

# 甬证资管季季盈 1 号集合资产管理计划 2023 年度报告

上海甬  
骑

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：2023 年 1 月 1 日-2023 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.....	8
四、集合计划托管人履职报告.....	9
五、集合计划主要财务指标和投资表现.....	10
(一) 主要财务指标.....	10
(二) 投资表现.....	10
七、集合计划财务报表.....	14
(一) 资产负债表.....	14
(二) 利润表.....	16
(三) 净资产变动表.....	17
(四) 财务报表附注.....	18
八、集合计划投资组合报告.....	22
(一) 资产组合情况.....	22
(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.....	22
(三) 投资组合报告附注.....	22
九、集合计划收益分配情况.....	23
十、集合计划份额变动情况.....	23
十一、集合计划运用杠杆情况.....	23
十二、重大事项提示.....	23
十三、备查文件目录.....	24

## 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。

本资产管理计划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：168,049,559.41 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）

执行事务合伙人：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

### （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；

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

回顾 2023 年的债券市场，无风险利率整体下行、“一揽子”化债政策发力、资产荒加剧是主要的关键词。第一阶段：年初到 2 月末，市场对疫后经济复苏具有较强预期，叠加天量信贷对资金面带来的压力，长债利率有所上行并高位震荡；第二阶段：3 月初到 8

月中下旬，通胀下行，经济基本面上升斜率不及市场预期，叠加降息降准等宽货币举措，长债利率重回下行趋势；第三阶段：8月中下旬至11月末，“防空转”叠加财政发力、政府债供给放量，资金面偏紧，利率小幅回升。而10月份地方政府再融资债批量发行，“一揽子”化债政策开始发力，叠加一级信用债新发减少，“资产荒”现象加剧，信用利差开始急剧收窄，信用债整体走强；第四阶段：11月末至年末，稳增长政策力度被市场预期逐步消化，宽货币信号及预期较强，10年期国债收益率在年末下行至2.57%左右。全年来看，10年期国债年内呈现“M”型走势，整体下行约25BP，无风险利率再下台阶。地方政府债务化解政策下，信用债资产稀缺性提高，信用利差大幅收缩，在4季度以来走出了显著的趋势性牛市。

在2023年度的投资中，我们整体较好的把握住了市场机会。年初，我们在信用利差高位开始着手布局，对剩余期限在1年以内的信用债资产进行较大力度的配置，把产品杠杆水平提升到较高水平，把握住了3、4月份短端信用债信用利差快速收窄的趋势性行情；4到6月份，我们在维持杠杆在较高水平的同时，开始着手提升产品的久期水平，也抓住了信用债期限利差持续收窄的投资机会；3季度利率债市场承压，波动加剧，我们坚定信用债配置不动摇，通过深入研究挖掘信用资产配置机会，有效的控制了账户回撤水平；而年末则是收获的季节，随着“一揽子化债政策”的落地，信用利差快速压缩，无风险利率也快速下行，高杠杆和此前抬升久期的策略在这一阶段也取得了较大的收获。

展望后市，虽然我国经济复苏势头良好，但是在宏观和微观层面仍然存在一定的“温差”，这种“温差”的一个来源是价格因素。GDP增速的完美答卷彰显了宏观经济体感上的“温暖”，而CPI和PPI的负增长让微观层面感到了一些“寒冷”。下一步努力提升通胀水平，降低社会实际利率水平，通畅“宽货币”向“宽信用”的传导可能是政策面上的重要课题。因此，维持适度宽松的货币环境，推动社会融资成本的进一步下行可能是一个阶段的政策重心，而这样的环境对债券市场无风险利率中枢的下行有较好的促进作用，因此我们对未来的债券市场依旧抱有信心。

## （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	2023年1月1日-2023年12月31日
1	期初单位集合计划资产净值	1.0365
2	期末单位集合计划资产净值	1.1121
3	期末单位集合计划累计资产净值	1.1321
4	期末集合计划资产净值	168,049,559.41
5	本期集合计划利润	19,398,062.44
	其中：本期公允价值变动损益	7,532,254.00
6	本期集合计划累计单位净值增长率%	7.16
7	集合计划累计单位净值增长率%	13.21

### （二）投资表现

截止到2023年12月31日，本集合计划单位净值为1.1121元，本期集合计划累计单位净值增长率为7.16%，集合计划单位累计资产净值为1.1321元，累计净值增长率为13.21%。

## 六、集合计划审计报告

### 审计报告

上会师报字(2024)第 4835 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2023年12月31日的资产负债表,2023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2023年12月31日的财务状况以及2023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 2023 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

二〇二四年四月十六日

## 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

2023 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	134,160.20	273,902.18
结算备付金	2	2	-	778,829.24
存出保证金	3	3	3,221.98	2,912.04
衍生金融资产	4		-	-
应收清算款	5		-	-
应收利息	6		-	-
应收股利	7		-	-
应收申购款	8		-	-
买入返售金融资产	9	4	-	112,113,938.35
发放贷款和垫款	10		-	-
交易性金融资产	11	5	226,291,079.56	347,547,635.62
其中：股票投资	12		-	-
基金投资	13		-	-
债券投资	14		226,291,079.56	347,547,635.62
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		226,428,461.74	460,717,217.43

## 甬证资管季季盈1号集合资产管理计划 资产负债表

2023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	6	58,179,678.56	51,030,431.91
应付管理人报酬	28	7	126,962.46	360,801.64
应付托管费	29	8	8,464.14	24,053.42
应付销售服务费	30		-	-
应付投资顾问费	31		-	-
应交税费	32	9	33,996.87	57,949.05
应付清算款	33		-	-
应付赎回款	34		-	-
应付利息	35		-	-
应付利润	36		-	-
其他负债	37	10	29,800.30	29,673.66
负债合计	38		58,378,902.33	51,502,909.68
净资产：				
实收资金	39	11	151,109,119.88	394,792,284.64
其他综合收益	40		-	-
未分配利润	41	12	16,940,439.53	14,422,023.11
净资产合计	42		168,049,559.41	409,214,307.75
负债及净资产总计	43		226,428,461.74	460,717,217.43

注：报告截止日计划单位净值 1.1121 元，计划份额总额 151,109,119.88 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

2023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		23,341,319.31	18,130,207.80
利息收入	2	13	975,018.34	3,987,692.22
投资收益（损失以“-”填列）	3	14	14,834,046.97	19,984,535.58
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	15	7,532,254.00	-5,842,020.00
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		3,943,256.87	4,354,196.40
管理人报酬	9	16	1,932,158.44	2,805,862.96
其中：暂估管理人报酬	10		-	-
托管费	11	17	58,903.23	88,015.47
销售服务费	12		-	-
投资顾问费	13		-	-
利息支出	14	18	1,838,676.39	1,319,943.84
信用减值损失	15		-	-
税金及附加	16	19	59,879.42	87,174.13
其他费用	17	20	53,639.39	53,200.00
三、利润总额	18		19,398,062.44	13,776,011.40
减：所得税费用	19		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	20		19,398,062.44	13,776,011.40
五、其他综合收益的税后净额	21			
六、综合收益总额	22		19,398,062.44	13,776,011.40



### (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

2023 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	394,792,284.64	-	14,422,023.11	409,214,307.75	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、本年初余额	394,792,284.64	-	14,422,023.11	409,214,307.75	248,584,290.56	-	5,161,810.87	253,746,101.43
三、本年增减变动额（减少以“-”号填列）	-243,683,164.76	-	2,518,416.42	-241,164,748.34	146,207,994.08	-	9,260,212.24	155,468,206.32
（一）综合收益总额	-	-	19,398,062.44	19,398,062.44	-	-	13,776,011.40	13,776,011.40
（二）产品持有人申购和赎回	-243,683,164.76	-	-16,879,646.02	-260,562,810.78	146,207,994.08	-	455,886.63	146,663,880.71
其中：产品申购	236,943,108.23	-	14,466,891.77	251,410,000.00	557,175,897.03	-	17,201,655.97	574,377,553.00
产品赎回	-480,626,272.99	-	-31,346,537.79	-511,972,810.78	-410,967,902.95	-	-16,745,769.34	-427,713,672.29
（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	151,109,119.88	-	16,940,439.53	168,049,559.41	394,792,284.64	-	14,422,023.11	409,214,307.75

## （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	134,160.20	273,902.18
其中：应收利息	33.85	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
其中：应收利息	-	373.78
深交所	-	23,292.40
其中：应收利息	=	11.55
合计	=	<u>778,829.24</u>

### 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	3,221.98	2,538.06
其中：应收利息	1.54	1.21
深交所交易保证金		373.98
其中：应收利息	=	<u>0.22</u>
合计	<u>3,221.98</u>	<u>2,912.04</u>

### 4、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
其中：应收利息	-	148,938.35

### 5、交易性金融资产

项目	期末余额	上年年末余额
债券投资	226,291,079.56	347,547,635.62
其中：应收利息	4,880,059.56	8,091,635.62

### 6、卖出回购金融资产款

项目	期末余额	上年年末余额
银行间质押式回购	30,141,475.78	30,017,199.04
上交所债券质押式协议回购	28,038,202.78	-
上交所质押式回购	=	<u>21,013,232.87</u>
合计	<u>58,179,678.56</u>	<u>51,030,431.91</u>
其中：应付利息	80,043.71	30,676.91

## 7、应付管理人报酬

项目	期末余额	上年年末余额
管理费	126,962.46	360,801.64

## 8、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	8,464.14	24,053.42

## 9、应交税费

项目	期末余额	上年年末余额
增值税	30,354.35	51,740.22
城建税	2,124.80	3,621.82
教育税及附加	910.63	1,552.21
地方教育税及附加	607.09	1,034.80
合计	<u>33,996.87</u>	<u>57,949.05</u>

## 10、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	4,500.30	4,373.66
合计	<u>29,800.30</u>	<u>29,673.66</u>

## 11、实收资金

项目	计划份额
上年年末金额	394,792,284.64
本年申购	236,943,108.23
本年赎回	-480,626,272.99
期末金额	151,109,119.88

注：集合计划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。

## 12、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	18,311,119.02	-3,889,095.91	14,422,023.11
本期净利润	11,865,808.44	7,532,254.00	19,398,062.44
本期计划份额交易产生的变动数	-15,473,797.32	-1,405,848.70	-16,879,646.02
其中：计划申购款	14,620,516.37	-153,624.60	14,466,891.77
计划赎回款	-30,094,313.69	-1,252,224.10	-31,346,537.79
本期已分配利润	-	-	-
其他	-	-	-

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
期末余额	14,703,130.14	2,237,309.39	16,940,439.53

### 13、利息收入

项目	本期金额	上期金额
存款利息收入	78,987.57	50,869.53
其中：活期存款利息收入	74,031.75	46,266.17
备付金利息收入	4,915.93	4,568.00
保证金利息收入	39.89	35.36
买入返售金融资产利息收入	922,911.75	4,062,227.61
减：利息收入增值税	<u>26,880.98</u>	<u>125,404.92</u>
合计	<u>975,018.34</u>	<u>3,987,692.22</u>

### 14、投资收益

项目	本期金额	上期金额
基金红利收益	-	-
债券投资收益	15,313,663.67	20,589,925.45
减：投资收益增值税	472,114.20	601,046.15
交易费用	<u>7,502.50</u>	<u>4,343.72</u>
合计	<u>14,834,046.97</u>	<u>19,984,535.58</u>

### 15、公允价值变动收益

项目	本期金额	上期金额
债券投资	7,532,254.00	-5,842,020.00

### 16、管理人报酬

项目	本期金额	上期金额
业绩报酬	1,048,608.71	1,485,631.25
管理费	<u>883,549.73</u>	<u>1,320,231.71</u>
合计	<u>1,932,158.44</u>	<u>2,805,862.96</u>
其中：暂估管理人报酬	-	-

注：暂估管理人报酬事项说明：暂估管理人报酬指暂估业绩报酬，合同中业绩报酬计提原则，不涉及暂估事项，故审计财务报表中，暂估管理人报酬为 0 元。根据 2022 年财政部关于印发《资产管理产品相关会计处理规定》的通知，需对暂估管理人报酬列示和披露，根据注册登记机构测算，截至 2023 年 12 月 31 日，本计划暂估管理人报酬【 1,490,052.90 】元，暂估管理人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。

### 17、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	58,903.23	88,015.47

## 18、利息支出

项目	本期金额	上期金额
卖出回购利息支出	1,838,676.39	1,319,943.84

## 19、税金及附加

项目	本期金额	上期金额
城建税附加	34,929.66	50,851.58
教育税附加	14,969.85	21,793.53
地方教育税附加	9,979.91	14,529.02
合计	59,879.42	87,174.13

## 20、其他费用

项目	本期金额	上期金额
账户维护费	37,200.00	37,200.00
审计费	16,000.00	16,000.00
税费	-	-
其他	439.39	-
合计	53,639.39	53,200.00

## 八、集合计划投资组合报告

### （一）资产组合情况

日期：2023-12-31

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	226,291,079.56	99.94
	其中：债券	226,291,079.56	99.94
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	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	134,160.20	0.06
6	其他资产	3,221.98	0.00
7	合计	226,428,461.74	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（%）
250442	23 商古 D1	200,000.00	21,184,405.48	12.61
177097	20 合投 01	200,000.00	20,939,649.32	12.46
194653	22 聚鑫 V1	200,000.00	20,868,734.25	12.42
102281078	22 淄博高新 MTN001	200,000.00	20,800,808.74	12.38
101901555	19 港兴港投 MTN004	200,000.00	20,407,426.23	12.14

### （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

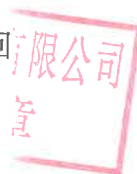
本报告期内，无收益分配情况。

## 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）
394,792,284.64	236,943,108.23	480,626,272.99	151,109,119.88

## 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 58,179,678.56 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。2023年3月14日，本计划管理人完成注册资本增加的工商变更登记手续，并取得上海市市场监督管理局换发的《营业执照》，管理人当前注册资本为4亿元整。

（四）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。

（五）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。

（六）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。

(七) 本报告期末, 本集合计划规模(含利息转份额)共计 15110.91 万份, 参与投资者 23 个, 其中个人投资者 17 个, 机构投资者 2 个, 产品投资者 4 个。截至本报告期末, 管理人自有资金认购本集合计划份额 2248.47 万份(含利息转份额), 占总份额比例为 14.88%; 管理人从业人员及其配偶认购份额 50.00 万份(含利息转份额), 占总份额比例为 0.33%; 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 369.78 万份(含利息转份额), 占总份额比例为 2.45%。

(八) 本报告期内, 没有其他涉及投资者利益的重大事项。

## 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

2024 年 4 月 26 日