长安迈科安盈8号集合资产管理计划

2020年第4季度报告

2020年12月31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:国泰君安证券股份有限公司

报告送出日期:2021年01月29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　基金产品概况

资产管理计划简称	长安迈科安盈8号
资产管理计划主代码	741211
资产管理计划合同生效日	2020年08月28日
报告期末资产管理计划份额总额	33,872,543.69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	国泰君安证券股份有限公司

§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10月01日 - 2020年12月31日）
1.本期已实现收益	322,842.98
2.本期利润	-900,564.94
3.加权平均资产管理计划份额本期利润	-0.0273
4.期末资产管理计划资产净值	33,053,458.37
5.期末资产管理计划份额净值	0.976
6.期末杠杆比例	1.0034

附注：期末杠杆比例=期末总资产/期末资产净值

注：

一、管理费、托管费、业绩报酬的计提基准、计提方式和支付方式：

1、资产管理人的管理费

资产管理人的管理费按本计划管理费计提日前一自然日资产管理计划资产净值的0.85%年费率计提。计算方法如下：

H＝E×0.85%÷当年天数

H 为每日应计提的管理费

E 为前一自然日的资产管理计划资产净值

本计划成立之日起，管理费每日计提，按季支付，由资产管理人于本计划成立之日的次季度起，每季度首日起10个工作日内向资产托管人发送资产管理计划管理费划付指令,经资产托管人复核后于3个工作日内从资产管理计划资产中支付给资产管理人。若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延，若遇不可抗力或计划资产无法变现致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

2、资产托管人的托管费

资产管理计划的托管费按本计划托管费计提日前一自然日资产管理计划资产净值的0.03%年费率计提，托管费的计算方法如下：

H＝E×0.03%÷当年天数

H 为每日应计提的托管费

E 为前一自然日的资产管理计划资产净值

本计划成立之日起，托管费每日计提，按季支付，由资产管理人于本计划成立之日的次季度起，每季度首日起10个工作日内向资产托管人发送资产管理计划托管费划付指令,经资产托管人复核后于3个工作日内从资产管理计划资产中支付给资产托管人。若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延，若遇不可抗力或计划资产无法变现致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

3、资产管理人的业绩报酬

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6个月的对日、计划终止日（以下简称“业绩报酬计提日”）可以计提资产管理人的业绩报酬（届时是否计提资产管理人的业绩报酬由资产管理人决定）。在业绩报酬计提日，资产管理人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6个月的对日、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6个月对日部分退出的，退出份额与继续持有份额分别计提业绩报酬，下同）在对应期间超过业绩报酬计提基准的超额收益（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20%的业绩报酬。

本计划首期业绩报酬计提基准为年化收益率6.3%，管理人有权根据市场情况在开放退出日首日调整（包括调高或调低）下一个业绩报酬计提期的业绩报酬计提基准，新的业绩报酬计提基准不低于截至调整日前一交易日的3个月上海银行间同业拆放利率+2%，新的业绩报酬计提基准以资产管理人届时公告为准，调整周期不低于6个月。投资者签署本合同投资本计划视为同意管理人有权调整上述事项，如果投资人不认同届时公告的业绩报酬计提基准，可在临近的开放退出日退出本计划。

（1）业绩报酬的计算方法

资产委托人单笔投资计划份额中由资产管理人提取的业绩报酬具体计算方法如下：

1）资产委托人的计划份额首次被资产管理人提取的业绩报酬

业绩报酬=Si*NAV0’*[（NAV1—NAV0）/NAV0’—B*T/当年天数]*20%

其中：

Si 为业绩报酬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；

NAV1为业绩报酬计提日的计划份额累计净值；

NAV0 为业绩报酬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；

NAV0’为业绩报酬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；

B 为当期业绩报酬计提基准（年化收益率）；

T 为业绩报酬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 次开始被资产管理人提取的业绩报酬

业绩报酬=Si*NAV0’*[（NAV1—NAV0）/NAV0’—B*T/当年天数]*20%

其中：

Si 为业绩报酬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；

NAV1为业绩报酬计提日的计划份额累计净值；

NAV0 为业绩报酬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；

NAV0’为业绩报酬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；

B 为当期业绩报酬计提基准（年化收益率）；

T 为业绩报酬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。

某业绩报酬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；某业绩报酬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。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，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应计提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6 个月的对日、收益分配基准日提取业绩报酬的，资产管理人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，所扣减的部分作为资产管理人的业绩报酬；资产委托人退出计划份额或本计划终止时，资产管理人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资产管理人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资产管理人。业绩报酬收取账户为本合同约定的资产管理人管理费收取账户。

4、投资顾问的投资顾问费

投资顾问的投资顾问费按本计划投资顾问费计提日前一自然日计划资产净值的0.1%年费率计提。计算方法如下：

H＝E×0.1%÷当年天数

H 为每日应计提的资产管理计划投资顾问费

E 为前一自然日的资产管理计划资产净值

本计划的投资顾问费自本计划成立之日起，每日计提，按季度支付。由管理人于下一季度前10 个工作日之内向托管人发送划款指令，托管人复核后，从计划财产中一次性支付至投资顾问账户。若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延，若遇不可抗力或计划资产无法变现致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

5、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6个月的对日、计划终止日（以下简称“业绩报酬计提日”）可以计提投资顾问的业绩报酬（届时是否计提投资顾问的业绩报酬由资产管理人决定）。在业绩报酬计提日，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6个月的对日、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6 个月对日部分退出的，退出份额与继续持有份额分别计提业绩报酬，下同）在对应期间超过业绩报酬计提基准的超额收益（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40%的业绩报酬。本计划首期业绩报酬计提基准为年化收益率6.3%，管理人有权根据市场情况在开放退出日首日调整（包括调高或调低）下一个业绩报酬计提期的业绩报酬计提基准，新的业绩报酬计提基准不低于截至调整日前一交易日的3 个月上海银行间同业拆放利率（ShanghaiInterbank Offered Rate，简称Shibor）+2%，新的业绩报酬计提基准以资产管理人届时公告为准，调整周期不低于6个月。投资者签署本合同投资本计划视为同意管理人有权调整上述事项，如果投资人不认同届时公告的业绩报酬计提基准，可在临近的开放退出日退出本计划。

（1）业绩报酬的计算方法

资产委托人单笔投资计划份额中由投资顾问提取的业绩报酬具体计算方法如下：

1）资产委托人的计划份额首次被投资顾问提取的业绩报酬

业绩报酬=Si*NAV0’*[（NAV1—NAV0）/NAV0’—B*T/当年天数]*40%

其中：

Si 为业绩报酬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；

NAV1为业绩报酬计提日的计划份额累计净值；

NAV0 为业绩报酬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；

NAV0’为业绩报酬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；

B 为当期业绩报酬计提基准（年化收益率）；

T 为业绩报酬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 次开始被投资顾问提取的业绩报酬

业绩报酬=Si*NAV0’*[（NAV1—NAV0）/NAV0’—B*T/当年天数]*40%

其中：

Si 为业绩报酬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；

NAV1为业绩报酬计提日的计划份额累计净值；

NAV0 为业绩报酬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；

NAV0’为业绩报酬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；

B 为当期业绩报酬计提基准（年化收益率）；

T 为业绩报酬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。

某业绩报酬计提日单个资产委托人计提的投资顾问业绩报酬总额为该资产委托人持有的各笔投资应计提的投资顾问业绩报酬之和；某业绩报酬计提日计提的投资顾问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投资顾问业绩报酬之和。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，投资顾问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应计提的投资顾问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

投资顾问的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6个月的对日、收益分配基准日提取业绩报酬的，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。

投资顾问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资产管理人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	-2.69%	0.64%
自资产管理计划合同生效起至今	-2.40%	0.54%

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

§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遵规守信情况的说明

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年四季度，国际方面，美国大选尘埃落定，新冠疫苗获准入市，但海外疫情依然严重，主要发达经济体股市在天量流动性推动下继续上涨，全球定价的铜、铁矿石等大宗商品均大幅上涨。国内方面经济继续恢复，推升企业盈利上升，中央经济工作会议定调政策不急转弯，短期政策急刹车的风险被排除，通胀压力整体依然不大。

四季度债券市场横盘震荡，债市收益率先上后下，收益率曲线先平后陡。11月债券市场信用违约事件持续发酵，债券市场面临流动性冲击，收益率快速上行；11月下旬，随着金融委会议定调维稳债券市场，资金面开始宽松，债券市场收益率开始下行。

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8号资产管理计划份额净值为0.976元，本报告期内，资产管理计划份额净值增长率为-2.69%。

§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	380,840.46	1.15
3	固定收益投资	31,327,254.70	94.46
	其中：债券	31,327,254.70	94.46
	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	306,518.19	0.92
8	其他资产	1,150,508.71	3.47
9	合计	33,165,122.06	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未持有股票。

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未持有股票。

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	30,202,454.70	91.37

5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	1,124,800.00	3.40
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	31,327,254.70	94.78

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	1280097	12河套水务债	278,590	8,235,120.40	24.91
2	136773	16清控02	90,000	4,401,000.00	13.31
3	127681	17安交投	52,500	4,158,525.00	12.58
4	127661	17旅投01	30,000	2,630,700.00	7.96
5	112682	18苏宁01	30,000	2,623,800.00	7.94

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未持有资产支持证券。

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未持有贵金属。

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	26,485.89
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	6,448.00
4	应收利息	1,117,574.82
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	1,150,508.71

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	29,886,739.29
报告期期间资产管理计划总申购份额	3,985,804.40
减：报告期期间资产管理计划总赎回份额	-
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	33,872,543.69

§7 资产管理计划投资收益分配情况

无。

§8托管人报告

8.1 报告期内本资产管理计划托管人遵规守信情况声明

本报告期内，托管行在对本计划的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、资产管理计划合同的有关规定，完全尽职尽责地履行了应尽的义务，不存在任何损害资产管理计划份额持有人利益的行为。

8.2 托管人对报告期内本资产管理计划投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，托管行根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、资产管理计划合同的规定，对本资产管理计划管理人的投资运作方面进行了必要的监督，对资产管理计划资产净值的计算、资产管理计划份额申购赎回价格的计算以及费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本资产管理计划管理人存在损害资产管理计划份额持有人利益的行为。

8.3 托管人对本季度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由长安基金管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§9 其他重要事项说明

无。

长安基金管理有限公司

2021年01月29日

免责说明

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，请详细阅读。