

西部证券安盈泓利6月期1号集合资产管理计划

2022年第3季度报告

2022年07月01日-2022年09月30日

资产管理人:西部证券股份有限公司

资产托管人:兴业银行股份有限公司

§ 1 重要提示

集合资产管理计划托管人于2022年10月18日对本报告中的财务指标、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。

本报告期自2022年07月01日起至2022年09月30日止。

§ 2 资产管理计划产品概况

资产管理计划简称	西部证券安盈泓利6月期1号
资产管理计划编码	SLT750
资产管理计划运作方式	契约型开放式
资产管理计划合同生效日	2020年09月11日
报告期末资产管理计划份额总额	938,613,127.74份
资产管理计划合同存续期	10年
资产管理人	西部证券股份有限公司
资产托管人	兴业银行股份有限公司

§ 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（2022年07月01日 - 2022年09月30日）
本期已实现收益	20,144,032.92
本期利润	23,777,338.39
期末资产管理计划资产净值	1,076,513,813.47
期末资产管理计划份额净值	1.1469

§ 4 管理人报告

4.1 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，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。

4.2 报告期内资产管理计划的投资报告

1、投资经理简介

杨政祎先生，上海财经大学金融硕士，7年债券从业经历，曾任珠海农商行理财银行部债券配置岗、太平洋证券资产管理总部助理投资主办、云南国际信托债券投资经理、朝阳永续任基金研究员。2020年12月加入西部证券股份有限公司上海证券资产管理分公司，现任西部证券股份有限公司上海证券资产管理分公司投资经理。

耿帅先生，中国人民大学农林经济管理硕士，8年债券从业经历，曾任厦门国际银行金融市场部交易员、投资助理，西部证券证券投资部投资经理助理、投资经理。2022年8月加入西部证券股份有限公司上海证券资产管理分公司担任投资经理。

2、投资经理工作报告

2022年三季度，资金面宽松，经济复苏态势偏弱，债市以上涨为主，信用利差普遍收窄。偏弱的经济数据及略显意外的央行调降公开市场操作利率，债市收益率快速下行，10年国债突破前期2.7%平台下探到2.6%附近。9月，随着疫情边际好转，经济小幅修复，债市小幅回调。整个季度10年国债下行6bp，3年期信用债下行接近30bp，信用利差大幅压缩。

展望四季度，目前经济的主要矛盾点在于疫情扰动和地产疲软。国庆节后，官媒接连表态防疫政策不动摇，且假期新增阳性增多，各地防疫措施普遍收紧，预计对投资和消费的负面影响将加大。地产在不断放松政策刺激下，高频销售数据尚未出现持续改善，但资金来源预计将得到较大改善，居民对期房信心的修复尚需时间，房地产仍在艰难寻底过程。前三季度支撑经济的出口也将随着欧美经济下行而不断转弱，政策属性较强的基建仍将成为经济的压舱石，但也相对克制，托而不举。经济复苏仍然艰难，但也过了二季度疫情和地产最艰难的时刻，收益率很难突破前低。从社融及M2增速来看，今年的融资需求也远远弱于2020年疫情复苏后，预计收益率上行空间也有限，整体维持震荡观点。

操作策略上，在震荡市将采取“票息为王”的策略，精选期限较短、收益率较高的中东部地区城投债，同时采取骑乘策略增厚收益，在避免净值大幅波动的前提下争取稳健增长。

4.3 报告期内资产管理计划的投资表现

报告期间，本资产管理计划净值季度增长率为2.48%。



4.4 报告期内资产管理计划投资收益分配情况

在本报告期内未进行收益分配。

4.5 产品运用杠杆情况

截止2022年09月30日，本资产管理计划总资产与净资产的比例为141.82%。

4.6 两费及业绩报酬说明

1、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。

2、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。

3、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。

4.7 托管人履职报告

详见托管报告。

§ 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	1,492,019,753.88	97.73
	其中：债券	1,429,426,167.32	93.63
	资产支持证券	62,593,586.56	4.10
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	34,229,834.99	2.24
	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	413,016.74	0.03
8	其他资产	7,150.34	0.00
9	合计	1,526,669,755.95	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	032280062	22景德城投PPN001	700,000	71,092,000.00	6.60
2	012281989	22蚌埠高新SCP002	600,000	61,240,000.00	5.60
3	194627	22漯河D1	600,000	59,947,740.00	5.57
4	177595	21药城01	568,000	57,459,788.80	5.34
5	175177	20长寿G2	500,000	51,165,150.00	4.75

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基金投资明细

本报告期末未持有基金

5.4 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	180331	招融9优	230,000	23,002,576.00	2.14
2	136992	22国泰A2	180,000	17,425,692.00	1.62
3	082280443	22华发实业ABN001优先	100,000	10,109,000.00	0.94
4	189640	高链1优	100,000	10,005,810.00	0.93
5	193123	海幸1A2	200,000	1,499,980.00	0.14

5.5 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	7,150.34
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	7,150.34

5.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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。

§ 6 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	748,439,107.91
报告期期间资产管理计划总申购份额	285,641,547.36
报告期期间资产管理计划总赎回份额	95,467,527.53
报告期期末资产管理计划份额总额	938,613,127.74

§ 7 重大事项揭示

7.1 证券期货经营机构董事、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参与证券期货经营机构设立的资产管理计划

在本报告期内，发生本公司董事、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交易本集合计划的情况，截止2022年9月30日，本公司从业人员及配偶共持有份额18,441,256.64份；本公司其他关联方机构共持有份额 321,588,486.60份。

7.2 投资经理变更情况

本报告期内，本集合计划增加耿帅先生为投资经理。自2022年8月25日起，由杨政祎先生、耿帅先生共同本集合计划的投资经理。

7.3 重大关联交易情况

无。

7.4 资产管理合同约定的应当披露的其他信息

管理人西部证券股份有限公司以自有资金持有份额98,245,809.04份。本报告期内，本资产管理计划未进行合同变更。

§ 8 备查文件目录

8.1 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、管理人业务资格批件、营业执照

8.2 存放地点

上海市浦东新区耀体路276号1501室-1508室

8.3 查阅方式

网址：www.west95582.com

电话：95582

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。

