

太平洋证券均盈优选 FOF1 号集合资产管理计划
2023 年第 3 季度管理报告
(报告期: 2023 年 07 月 01 日-2023 年 09 月 30 日)



管理人: 太平洋证券股份有限公司
托管人: 国泰君安证券股份有限公司



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	太平洋证券均盈优选 FOF1 号集合资产管理计划
产品类型	混合类
成立日期	2018 年 9 月 18 日
成立规模	3340 万
存续期限	10 年
产品风险等级	R4 中高风险
适合推广对象	C4 积极型、C5 激进型

三、管理人履职报告

（一）投资经理简介

1、姓名：王丹凤

（1）从业简历：2020 年 3 月加入太平洋证券资产管理总部，现任资产管理总部投资经理。2017 年起开始从事基金尽调工作。

（2）学历及兼职情况：上海交通大学管理学硕士学位。无兼职情况。

(3) 业务经验情况：具有丰富的基金尽调与分析经验。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 年第 3 季度市场回顾

2023 年 3 季度海外主要经济体因通胀压力持续收紧流动性，政治局会议后国内出台系列政策加大宏观调控力度，3 季度经济逐步企稳，股票市场短暂冲高后显著回调。当季上证指数下跌 2.86%，深证成指下跌 8.32%。

太平洋证券均盈优选 FOF1 号集合资产管理计划当季适度降低权益基金仓位，涉及的主要板块为大消费、非银和指数基金。

2、2023 年第 4 季度市场展望

展望四季度，海外流动性收紧逐步进入尾声但仍有一定的不确定性，高利率持续时间的风险值得关注。国内经济整体平稳，政策预计将持续对经济形成托底。权益市场预计仍以结构性行情为主。

四、托管人履职情况

本托管人依据太平洋证券均盈优选 FOF1 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“太平洋证券均盈优选 FOF1 号集合资产管理计划”（以下简称“本计划”）的全部资产。

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。

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，未发现其存在任何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《太平洋证券均盈优选 FOF1 号集合资产管理计划 2023 年第 3 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 9 月 30 日，本产品的份额净值为 1.2180 元，份额累计净值为 1.4935 元，本报告期份额净值增长率为-2.58%。

(二) 主要财务指标

日期：2023-07-01~2023-09-30

单位：元

集合计划本期利润	-579,970.01
期末集合计划资产净值	17,502,946.26
期末单位集合计划份额净值	1.2180
期末单位集合计划份额累计净值	1.4935
本期集合计划净值增长率	-2.58%
集合计划累计净值增长率	54.13%

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

(三) 财务报表

1、资产负债表

日期：2023-09-30

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	977,817.38	592,296.24	短期借款	0.00	0.00

结算备付金	0.00	0.00	交易性金融负债	0.00	0.00
存出保证金	848,578.18	2,412,840.25	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	0.00	0.00
交易性金融资产	15,757,929.17	32,101,331.57	应付清算款	0.00	0.00
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	0.00	0.00	应付管理人报酬	57,349.12	96,739.41
债权投资	0.00	0.00	应付托管费	16,718.11	4,836.99
其他债权投资	0.00	0.00	应付销售服务费	0.00	0.00
应收清算款	0.00	525,860.00	应付投资顾问费	0.00	0.00
应收利息	0.00	0.00	应交税费	0.00	0.00
应收股利	168.96	90,458.68	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	7,480.20	20,000.00
			负债合计	81,547.43	121,576.40
			所有者权益		
			实收资金	14,369,706.88	28,486,488.39
			其他综合收益	0.00	0.00
			未分配利润	3,133,239.38	7,114,721.95
			所有者权益合计	17,502,946.26	35,601,210.34
资产合计	17,584,493.69	35,722,786.74	负债和所有者权益总计	17,584,493.69	35,722,786.74

2、经营业绩表

日期：2023 年 07 月~2023 年 09 月

单位：元

序号	项目	本期数	上期数
1	一、收入	-503,189.82	-747,838.99
2	1.利息收入	2,041.22	4,451.96
3	2.投资收益（损失以“-”填列）	-43,299.52	-294,464.21
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）	-461,931.52	-457,826.74
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	76,780.19	65,939.46
9	1.管理人报酬	57,349.12	70,226.61
10	2.托管费	16,718.11	3,511.29
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	0.00	0.00
14	其中：卖出回购金融资产利息支出	0.00	0.00
15	6.信用减值损失	0.00	0.00
16	7.税金及附加	192.16	-291.84
17	8.其他费用	2,520.80	-7,506.60
18	三、利润总额	-579,970.01	-813,778.45
19	减：所得税费用	—	—
20	四、净利润	-579,970.01	-813,778.45
21	五、其他综合收益	0.00	0.00
22	六、综合收益总额	-579,970.01	-813,778.45

3、所有者权益变动表

日期：2023 年 07 月~2023 年 09 月

单位：元

序号	项目	本期金额			上期金额		
		实收基金	未分配利润	所有者权益	实收基金	未分配利润	所有者权益
1	一、上期期末余额	18,824,297.29	4,710,894.60	23,535,191.89	22,392,390.95	6,480,973.33	28,873,364.28
2	加：会计政策变更	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
3	前期差错更正	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
4	其他	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
5	二、本期期初余额	18,824,297.29	4,710,894.60	23,535,191.89	22,392,390.95	6,480,973.33	28,873,364.28
6	三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-4,454,590.41	-1,577,655.22	-6,032,245.63	-3,568,093.66	-1,770,078.73	-5,338,172.39
7	(一) 综合收益总额	0.00	-579,970.01	-579,970.01	0.00	-813,778.45	-813,778.45

8	(二) 产品持有人申购和赎回	-4,454,590.41	-997,685.21	-5,452,275.62	-3,568,093.66	-956,300.28	-4,524,393.94
9	其中: 1、产品申购	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
10	2、产品赎回	-4,454,590.41	-997,685.21	-5,452,275.62	-3,568,093.66	-956,300.28	-4,524,393.94
11	(三) 利润分配	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
12	(四) 其他综合收益结转留存收益	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
13	四、本期期末余额	14,369,706.88	3,133,239.38	17,502,946.26	18,824,297.29	4,710,894.60	23,535,191.89

(四) 投资资产管理产品的标准

本集合计划管理人精选市场中优秀金融产品，综合考虑投资回报与风险，合理配置不同风格的金融产品。同时根据市场行情变化，动态调整不同产品间的配置结构，力争提升产品收益。通过对投资对象的风险收益特征分析以及投资特性分析，使用定量分析和定性分析两方面的方法精选符合条件的金融产品进行投资。

(五) 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	0.00	0.00
基金	15,757,929.17	89.61%
债券	0.00	0.00
权证	0.00	0.00
资产支持证券	0.00	0.00
理财产品投资	0.00	0.00
货币市场工具(票据、CD)	0.00	0.00
现金(银行存款及清算备付金)	977,817.38	5.56%
银行定期存款(定期存款、通知存款、大额存单)	0.00	0.00
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)	848,747.14	4.83%
资产合计	17,584,493.69	100.00%

注: 其他资产包括“交易保证金”、“应收利息”等项目。

(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)	占组合净值比例(%)
1	159650	国开ETF	22,000.00	2,245,320.00	12.83
2	166301	华商新趋势优选灵活配置混合	221,429.50	2,054,422.90	11.74

3	511360	短融 ETF	18,800.00	2,030,381.20	11.60
4	001678	英大国企改革主题股票	1,162,229.77	1,959,403.17	11.19
5	001959	华商乐享互联灵活配置混合 A	668,541.79	1,430,010.89	8.17
		合计	2,093,001.06	9,719,538.16	55.53

注：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，因四舍五入，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

(三) 本报告期内份额变动情况如下：

期初集合计划份额总额	18,824,297.29
报告期内集合计划总申购份额	0.00
报告期内集合计划总赎回份额	4,454,590.41
报告期末集合计划份额总额	14,369,706.88

(四) 参与股指期货、国债期货的有关情况：

本报告期内，本集合计划未直接参与股指期货和国债期货。截至本报告期末，本集合计划未直接持有任何股指期货和国债期货。

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 0%。

八、产品费用计提基准、计提方式和支付方式

(一) 托管费：托管费的年费率为【0.05】%；

(二) 管理费：管理费的年费率为【1】%；

(三) 管理人的业绩报酬：本计划业绩报酬计提基准为【8%】/年，超出业绩报酬计提基准的持有期差额收益按【X%】（具体以管理人官网公告为准，最高不超过 60%）比例进行计提。

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

本集合计划在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

本集合计划在报告期内无涉及影响投资者权益的重大事项。

十一、管理人董事、监事、从业人员及其配偶和其他利害关系人、 控股股东、实际控制人或者其他关联方参与本集合计划情况

截至本报告期末，太平洋证券均盈优选 FOF1 号产品员工跟投份额共计 530,001.89 份，管理人会对本集合计划账户进行持续监控。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
2023 年 10 月 27 日



五