

# 长江资管乐享月月盈1号集合资产管理计划 2022年年度资产管理报告

管理人：长江证券（上海）资产管理有限公司

托管人：兴业银行股份有限公司

报告期间：2022年01月01日-2022年12月31日

## 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》（以下简称“《指导意见》”）、《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“《运作规定》”）及其他有关规定编制。

管理人保证本报告中所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担责任。

托管人兴业银行股份有限公司根据法律法规相关规定及本集合计划资产管理合同的约定，复核了本报告中的主要财务指标、会计报表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。

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。集合计划的过往业绩并不代表其未来表现，投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本集合计划的合同、风险揭示书等相关法律文件，了解所投资产品的风险收益特征，选择适合自己的产品。

本报告中的内容由管理人负责解释。

本报告中的金额单位除特指外均为人民币元。

本报告期起止时间：2022年01月01日—2022年12月31日

## 一、集合计划简介

### （一）基本资料

名称：长江资管乐享月月盈1号集合资产管理计划

类型：集合资产管理计划

成立日：2017年06月08日

成立份额：103,221,420.94份

报告期末总份额：106,431,717.00份

存续期：10年

### （二）集合计划管理人

名称：长江证券（上海）资产管理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道1198号世纪汇一座27层

办公地址：上海市浦东新区世纪大道 1198 号世纪汇一座 27 层

湖北省武汉市江汉区淮海路88号

法定代表人：高占军

联系电话：4001-166-866

### （三）集合计划托管人

名称：兴业银行股份有限公司

注册地址：福州市湖东路154号

法定代表人：高建平

联系电话：021-52629999

## 二、主要财务指标和净值表现

### （一）主要财务指标和净值表现

单位：人民币元

序号	主要财务指标和净值表现	2022年12月31日
1	期初份额净值	1.0007
2	期末份额净值	1.0001
3	期末份额累计净值	1.2334
4	期末资产净值	106,440,509.70
5	本期利润	2,774,210.22
6	期末可供分配利润	8,792.70
7	期末可供分配份额利润	0.0001

8	本期份额净值增长率	2.77%
9	份额累计净值增长率	23.34%

## (二) 财务指标的计算公式

- 1、期末份额净值=期末资产净值/报告期末总份额
- 2、期末份额累计资产净值=期末份额资产净值+份额已分红收益
- 3、本期份额净值增长率= (分红前一天单位净值/期初单位净值)\*{期末单位净值/(分红前一天单位净值-单位分红金额)}-1
- 4、份额累计净值增长率= (期末份额累计净值-1) ×100%

## 三、管理人履职报告

## (一) 集合计划投资表现

截止2022年12月31日，本集合计划份额净值为1.0001元，本期份额净值增长率为2.77%，期末份额累计净值1.2334元，份额累计净值增长率为23.34%。

## (二) 本报告期集合计划投资收益分配情况

序号	收益分配基准日	权益登记日	分红方式	分红方案
1	2022-02-14	2022-02-15	现金分红	本次分红总金额为人民币684,807.28元。
2	2022-03-14	2022-03-15	现金分红	本次分红总金额为人民币397,283.17元。
3	2022-04-11	2022-04-12	现金分红	本次分红总金额为人民币371,589.17元。
4	2022-05-09	2022-05-10	现金分红	本次分红总金额为人民币372,868.23元。
5	2022-06-13	2022-06-14	现金分红	本次分红总金额为人民币484,436.40元。
6	2022-07-18	2022-07-19	现金分红	每10份集合计划份额派发红利人民币0.035元。
7	2022-08-22	2022-08-23	现金分红	本次分红总金额为人民币570,246.82元。

## (三) 投资经理简介

姓名	任本集合计划投资经理的期限		说明
	任职日期	离任日期	

肖媛	2017-06-08	-	澳大利亚新南威尔士大学金融硕士。曾任长江证券股份有限公司资产管理总部产品经理、投资经理，现任长江证券（上海）资产管理有限公司私募固定收益投资部总经理、投资经理。
张帆	2021-11-24	-	香港理工大学精算学硕士。曾任汉口银行金融同业部华北团队负责人，从事债券及非标资产的投资管理工作，长江证券（上海）资产管理有限公司投资经理助理。现任长江证券（上海）资产管理有限公司投资经理。
肖怡	2022-11-17	-	法国巴黎第十二大学经济学硕士。曾任长江证券股份有限公司资产管理总部交易员、长江证券（上海）资产管理有限公司投资经理助理，现任长江证券（上海）资产管理有限公司投资经理。

#### （四）投资经理工作报告

##### 1、市场回顾

2022年债券市场整体呈现低位震荡行情，长端利率波动为近5年来最小。年初，资金面总体宽松，投资者降息预期一致，推动收益率下行。十年期国开债、十年期国债一度下行至2.915%、2.675%。2月至3月上旬，美债收益率上行，国内多地放开地产政策，金融数据放量，加之央行上缴1万亿元结存利润、两会经济增长目标设置偏积极，宽信用预期升温，利率出现回升。到了3月份，随着俄乌冲突升级，国内金融数据转弱，上海等地疫情暴发，资金面维持宽松，利率下行。5月下旬起，疫情冲击逐渐消退、基本面修复，政策性开发性金融工具落地，加之海外情绪引导，利率再度回升。7月中旬，疫情反复、断贷风波和村镇银行风险事件加剧了经济复苏的不确定性，加之台海局势升温推升避险情绪，资金面宽松预期增强，利率持续下行。8月15日，早盘央行超预期调降MLF和7天逆回购利率10BP，为中美货币政策周期背离大背景下首次动用降息工具，其后发布的7月经济数据均弱，十年期国债收益率单日下行7.65BP。之后，十年期国开债和国债分别下行至年内低点2.78%和2.58%。8月下旬以来，稳增长政策不断出台，人民币汇率快速贬值，市场情绪有所转向。十一国庆假期后，地产数据并未因前期利好政策改善，节后疫情多点散发，市场对前期宽信用政策预期有所降温，利率震荡下行。进入11月，疫情防控二十条、支持地产十六条等超预期政策出台，加之在岸人民币一度贬至7.32，资金价格一改月初下行常态，引发市场担忧，债市急速回调，并引发债基、

银行理财产品因净值波动赎回负反馈，十年期国开、国债一度上行超 20BP，短债利率上行更加剧烈。随后在资金面、政策面呵护下，市场情绪逐渐平复。

## 2、未来操作策略

操作策略上，管理人将坚持基于安全性、流动性和收益性为均衡管理目标，密切关注债券市场和货币市场投资品种的走势，抓住市场趋势性机会，配置高性价比固定收益资产，捕捉交易波段机会，为集合计划争取更高的投资收益。

## （五）管理人内部声明

### 1、集合计划运作合规性声明

本报告期内，管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《指导意见》、《管理办法》、《运作规定》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用本集合计划资产，在严格控制风险的基础上，争取为份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本集合计划运作合法合规，无损害份额持有人利益的行为，本集合计划的投资管理符合有关法规的规定。

### 2、内部监察报告

本报告期内，管理人负责稽核监察的相关部门依照管理人已颁布执行的内部控制、稽核监察、风险控制、合规性检查、投资管理制度等规章制度，独立开展内部控制工作。

在开展工作的过程中，采用了现场与非现场、定期与不定期相结合的工作方法，具体采用了实时监控、现场检查、材料审阅、人员询问和综合分析等多种方法，对投资交易、财务核算等进行了全面细致的审查，对业务流程和规章制度的完善及执行进行了长期的跟踪督察。

## （六）公平交易专项说明

### 1、公平交易制度的执行情况

本报告期内，管理人严格遵守《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的相关规定，通过严格的内部风险控制制度和流程，对各环节的投资风险和管理风险进行有效控制，确保公平对待所管理的所有投资组合，切实防范利益输送行为。

### 2、异常交易行为的专项说明

本报告期内，本集合计划与管理人所管理的其他投资组合未发生大额同日反向交易。本报告期内，未发现本集合计划有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

## 四、托管人履职报告

托管人履职报告详见《托管报告》。

## 五、财务会计报告

### （一）资产负债表（报告截止日：2022年12月31日）

单位：人民币元

资产	期末余额	上年年末余额
<b>资产：</b>		
货币资金	9,173.48	70,766.15
结算备付金	932,450.57	1,048,187.48
存出保证金	1,990.62	2,493.21
衍生金融资产	-	-
应收清算款	-	-
应收利息	-	1,721,207.35
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
买入返售金融资产	-	23,938,000.00
发放贷款和垫款	-	-
交易性金融资产	130,058,792.63	81,966,446.87
债权投资	-	-
其他债权投资	-	-
其他权益工具投资	-	-
长期股权投资	-	-
其他资产	-	-
<b>资产总计</b>	<b>131,002,407.30</b>	<b>108,747,101.06</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>期末余额</b>	<b>上年年末余额</b>
<b>负债：</b>		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	24,505,957.07	7,999,920.00
应付管理人报酬	8,742.13	23,214.09
应付托管费	2,010.47	1,547.62
应付销售服务费	-	-
应付投资顾问费	-	-
应交税费	17,450.03	13,347.24

应付清算款	-	4,817.53
应付赎回款	-	-
应付利息	-	-3,673.15
应付利润	-	-
其他负债	27,737.90	26,850.83
<b>负债合计</b>	<b>24,561,897.60</b>	<b>8,066,024.16</b>
<b>净资产：</b>		
实收资金	106,431,717.00	100,606,156.18
其他综合收益	-	-
未分配利润	8,792.70	74,920.72
<b>净资产合计</b>	<b>106,440,509.70</b>	<b>100,681,076.90</b>
<b>负债和净资产总计</b>	<b>131,002,407.30</b>	<b>108,747,101.06</b>

## (二) 利润表 (2022年01月01日至2022年12月31日)

单位：人民币元

项目	本期金额	上期金额
<b>一、营业总收入</b>	<b>4,085,965.59</b>	<b>3,735,665.16</b>
1. 利息收入	938,891.77	3,275,617.80
2. 投资收益 (损失以“-”填列)	4,315,869.65	381,291.79
其中：以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益	-	-
3. 公允价值变动收益 (损失以“-”号填列)	-1,296,766.37	34,485.37
4. 汇兑损益 (损失以“-”号填列)	-	-
5. 其他业务收入	127,970.54	44,270.20
<b>二、营业总支出</b>	<b>1,311,755.37</b>	<b>1,423,090.28</b>
1. 管理人报酬	736,879.25	1,214,646.83
其中：暂估管理人报酬	-	-
2. 托管费	26,541.75	14,367.20
3. 销售服务费	-	-
4. 投资顾问费	-	-



5. 利息支出	468,053.71	115,452.46
6. 信用减值损失	-	-
7. 税金及附加	17,868.61	6,414.23
8. 其他费用	62,412.05	72,209.56
三、利润总额	2,774,210.22	2,312,574.88
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	2,774,210.22	2,312,574.88
五、其他综合收益的税后净额	-	-
六、综合收益总额	2,774,210.22	2,312,574.88

## (三) 净资产变动表（2022年01月01日至2022年12月31日）

单位：元

项目	本金额			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上年年末余额	100,606,156.18	-	74,920.72	100,681,076.90
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本年初余额	100,606,156.18	-	74,920.72	100,681,076.90
三、本年增减变动额（减少以“-”号填列）	5,825,560.82	-	-66,128.02	5,759,432.80
（一）综合收益总额	-	-	2,774,210.22	2,774,210.22
（二）产品持有人申购和赎回	5,825,560.82	-	511,480.53	6,337,041.35
其中：1、产品申购	249,190,678.95	-	1,384,643.61	250,575,322.56
2、产品赎回	-243,365,118.13	-	-873,163.08	-244,238,281.21
（三）利润分配	-	-	-3,351,818.77	-3,351,818.77
（四）其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本年年末余额	106,431,717.00	-	8,792.70	106,440,509.70
项目	上年金额			

	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上年年末余额	83,891,597.31	-	871,047.06	84,762,644.37
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本年年初余额	83,891,597.31	-	871,047.06	84,762,644.37
三、本年增减变动额 (减少以“-”号填列)	16,714,558.87	-	-796,126.34	15,918,432.53
(一) 综合收益总额	-	-	2,312,574.88	2,312,574.88
(二) 产品持有人申 购和赎回	16,714,558.87	-	1,783.01	16,716,341.88
其中：1、产品申购	114,395,697.26	-	54,509.81	114,450,207.07
2、产品赎回	-97,681,138.39	-	-52,726.80	-97,733,865.19
(三) 利润分配	-	-	-3,110,484.23	-3,110,484.23
(四) 其他综合收益 结转留存收益	-	-	-	-
四、本年年末余额	100,606,156.18	-	74,920.72	100,681,076.90

报表附注为财务报表的组成部分。

报表附注：

### 1、集合计划基本情况

长江资管乐享月月盈1号集合资产管理计划(以下简称“本集合计划”或“本计划”)系由长江证券(上海)资产管理有限公司为本集合计划管理人、注册登记机构,长江证券股份有限公司和长江证券(上海)资产管理有限公司为推广机构,兴业银行股份有限公司为本集合计划托管人。于2017年06月08日成立。

### 2、财务报表的编制基础

本集合计划以持续经营为基础编制财务报表。本财务报表按照财政部颁布的各项企业会计准则、应用指南、解释、《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(以下简称“企业会计准则”)、以及中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的实务操作编制。

### 3、遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则以及中国证监会、中国证券投资基金业协会发布的有关规定和允许的实务操作要求，真实、完整地反映了本集合计划2022年12月31日的财务状况、2022年度的经营成果和净资产变动情况。

#### 4、重要会计政策和会计估计

##### (1) 会计年度

本集合计划的会计年度自公历1月1日至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为2022年1月1日至2022年12月31日。

##### (2) 记账本位币

本集合计划的记账本位币为人民币，编制财务报表采用的货币为人民币。本集合计划选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

#### 5、会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### (1) 会计政策变更的说明

本计划自2022年1月1日起执行了财政部发布的《企业会计准则第22号——金融工具确认和计量(修订)》、《企业会计准则第23号——金融资产转移(修订)》、《企业会计准则第24号——套期会计(修订)》及《企业会计准则第37号——金融工具列报(修订)》(统称“新金融工具准则”)，自2022年7月1日起执行财政部发布的《资产管理产品相关会计处理规定》。

##### 1) 新金融工具准则

根据财政部发布的新金融工具准则相关衔接规定，以及财政部、中国银行保险监督管理委员会于2020年12月30日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，本计划应当自2022年1月1日起执行新金融工具准则。

新金融工具准则修订了财政部于2006年颁布的《企业会计准则第22号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第23号——金融资产转移》和《企业会计准则第24号——套期保值》以及财政部于2014年修订的《企业会计准则第37号——金融工具列报》(统称“原金融工具准则”)。

新金融工具准则将金融资产划分为三个基本分类：①以摊余成本计量的金融资产；②以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产；及③以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。在新金融工具准则下，金融资产的分类是基于本计划管理金融资产的商业模式及该资产合同现金流量特征而确定。新金融工具准则取消了原金融工具准则中规定的持有至到期投资、贷款和应收款项及可供出售金融资产三个分类类别。根据新金融工具准则，嵌入衍生工具不再从金融资产的主合同中分拆出来，而是将混合金融工具整体适用关于金融资产分类的相关规定。

新金融工具准则以“预期信用损失”模型替代了原金融工具准则中的“已发生损失”

模型。“预期信用损失”模型要求持续评估金融资产的信用风险，因此在新金融工具准则下，本计划信用损失的确认时点早于原金融工具准则。

本计划按照新金融工具准则的衔接规定，对新金融工具准则施行日（即2022年1月1日）未终止确认的金融工具的分类和计量（含减值）进行追溯调整。本计划未调整比较财务报表数据，将金融工具的原账面价值和在新金融工具准则施行日的新账面价值之间的差额计入2022年年初留存收益或其他综合收益。

执行新金融工具准则对2022年1月1日本计划财务报表的影响汇总如下：

#### ①金融工具的分类影响

于2021年12月31日，本计划持有的银行存款、结算备付金、存出保证金、交易性金融资产、买入返售金融资产和卖出回购金融资产款等对应的应计利息余额均列示在应收利息或应付利息科目中。于2022年1月1日，本计划按照新金融工具准则，将上述应计利息分别转入银行存款、结算备付金、存出保证金、交易性金融资产、买入返售金融资产和卖出回购金融资产款等科目项下列示，无期初留存收益影响。

首次执行日（2022年1月1日）对财务报表的具体影响科目及金额见下表：

单位：人民币元

项目	2021年12月31日	2022年1月1日	调整数
资产：			
银行存款	70,766.15	71,526.78	760.63
结算备付金	1,048,187.48	1,048,706.35	518.87
存出保证金	2,493.21	2,494.42	1.21
交易性金融资产	81,966,446.87	83,675,646.47	1,709,199.60
买入返售金融资产	23,938,000.00	23,948,727.04	10,727.04
应收利息	1,721,207.35		-1,721,207.35
负债：			
卖出回购金融资产款	7,999,920.00	7,996,246.85	-3673.15
应付利息	-3,673.15		3,673.15

#### ②采用“预期信用损失”模型的影响

“预期信用损失”模型适用于本计划持有的以摊余成本计量的金融资产。采用“预期信用损失”模型未对本计划2022年年初留存收益产生重大影响。

2) 本计划执行财政部发布的《资产管理产品相关会计处理规定》，未对本计划财务报表列报和披露产生重大影响。

### 3) 首次执行新金融工具准则追溯调整前期比较数据的说明

本计划首次执行新金融工具准则和《资产管理产品相关会计处理规定》，未追溯调整前期比较数据。变更对本计划利润和持有人权益无影响。

#### (2) 会计估计变更的说明

本报告期，本集合计划未发生重大会计估计变更。

#### (3) 差错更正的说明

本报告期，本集合计划未发生重大会计差错更正。

## 6、重要财务报表项目的说明

### (1) 管理人报酬的确定方法

请查阅《长江资管乐享月月盈1号集合资产管理计划资产管理合同》中关于业绩报酬计提的具体内容。

### (2) 暂估管理人报酬与实际管理人报酬存在差异的说明

根据2022年12月31日的业绩表现及合同约定的业绩报酬计提方法，假设于2022年12月31日按照当日的份额净值清算并计提管理人业绩报酬，其金额为人民币7,667.87元，未在当期损益中计提暂估业绩报酬，系由于相关义务发生的可能性及金额计量的可靠性未满足预计负债确认条件。该暂估金额仅供参考，与实际需要份额持有人承担的业绩报酬可能存在差异。

### (3) 公允价值计量

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

## 7、或有事项、资产负债表日后事项的说明

### (1) 或有事项

截至资产负债表日，本集合计划无须作披露的或有事项。

### (2) 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本集合计划无须作披露的资产负债表日后事项。

## 8、关联方关系及其交易

### (1) 关联方关系

关联方名称	与本集合计划的关系
长江证券（上海）资产管理有限公司	集合计划管理人、销售机构、注册登记机构

## (2) 关联方交易

关联方名称	本期末2022年12月31日	
	持有份额	持有份额占总份额的比例
长江证券（上海）资产管理有限公司	14,434,643.14	13.56%

## 9、金融工具风险及管理

## (1) 流动性风险

流动性风险，是指企业在履行以交付现金或其他金融资产的方式结算的义务时发生资金短缺的风险。

对于金融工具的流动性风险，产品管理人在构建投资组合时，一方面，对债券的流动性进行事前评级。对交易所债券采用GARCH模型分析流动性，对交投不活跃的银行间债券主要使用定性的方法。债券研究员需要对每只债券进行流动性评级，剔除流动性差的及流动性不足的债券。另一方面，对产品所持有的金融工具进行流动性实时监测。遵循全面性、审慎性和预见性原则，对各类型券种的成交活跃度、波动指标、交易广度及深度进行实时监测。

## (2) 信用风险

信用风险是指金融工具的一方不履行义务，造成另一方发生财务损失的风险，或者交易对手未能按时履约的风险。

管理人已制定信用风险管理制度，并建立了信用风险管理流程，通过准入标准、黑名单等方式对入池、投中、投后等全流程进行信用风险管理覆盖：包括内部投资限制分层管理、投后风险监控提示、交易对手和质押券分层风险管理机制、证券池管理、内部信用评级、风险资产处置小组等。

## (3) 市场风险

金融工具的市场风险，是指金融工具的公允价值或未来现金流量因市场价格变动而波动的风险，包括汇率风险、利率风险和其他价格风险。

对于市场风险，产品管理人主要采取如下措施进行控制：建立完备的系统性风险监控和预警系统。策略分析师负责宏观经济分析，研究国家经济发展状况以及政治、宏观政策、法律法规、监管政策的变化等宏观因素对资本市场的影响，评估出现系统性风险的可能性和严重程度，提出规避和降低系统性风险的措施。市场风险的计量模型与工具包括但不限于：风险价值（VAR）、久期分析、压力测试、情景分析、敞口分析等。根据风险的影响程度和发生可能性等建立评估标准，采取定性与定量相结合的方法，对识别的风险进行分析计量并进行等级评价或量化排序，确定重点关注和优先控制的风险。

## 10、侧袋机制及其说明

本报告期，本集合计划未启用侧袋机制。

## (四) 资产管理计划相关费用的计提基准、计提方式和支付方式

项目	计提基准	计提方式	支付方式
管理费	本集合计划的管理费按前一日集合计划的资产净值计提，管理费的年费率为0.3%。	计算方法如下： $H = E \times 0.3\% \div 365$ H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。	集合计划管理费每日计提，按月支付。经管理人与托管人双方核对无误后，由托管人于次月首日起3个工作日内从集合计划资产中一次性支付给管理人。
托管费	本集合计划托管人托管费按前一日集合计划资产净值的0.02%年费率计提。	计算方法如下： $H = E \times 0.02\% \div 365$ H为每日应计提的托管费； E为前一日集合计划资产净值。	集合计划托管费每日计提，按月支付。经管理人与托管人双方核对无误后，由托管人于次月首日起3个工作日内从集合计划资产中一次性支付给托管人。

注：本计划运作过程中可能发生的其他费用由托管人根据法律法规及相应协议的规定，按实际发生金额支付，列入或摊入当期费用。

## 六、投资组合报告

## (一) 期末集合计划资产组合情况（报告截止日：2022年12月31日）

单位：人民币元

项目	期末金额	占期末总资产比例
银行存款	9,173.48	0.01%
清算备付金	932,450.57	0.71%
存出保证金	1,990.62	0.00%
股票投资	-	-
债券投资	130,058,792.63	99.28%

资产支持证券投资	-	-
基金投资	-	-
资产管理产品投资	-	-
买入返售金融资产	-	-
其他各项资产	-	0.00%
资产合计	131,002,407.30	100.00%

注：（1）其他各项资产包括“应收股利”、“应收利息”、“应收清算款”和“其他应收款”等项目；（2）由于四舍五入的原因，期末金额占期末总资产比例的分项之和与合计可能有尾差。

### （二）期末按公允价值占计划资产净值比例大小排序的前五名债券明细

证券代码	证券名称	数量(张)	公允价值(元)	占计划资产净值比例
167089	20延安01	80,000.00	8,183,857.53	7.69%
042280154	22咸宁高新CP001	70,000.00	7,186,255.62	6.75%
032280380	22邢台路桥PPN001	50,000.00	5,292,910.96	4.97%
166459	20淮建01	50,000.00	5,241,006.85	4.92%
185627	22建机01	50,000.00	5,197,424.66	4.88%

### （三）资产管理计划运用杠杆情况

截至本报告期末，本集合计划从事交易所市场和银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为24,505,957.07元。

## 七、期末关联方持有集合计划情况

单位：份

项目	持有份额总数	占总份额比例
管理人董事、监事、从业人员及其配偶	0	0
管理人控股股东、实际控制人或者其他关联方	14,434,643.14	13.56%

## 八、集合计划份额变动的情况

单位：份

期初总份额	本期参与份额	本期退出份额	期末总份额
-------	--------	--------	-------



100,606,156.18	249,190,678.95	243,365,118.13	106,431,717.00
----------------	----------------	----------------	----------------

## 九、重要事项提示

### （一）涉及管理人、资产管理计划财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，未发生涉及对管理人运营管理及本集合计划运作产生重大影响的，与本集合计划管理人、委托财产、托管业务相关的重大诉讼事项。

### （二）投资策略的改变

本报告期内，本集合计划投资策略未发生重大改变。

### （三）管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本集合计划的管理人、托管人及其高级管理人员未受到监管部门的任何处罚。

### （四）管理人、托管人的专门托管部门的重大人事变动

1、本报告期内，自2022年7月5日起，谷松女士担任长江证券（上海）资产管理有限公司副总经理。

2、本报告期内，自2022年9月5日起，长江证券（上海）资产管理有限公司董事长由周纯先生变更为高占军先生。

3、本报告期内，自2022年9月16日起，长江证券（上海）资产管理有限公司法定代表人由周纯先生变更为高占军先生。

4、本报告期内，本集合计划托管人的专门托管部门未发生重大人事变动。

### （五）投资经理的变更

本报告期内，本集合计划投资经理自2022年11月17日起由肖媛、张帆变更为肖媛、张帆、肖怡。

### （六）关联交易

#### 1、资产管理计划参与关联方证券的情况

本报告期内，管理人根据本集合计划合同约定、产品投资策略，并经内部审批，投资22联投02，数量80,000.00张，交易金额合计8,007,298.63元。该证券属于管理人股东关联方发行的证券。

#### 2、一般关联交易和重大关联交易

本报告期内，本集合计划投资于股东关联方发行的证券22联投02，上述交易属于一般关联交易。

### （七）利益冲突

本报告期内，本集合计划的投资运作不存在可能发生利益冲突的情况。

### （八）其他重大事项

本报告期内，本集合计划未发生涉及投资者权益的其他重大事项。

## 十、备查文件目录

### （一）备查文件目录

- 1、《长江资管乐享月月盈1号集合资产管理计划资产管理合同》等法律文件
- 2、管理人业务资格批件、营业执照
- 3、本报告期内按规定披露的各项公告

### （二）存放地点及查阅方式

地址：上海市浦东新区世纪大道1198号世纪汇一座27层

网址：[www.cjzcg1.com](http://www.cjzcg1.com)

客服电话：4001-166-866

投资者对本报告书如有任何疑问，可咨询管理人长江证券（上海）资产管理有限公司。

长江证券（上海）资产管理有限公司

2023年03月31日