

# 华西证券东风3号集合资产管理计划

## 2020年第三季度资产管理报告

(2020年7月1日——2020年9月30日)

### 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》、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》、《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》及其他有关规定制作。

东风3号于2020年5月28日成立，并在中国证券投资基金业协会备案，同时抄送证券公司住所地中国证监会派出机构，但中国证券投资基金业协会和证券公司住所地中国证监会派出机构对本集合计划做出的任何决定，均不表明其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、谨慎勤勉的原则管理和运用集合计划资产，但不保证本集合计划一定盈利，也不保证最低收益。

托管人已复核本报告的财务指标、净值表现、投资组合报告。本报告未经审计。

管理人、托管人保证本报告书中所载资料的真实性、准确性和完整性。

本报告书中的内容由管理人负责解释。

本报告书中的金额单位除特指外均为人民币元。

本报告期起止时间：2020年7月1日——2020年9月30日



## 一、集合计划简介

### (一) 基本资料

名称：华西证券东风3号集合资产管理计划

成立日：2020年5月28日

成立规模：56,493,972.89份

报告期末计划总份额：56,493,972.89份

存续期：五年

管理人：华西证券股份有限公司

托管人：宁波银行股份有限公司

### (二) 管理人

名称：华西证券股份有限公司

设立日期：2000年7月13日

注册地址：四川省成都市天府二街198号

办公地址：四川省成都市天府二街198号

法定代表人：杨炯洋

信息披露网址：[www.hx168.com.cn](http://www.hx168.com.cn)

### (三) 托管人

名称：宁波银行股份有限公司

法定代表人/负责人：陆华裕

通信地址：浙江省宁波市宁东路 345 号

联系电话：0574-87010643

传真：0574-89103213

## 二、集合计划管理人履职报告

### （一）业绩表现

截至2020年9月30日，东风3号集合计划单位净值为1.0192元，累计单位净值为1.0192元。

### （二）投资经理工作报告

#### 1、投资经理简介

涂波，厦门大学金融学硕士，2012年7月至2013年8月任鹏元资信证券评级部分析师，2013年8月至2015年9月任招商证券研究所固定收益分析师，2015年10月至2019年9月任华西证券固定收益部研究主管，2019年10月起任华西证券资管总部债券投资部投资经理。

#### 2、行情回顾及运作分析

经济基本面方面，投资增速继续回升，1-8月固定资产投资增速为-0.3%，降幅较上月缩窄1.3个百分点。其中地产投资增速提高1.2个百分点至4.6%，基建投资增速提高0.83个百分点至2.02%，制造业增速提高2.1个百分点至-8.1%。工业生产反弹，8月份规模以上工业增加值同比增长5.6%，增速较7月提高0.8个百分点，环比增长1.02%。社融方面，7月特别国债发行和8月地方专项债大规模发行推动政府债券融资大幅扩张，对社融形成支撑。7-8月新增社融分别为1.69、3.58万亿元。7-8月M2同比增速分别在10.7%和10.4%，增速放缓。食品价格涨幅下降，带动CPI同比和环比涨幅回落，7-8月CPI同比增速分别为2.7%、2.4%。

货币市场方面，3季度央行货币政策回归中性，3季度GC001的平均利率为2.36%，较上季度明显上升。DR007平均利率为2.57%，较上季度

上行46BP。3个月AAA股份制银行同业存单发行利率由季度初的2.1%上行至2.78%附近。

债券市场方面，随着货币政策回归中性，加上一级发行量较大的因素，银行超储率偏低，债券市场继续延续调整的局面。展望未来，预计消费和投资继续改善，通胀下行，地方债发行接近尾声，4季度供给压力有望缓解，债券市场仍处在多空交织状态。

### 3、市场展望及投资策略

展望后市，预计货币政策维持中性，基建领域投资增速预计加快，对城投有一定利好，城投债仍有配置的价值。产品仍以信用债投资获取票息为主，寻找性价比较高的信用债品种进行配置。利率债方面，产品会适度控制久期和杠杆并做好流动性管理，耐心等待机会进行利率品种的波段交易。

#### （三）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《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》、《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》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本集合计划资产。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律法规的规定。

##### 2、风险控制报告

本报告期内，集合计划管理人通过对本集合计划的事前分析、事

中监控和事后评估，严格控制风险。

在本报告期内，本集合计划管理人对集合计划的管理始终按照有关法律法规、公司相关制度和集合资产管理计划说明书的要求进行。本集合计划的投资决策、投资交易程序、投资权限等各方面均符合相关法律法规的要求；交易行为合法合规，未出现异常交易、操纵市场的现象；未发现内幕交易的情况；相关的信息披露和财务数据皆真实、完整、准确、及时。

### 三、集合计划托管人履职报告

#### （一）报告期内本计划托管人遵规守信情况声明

本报告期内，宁波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，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，管理人未发现托管人存在损害资产份额持有人或资产委托人利益的行为。

#### （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，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

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。

#### 四、集合计划投资表现

##### (一) 主要业绩指标

序号	主要财务指标	2020年7月1日至 2020年9月30日
1	集合计划本期利润总额（元）	919,841.66
2	期末集合计划资产净值（元）	57,581,228.64
3	期末单位集合计划资产净值（元）	1.0192
4	期末单位集合计划累计资产净值（元）	1.0192
5	本期单位集合计划净值增长率	1.62%
6	单位集合计划累计净值增长率	1.62%

##### (二) 业绩指标计算公式

1、单位集合计划资产净值= 集合计划资产净值 ÷ 集合计划份额

2、本期单位集合计划净值增长率= (本期第一次分红前单位集合计划资产净值 ÷ 期初单位集合计划资产净值) × (本期第二次分红前单位集合计划资产净值 ÷ 本期第一次分红后单位集合计划资产净值) × …… × (期末单位集合计划资产净值 ÷ 本期最后一次分红后单位集合计划资产净值) - 1

3、单位集合计划累计净值增长率=（第一年度单位集合计划资产净值增长率+1）×（第二年度单位集合计划资产净值增长率+1）×（第三年度单位集合计划资产净值增长率+1）×……×（上年度单位集合计划资产净值增长率+1）×（本期单位集合计划资产净值增长率+1）-1

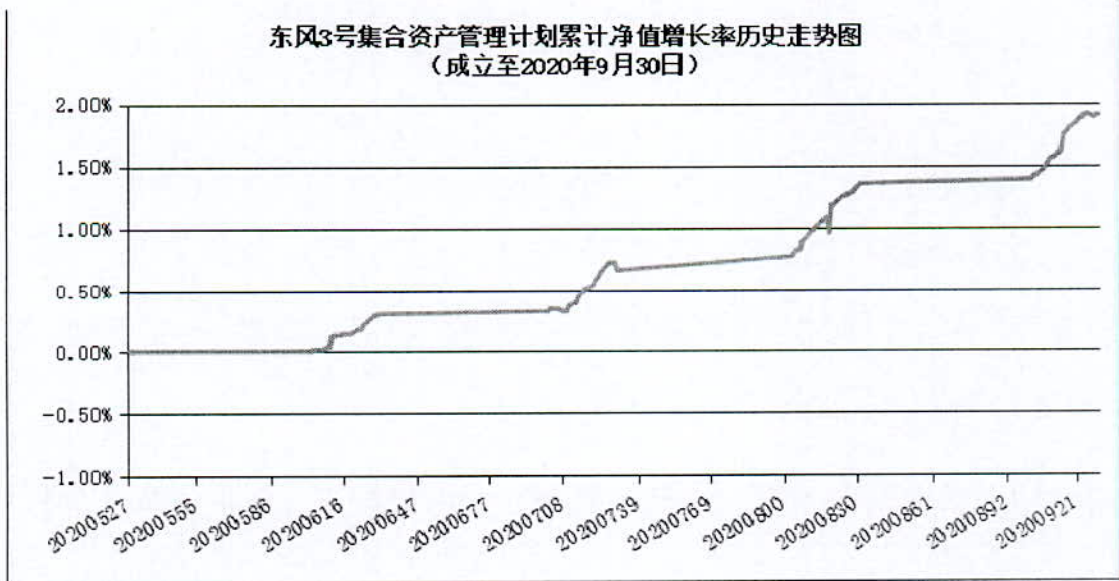
### （三）集合计划累计净值增长率变动情况

#### 1、本计划历史各时间段净值增长率列表

阶段	单位累计净值增长率	日累计净值增长率标准差
过去三个月	1.62%	0.04%

注：本计划成立日为2020年5月28日。

#### 2、本计划累计净值增长率历史走势图



## 五、集合计划投资组合报告

### 1、期末集合计划资产组合情况（2020年9月30日）

金额单位：元

项目	期末市值	占总资产比例
银行存款和结算备付金	1,593,462.91	2.11%
股票		0.00%
债券	69,478,349.50	91.93%
基金	1,810,500.00	2.40%
资产支持证券投资		0.00%
买入返售证券		0.00%
其他资产	2,693,570.95	3.56%
合计	75,575,883.36	100.00%

注1：“其他资产”包括：“存出保证金”、“应收股利”、“应收利息”、“应收证券清算款证券”等项目。

注2：因四舍五入原因，期末集合计划资产组合情况中期末市值占总资产比例的分项之和与合计可能存在误差。

### 2、按市值占净值比例大小排序的排名前五的债券投资明细

序号	债券名称	期末数量 (张)	期末市值 (元)	占期末集合计划净值比
1	19 兰花 02	100,000.00	10,053,500.00	17.46%



2	19 明官 02	100,000.00	10,050,400.00	17.45%
3	16 云工 01	100,000.00	10,000,000.00	17.37%
4	20 柳州 D1	100,000.00	10,000,000.00	17.37%
5	18 金辉 03	100,000.00	9,966,800.00	17.31%

## 六、集合计划财务报告

### (一) 集合计划会计报告书

#### 1、集合计划资产负债表

金额单位：元

项目	2020年9月30日	2020年6月30日
资产：		
银行存款	452,373.85	103,148.35
结算备付金	1,141,089.06	-
存出保证金	3,267.89	-
交易性金融资产	71,288,849.50	53,324,483.75
其中：股票投资	-	-
债券投资	69,478,349.50	51,494,543.75
资产支持证券投资	-	-
基金投资	1,810,500.00	1,829,940.00
衍生金融资产		
买入返售金融资产	-	1,300,000.00

应收证券清算款	-	231.33
应收利息	2,690,303.06	1,956,540.27
应收股利		-
应收申购款		-
其他资产		
资产合计:	75,575,883.36	56,684,403.70
负债:		
短期借款		
交易性金融负债		
衍生金融负债		
卖出回购金融资产款	17,900,000.00	
应付证券清算款	15,425.93	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	43,171.10	15,339.27
应付托管费	2,878.10	1,022.65
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	-	-
应付税费	41,111.91	5,095.22
应付利息	-13,711.94	-
应付利润	-	-
其他负债	5,779.62	1,559.58

负债合计	17,994,654.72	23,016.72
所有者权益：		
实收基金	56,493,972.89	56,493,972.89
未分配利润	1,087,255.75	167,414.09
所有者权益合计	57,581,228.64	56,661,386.98
负债与持有人权益总计：	75,575,883.36	56,684,403.70

**2、集合计划利润表**

金额单位：元

项目	本期数	累计数
一、收入	1,137,979.10	1,324,461.71
1、利息收入	1,097,351.22	1,220,739.18
其中：存款利息收入	4,863.18	5,780.01
债券利息收入	1,092,255.34	1,200,166.02
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	232.70	14,793.15
2、投资收益（损失以“-”填列）	-14,634.25	17,575.25
其中：股票投资收益	-	-
债券投资收益	-14,634.25	-14,634.25
资产支持证券投资收益	-	-
基金投资收益	-	-

权证投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
红利收益	-	32,209.50
3、公允价值变动损益（损失以“-”填列）	55,262.13	86,147.28
4、其他收入（损失以“-”填列）	-	-
二、费用	218,137.44	237,205.96
1、管理人报酬	43,171.10	58,510.37
2、托管费	2,878.10	3,900.75
3、销售服务费	-	-
4、交易费用	28.71	229.82
5、利息支出	163,755.35	163,755.35
其中：卖出回购金融资产支出	163,755.35	163,755.35
6、其他费用	8,304.18	10,809.67
三、利润总额	919,841.66	1,087,255.75

## （二）集合计划份额的变动

单位：份

期初总份额	期间 参与份额	期间 退出份额	期末总份额
56,493,972.89			56,493,972.89

## 七、集合计划收益分配情况

本报告期内，本集合计划未进行收益分配。

## 八、重要事项

- (一) 本报告期内集合计划法律文件未发生变更。
- (二) 本报告期内集合计划未发生重大关联交易事项。
- (三) 本报告期内集合计划投资经理未发生变更。
- (四) 本集合计划聘请的会计师事务所未发生变更。
- (五) 本集合计划管理人、托管人办公地址未发生变更。
- (六) 本报告期内集合计划的投资组合策略未发生重大改变。
- (七) 本集合计划管理人及托管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。

## 九、备查文件目录

### (一) 本集合计划备查文件目录

- 1、《华西证券东风3号集合资产管理计划说明书》
- 2、《华西证券东风3号集合资产管理计划合同》
- 3、《华西证券东风3号集合资产管理计划托管协议》
- 4、管理人业务资格批件、营业执照
- 5、《华西证券东风3号集合资产管理计划验资报告》

### (二) 存放地点及查阅方式

查阅地址：四川省成都市天府二街198号

网址：[www.hx168.com.cn](http://www.hx168.com.cn)

客户服务热线：4008-888-818

投资者对本报告书如有任何疑问，可咨询管理人华西证券股份有限公司。

