

# 安信证券安盈宝集合资产管理计划

## 2021 年第二季度报告

管理人：安信证券资产管理有限公司

托管人：中国光大银行股份有限公司

报告期：2021 年 4 月 1 日—2021 年 6 月 30 日



## 重要提示

本报告由集合计划管理人编制。托管人中国光大银行股份有限公司根据本集合资产管理计划合同规定，已复核了本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容。

管理人承诺以诚实信用、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。

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，委托人在做出投资决策前应仔细阅读本集合资产管理计划合同及风险揭示书。

本报告中的财务资料未经审计。

## 目 录

一、集合资产管理计划概要.....	1
二、主要财务指标和集合资产管理计划净值表现.....	2
(一) 主要财务指标.....	2
(二) 收益分配情况.....	2
三、管理人报告.....	3
(一) 业绩表现.....	3
(二) 投资主办人简介.....	3
(三) 风险控制报告.....	3
(五) 公平交易专项说明.....	5
(六) 异常交易行为的专项说明.....	5
四、财务会计报告.....	6
(一) 集合计划资产负债表(2021 年 6 月 30 日).....	6
(二) 集合计划利润表.....	7
五、投资组合报告.....	8
(一) 资产组合情况.....	8
(二) 报告期末市值占集合计划资产净值比例前十名证券投资明细.....	8
(三) 集合计划份额变动情况.....	10
六、重大事项报告.....	10
七、备查文件目录.....	11



## 一、集合资产管理计划概要

集合计划名称	安信证券安盈宝集合资产管理计划
集合计划类型	非限定性集合资产管理计划
集合计划成立日	2013年5月22日
集合计划成立总份额	158,771,516.32份
集合计划报告期末总份额	273,513,497.36份
集合计划存续期	无固定管理期限
管理人	安信证券资产管理有限公司
托管人	中国光大银行股份有限公司

## 二、主要财务指标和集合资产管理计划净值表现

### (一) 主要财务指标

单位：人民币元

序号	主要财务指标	报告期(2021年4月1日—2021年6月30日)
1	集合计划本期利润	2,616,242.74
2	期末集合计划资产净值	273,513,497.36
3	期末七日年化收益率	3.200%

### (二) 收益分配情况

本集合计划本报告期内未进行收益分配。

### 三、管理人报告

#### (一) 业绩表现

截至期末,本集合计划期末七日年化收益率 3.200%。

#### (二) 投资主办人简介

吴慧文,女,武汉大学金融工程专业硕士,8 年债券投资经验。历任长城证券固定收益部交易员、投资助理、投资经理。擅长国债期货的策略投资、利率债的波段操作以及信用债的价值挖掘,现任安信证券资产管理有限公司投资经理。

#### (三) 投资主办人工作报告

##### 1、市场回顾

2021 年二季度,债券市场走出了慢牛行情,主要受到几方面因素的支撑。首先,在财政投放加大背景下资金面的持续宽松,支撑了短端债券的持续下行,以及本轮期限利差的持续扩大;其次,地方政府专项债的供给迟迟未达预期,在防风险、稳杠杆的调控思路下,地方政府发债动力不达预期,相比往年进度缩减较大;再次,大多数机构在资管新规后产品端维持了低杠杆、低久期的配置,机构普遍欠配,也使得利率上行难度加大。

二季度宏观基本面展现出了一定的韧性,出口和制造业投资对经济基本面构成支撑,同时,消费的修复弱于预期,投资增速受到地方政府和房地产融资严监管影响增速有所收敛,整体经济基本面较为平稳。截至半年末,市场跨季虽有波动但平稳过度,信用风险事件也没有实质性暴露。

二季度以来利率中枢持续处于历史较低分位数水平上，利率的下行也是缓慢的，期限利差放大，信用利差缩窄。

账户操作方面，安盈宝二季度增配超短久期优质高票息资产，维持了中等久期中性杠杆操作，随着资产到期精选资产进行再投资。

## 2、展望

展望三季度，随着央行表态货币政策进入常态状态下的常规操作，考虑到宏观经济增长压力和大宗品涨价对中小企业利润挤压，预计资金面维持偏宽松的格局，另外随着消费修复弱于预期、出口有趋缓的迹象，预计财政宽松将会提速，地方政府专项债供给进度将会加快，因此整体来看，基本面在对冲思路下，或不太弱，同时资金宽松，地方专项债供给提速，预计债市整体仍有下行空间，不过随着美国疫情后修复，经济将逐步企稳，美联储下半年财政紧缩的节奏或临近，届时将会带来利率和汇率的波动，因此债市下行窗口时间和幅度上预计也会有限。

基于上述对市场的判断，债券市场波动预计较为收敛，资金成本中枢预计有所下移，套息价值尚可，收益率下行时间和幅度预计有限，产品预计后续将要变更合同，提前做好流动性覆盖以及超短期限债券进行套息操作。

## （四）风险控制报告

### 1、集合计划合规性声明

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》及其他相关法律法规的规定，严格执行管理人内部各项管理制度，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。

本报告期内，集合计划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、与公司相关制度进行投资运作，没有出现重大违法违规行为，投资管理各项业务均符合相关规定。

## 2、风险控制报告

本报告期内，管理人针对本集合计划的运作特点，通过日常风险监控工作和风险预警机制，对业务运作过程中可能出现的风险状况进行全面检查，及时进行风险提示，评估集合计划运作过程中面临的市场风险、信用风险和流动性风险，确保集合计划运作风险水平与其投资目标相一致。

本报告期内，集合计划管理人严格按照有关法律法规、公司制度和集合计划合同书进行集合计划资产的管理运作。本集合计划持有的证券符合投资范围及投资比例的要求，相关的信息披露和财务数据皆真实、准确、及时。

### （五）公平交易专项说明

本报告期内，管理人通过建立有纪律、规范化的投资研究和决策流程、交易流程，以及强化事后监控分析来确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。本计划管理人制定了严格的投资权限管理制度、投资证券池管理制度和集中交易制度等，并重视交易执行环节的公平交易措施，通过投资交易系统内的公平交易模块，以尽可能确保公平对待各投资组合。本报告期内，公平交易制度总体执行情况良好。

### （六）异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，共发生 6 起同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的情况。

本报告期内，未发现本计划有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。



## 四、财务会计报告

## (一) 集合计划资产负债表(2021 年 6 月 30 日)

单位：人民币元

资产	期末余额	负债和所有者权益	期末余额
资产：		负债：	
银行存款	19,037,154.26	短期借款	0.00
结算备付金	0.00	交易性金融负债	0.00
存出保证金	1,534.12	衍生金融负债	0.00
交易性金融资产	277,334,158.53	卖出回购金融资产	0.00
其中：股票投资	0.00	应付证券清算款	18,000,000.00
债券投资	277,334,158.53	应付赎回款	0.00
基金投资	0.00	应付管理人报酬	30,978,609.82
权证投资	0.00	应付托管费	8,134.30
资产支持证券投资	0.00	应付销售服务费	0.00
衍生金融工具	18,000,180.00	应付交易费用	8,330.86
买入返售金融资产	0.00	应交税费	336,604.69
应收证券清算款	0.00	应付利息	0.00
应收利息	8,752,736.51	应付利润	266,701.88
应收股利	0.00	其他负债	13,884.51
应收申购款	0.00	负债合计	49,612,266.06
其他资产	0.00		
		所有者权益：	
		实收基金	273,513,497.36
		未分配利润	0.00
		所有者权益合计	273,513,497.36
资产总计	323,125,763.42	负债和所有者权益总计	323,125,763.42

(二) 集合计划利润表

单位：人民币元

项目	本期数	本年累计数
一、收入	4,811,723.97	9,105,045.59
1. 利息收入	4,578,359.03	8,606,742.99
其中：存款利息收入	7,257.24	15,617.66
债券利息收入	4,444,630.82	8,322,866.87
资产支持证券利息收入	117,456.60	251,516.70
买入返售金融资产收入	9,014.37	16,741.76
2. 投资收益	233,364.94	498,302.60
其中：股票投资收益	0.00	0.00
债券投资收益	240,365.89	513,251.68
基金投资收益	0.00	0.00
权证投资收益	0.00	0.00
资产支持证券投资收益	0.00	0.00
衍生工具收益	0.00	0.00
股利收益	0.00	0.00
个股期权收益	0.00	0.00
投资收益增值税抵减	-7,000.95	-14,949.08
3. 公允价值变动收益	0.00	0.00
4. 其他收入	0.00	0.00
二、费用	2,195,481.23	4,323,503.60
1. 管理人报酬	1,918,069.71	3,865,696.47
2. 托管费	24,570.94	44,832.63
3. 销售服务费	0.00	0.00
4. 交易费用	0.00	0.00
5. 利息支出	220,793.61	341,576.70
其中：卖出回购金融资产支出	220,793.61	341,576.70
6. 增值税金及附加	16,006.36	30,666.98
7. 其他费用	16,040.61	40,730.82
三、利润总和	2,616,242.74	4,781,541.99

## 五、投资组合报告

### (一) 资产组合情况

项目名称	期末市值 (人民币元)	占总资产比例 (%)
银行存款	19,037,154.26	5.89
其中: 活期存款	19,037,154.26	5.89
协议活期	0.00	0.00
定期存款	0.00	0.00
债券投资	277,334,158.53	85.83%
资产支持证券投资	0.00	0.00
存出保证金	1,534.12	0.00
其他资产	26,752,916.51	8.28
合计	323,125,763.42	100.00

### (二) 报告期末市值占集合计划资产净值比例前十名证券投资明细

序号	证券代码	名称	数量	期末市值 (元)	占期末集合计划净值比例 (%)
1	101900910	19 粤铁建 MTN002	200,000.00	20,071,238.55	7.34
2	101800958	18 无锡建投 MTN002	200,000.00	20,001,298.24	7.31
3	101800493	18 青岛黄岛 MTN001	200,000.00	20,001,242.83	7.31
4	042000483	20 徐州交通 CP001	200,000.00	20,000,077.21	7.31
5	102001953	20 浦口康居 MTN005	200,000.00	19,999,795.55	7.31
6	012003596	20 蚌埠投资 SCP003	200,000.00	19,998,593.98	7.31
7	101777001	17 新开元 MTN001	200,000.00	19,993,212.98	7.31
8	1624021	16 荆门管廊项目债	200,000.00	18,593,566.20	6.80
9	1780110	17 观山湖债	200,000.00	11,935,380.51	4.36
10	1680356	16 合川专项债	200,000.00	11,746,364.98	4.29

(三) 集合计划份额变动情况

单位：份

期初总份额	本期参与份额	本期退出份额	期末总份额
326,733,083.77	109,698,568.31	162,918,154.72	273,513,497.36

## 六、重大事项报告

- (一) 经安永华明会计事务所验资，本集合计划于 2013 年 5 月 22 日成立。
- (二) 本报告期内集合计划的投资组合策略没有发生重大变化。
- (三) 本报告期内集合计划没有需要披露的重大事项。
- (四) 本报告期内管理人没有需要披露的重大事项。
- (五) 本报告期内托管人没有需要披露的重大事项。

## 七、备查文件目录

### （一）备查文件目录

- 1、安信证券安盈宝集合资产管理计划资产管理合同
- 2、安信证券安盈宝集合资产管理计划说明书
- 3、安信证券安盈宝集合资产管理计划风险揭示书
- 4、安信证券安盈宝集合资产管理计划托管协议

### （二）存放地点及查阅方式

- 1、地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 A 座 27 楼
- 2、网址：[www.axzqzg.com](http://www.axzqzg.com)
- 3、客服电话：95517

