

长安迈科安盈 6 号集合资产管理计划

2020 年第 3 季度报告

2020 年 09 月 30 日

资产管理计划管理人:长安基金管理有限公司

资产管理计划托管人:招商银行股份有限公司

报告送出日期:2020 年 10 月 30 日

§ 1 重要提示

本报告并非宣传推介材料，所载内容仅供特定客户资产管理业务客户参考。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。

投资有风险，请理性选择。资产管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用委托资产，但不保证委托资产一定盈利，也不保证最低收益。本委托资产的过往业绩及净值高低并不预示其未来业绩表现，也不代表持有人可以获得的最终收益，管理人管理的其他资产的业绩也不构成本委托资产业绩表现的保证。本特定客户资产管理业务的具体情况以该产品法律文件为准，请详细阅读。

§ 2 资产管理计划产品概况

资产管理计划简称	长安迈科安盈6号
资产管理计划主代码	741203
资产管理计划运作方式	契约型开放式
资产管理计划合同生效日	2020年01月22日
报告期末资产管理计划份额总额	19,905,759.85份
资产管理计划管理人	长安基金管理有限公司
资产管理计划托管人	招商银行股份有限公司

§ 3 主要财务指标和资产管理计划净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2020年07月01日 - 2020年09月30日）
1. 本期已实现收益	570,941.97
2. 本期利润	253,503.50
3. 加权平均资产管理计划份额本期利润	0.0117
4. 期末资产管理计划资产净值	21,462,388.44
5. 期末资产管理计划份额净值	1.078
6. 期末杠杆比例	1.0121

附注：期末杠杆比例=期末总资产/期末资产净值

注：

管理费、托管费、业绩报酬的计提基准、计提方式和支付方式:

(一) 资产管理人的管理费

在通常情况下, 资产管理计划管理费按前一日资产管理计划资产净值的 0.9% 年费率每日计提。

计算方法如下:

$$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的本计划管理费

E 为前一日本计划资产净值

资产管理计划管理费自计划成立日起, 每日计提, 按季支付。托管人根据复核无误的管理人所发送的管理费划款指令, 于每季度结束后下月初的前 5 个工作日内, 将上季应付管理费从计划财产中一次性支付给管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的, 顺延至最近可支付日支付。

(二) 资产托管人的托管费

在通常情况下, 本计划托管费按本计划资产净值的 0.03% 年费率每日计提。计算方法如下:

$$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的本计划托管费

E 为前一日本计划资产净值

资产管理计划托管费自计划成立日起, 每日计提, 按季支付。托管人根据复核无误的管理人所发送的托管费划款指令, 于每季度结束后下月初的前 5 个工作日内, 将上季应付托管费从计划财产中一次性支付给托管人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的, 顺延至最近可支付日支付。

(三) 投资顾问的投资顾问费

在通常情况下, 资产管理计划的投资顾问费按前一日资产管理计划资产净值的 0.1% 年费率每日计提。

计算方法如下:

$$H = E \times \text{年投资顾问费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的本计划投资顾问费

E 为前一日本计划资产净值

资产管理计划投资顾问费自计划成立日起, 每日计提, 按季支付。托管人根据复核无误的管理人所发送的投资顾问费划款指令, 于每季度结束后下月初的前 5 个工作日内, 将上季应付投资顾问费从计划财产中一次性支付给投资顾问。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的, 顺延至最近可支付日支付。

(四) 投资顾问的业绩报酬

本计划在收益分配基准日、资产委托人全部或部分退出资产管理计划日、资产管理计划成立日每满 1 年的对日、计划终止日 (以下简称“计提日”), 投资顾问按资产委托人应计提业绩报酬的每笔计划份额 (收益分配基准日、计划成立日每满 1 年对日、计划终止日计提的, 应计提业绩报酬

的每笔计划份额指资产委托人持有的所有计划份额；资产委托人全部或部分退出资产管理计划日计提的，应计提业绩报酬的每笔计划份额指资产委托人申请退出的计划份额；资产委托人于计划每满 1 年对日部分退出的，退出份额与继续持有份额分别计提业绩报酬，下同）在对应期间超过年化收益率 6.3% 以上部分的超额收益（投资增值部分，包含收益分配部分和净值增长部分，高于预先设定的计提基准的部分）收取 60% 的业绩报酬。

（1）业绩报酬的计算方法

资产委托人单笔投资计划份额业绩报酬的具体计算方法如下：

1) 资产委托人的计划份额首次被提取的业绩报酬

$$\text{业绩报酬} = S_i * NAV_0' * [(NAV_1 - NAV_0) / NAV_0' - 6.3\% * T / \text{当年天数}] * 60\%$$

其中：

S_i 为计提日资产委托人需计提业绩报酬的每笔退出或持有计划份额的数量；

NAV_1 为计提日的计划份额累计净值；

NAV_0 为计提日资产委托人需计提业绩报酬的每笔退出或持有份额所对应的认购确认日或参与确认日的计划份额累计净值；

NAV_0' 为计提日资产委托人需计提业绩报酬的每笔退出或持有份额所对应的认购确认日或参与确认日的计划份额净值；

T 为计提日资产委托人持有需计提业绩报酬的计划份额的自然天数；

计划份额累计净值 = 计划份额净值 + 份额累计分红；

若业绩报酬 ≤ 0 ，则不计提，也不算做首次计提。

2) 资产委托人的计划份额从第 2 次开始被提取的业绩报酬

$$\text{业绩报酬} = S_i * NAV_0' * [(NAV_1 - NAV_0) / NAV_0' - 6.3\% * T / \text{当年天数}] * 60\%$$

其中：

S_i 为计提日资产委托人需计提业绩报酬的每笔退出或持有计划份额的数量；

NAV_1 为计提日的计划份额累计净值；

NAV_0 为计提日资产委托人需计提业绩报酬的每笔退出或持有份额所对应的前次业绩报酬计提日的计划份额累计净值；

NAV_0' 为计提日资产委托人需计提业绩报酬的每笔退出或持有份额所对应的前次业绩报酬计提日的计划份额净值；

T 为计提日距上次业绩报酬计提日的自然天数；

计划份额累计净值 = 计划份额净值 + 份额累计分红；

若业绩报酬 ≤ 0 ，则不计提。

某计提日单个资产委托人计提的业绩报酬总额为该资产委托人持有的各笔投资应计提的业绩报酬之和；某计提日计提的业绩报酬总额为该计提日所有单个资产委托人各笔投资应计提的业绩报酬之和，但对于被冻结（人民法院、人民检察院、公安机关及其他国家有权机关依法要求冻结）的计划份额则业绩报酬可以顺延至可计提日计提。

单个资产委托人单笔投资的业绩报酬保留到小数点后 2 位，小数点后第 3 位舍去，由此误差产生的收益由计划财产享有。

2) 业绩报酬的提取频率

业绩报酬提取频率不得超过每 6 个月一次，因资产委托人退出本计划提取的业绩报酬不受前述提取频率的限制。

3) 业绩报酬的支付

本计划成立日每满 1 年的对日、收益分配基准日，投资顾问的业绩报酬将扣减资产委托人持有的计划份额，显示为资产委托人所持计划份额的减少，所扣减的部分作为投资顾问的业绩报酬；资产委托人退出计划份额或本计划终止时，投资顾问的业绩报酬将从资产委托人退出款或清算款中扣除。

业绩报酬的计提金额以资产管理人计算为准，业绩报酬的计算和复核由管理人负责。资产管理人向资产托管人发送投顾顾问的业绩报酬划款指令，资产托管人在业绩报酬计提日后的 10 个工作日内根据资产管理人指令一次性支付给投资顾问。

3.2 资产管理计划净值表现

3.2.1 资产管理计划份额净值增长率

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②
过去三个月	1.22%	0.08%
过去六个月	4.46%	0.14%
自资产管理计划合同生效起至今	7.80%	0.22%

3.2.2 自资产管理计划合同生效以来资产管理计划累计净值增长率变动

长安迈科安盈6号集合资产管理计划累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



§ 4 管理人报告

4.1 管理人对报告期内本资产管理计划运作合规守信情况的说明

本报告期内，本管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《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》产品合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用资产管理计划资产，在认真控制投资风险的基础上，为资产管理计划份额持有人谋求最大利益，没有损害资产管理计划份额持有人利益的行为。

4.2 报告期内资产管理计划的投资策略和运作分析

2020年9月份经济数据显示，9月经济恢复势头强劲，前三季度GDP增速实现由负转正，经济运行逐步恢复常态，四季度有望继续回暖势头。

货币政策逐步回归正常化，降息降准政策退出，LPR报价长期维持不变，货币政策调整到位后预计将继续维持中性。

1、资产配置策略，自上而下地实施整体资产配置策略，通过预测各大类资产未来收益率变化情况，在不同的大类资产之间进行动态调整和优化，以规避市场风险，提高收益率。

2、个券选择策略，在已有的债券目标久期、信用债券配置比例确定基础上，本投资组合对价值低估的品种进行投资获得超额收益；

3、持有到期策略，获取定期本息；

通过对上述策略的综合运用，积极寻找市场中的价值洼地，在风险一定的情况下，博取超额收益。

4.3 报告期内资产管理计划的业绩表现

截至报告期末长安迈科安盈6号资产管理计划份额净值为1.078元，本报告期内，资产管理计划份额净值增长率为1.22%。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末资产管理计划资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占资产管理计划总资产的比例 (%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	2,140,163.05	9.85
3	固定收益投资	18,816,146.30	86.62
	其中：债券	18,816,146.30	86.62
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	147,824.39	0.68
8	其他资产	617,386.11	2.84
9	合计	21,721,519.85	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本资产管理计划本报告期末持有股票。

5.3 报告期末按公允价值占资产管理计划资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本资产管理计划本报告期末持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占资产管理计划资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	16,279,346.30	75.85
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	2,536,800.00	11.82
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	18,816,146.30	87.67

5.5 报告期末按公允价值占资产管理计划资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占资产管理计划资产净值比例(%)
1	143218	17清控01	47,030	4,195,546.30	19.55
2	127677	17都江堰	36,000	3,294,000.00	15.35
3	101674013	16春华水务MTN003	30,000	2,536,800.00	11.82
4	139089	16津广成	40,000	2,330,800.00	10.86
5	1680464	16天长专项债01	30,000	2,261,400.00	10.54

5.6 报告期末按公允价值占资产管理计划资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本资产管理计划本报告期末持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占资产管理计划资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本资产管理计划本报告期末持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占资产管理计划资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本资产管理计划本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本资产管理计划投资的股指期货交易情况说明

本资产管理计划本报告期末未进行股指期货交易。

5.10 报告期末本资产管理计划投资的国债期货交易情况说明

本资产管理计划本报告期末未进行国债期货交易。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 报告期内本资产管理计划投资决策程序符合相关法律法规的要求，未发现本资产管理计划投资的前十名证券的发行主体本期内出现被监管部门立案调查或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.11.2 报告期内，本资产管理计划投资的前十名股票中，没有超出资产管理计划合同规定的备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	6,809.97
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	610,576.14
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	617,386.11

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本资产管理计划本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本资产管理计划本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 6 开放式资产管理计划份额变动

单位：份

报告期期初资产管理计划份额总额	26,599,077.12
报告期期间资产管理计划总申购份额	3,849,765.22

减：报告期期间资产管理计划总赎回份额	10,543,082.49
报告期期间资产管理计划拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末资产管理计划份额总额	19,905,759.85

§ 7 资产管理计划投资收益分配情况

无。

§ 8 托管人报告

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度。我行在对长安迈科安盈6号资产管理产品托管的过程中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

§ 9 其他重要事项说明

无。

长安基金管理有限公司
2020年10月30日

免责声明

本报告并非宣传推介材料，所载内容仅供特定客户资产管理业务客户参考。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。

投资有风险，请理性选择。资产管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用委托资产，但不保证委托资产一定盈利，也不保证最低收益。本委托资产的过往业绩及净值高低并不预示其未来业绩表现，管理人管理的其他资产的业绩也不构成本委托资产业绩表现的保证。本特定客户资产管理业务的具体情况以该产品法律文件为准，请仔细阅读。