

西藏东方财富证券年年赢 1 号 固定收益类集合资产管理计划

2021 年第 2 季度管理报告

管理人：东方财富证券股份有限公司

托管人：宁波银行股份有限公司

一、重要提示

集合计划管理人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个别及连带责任。

集合计划托管人于 2021 年 7 月 13 日复核了本报告中的财务指标和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。

集合计划管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用集合计划资产，但不保证集合计划一定盈利。

集合计划的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本集合计划的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 4 月 1 日起至 2021 年 6 月 30 日止。

二、集合计划产品概况

| | |
|---------|---|
| 集合计划名称: | 西藏东方财富证券年年赢 1 号固定收益类集合资产管理计划 |
| 集合计划类型: | 固定收益类 |
| 最近一次开放日 | 2020 年 8 月 31 日 |
| 成立规模: | 34281672.83 份 |
| 存续期: | 5 年，可展期 |
| 投资目标: | 固定收益类资产，包括现金、货币市场基金、同业存单、银行存款（包括银行活期存款和通知存款）、期限在 7 天以内（含 7 天）的债券逆回购、到期日在一年以内的政府债券、国内依法发行的国债、地方政府债、企业债、公司债（含可转换债券、分离交易可转债、可交换债券等）、非公开发行的公司债、金融债（含次级债、混合资本债、政策性金融债）、永续债、央行票据、经银行间市场交易商协会批准注册发行的各类债务融资工具（如超短期融资券、短期融资券、中期票 |

| | |
|----------|---|
| | 据、集合票据、集合债券、非公开定向债券融资工具（PPN）、资产支持票据（ABN）等）、资产支持证券（ABS）、期限在 7 天以上（不含 7 天）的债券回购等交易所、银行间市场交易的债券品种，债券型公募基金、公募分级基金优先级份额； |
| 集合计划管理人： | 东方财富证券股份有限公司 |
| 集合计划托管人： | 宁波银行股份有限公司 |

三、管理人履职报告

（一）投资经理简介

陶照，北京大学光华管理学院金融学硕士，CFA 三级，具备 8 年金融行业从业经验。曾在中国金融期货交易所从事衍生品产品设计与宏观研究工作。2015 年入职华林证券，先后在投资管理部和资产管理部从事交易与投资研究相关工作。期间参与交易量上千亿，具备丰富的债券组合管理经验。现任东方财富证券资产管理总部固收投资主管。

（二）投资经理工作报告

二季度债券市场利率震荡下行，相较于一季度末，10Y 国债下行 11bp、10Y 国开下行 8bp；一年国债下行 15bp 至 2.43%、一年国开下行 25bp 至 2.51%，近期均处于前低附近。行情的主要支撑在于货币政策未如预期收紧，资金面整体平稳偏宽松，缴税、跨季均没有出现大的波动。二季度信用债现券交投活跃，各期限、各等级收益率多数下行，以中短久期和中低评级下行幅度较大，其中 3 年期 AA 中短期票据中债到期收益率从 4.31% 下行到 4.01%，下行 30bp。

宏观经济方面，经济复苏放缓、增长动能有所减弱。4、5 月规模以上工业增加值当月同比分别为 9.8%，8.8%，两年复合增速分别为 6.8% 和 6.6%，工业生产边际放缓。4-6 月份，中采 PMI 指数分别为 51.1、51、50.9，经济虽然仍处于扩张区间，但景气度有所回落。价格方面，4-6 月份，CPI 当月同比分别为 0.9%、1.3%、1.1%，走势较为温和；PPI 当月同比分别为 6.8、9%、8.8%，冲高后回落。货币政策基本维持稳定，4、5 月末社会融资规模存量分别为 296.15 万亿元和

297.98 万亿元，同比增速分别为 11.7%和 11%。

展望三季度，利率债可能维持震荡下行趋势。7月7日，国常会提及“实施运用降准等货币政策工具，进一步加强金融对实体经济特别是小微企业的支持，促进综合融资成本稳中有降”，打开了货币政策宽松、至少是不会收紧的想象空间。通胀和经济增长走势或将在三季度逐渐明朗。在 2021 年三季度，我们仍旧采用票息策略，以信用债持仓为主，并谨慎控制产品久期，根据经济基本面和市场风险偏好变化，把握利率债交易时机。

（三）管理人对报告期内本计划运作合规守信情况的说明

本报告期内，本计划管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、中国证监会和《西藏东方财富证券年年赢 1 号固定收益类集合资产管理计划管理合同》的规定，本着诚实守信、审慎尽责、谨慎勤勉的原则管理和运用本计划资产，在严格控制风险的基础上，为本计划份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本计划运作整体合法合规，没有损害份额持有人利益。本计划的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及资产管理合同的规定。

（四）管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

1、公平交易制度和控制方法

本计划管理人根据《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》以及有关法律法规的规定，建立了公平交易制度及异常交易监控机制，公平对待所管理的不同资产，对投资交易行为进行监控、分析、评估、核查，监督投资交易的过程和结果。

2、公平交易制度的执行情况

本报告期内，本计划管理人严格执行《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》以及有关法律法规的规定，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待所管理的所有资管计划。

3、异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本计划存在异常交易行为。

四、托管人履职报告

本报告期内（2021年第2季度），本托管人在西藏东方财富证券年年赢1号固定收益类集合资产管理计划的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》、《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》、《西藏东方财富证券年年赢1号固定收益类集合资产管理计划管理合同》、《西藏东方财富证券年年赢1号固定收益类托管协议》和其他有关规定，不存在损害委托人利益的行为，完全尽职尽责地履行了托管人应尽的义务。

本报告期内（2021年第2季度），本托管人按照国家有关规定、《西藏东方财富证券年年赢1号固定收益类集合资产管理计划管理合同》、《西藏东方财富证券年年赢1号固定收益类集合资产管理计划托管协议》和其他有关规定，对委托资产的投资运作方面进行了监督，未发现管理人有损害委托人利益的行为。

本报告期内（2021年第2季度），本集合计划未实施利润分配。

本托管人复核审查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。

五、主要财务指标和集合计划投资表现情况

下述集合计划业绩指标不包括持有人认购或交易集合计划的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

主要财务指标

单位：元

| 主要财务指标 | 本期间 |
|----------------------|------------|
| 本期利润扣除本期公允价值变动损益后的净额 | 48,990.00 |
| 本期利润 | 353,859.44 |
| 其中：本期公允价值变动损益 | 304,869.44 |

| | |
|------------|---------------|
| 加权平均份额本期利润 | 0.0295 |
| 加权平均净值利润率 | 2.6104% |
| 本期单位净值增长率 | 2.6382% |
| 期末可分配利润 | 1,479,596.64 |
| 期末可供分配份额利润 | 0.1233 |
| 期末资产净值 | 13,777,010.85 |
| 期末单位资产净值 | 1.1477 |
| 单位累计净值增长率 | 14.7700% |

截止 2021 年 6 月 30 日，本集合计划单位净值为 1.1477 元。

六、集合计划投资组合报告

(一) 报告期末集合计划资产组合情况

集合计划资产组合情况

单位：元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|---------------|---------------|
| 1 | 权益投资 | | |
| | 其中：股票 | | |
| | 基金 | | |
| 2 | 固定收益投资 | 13,698,852.78 | 94.42 |
| | 其中：债券 | 13,698,852.78 | 94.42 |
| | 资产支持证券 | | |
| 3 | 金融衍生品投资 | | |
| 4 | 买入返售金融资产 | | |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | | |
| 5 | 银行存款和结算备付金合计 | 238,900.19 | 1.65 |
| 6 | 其他资产 | 570,718.22 | 3.93 |
| 7 | 合计 | 14,508,471.19 | 100.00 |

(二) 投资组合报告附注

1、报告期内集合计划投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查的，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的。

2、集合计划投资的前十名证券中，没有投资于超出集合计划合同规定可投资证券库之外的。

七、财务会计报告

(一) 集合计划资产负债表

集合计划资产负债表

单位：元

| 资产 | 期末余额 | 年初余额 |
|-------------|----------------------|----------------------|
| 资产： | | |
| 银行存款 | 137,605.22 | 371,331.81 |
| 结算备付金 | 101,294.97 | 41,162.50 |
| 存出保证金 | 1,749.32 | 2,439.07 |
| 交易性金融资产 | 13,698,852.78 | 12,765,196.20 |
| 其中：股票投资 | 0.00 | 0.00 |
| 债券投资 | 13,698,852.78 | 12,765,196.20 |
| 基金投资 | 0.00 | 0.00 |
| 权证投资 | 0.00 | 0.00 |
| 资产支持证券投资 | 0.00 | 0.00 |
| 衍生金融工具 | 0.00 | 0.00 |
| 买入返售金融资产 | 0.00 | 0.00 |
| 应收证券清算款 | 0.00 | 0.00 |
| 应收利息 | 568,968.90 | 311,028.15 |
| 应收股利 | 0.00 | 0.00 |
| 应收申购款 | 0.00 | 0.00 |
| 其他资产 | 0.00 | 0.00 |
| | | |
| | | |
| | | |
| 资产合计 | 14,508,471.19 | 13,491,157.73 |



集合计划资产负债表（续）

| 负债与持有人权益 | 期末余额 | 年初余额 |
|-------------|------|------|
| 负 债： | | |
| 短期借款 | 0.00 | 0.00 |
| 交易性金融负债 | 0.00 | 0.00 |

| | | |
|-------------------|----------------------|----------------------|
| 衍生金融负债 | 0.00 | 0.00 |
| 卖出回购金融资产款 | 699,965.00 | 0.00 |
| 应付证券清算款 | 0.00 | 0.00 |
| 应付赎回款 | 0.00 | 0.00 |
| 应付管理人报酬 | 16,886.11 | 16,907.12 |
| 应付托管费 | 1,013.22 | 1,014.42 |
| 应付销售服务费 | 0.00 | 0.00 |
| 应付交易费用 | 4,611.46 | 1,493.19 |
| 应交税费 | 6,357.73 | 1,657.93 |
| 应付利息 | 147.12 | 0.00 |
| 应付利润 | 0.00 | 0.00 |
| 其他负债 | 2,479.70 | 5,000.00 |
| 负债合计 | 731,460.34 | 26,072.66 |
| | | |
| 所有者权益： | | |
| 实收基金 | 12,003,995.38 | 12,003,995.38 |
| 未分配利润 | 1,773,015.47 | 1,461,089.69 |
| 所有者权益合计 | 13,777,010.85 | 13,465,085.07 |
| 负债和所有者权益总计 | 14,508,471.19 | 13,491,157.73 |

(二) 集合计划经营业绩表

集合计划经营业绩表

单位：元

| 序号 | 项目 | 本期数 | 本年累计数 |
|----|----------------|------------|-------------|
| 1 | 一、收入 | 381,703.12 | 361,303.54 |
| 2 | 1、利息收入 | 171,122.18 | 321,936.99 |
| 3 | 其中：存款利息收入 | 453.65 | 896.49 |
| 4 | 债券利息收入 | 174,030.37 | 326,579.17 |
| 5 | 资产支持证券利息收入 | 0.00 | 0.00 |
| 6 | 买入返售证券收入 | 1,665.89 | 3,804.86 |
| 7 | 信托理财产品利息收入 | 0.00 | 0.00 |
| 8 | 利息收入-增值税贷款服务抵减 | -5,027.73 | -9,343.53 |
| 9 | 2、投资收益 | -94,750.06 | -129,993.66 |
| 10 | 其中：股票投资收益 | 0.00 | 0.00 |
| 11 | 债券投资收益 | -94,750.06 | -129,993.66 |
| 12 | 基金投资收益 | 0.00 | 0.00 |

| | | | |
|----|----------------|------------|------------|
| 13 | 权证投资收益 | 0.00 | 0.00 |
| 14 | 资产支持证券投资收益 | 0.00 | 0.00 |
| 15 | 衍生工具收益 | 0.00 | 0.00 |
| 16 | 股利收益 | 0.00 | 0.00 |
| 17 | 基金红利收益 | 0.00 | 0.00 |
| 18 | 证券理财产品红利收入 | 0.00 | 0.00 |
| 19 | 投资收益-差价收入增值税抵减 | 0.00 | 0.00 |
| 20 | 3、公允价值变动收益 | 305,331.00 | 169,360.21 |
| 21 | 4、其他收入 | 0.00 | 0.00 |
| 22 | 二、费用 | 27,843.68 | 49,377.76 |
| 23 | 1、管理人报酬 | 16,886.11 | 33,451.60 |
| 24 | 2、托管费 | 1,013.22 | 2,007.12 |
| 25 | 3、销售服务费 | 0.00 | 0.00 |
| 26 | 4、交易费用 | 4,443.39 | 6,175.77 |
| 27 | 5、利息支出 | 3,189.36 | 3,680.78 |
| 28 | 其中：卖出回购金融资产支出 | 3,189.36 | 3,680.78 |
| 29 | 6、其他费用 | 1,246.70 | 2,479.70 |
| 30 | 7、增值税金及附加税 | 1,064.90 | 1,582.79 |
| 31 | 三、利润总和 | 353,859.44 | 311,925.78 |

八、投资收益分配情况

根据本计划合同约定，当集合计划单位净值不低于面值且有可分配收益时，管理人可以进行收益分配，收益分配方案由管理人拟定，经托管人核实后由管理人报告委托人。在符合有关分红条件和收益分配原则的前提下，管理人可自行决定收益分配的时间，委托人可以选择收益分配方式为两种：现金分红和红利再投资。其他收益分配的有关约定详见资管合同。

根据本计划合同对收益分配事项的约定以及本计划的实际运作情况，报告期本计划未有分配事项。

九、投资经理变更、重大关联交易等涉及投资者权益的重大事项的说明

（一）投资经理变更情况

由于工作岗位调整，自 2021 年 6 月 18 日起，西藏东方财富证券年年赢 1 号固定收益类集合资产管理计划的投资经理变更为陶照女士。陈天悦女士不再担任西藏东方财富证券年年赢 1 号固定收益类集合资产管理计划的投资经理。

（二）重大关联交易等涉及投资者权益的重大事项说明

本报告期内，未发生重大关联交易等涉及投资者权益的重大事项。

十、备查文件目录

（一）备查文件目录

- 1、备案确认函；
- 2、《西藏东方财富证券年年赢 1 号固定收益类集合资产管理计划资产管理合同》；
- 3、《西藏东方财富证券年年赢 1 号固定收益类集合资产管理计划托管协议》；
- 4、《西藏东方财富证券年年赢 1 号固定收益类集合资产管理计划说明书》；
- 5、合规审查意见；
- 6、集合计划管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、集合计划托管人业务资格批件、营业执照。

（二）存放地点

文件存放地点：上海市徐汇区宛平南路 88 号金座

网址：<http://www.18.cn/>

信息披露电话：95357

投资者对本报告书如有任何疑问，可咨询管理人东方财富证券股份有限公司。

东方财富证券股份有限公司

2021年7月21日

