

太平洋证券稳健增强1号集合资产管理计划

2023年年度管理报告

(报告期: 2023年1月1日-2023年12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。

本报告中财务资料已经审计。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12月26日 |
| 成立规模 | 47,161,865.80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 年度市场回顾

2023 年国内外宏观经济与金融市场围绕两大预期差展开。国内方面，国内基本面修复的“强预期”落空，逐步被“弱现实”取代；国外方面，美国在中小银行危机后未陷入衰退，经济韧性超预期。大类资产走势上，国内债券市场表现强于权益市场，海外权益市场在美债利率整体上行背景下仍表现强劲。

基本面方面，2023 年 GDP 为 1260582 亿元，比上年增长 5.2%，分季度增速分别为 4.5%、6.3%、4.9%和 5.2%。规模以上工业增加值同比在 3.9%-5.6%区间，均较 22 年有所修复；但是价格方面，核心 CPI 同比维持在 1.0%以下，PPI 同比低位回落，反映出经济的产出缺口有待弥合。资产方面表现股弱债强，人民币汇率承压，大宗商品价格下行。

债市方面，2023 年整体走牛，宏观经济新旧动能切换仍是大背景，微观主体活力和融资需求不足，但财政偏紧、货币偏松，“大行放贷，小行买债”贡献

做多力量。利率波动区间依然很窄，十年国债顶点从2.9%-2.8%-2.7%逐级下行，但2.5%的“历史底”看似仍然稳固。

信用债方面，2023年信用债市场走势明确，主线清晰。年初在赎回潮后利差从高位快速回落，年中在部分地区城投舆情扰动下短暂进入迷茫期。下半年城投化债主线得以明确，城投市场下沉行情轰轰烈烈，各地区的收益空间被充分挖掘。而到了年末，城投融资监管边际趋紧，供给难以放量，信用市场配置需求向城农商行二永债、城投美元债等板块蔓延。

股市方面，2023年国内经济运行平稳，但也存在社会预期偏弱，有效需求不足，部分行业产能过剩等问题，给权益市场走势带来一定压力。上证综指全年下跌3.70%，深证成指下跌13.54%，创业板指下跌19.41%。市场风格来看，TMT、中特估、高股息策略、低估值风格等均有出现阶段性行情。

核心资产与经济复苏水平相关性较高，因此我们密切跟踪经济复苏相关数据，保持了对经济复苏情况的动态评估。本产品2023年在权益投资方面继续采取了防守策略，控制了股票仓位，阶段性使用了衍生工具对冲部分市场风险。

2、2024年市场展望

展望2024年，基本面方面，国内宏观处于新旧动能切换中，经济增长预期抬升，但受政策拉动特征明显，内生动力依然不强，经济增长或先抑后扬。外部方面，美国加息有望放缓，但中美可能长期维持高利差。2024年政策是宽财政、地方控债务、宽货币、地产持续刺激的政策组合，央行和财政的配合成为影响债市波动的因素。货币政策方面，汇率掣肘有所缓解，货币政策预计仍然宽松以配合财政发力，上半年宽松力度或将大于下半年；降准降息仍然可期，结构性工具也会成为投放基础货币的重要方式。财政政策方面，2024年，将沿着中央加杠杆、地方化风险、整体稳增长的“三大主线”，主要聚焦城中村改造、保障性住房建设和“平急两用”公共基础设施建设的“三大工程”，防范化解地产和地方债务风险，通过扩大赤字率及财政支出方式实施“财政主导，货币配合”的宏观调控政策，财政政策与货币政策的协同效应机制将进一步强化。

债市方面，预计上半年我国经济增长偏弱，仍需加大货币宽松力度扶持，资金利率中枢处于相对低位，利率债供给量少于下半年，加之银行、理财产品和保险的配置需求较为旺盛，债券收益率处于低位震荡态势。下半年，随着经济情况

好转，货币宽松力度收敛，资金利率中枢上升，利率债供给压力释放，市场偏好改善，A股趋势性回升，债券收益率将震荡上行。此外，境外机构的中债需求有望增加，抑制债券收益率的上行幅度。

信用债方面，2024年信用债将维持供不应求的格局。预计上半年信用债收益率将维持低位震荡，下半年跟随利率债收益率震荡上行。目前信用利差已处于历史低位，进一步压缩空间有限，预计全年信用利差仍将保持低位震荡。在化债政策的利好下，城投债短期风险可控，短久期下沉和好资质拉久期策略仍然占优。

可转债方面，2024年以结构性行情为主。随着提振经济的政策不断出台，板块机会可以关注，主要聚焦在高端制造产业升级、AI、TMT，高股息现金流稳定的公用事业和能源行业等。

股市方面，中央经济工作会议积极定调，要巩固和增强经济回升向好态势，强化宏观政策逆周期和跨周期调节，继续实施积极的财政政策和稳健的货币政策。随着政策起效与政策加码，经济复苏趋势将不断被验证。市场对经济预期和政策目标存在较大潜在空间，叠加外围环境更加温和，权益市场当前处于战略性底部区域，具备良好的长期配置价值。

展望后市，随着雪球敲入、量化基金被动减仓等流动性负反馈快速出清，市场有望企稳回升。配置方面，本产品操作上将把握市场节奏，增配部分性价比良好的核心资产标的。

四、托管人履职情况

本托管人依据太平洋证券稳健增强1号集合资产管理计划的合同与托管协议，自计划成立日起托管“太平洋证券稳健增强1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，本托管人严格遵守《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，本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，未发现其存在损害本计划委托人利益的行为。

本托管人认真复核了本报告期《太平洋证券稳健增强1号集合资产管理计划2023年年度管理报告》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12月31日，本产品的单位净值为1.0903元，累计单位净值为1.4513元，本报告期份额净值增长率为9.38%。

（二）主要财务指标

日期：2023-01-01~2023-12-31

单位：元

| | |
|-------------|----------------|
| 本报告期利润 | 8,945,482.36 |
| 本报告期末资产净值 | 117,563,709.67 |
| 本报告期末份额净值 | 1.0903 |
| 本报告期末累计份额净值 | 1.4513 |
| 本报告期份额净值增长率 | 9.38% |

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

若本报告期末未分红，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：2023-12-31

单位：元

| 资产 | 期末余额 | 年初余额 | 负债与持有人权益 | 期末余额 | 年初余额 |
|----------|----------------|----------------|------------|----------------|----------------|
| 资产： | | | 负债： | | |
| 银行存款 | 45,938.29 | 944,410.18 | 短期借款 | 0.00 | 0.00 |
| 结算备付金 | 3,069,480.18 | 3,632,029.90 | 交易性金融负债 | 0.00 | 0.00 |
| 存出保证金 | 6,127.52 | 12,051.60 | 衍生金融负债 | 0.00 | 0.00 |
| 交易性金融资产 | 0.00 | 0.00 | 卖出回购金融资产款 | 18,997,338.95 | 7,797,601.14 |
| 其中：股票投资 | 135,467,255.65 | 129,971,178.70 | 应付清算款 | 180,796.49 | 104,562.74 |
| 债券投资 | 0.00 | 0.00 | 应付赎回款 | 0.00 | 0.00 |
| 基金投资 | | | 应付管理人报酬 | 1,802,913.26 | 709,064.36 |
| 权证投资 | 0.00 | 0.00 | 应付托管费 | 8,730.21 | 9,648.59 |
| 资产支持证券投资 | | | 应付销售服务费 | 0.00 | 0.00 |
| 衍生金融工具 | 143,691.60 | 47,179.04 | 应付投资顾问费 | 0.00 | 0.00 |
| 买入返售金融资产 | 0.00 | 0.00 | 应交税费 | 163,221.34 | 88,262.83 |
| 应收证券清算款 | 0.00 | 0.00 | 应付利息 | 0.00 | 0.00 |
| 应收利息 | 0.00 | 0.00 | 应付利润 | 0.00 | 0.00 |
| 应收股利 | 0.00 | 0.00 | 其他负债 | 15,783.32 | 22,923.37 |
| 应收申购款 | | | 负债合计 | 21,168,783.57 | 8,732,063.03 |
| 其他资产 | | | 所有者权益 | | |
| | | | 实收资金 | 107,824,328.46 | 117,591,610.27 |
| | | | 其他综合收益 | | |
| | | | 未分配利润 | 9,739,381.21 | 8,283,176.12 |
| | | | 所有者权益合计 | 117,563,709.67 | 125,874,786.39 |
| 资产合计 | 138,732,493.24 | 134,606,849.42 | 负债和所有者权益总计 | 138,732,493.24 | 134,606,849.42 |

2、经营业绩表

日期：2023年1月~2023年12月

单位：元

| 序号 | 项目 | 本期金额 | 上年金额 |
|----|--------------------------|---------------|---------------|
| 1 | 一、收入 | 12,353,438.74 | 6,971,628.62 |
| 2 | 1. 利息收入 | 26,150.68 | 14,010.57 |
| 3 | 2. 投资收益（损失以“-”填列） | 10,542,298.62 | 9,258,189.44 |
| 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） | 1,784,989.44 | -2,300,571.39 |
| 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 | 3,407,956.38 | 1,598,895.04 |
| 9 | 1. 管理人报酬 | 2,715,964.70 | 1,328,065.88 |
| 10 | 2. 托管费 | 37,614.78 | 31,578.09 |
| 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 | 577,856.82 | 168,651.19 |
| 14 | 其中：卖出回购金融资产利息支出 | 577,856.82 | 168,651.19 |
| 15 | 6. 信用减值损失 | 0.00 | 0.00 |
| 16 | 7. 税金及附加 | 37,468.74 | 15,440.64 |
| 17 | 8. 其他费用 | 39,051.34 | 55,159.24 |
| 18 | 三、利润总额 | 8,945,482.36 | 5,372,733.58 |
| 19 | 减：所得税费用 | — | — |
| 20 | 四、净利润 | 8,945,482.36 | 5,372,733.58 |
| 21 | 五、其他综合收益 | | |
| 22 | 六、综合收益总额 | 8,945,482.36 | 5,372,733.58 |

3、所有者权益变动表

日期：2023年1月~2023年12月

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 | 117,591,610.27 | | 8,283,176.12 | 125,874,786.39 | 84,791,779.26 | | 5,548,671.93 | 90,340,451.19 |
| 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 | 117,591,610.27 | | 8,283,176.12 | 125,874,786.39 | 84,791,779.26 | | 5,548,671.93 | 90,340,451.19 |
| 6 | 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | -9,767,281.81 | | 1,456,205.09 | -8,311,076.72 | 32,799,831.01 | | 2,734,504.19 | 35,534,335.20 |
| 7 | （一）综合收益总额 | | | 8,945,482.36 | 8,945,482.36 | | | 5,372,733.58 | 5,372,733.58 |
| 8 | （二）产品持有人申购和赎回 | -9,767,281.81 | | -914,383.43 | -10,681,665.24 | 32,799,831.01 | | 4,183,830.27 | 36,983,661.28 |

| | | | | | | | | |
|----|--------------------------|--------------------|-------------------|--------------------|--------------------|-------------------|--------------------|--|
| | 回 | | | | | | | |
| 9 | 其中：1、产品 申购 | 53,382,49 1.00 | 5,701,8 07.67 | 59,084,2 98.67 | 67,530,334 .11 | 7,694,1 80.77 | 75,224,5 14.88 | |
| 10 | 2、产品 赎回 | -63,149,7 72.81 | -6,616, 191.10 | -69,765, 963.91 | -34,730,50 3.10 | -3,510, 350.50 | -38,240, 853.60 | |
| 11 | (三) 利润分 配 | | -6,574, 893.84 | -6,574,8 93.84 | | -6,822, 059.66 | -6,822,0 59.66 | |
| 12 | (四) 其他综 合收益结转留 存收益 | | | | | | | |
| 13 | 四、本期期末 余额 | 107,824,3 28.46 | 9,739,3 81.21 | 117,563, 709.67 | 117,591,61 0.27 | 8,283,1 76.12 | 125,874, 786.39 | |

(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 | 8,729,027.52 | 6.29% |
| 基金 | 1,042,120.00 | 0.75% |
| 现金 (银行存款及清算备付金) | 3,115,418.47 | 2.25% |
| 债券投资 | 125,696,108.13 | 90.60% |
| 其他资产 | 149,819.12 | 0.11% |
| 合计 | 138,732,493.24 | 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 | 152584 | 20 云建 03 | 80,000.00 | 8,601,764.38 | 7.32 |
| 2 | 032300558 | 23 豫能化 PPN001 | 70,000.00 | 7,030,482.51 | 5.98 |
| 3 | 155477 | 19 联想 03 | 60,000.00 | 6,150,197.26 | 5.23 |
| 4 | 188011 | 21 筑城 02 | 50,000.00 | 5,210,280.82 | 4.43 |
| 5 | 042380370 | 23 潍坊水务 CP004 | 50,000.00 | 5,193,174.86 | 4.42 |
| | 合计 | | 310,000.00 | 32,185,899.83 | 27.38 |

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 | 117,591,610.27 |
| 报告期内集合计划总申购份额 | 53,382,491.00 |
| 报告期内集合计划总赎回份额 | 63,149,772.81 |
| 报告期末集合计划份额总额 | 107,824,328.46 |

(四) 参与股指期货的有关情况:

本报告期内本集合计划参与股指期货的投资损益为-123,940.00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,本集合计划的融资金额占本集合计划资产净值的比例为16.16%。

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)

本计划的托管费按前一日产品资产净值计算,按日计提,按季支付。由托管人根据与管理人的指令,在每季初的前5个工作日内从集合计划资产中一次性支付。若因战争、自然灾害等不可抗力或法定节假日致使无法按时支付的,则在不可抗力情形消除后或法定节假日终止后的首个工作日支付。本合同终止(包括提前或延期)后,依据清算程序支付托管人尚未支付的托管费。

(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0.5%的年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 0.5\% \div 365$$

H为管理人当日计提的管理费

E为前一日计划资产净值（首日按本计划初始资金金额）

按前一日计划资产净值计算，按日计提，按季支付。由托管人根据与管理人的指令，在每季初的前5个工作日内从集合计划资产中一次性支付。若因战争、自然灾害等不可抗力或法定节假日致使无法按时支付的，则在不可抗力情形消除后或节假日终止后的首个工作日支付。产品终止后，依据清算程序支付管理人尚未支付的管理费。

（三）业绩报酬

本集合计划业绩报酬计入管理费。

1. 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. 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）。

3. 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)，管理人不得提取业绩报酬；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：

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

$$\text{其中, } B_i = \sum_{t=1}^n \frac{r_{it}}{365} - \sum_{t=1}^m \frac{r_{it}}{365}, n \geq m; \text{ 当 } \frac{\text{NAV}_e - \text{NAV}_{is}}{\text{NAV}_{is}} \leq B_i \text{ 时, } H_i = 0;$$

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

其中：

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。

九、产品收益分配情况

本报告期内进行收益分配，金额为8,232,303.13元，提取业绩报酬金额2,089,050.74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

本报告期内投资经理未发生变更。

（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，本集合计划合同进行了变更并于2023年3月15日生效，具体变更情况详见管理人网站相关公告。

十一、管理员工跟投情况

截止报告期末，管理员工及其配偶、利害关系人共持有本集合计划合计2,376,418.02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


太平洋证券股份有限公司
2024年4月30日