

# 安信证券添添利 5 号集合资产管理计划 2021 年

## 第 2 季度报告

2021 年 06 月 30 日

资产管理人:安信证券资产管理有限公司

资产托管人:广发银行股份有限公司



## § 1 重要提示

本报告由集合计划管理人编制。托管人广发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。

本报告期自 2021 年 04 月 01 日起至 2021 年 06 月 30 日止。

## § 2 资产管理计划产品概况

资产管理计划全称	安信证券添添利 5 号集合资产管理计划
资产管理计划成立日	2019 年 10 月 29 日
报告期末资产管理计划份额总额	98,102,571.46 份
资产管理人	安信证券资产管理有限公司
资产托管人	广发银行股份有限公司

## § 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(2021 年 04 月 01 日 - 2021 年 06 月 30 日)
本期已实现收益	1,492,436.88
本期利润	1,565,435.27
期末资产管理计划资产净值	102,657,834.46
期末资产管理计划份额净值	1.0464

### 3.2 集合计划累计单位净值增长率历史走势图



## § 4 管理人报告

### 4.1 投资经理（或投资经理小组）简介

竺印，中南财经政法大学会计学硕士，中国注册会计师，历任安信证券资产管理部债券交易员、信用研究员，7年债券研究与交易经验，现任安信证券资产管理有限公司投资经理。

本报告期内投资经理是否变更：否。

### 4.2 报告期内本资产管理计划运作合规守信情况说明

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》、《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》及其他相关法律法规的规定，严格执行安信证券内部各项管理制度，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。

### 4.3 公平交易专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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。

#### 4.3.2 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。

#### 4.4 报告期内资产管理计划的投资策略和运作分析

##### 1、市场回顾

2021 年二季度，国内宏观经济呈现不均衡的复苏状态，上游发展态势良好，中游制造业受到大宗商品价格上涨而被挤压，下游消费在零星疫情影响之下，尚未回到疫情前的水平。在资金面保持平稳宽松的环境里，债券收益率在机构配置需求的驱动下迎来了整体向下的趋势性行情，其中，由于二季度整体市场信用风险未实质性暴露，信用利差压缩明显。大多机构对资金水平生变持续保持担忧，因此整体杠杆、久期水平保持低位。

账户操作方面，组合维持了中性久期和杠杆，在赚取票息收入的同时，及时把握住了一季度债券市场的趋势性行情，为组合收益贡献了丰厚的。

##### 2、下阶段展望

展望 2021 年下半年，随着投资增速降低、出口迎来拐点、工业品维持高位震荡，国内经济整体增速仍将继续放缓，但资本密集、技术密集型行业仍将保持高资本支出状态，整体经济继续呈现非均衡性发展。受制于国际经济恢复的不均衡性，货币政策仍将保持平稳宽松，不会大幅收紧。

国内去杠杆背景下，信用分化仍将继续，信用债配置策略仍将发挥比较优势，现阶段信用债配置价值仍然较高，城投债的安全性边际仍在。

##### 3、操作方面

账户会根据市场情况动态调整持仓结构和久期，在信用债选择上更多考虑票息价值，并考虑流动性因素，以短久期、中高等级信用债为主，精细挖掘城投和产业债的配置机会。

#### 4.5 报告期内资产管理计划投资收益分配情况

本报告期内,本集合计划未进行收益分配。

#### 4.6 报告期内资产管理计划重大关联交易情况

无。

### § 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	-	-
3	固定收益投资	139,790,740.00	95.26
	其中:债券	129,847,740.00	88.49
	资产支持证券	9,943,000.00	6.78
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	1,636,194.63	1.11
8	其他资产	5,317,092.43	3.62
9	合计	146,744,027.06	100.00

#### 5.2 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	031900681	19漯河城投PPN001	130,000	13,010,400.00	12.67
2	031900865	19商丘发展PPN001	100,000	10,252,000.00	9.99
3	031900714	19荆门城投PPN002	100,000	10,131,000.00	9.87
4	101901504	19陕文投MTN001	100,000	10,103,000.00	9.84
5	162521	19淮开04	100,000	10,077,000.00	9.82

#### 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名的前十名资产支持证券投资明细

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值(元)	占资产管理计划资产净值比例(%)
1	082000800	20融信通达ABN002优先	100,000	9,943,000.00	9.69

#### 5.4 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	770.95
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	5,316,321.48
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	5,317,092.43

#### 5.5 两费及业绩报酬说明

项目	计提方式
管理费	0.5%/年，每日计提，按季支付
托管费	0.01%/年，每日计提，按季支付
业绩报酬	当资产管理计划份额退出、终止或分红时，管理人将提取退出份额（资产管理计划终止视同于退出情形）或分红份额当期实际年化收益率超过业绩报酬超计提基准的部分提取 60%作为管理人的业绩报酬。 管理人于每个封闭期结束前公布下一个封闭期的业绩报酬计提基准。资产管理计划第二个封闭期内的业绩报酬计提基准为 4.5%。 管理人于每个业绩报酬提取日提取业绩报酬，由托管人于业绩报酬提取日后 5 个工作日内按照管理人指令从本集合计划资产中一次性支取

### § 6 资产管理计划份额变动

#### 6.1 集合计划份额变动情况

单位：份

报告期期初资产管理计划份额总额	98,102,571.46
报告期期间资产管理计划总申购份额	-
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	98,102,571.46

#### 6.2 关联方持有本集合计划份额变动情况

单位：份

期初份额	-
报告期间参与份额	-
红利再投资份额	-



报告期间退出份额	-
报告期末份额	-
期末份额占集合计划总份额的比例	-

注：关联方指本公司董事、监事、从业人员及其配偶、控股股东、实际控制人或者其他关联方。

### § 7 其他重大事项

本报告期内，本集合资产管理计划没有其他需要披露的重大事项。

安信证券资产管理有限公司

2021年7月28日

