

西部证券安盈泓利 6 月期 1 号集合资产管理计划

2021 年第 3 季度资产管理报告

计划管理人：西部证券股份有限公司

计划托管人：兴业银行股份有限公司

报告期间：2021 年 7 月 1 日——2021 年 9 月 30 日



一、重要提示

集合资产管理计划托管人兴业银行股份有限公司于2021年10月25日对本报告中的财务指标、财务会计报表、投资组合报告等数据进行了复核。本报告未经审计。

管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用本集合计划资产，但不保证本集合计划一定盈利，也不保证最低收益。管理人保证本报告书中所载资料的真实性、准确性和完整性，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担责任。本报告书中的内容由管理人负责解释。

本报告期起止时间：2021年7月1日—2021年9月30日

二、集合计划简介

集合计划名称：西部证券安盈泓利6月期1号集合资产管理计划

集合计划类型：固定收益类集合资产管理计划

集合计划成立日：2020年9月11日

集合计划成立规模：29,620,105.60份

集合计划报告期末计划总规模：360,526,281.17份

集合计划存续期：10年

计划管理人：西部证券股份有限公司

计划托管人：兴业银行股份有限公司

三、集合计划主要财务指标

（一）主要财务指标

图表1：2021年7月1日—2021年9月30日主要财务指标（单位：人民币元、%）

序号	主要财务指标	2021年07月01日-2021年09月30日
1	集合计划本期利润	4,515,190.04

2	集合计划本期利润扣除本期公允价值变动损益后的净额	4,776,190.04
3	期末集合计划资产净值	380,991,401.88
4	期末集合计划单位资产净值	1.0568
5	本期集合计划单位净值增长率	1.3620%
6	集合计划单位累计净值增长率	5.6800%

四、管理人履职 报告

（一）投资经理简介

张超先生，复旦大学财务学博士，10 余年债券从业经历，曾任东莞证券固定收益部债券研究员、投资经理，国泰君安证券研究所债券研究员。2016 年 1 月加入西部证券股份有限公司上海证券资产管理分公司，任投资经理。

（二）投资经理工作报告

第三季度，债券收益率总体呈现下行走势，1、10 年期国债收益率分别从第二季度末的 2.43%、3.08%下降 10bp、20bp 至第三季度末的 2.33%、2.88%。第三季度债市走势可以分为两个阶段，第一阶段为 7 月份的收益率下行阶段，第二阶段为 8~9 月份的收益率震荡上行阶段。第一阶段，7 月份央行进行了全面降准，市场将其理解为全面货币政策宽松的开始，并逐渐形成了一致预期，10 年国债收益率最大下行幅度达到 30BP。第二阶段，8~9 月份央行并未出台持续的宽松政策，市场对宽货币的预期逐渐落空，而对宽信用的预期开始增强，同时资金面边际收紧，债券收益率在此影响下震荡上行。

展望第四季度，宏观经济走势仍然偏弱。今年以来房地产销售增速持续放缓，土地购置面积、新开工面积增速均下滑，第四季度房地产调控政策可能会出现微调，但房地产投资增速仍将延续放缓趋势。制造业投资增速继续反弹。去年第四季度制造业开始补库存，今年第二季度以来补库存趋于震荡。制造业投资对经济的拉动作用有限。地方债发行加速、多地重大项目集中开工有利于基金投资增速的回升，但回升幅度有限。通胀方面，能耗双控达标导致的限产对相关产品供需

缺口形成压力，预计第四季度 PPI 同比将处于筑顶阶段。货币政策预计将以稳为主，资金面继续保持偏宽松的态势。因此，预计第四季度债市收益率呈现震荡走势。

西部证券安盈泓利 6 月期 1 号集合资产管理计划成立以来累计单位净值增长率为 5.68%。2021 年第四季度，预计安盈泓利 6 月期 1 号的资产净值将保持增长态势，总资产与净资产的比例将维持在 120%左右的水平。

五、托管人履职报告

详见托管报告。

六、集合计划财务报表

(一) 资产负债表

图表2：截止2021.9.30资产负债表（单位：人民币元）

资产	期末余额	年初余额	负债与持有人权益	期末余额	年初余额
资 产:			负 债:		
银行存款	3,648,064.33	372,282.25	短期借款	0.00	0.00
结算备付金	0.00	0.00	交易性金融负 债	0.00	0.00
存出保证金	0.00	0.00	衍生金融负债	0.00	0.00
交易性金融资产	440,201,940.00	122,077,142.47	卖出回购金融 资产款	84,825,000.00	22,265,000.00
其中：股票投资	0.00	0.00	应付证券清算 款	0.00	0.00
债券投资	394,201,940.00	121,083,500.00	应付赎回款	0.00	0.00
基金投资	0.00	0.00	应付管理人报 酬	422,375.01	63,208.95

权证投资	0.00	0.00	应付托管费	25,342.49	3,792.54
资产支持证 券投资	46,000,000.00	993,642.47	应付销售服务 费	0.00	0.00
衍生金融工具	0.00	0.00	应付交易费用	29,149.76	495.51
买入返售金融资产	11,000,275.00	0.00	应交税费	63,948.55	17,244.20
应收证券清算款	0.00	0.00	应付利息	53,460.32	17,787.26
应收利息	11,575,356.35	2,477,204.81	应付利润	0.00	0.00
应收股利	0.00	0.00	其他负债	14,957.67	20,000.00
应收基金红利	0.00	0.00	负债合计	85,434,233.80	22,387,528.46
应收申购款	0.00	0.00			
其他资产	0.00	0.00	所有者权益:		
			实收集合计划	360,526,281.17	101,230,379.30
			未分配利润	20,465,120.71	1,308,721.77
			持有人权益合 计	380,991,401.88	102,539,101.07
资产合计	466,425,635.68	124,926,629.53	负债及持有人权 益总计	466,425,635.68	124,926,629.53

(二) 经营业绩表

图表 3: 2021.7.1-2021.9.30 经营业绩表

(单位: 人)

序号	项目	本期数	本年累计数
1	一、收入	5,266,671.80	12,337,424.57
2	1、利息收入	5,354,848.40	12,304,622.87
3	其中: 存款利息收入	5,313.06	11,174.30
4	债券利息收入	5,016,807.02	11,702,437.21
5	资产支持证券利息收入	238,771.17	251,618.69
6	买入返售证券收入	93,957.15	339,392.67

7	2、投资收益	-10,460.00	5,297.53
8	其中：股票投资收益	0.00	0.00
9	债券投资收益	-10,460.00	-1,060.00
10	基金投资收益	0.00	0.00
11	权证投资收益	0.00	0.00
12	资产支持证券投资收益	0.00	6,357.53
13	衍生工具收益	0.00	0.00
14	股利收益	0.00	0.00
15	基金红利收益	0.00	0.00
16	理财产品投资收益	0.00	0.00
17	3、公允价值变动收益	-261,000.00	-261,000.00
18	4、其他收入	185,077.57	290,757.30
19	5、投资收益增值税递减	1794.17	2253.13
20	二、费用	751,481.76	1,942,698.69
21	1、管理人报酬	422,375.01	928,297.92
22	2、托管费	25,342.49	55,697.88
23	3、销售服务费	0.00	0.00
24	4、交易费用	13,434.90	27,336.26
25	5、利息支出	259,457.05	857,181.75
26	其中：卖出回购金融资产支出	259,457.05	857,181.75
27	6、其他费用	11,398.85	29,658.36
28	7、增值税附加调减	19473.46	44526.52
29	三、利润总和	4,515,190.04	10,394,725.88

七、集合计划投资组合报告

(一) 资产组合情况

图表 4: 截止 2021.9.30 资产组合情况 (单位: 人民币元、%)

项目	期末市值 (人民币元)	占集合计划资产总值比例
银行存款和结算备付金	3,648,064.33	0.78%
股票		
债券及资产支持证券	440,201,940.00	94.38%
基金 (含货币基金)		
买入返售金融资产	11,000,275.00	2.36%
其他资产 (含专项资产管理计划投资)	11,575,356.35	2.48%
合计	466,425,635.68	100.00%

(*注: 其他资产包括应收利息项目)

(二) 报告期末按市值占集合计划资产净值比例大小排序的前五名持仓明细

图表 5: 截止 2021.9.30 本集合计划前五名持仓明细 (单位: 人民币元)

债券名称	数量 (张)	市值 (元)	市值占净值比例 (%)
恒信 43B	360,000.00	36,000,000.00	9.4490
20 如皋 02	350,000.00	35,147,700.00	9.2253
21 磁湖高 新 PPN001A	300,000.00	29,739,000.00	7.8057
20 兴南 01	200,000.00	20,083,500.00	5.2714
20 兴化 D4	200,000.00	20,000,000.00	5.2495

(三) 投资组合报告附注

(1) 报告期内本集合计划投资的前五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) 本集合计划没有投资于超出集合计划合同规定之外的品种。本集合计划其他资产构成请见下表。

图表 6: 截止 2021. 9. 30 本集合计划其他资产的构成 (单位: 人民币元)

序号	名称	金额
1	交易保证金	
2	应收证券清算款	
3	应收股利	
4	应收基金红利	
5	应收利息	11, 575, 356. 35
6	应收申购款	
7	其他应收款	
8	待摊费用	
9	其他 (专项资产管理计划投资)	
10	合计	11, 575, 356. 35

(四) 运用杠杆情况

西部证券安盈泓利 6 月期 1 号集合资产管理计划基本建仓完毕, 截止 2021 年 9 月 30 日总资产与净资产的比例为 122. 42%。

八、集合计划份额变动情况

(一) 集合计划份额变动情况

图表 1: 2021. 7. 1-2021. 9. 30 本集合计划份额变动情况 (单位: 份)

期初总份额	期间参与份额	期间退出份额	期末总份额
306, 672, 526. 03	113, 991, 190. 44	60, 137, 435. 30	360, 526, 281. 17

九、集合计划支付的管理费、托管费、业绩报酬的计提基准、计提方式和支付方式

(一) 管理费

计提基准	本集合计划管理费按照集合计划资产净值的【0.5%】年费率计算
计提方式	每日计提
支付方式	按季支付

(二) 托管费

计提基准	本集合计划托管费按照集合计划资产净值的【0.03%】年费率计算
计提方式	每日计提
支付方式	按季支付

(三) 业绩报酬

计提基准	4.7%/年
计提方式	管理人业绩报酬计提日为本集合计划分红日、投资者退出日和计划终止日。以上一个业绩报酬计提日（如投资者该笔份额未发生业绩报酬计提，初始募集期认购的，以本集合计划成立日为上一个业绩报酬计提日，存续期内申购的，以申购当日为上一个业绩报酬计提日，下同）至本次业绩报酬计提日的期间为基准。投资者赎回时，按照“先进先出”法，分别计算每一笔申购份额应收的管理人业绩报酬。在业绩报酬计提日，若投资者在该期间内的实际年化收益率 R 小于或等于该笔份额适用的业绩报酬计提基准 R^* ，管理人不计提业绩报酬；若在该期间内的实际年化收益率 R 大于业绩报酬计提基准 R^* ，管理人将对超过部分收益的 30% 计提业绩报酬，剩余部分归投资者所有。

业绩报酬计算方法如下：

本期实际年化收益率 R	计提比例
$R \leq R^*$	0
$R > R^*$	30%

业绩报酬计提公式：

$$R = \frac{(P - P_0)}{P_0^*} \times \frac{365}{D}$$

$$H = N \times P_0^* \times (R - R^*) \times \frac{D}{365} \times 30\%$$

其中：

P ：在业绩报酬计提日的累计单位净值；

P_0 ：为上一个业绩报酬计提日本集合计划的累计单位净值；

P_0^* ：为上一个业绩报酬计提日本集合计划的单位净值；

D ：为本次计提业绩报酬区间天数，即该投资者上一个业绩报酬计提日至本次业绩报酬计提日的间隔天数；

H ：业绩报酬计提日管理人应计提的业绩报酬；

N ：业绩报酬计提日投资者退出份额数或计划分红、终止时持有份额总数；

R^* ：为该笔份额适用的业绩报酬计提基准。

支付方式

由托管人根据管理人发送的业绩报酬划付指令于 5 个工作日内从集合计划资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。

十、投资收益分配情况

在本报告期内未进行收益分配。

十一、关于风险管理与内部控制制度在报告期内执行情况

本报告期内，管理人严格遵守相关法律、法规公司制度的要求，产品运作严格按照产品合同约定进行，不存在任何损害投资者利益的行为。本报告期内，本计划运作合法合规，管理人严格遵守法律法规和公司制度，对资产管理业务的投资交易行为进行监控、分析和核查，监督投资交易的过程和结果，及时向客户披露本计划的运作管理情况，并严格遵守法律法规和公司制度关于投资决策、公平交易、会计核算、风险控制、合规管理等方面的要求，控制业务风险，维护客户合法权益。

十二、涉及投资者权益的重大事项及其他需要说明的情况

（一）投资经理变更

无

（二）公司关联人员持有本集合计划的情况

本报告期内，发生从业人员及其配偶、控股股东、实际控制人或者其他关联方交易本集合计划的情况。截止 2021 年 9 月 30 日，本公司从业人员及配偶共持有份额 4,773,178.48 份。

（三）重大关联交易情况

无

（四）其他需要说明的情况

本报告期内，管理人于 2021 年 7 月 27 日以自有资金追加参与 9,551,098.38 份。截止 2021 年 9 月 30 日，管理人自有资金参与份额共为 34,207,913.44 份。

本报告期内，管理人对本产品合同内容关于“退出费用”部分发起了合同变更，于 2021 年 9 月 3 日发布了《关于西部证券安盈泓利 6 月期 1 号集合资产管

理计划资产管理合同变更暨征询意见函的公告》，于2021年9月9日发布了《关于西部证券安盈泓利6月期1号集合资产管理计划资产管理合同变更生效的公告》，变更后的《西部证券安盈泓利6月期1号集合资产管理计划资产管理合同（第一次修订）》于2021年9月9日正式生效。合同变更内容已于2021年9月13日在中国证券投资基金业协会完成备案。

十二、备查文件目录

（一）本集合计划备查文件目录

- 1、《西部证券安盈泓利6月期1号集合资产管理计划说明书》
- 2、《西部证券安盈泓利6月期1号集合资产管理计划资产管理合同（第一次修订）》
- 3、《西部证券安盈泓利6月期1号集合资产管理计划托管协议》
- 4、《关于西部证券安盈泓利6月期1号集合资产管理计划资产管理合同变更暨征询意见函的公告》
- 5、《关于西部证券安盈泓利6月期1号集合资产管理计划资产管理合同变更生效的公告》
- 6、管理人业务资格批件、营业执照

（二）查阅方式

网址：www.west95582.com

信息披露电话：95582

文件存放地点：上海市浦东新区耀体路276号1501室-1508室

投资者对本报告书如有任何疑问，可咨询管理人西部证券股份有限公司。

