

东北证券 6 号核心优势 集合资产管理计划季度报告

(2020 年第三季度)

集合计划管理人：东证融汇证券资产管理有限公司

集合计划托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二〇年十月二十八日

重要提示

本报告依据《中华人民共和国证券法》（中华人民共和国主席令第14号，以下简称《证券法》）、《中华人民共和国证券投资基金法》（中华人民共和国主席令第23号，以下简称《基金法》）、《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》（银发[2018]106号，以下简称《指导意见》）及其他有关规定由集合资产管理计划管理人编制。

中国证监会2011年11月21日对本集合计划出具了核准文件《关于核准东北证券股份有限公司设立东北证券6号核心优势集合资产管理计划的批复》（证监许可[2011]1842号），但中国证监会对本集合计划作出的任何决定，均不表明中国证监会对本集合计划的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明参与本集合计划没有风险。

管理人、托管人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用集合资产管理计划资产，但不保证集合资产管理计划一定盈利，也不保证最低收益。

集合资产管理计划的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本集合资产管理计划说明书。

集合资产管理计划托管人中国建设银行股份有限公司复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，认为复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本报告相关财务资料未经审计。

本报告书中的内容由管理人负责解释。

本报告期间：2020年7月1日至2020年9月30日。

一、集合资产管理计划概况

名称：东北证券6号核心优势集合资产管理计划

类型：非限定性集合资产管理计划

成立日：2012年6月21日

报告期末份额总额：5,094,305,549.99份

存续期：不设固定期限

投资目标：本集合计划在追求集合资产安全的基础上，力争为集合计划份额持有人创造稳定持续的投资收益。

投资范围：国内依法发行的固定收益品种，包括中国境内依法发行的债券、央行票据、短期融资券、资产支持证券、中期票据，保证收益及保本浮动收益商业银行理财计划、银行存款、债券回购以及中国证监会认可的其他投资品种。

管理人：东证融汇证券资产管理有限公司

托管人：中国建设银行股份有限公司

注册登记机构：中国证券登记结算有限责任公司

二、主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	本期数
本期利润扣除本期公允价值变动损益后的净额	68,256,954.55
本期利润	68,256,954.55
期末集合计划资产净值（元）	5,094,305,549.99
期末单位集合计划资产净值（元）	1.0000
期末单位集合计划累计资产净值（元）	1.0000
本期集合计划单位净值增长率	0.00%

三、管理人报告

（一）业绩表现

本集合计划在 2012 年 6 月 21 日成立，截止 2020 年 9 月 30 日，本集合计划单位净值 1.000 元。

（二）投资经理简介

石睿柯先生，吉林大学数量经济学博士，2014 年开始从事证券行业相关工作，在固定收益投资研究方面具备扎实功底。历任东北证券固定收益部承销业务高级经理、投资助理，2016 年 5 月加入东证融汇证券资产管理有限公司，担任投资助理、投资经理，负责债券市场投资交易、产品流动性管理、利率及信用研究等工作。截至报告期末，石睿柯先生担任东北证券元伯 1 号债券优选分级集合资产管理计划、东北证券元伯 2 号债券优选分级集合资产管理计划、东北证券现金管家集合资产管理计划和东北证券 6 号核心优势集合资产管理计划投资经理。

（三）投资经理工作报告

1、市场及投资回顾

2020 年 3 季度，随着国内新冠疫情传播得到有效控制，经济生产活动恢复正常运行，各项经济指标逐步修复。资金利率维持在年内较高水平，3 季度银行间隔夜和 7 天逆回购利率均值分别为 1.87%和 2.33%，债券市场收益率震荡上行，信用利差和期限利差压缩。3 季度末 10 年期国债和 10 年期国开债收益率分别为 3.15%和 3.72%，全季度分别累计上行 32bp 和 62bp。

操作上，本集合计划在 2020 年第三季度的运作中，合理控制产品杠杆和久期，把握交易机会，持续优化债券配置。

2、市场展望及投资策略

市场方面，目前经济仍在疫情的恢复进程当中，前期积压的需求逐步释放，前期政策刺激效果逐渐显现，信用扩张仍在持续，社融指标尚未出现向下拐点，

狭义货币供应量和企业融资结构继续改善,显示实体经济动能较为活跃。需求端,基建和地产的刺激力度有所消退,制造业和消费等指标有望接棒恢复,经济整体韧性仍足。在这种环境下,短期难以看到货币政策的大幅放松,收益率预计继续高位震荡,等待基本面的进一步明确。

策略方面,继续控制组合久期,减少短期市场调整带来的净值回撤,在严控信用风险的前提下,重点挖掘信用债的超额收益,提升产品净值。观测各项经济指标走势,预判货币政策的拐点,把握市场调整节奏,适时参与利率债和转债的波段机会。

(四) 风险控制报告

1、集合计划运作合规性声明

本报告期内,集合计划管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《基金法》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,为集合计划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,无损害集合计划持有人利益的行为,本集合计划的投资管理符合有关法规的规定。

2、风险控制报告

本集合计划自2012年6月21日成立,开始投资管理运作,截至2020年9月30日,管理人针对本集合计划的运作特点,通过风险监控工作以及风险预警机制,及时发现运作过程中可能出现的风险状况,并提醒投资经理采取相应的风险规避措施,确保集合计划合法合规、正常运行。

在本报告期内,管理人严格按照有关的法律法规、集合资产管理合同与说明书进行投资运作,未发生损害集合计划份额持有人利益的内幕交易等行为。

四、托管人报告

东北证券6号核心优势集合资产管理计划 2020年第三季度托管人报告

中国建设银行根据《东北证券6号核心优势集合资产管理计划合同》和《东北证券6号核心优势集合资产管理计划托管协议》，自2012年6月21日起托管东北证券6号核心优势集合资产管理计划（以下称“本计划”）资产。

2020年第三季度期间，中国建设银行及时准确地执行了管理人的投资和清算指令，办理了本计划名下的资金往来。

2020年第三季度期间，中国建设银行对管理人的投资运作行为按合同约定进行了监督，未发现存在损害委托人利益的行为。

2020年第三季度期间，中国建设银行对报告期内资产净值的计算、费用开支方面进行了复核，未发现管理人存在损害委托人利益的行为。

中国建设银行复核了本计划资产管理报告(2020年第三季度报告)中的有关财务数据部分，内容真实、准确和完整。

（一）报告期内本计划托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国建设银行股份有限公司在对本资产管理计划的托管过程中，严格遵守了国家有关法律法规、本计划资产管理合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害资产份额持有人或资产委托人利益的行为，完全尽职尽责地履行了托管人应尽的义务。

（二）托管人对报告期内本计划投资运作遵规守信、财产估值等情况的说明

本报告期内，本托管人严格按照国家法律法规、本计划资产管理合同、托管协议和其他有关规定，对本计划财产估值的计算等方面进行了认真的复核，对本计划的投资运作方面进行了监督，未发现管理人存在损害资产份额持有人或资产委托人利益的行为。

（三）托管人对本报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。

中国建设银行资产托管业务部

2020年10月28日

五、集合计划财务报告

(一) 集合计划资产负债表 (2020-9-30)

单位: 元

资产	期末余额	负债与持有人权益	期末余额
资 产:		负 债:	
银行存款	5,470,885.92	短期借款	0.00
结算备付金	15,652,377.31	交易性金融负债	0.00
存出保证金	15,581.05	衍生金融负债	0.00
交易性金融资产	5,858,559,721.42	卖出回购金融资 产款	789,787,966.80
其中: 股票投资	0.00	应付证券清算款	193,303.56
债券投资	5,758,542,445.13	应付赎回款	0.00
基金投资	0.00	应付赎回费	0.00
权证投资	0.00	应付管理人报酬	9,254,897.83
资产支持证券投资	100,017,276.29	应付托管费	334,639.44
衍生金融工具	0.00	应付投资咨询费	0.00
买入返售金融资产	0.00	应付交易费用	53,803.18
应收证券清算款	0.00	应交税费	827,905.80
应收利息	145,357,609.70	应付利息	233,421.34
应收股利	0.00	应付利润	130,054,954.98
应收申购款	0.00	其他负债	9,732.48
其他资产	0.00	负债合计	930,750,625.41
		所有者权益:	
		实收基金	5,094,305,549.99
		未分配利润	0.00
		持有人权益合计	5,094,305,549.99
资产合计	6,025,056,175.40	负债及持有人权益 总计	6,025,056,175.40

(二) 集合计划经营利润表 (2020-7-1 至 2020-9-30)

单位: 元

序号	项目	本期数
1	一、收入	77,266,791.17
2	1、利息收入	75,518,787.02
3	其中: 存款利息收入	113,009.29
4	债券利息收入	73,841,482.68
5	资产证券化利息收入	1,491,505.72
6	买入返售证券收入	72,789.33
7	2、投资收益	1,748,004.15
8	其中: 股票投资收益	0.00

9	债券投资收益	1,796,311.05
10	资产证券化投资收益	0.00
11	基金投资收益	0.00
12	权证投资收益	0.00
13	交易性金融负债差价收入	0.00
14	投资收益-差价收入增值税抵减	-48,306.90
15	衍生工具收益	0.00
16	股利收益	0.00
17	3、公允价值变动收益	0.00
18	4、其他收入	0.00
19	二、费用	9,009,836.62
20	1、管理人报酬	3,851,597.05
21	2、托管费	1,027,092.67
22	3、增值税及附加	274,634.74
23	4、销售服务费	0.00
24	5、交易费用	384.90
25	6、利息支出	3,825,948.23
26	其中：卖出回购金融资产支出	3,825,948.23
27	7、其他费用	30,179.03
28	三、利润总和	68,256,954.55

六、投资组合报告

(一) 资产组合情况

项目名称	项目市值(元)	占总资产比例
银行存款	5,470,885.92	0.09%
清算备付金	15,652,377.31	0.26%
存出保证金	15,581.05	0.00%
债券投资	5,758,542,445.13	95.58%
资产支持证券投资	100,017,276.29	1.66%
应收利息	145,357,609.70	2.41%
合计	6,025,056,175.40	100.00%

注：本报告中因四舍五入原因，投资组合报告中市值占总资产或净资产比例的分项之和与合计可能存在尾差。

(二) 期末市值占集合计划资产净值前十名股票明细

注：本集合计划报告期末未持有股票。

(三) 期末成本占集合计划资产净值前五名债券明细

序号	证券代码	证券名称	数量	成本(元)	占组合净值比例(%)
1	101677004	16 大足国资 MTN001	1,300,000.00	132,748,690.89	2.61
2	200403	20 农发 03	1,300,000.00	129,456,588.23	2.54
3	101900567	19 金华融盛 MTN002	1,000,000.00	103,058,791.84	2.02
4	101900803	19 万盛经开 MTN001	1,000,000.00	102,074,209.64	2.00
5	101900942	19 金坛国发 MTN001	1,000,000.00	101,514,742.71	1.99

(四) 期末市值占集合计划资产净值前十名基金明细

注：本集合计划报告期末未持有基金。

(五) 期末市值占集合计划资产净值前十名权证明细

注：本集合计划报告期末未持有权证。

(六) 投资组合报告附注

本集合资产管理计划投资的前十名证券的发行主体在本报告期内未被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内也未到受到公开谴责、处罚。

七、集合计划份额变动

单位：份

期初份额总额	5,114,155,079.52
报告期间总参与份额	3,343,570,131.63
红利再投资份额	0.00
报告期间总退出份额	3,363,419,661.16
报告期末份额总额	5,094,305,549.99

八、重要事项提示

(一) 本集合计划管理人相关事项

1、本集合计划管理人在本报告期内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。

2、本集合计划管理人办公地址没有发生变更。

3、本集合计划的管理人及其高级管理人员没有受到任何处罚。

（二）本集合计划托管人相关事项

1、本集合计划托管人在本报告期内没有发生涉及本集合计划托管人、财产、托管业务的诉讼事项。

2、本集合计划托管人办公地址没有发生变更。

3、本集合计划托管人涉及托管业务机构及其高级管理人员没有受到任何处罚。

（三）本集合计划相关事项

1、本报告期内，合同变更、关联交易、自有资金参与退出等重大事项请详见网站公告。

2、本报告期间，本集合计划收益分配金额（不含管理人业绩报酬部分）共51,478,014.37元。

3、本报告期内，本集合计划共进行1次投资经理变更。自2020年9月14日起，单海涛先生不再担任本集合计划投资经理，由石睿柯先生担任本集合计划投资经理。

4、本报告期末，管理人其他关联方共持有本集合计划665,000.00份。

九、备查文件目录及查阅方式

（一）本集合计划备查文件目录

1、中国证监会《关于核准东北证券股份有限公司设立东北证券6号核心优势集合资产管理计划的批复》（证监许可[2011]1842号）

2、《东北证券6号核心优势集合资产管理计划说明书》

3、《东北证券6号核心优势集合资产管理计划管理合同》

4、《东北证券6号核心优势集合资产管理计划托管协议》

5、管理人业务资格批件、营业执照

（二）存放地点及查阅方式

查阅地址：上海市浦东新区杨高南路729号陆家嘴世纪金融广场1号楼16层

网址：www.nesc.cn

客户服务电话：021-20361067

投资者对本报告书如有任何疑问,可咨询管理人东证融汇证券资产管理有限公司。

东证融汇证券资产管理有限公司

2020年10月28日