩报酬的原则：

管理人根据当时市场情况，在本集合计划发行前确定业绩报酬计提基准且有权在本集合计划每个开放期前变更业绩报酬计提基准（年化），并通过管理人网站、销售机构指定网络系统或其他途径和方式进行公告，本集合计划业绩报酬计提基准变更频率应该与本集合计划开放期相匹配，即业绩报酬计提基准调整周期不得短于本集合计划两个开放期的间隔时间。本集合计划业绩报酬计提比例暂定为60%，但管理人有权在每个开放期前通过管理人网站、销售机构指定网络系统或其他途径和方式进行公告调整该业绩报酬计提比例（X%），但X%最高不得超过60%。

#### 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：

本计划的业绩报酬计提基准日为：本集合计划分红日、投资者赎回申请日和本集合计划终止日；业绩报酬的计提日：分红确认日、投资者退出确认日和本集合计划终止确认日（即注册登记机构办理清盘或者终止强赎之日）。

业绩报酬的计算：业绩报酬的计算采用单个投资者单笔份额对应的业绩报酬计提期间（以下简称“期间”）年化收益率和对应期间业绩报酬计提基

准的差额来计提（赎回份额按照“先进先出”原则和本合同所约定的相关条款计算；终止清算时，所有投资者视同全部赎回）。即以份额持有人单笔份额期间收益为基准，按比例提取，具体提取比例如下：

当份额持有人单笔份额期间年化收益率低于对应期间业绩报酬计提基准（含），管理人不提取业绩报酬；当份额持有人单笔份额期间年化收益率高于对应期间业绩报酬计提基准（不含），管理人提取超额收益的X%作为业绩报酬。业绩报酬提取频率不得超过每6个月一次，但因份额持有人退出本集合计划，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。

在分红日提取业绩报酬的，业绩报酬从分红款中扣除，管理人在分红前先按“退出或计算清算时提取业绩报酬”的方法计算每个资产委托人的应计提业绩报酬金额，然后在派发分红时从分红金额中扣除业绩报酬；当分红金额不足于扣除业绩报酬时，以分红金额为限进行扣除；在投资者赎回申请日或计划终止日提取业绩报酬的，业绩报酬从退出资金中扣除；

同一投资者不同时间多次参与的，对投资者每笔参与份额分别计算年化收益率、计提业绩报酬；投资者申请退出时，管理人按“先进先出”的原则，即按照投资者份额参与的先后次序进行顺序退出的方式确定退出份额，计算、提取退出份额对应的业绩报酬。业绩报酬的具体计算及支付如下：

$$\text{当 } \frac{\text{NAV}_e - \text{NAV}_{is}}{\text{NAV}_{is}} > B_i \text{ 时, } H_i = \left( \frac{\text{NAV}_e - \text{NAV}_{is}}{\text{NAV}_{is}} - B_i \right) \times N_i \times \text{NAV}_{is} \times X\%;$$

$$\text{其中, } B_i = \sum_{t=1}^n \frac{r_{it}}{365} - \sum_{t=1}^m \frac{T_{it}}{365}, n \geq m;$$

$$\text{当 } \frac{\text{NAV}_e - \text{NAV}_{is}}{\text{NAV}_{is}} \leq B_i \text{ 时, } H_i = 0;$$

$$H = \sum_{i=1}^k H_i;$$

$H_i$ 为该份额持有人本次赎回/分红对应的第*i*笔集合计划份额应计提的业绩报酬；

$B_i$ 为该份额持有人本次赎回/分红对应的第*i*笔集合计划份额期间业绩报酬计提基准， $\sum_{t=1}^n \frac{r_{it}}{365}$ 为截至本次业绩报酬计提日的期间业绩报酬计提基准，

$\sum_{t=1}^m \frac{r_{it}}{365}$  为截至上次业绩报酬计提日的期间业绩报酬计提基准；

$r_{it}$  为该份额持有人本次赎回/分红对应的第  $i$  笔集合计划份额对应持有第  $t$  天的业绩报酬计提基准（年化）；

$n-m$  为该份额持有人本次赎回/分红对应的第  $i$  笔集合计划份额本次业绩报酬计提期间运作天数，即上一个业绩报酬计提日（含当日，如果不存在上一个业绩报酬计提日：对于募集期参与的份额而言，其第一次业绩报酬计提的实际运作天数从成立日当日开始算；对于存续期参与的份额而言，其第一次业绩报酬计提的实际运作天数从该笔份额申购确认当日开始算；对于红利转投的份额而言，其第一次业绩报酬计提的实际运作天数从该笔转投份额登记当日开始算）到本次业绩报酬计提日（不含当日，无论本次业绩报酬计提日是否提到业绩报酬，均作为下次业绩报酬计提的起始日）间隔的自然日天数；

$n$  为该份额持有人本次赎回/分红对应的第  $i$  笔集合计划份额自申购确认日（对于存续期参与的份额而言）或者自成立日（对募集期参与的份额而言）或者转投份额登记日（对于红利转投的份额而言）至本次业绩报酬计提日（不含当日）间隔的自然日天数；

$m$  为该份额持有人本次赎回/分红对应的第  $i$  笔集合计划份额自申购确认日（对于存续期参与的份额而言）或者自成立日（对募集期参与的份额而言）或者转投份额登记日（对于红利转投的份额而言）至上次业绩报酬计提日（不含当日，如果不存在上一个业绩报酬计提日：对于募集期参与的份额而言，其第一次业绩报酬计提的实际运作天数从成立日当日开始算；对于存续期参与的份额而言，其第一次业绩报酬计提的实际运作天数从该笔份额申购确认当日开始算；对于红利转投的份额而言，其第一次业绩报酬计提的实际运作天数从该笔转投份额登记当日开始算）间隔的自然日天数；

$NAV'_e$  为本次业绩报酬计提基准日的份额累计净值；

$NAV'_{is}$  为上一个业绩报酬计提基准日的份额累计净值；

$NAV_{is}$  为上一个业绩报酬计提基准日的份额净值；

$N_i$ 为该份额持有人本次赎回/分红对应的第*i*笔集合计划份额数。

业绩报酬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。

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。

本集合计划的业绩报酬计提基准仅为管理人提取业绩报酬的标准，并不是管理人向客户保证其资产本金不受损失或者保证其取得最低收益的承诺。

管理人将于发行前或者每个开放期前以管理人公告形式，告知委托人和托管人具体业绩报酬计提基准以及生效时间，但业绩报酬计提基准变更频率不得大于每6个月一次。

### 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。

因涉及注册登记机构数据，业绩报酬由管理人负责计算并复核，托管人不承担业绩报酬的复核责任。

## 九、产品收益分配情况

本报告期内未进行收益分配，未提取业绩报酬。

## 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、员工及其配偶、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

截止报告期末，管理人工及其配偶、利害关系人共持有本集合计划合计3,559,664.09份，经对本集合计划账户进行监控，未发现存在因管理人关联方参与本集合计划导致的不公平对待投资者行为。

## 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  
2023年4月27日

