

太平洋卓越十八号混合型产品 2016 年一季度业务管理报告

2016 年 3 月 31 日

产品管理人：太平洋资产管理有限责任公司

产品托管人： 建设银行股份有限公司



§ 1 重要提示

太平洋资产管理有限责任公司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，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担相关责任。

产品管理人承诺以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用产品资产，但不保证集合产品一定盈利，也不保证最低收益。

产品的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资人在作出投资决策前应仔细阅读本产品的招募说明书。

本报告期中的财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 2016 年 3 月 31 日止。

§ 2 “太平洋卓越十八号混合型产品”产品概况

2.1 产品基本情况

产品名称	太平洋卓越十八号混合型产品
产品简称	卓越十八号
产品类型	
产品合同生效日	2015 年 11 月 3 日
产品管理人	太平洋资产管理有限责任公司

2.2 产品说明

投资目标	本产品通过主动投资于沪深两市上市公司的股票及其定向增发，在严格管理风险的前提下，谋求产品资产的持续稳健增值。
投资范围	本产品的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（含沪深主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票及其定向增发等）、债券逆回购、货币市场基金（含场内场外等）、银行存款（含活期存款、定期存款、协议存款、同业存款、通知存款、大额存单等）和产品管理人发行并管理的现金管理类保险资产管理产品。

投资比例	本产品的投资组合比例为： 股票资产占产品总资产的比例为 0%—100%；其余资产投资于债券逆回购、货币市场基金、银行存款和产品管理人发行并管理的现金管理类保险资产管理产品等。
业绩比较基准	无
风险收益特征	本产品属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资品种。

2.3 产品管理人

项 目	产品管理人	
名称	太平洋资产管理有限责任公司	
信息披露负责人	姓名	张云菀
	联系电话	021-33968939
	电子邮箱	http://www.cpic.com.cn/zcgl/
客户服务电话	021-68659993	
传真	021-50106127	

2.4 信息披露方式

登载报告正文的管理人互联网网址	http://www.cpic.com.cn/zcgl/
产品报告备置地点	上海市浦东新区世纪大道 100 号环球金融中心 39 楼

§ 3 管理人报告

3.1 产品管理人及产品投资经理情况

3.1.1 产品管理人简介

本产品管理人为太平洋资产管理有限责任公司。公司于 2006 年 6 月 9 日正式成立，由中国太平洋保险（集团）股份有限公司控股，注册资本为 5 亿元。公司以“诚信天下，稳健一生，追求卓越”为核心价值观，以“专业、稳健、服

务、卓越”为经营理念，经营范围为：管理运用自有资金及保险资金；委托资金管理业务；与资金管理业务相关的咨询业务；国家法律法规允许的其它资产管理业务。

3.1.2 产品投资经理简介

姓名	职务	证券从业年限	说明
曾继东	研究董事	9年	曾继东先生，毕业于上海财经大学金融学研究生硕士。曾任职于太保集团计财部。2007年4月加入太平洋资产管理有限责任公司，任研究部董事。

3.2 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

3.2.1 公平交易制度的执行情况

本产品管理人一贯公平对待旗下管理的所有产品，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。

3.2.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本产品存在异常交易行为。

3.3 管理人对报告期内产品的投资策略和业绩表现的说明

3.3.1 报告期内产品投资策略和运作分析

我们发现，长江电力三年定增项目恰能满足客户的投资需求，经与产品持有人协商一致，将全部资金用于参加长江电力定增项目，在定增项目缴款之前，资金暂用于购买货币基金以增加收益。4月1日，我们已赎回货币基金，完成长江电力的定增缴款工作。

3.3.2 产品内控情况

本报告期内，内控工作以保障公司合规运作、维护产品持有人利益为出发点，由独立的合规和风险管理部对公司后台运行、产品运作、产品销售工作的合规性进行定期和不定期检查，保证各项法规和管理制度的落实。

我公司防范投资风险的核心手段主要包括授权管理、流程控制与专业化作业等等。具体而言：

1、通过对于投资各个环节的风险点分析，建立严密的制度流程规范及制衡体系；

2、以授权管理为核心，根据岗位责任、风险程度及其业务分类进行多纬度的额度控制；

3、利用信息技术手段进行风险的实时拦截和监控，坚持内部控制体系的定期检查与更新；

4、运用先进的风险评估技术，定期进行风险评估，提供风险分析报告。

本产品管理人承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用产品资产，不断提高内部合规和风险管理工作科学性和有效性，努力防范和控制各种风险，充分保障产品持有人的合法权益。

3.4 管理人对投资的简要展望

产品全部资金已用于长江电力三年期定增项目，接下来的工作重点是跟踪项目情况，按时收取红利，验证投资是否符合预期，保持与投行及发行人的沟通。

§ 4 投资组合报告

4.1 期末产品资产组合情况

序号	项目	金额（人民币元）	占产品总资产的比例（%）
1	银行存款	192,671,669.68	99.99%
1.1	其中：定期/协议存款	-	-
2	股票	-	-
3	债券	-	-
4	证券投资基金	11,527.69	0.01%
5	买入返售金融资产	-	-
6	信贷资产支持证券	-	-
7	基础设施投资计划	-	-
8	不动产投资计划	-	-

9	项目资产支持计划	-	-
10	其他各项资产	11,915.13	0.01%
11	合计	192,695,112.50	100.00%

注：截至 2016 年 3 月 31 日，产品份额净值为 1.0088 元，累计产品份额净值为 1.0088 元。

太平洋资产管理有限责任公司

2016 年 3 月 31 日

