

# 西部利得安享收益 6 个月持有期集合资产管理计划

## 2022 年第 4 季度报告

### § 1 重要提示

资产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的法律责任。

资产管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用资产，但不保证资产管理计划一定盈利。

资产托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本资产管理计划合同规定，于 2023 年 1 月 16 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、投资组合报告等内容，认为复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本资产管理计划资产管理合同及其计划说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 10 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日止。

### § 2 基本情况

资产管理人：西部利得基金管理有限公司

资产托管人：上海浦东发展银行股份有限公司

合同生效日：2022 年 6 月 24 日

合同到期日：2032 年 6 月 23 日

投资类型：固定收益类

### § 3 主要财务指标、计划净值表现及投资收益分配情况

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2022 年 10 月 1 日 - 2022 年 12 月 31 日）
---------------	---



本期已实现收益	2,035,895.44
本期利润	2,178,351.44
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	<b>报告期末(2022年12月31日)</b>
期末总资产	305,398,637.48
期末资产净值	209,087,819.21
期末份额净值	1.036

### 3.2 资产管理计划产生的管理费、托管费、业绩报酬（如有）等费用：

金额单位：人民币元

费用（2022年10月1日 - 2022年12月31日）	
1、管理人报酬	176,762.78
其中：管理费	176,762.78
业绩报酬	-
2、托管费	7,070.50
3、投资顾问费	-
4、销售服务费	-
5、利息支出	338,936.44
其中：卖出回购金融资产支出	338,936.44
6、税金及附加	7,159.90
7、其他费用	25,668.80

注：1、委托财产的年管理费率为0.5%，每日计提，按月支付，其计算公式为：

日管理费 = 前一日委托财产净值 × 年管理费率 ÷ 当年天数。

2、委托财产的年托管费率为0.02%，每日计提，按月支付，其计算公式为：

日托管费 = 前一日委托财产净值 × 年托管费率 ÷ 当年天数。

### 3.3 本计划份额净值增长率

阶段	份额净值增长率	份额净值增长率标准差
自2022年10月1日至2022年12月31日	1.47%	0.05%

### 3.4 报告期内计划的投资收益分配情况

报告期本资产管理计划无收益分配情况发生。

## § 4 管理人报告

### 4.1 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，资产管理人严格遵循了《证券法》、《证券投资基金法》、本计划资产管理合同和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用资产，在严格控制风险的基础上，为计划份额持有人谋求最大利益。本报告期内本计划运作管理符合有关法律法规和资产管理合同的规定，无损害计划份额持有人利益的行为。

### 4.2 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.2.1 公平交易制度的执行情况

本投资管理人已根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规，制定了《西部利得基金管理有限公司公平交易管理办法》及《西部利得基金管理有限公司投资组合风险管理细则》并严格遵守上述制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制公平交易执行，以公平对待投资人。

对于场内交易，本投资管理人按照时间优先、价格优先的原则，对满足限价条件且对同一证券有相同交易需求的投资组合，采用了系统中的公平交易模块进行操作，实现了公平交易；对于场外交易，本投资管理人按照公司制度和流程进行规范。

本投资管理人风险管理部负责对各账户公平交易进行事后监察，分别于每季度和每年度末对本投资管理人管理的不同委托财产的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异以及不同时间窗口同向交易的交易价差进行分析。

#### 4.2.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本委托财产未参与交易所公开竞价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 5% 的交易。

### 4.3 投资经理情况

#### 4.3.1 本计划投资经理

张婉君

#### 4.3.2 报告期内投资经理变更情况

无

#### 4.4 管理人对宏观经济，以及资产管理计划的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 本季度回顾

2022年4季度在防疫政策优化、稳增长政策出台的背景下，市场对于经济复苏的预期不断增强。11月11日，国务院联防联控机制政府发布了进一步优化防疫工作的20条措施，为未来的防疫政策的调整做出了重要铺垫。另外，其他稳增长政策特别是房地产行业的利好政策持续出台也是导致市场风险偏好的发生一定调整的因素。债券资产有较大幅度的下跌，10年期国债收益率在11月内快速上行24bp，并于12月6日突破2.9%创下年内2.92%的收益率高点。信用债则在短短的一个月内跌回了年初的利差水平。利率曲线大幅平坦化上行，信用债各期限各等级信用利差均有大幅回升。

##### 4.4.2 产品运作情况

组合持仓以信用债、存单、利率债、逆回购为主，主要投资城投债及高等级产业债。4季度产品持仓债券票息及资本利得为主要净值贡献来源，产品净值增长稳定，杠杆在资金宽松的环境下维持中等偏上水平

##### 4.4.3 下季度展望

2023年1季度在稳增长的大环境下，宏观杠杆可能进一步提升。房地产投资下滑压力仍然较大。外部环境的不确定性下降，市场风险偏好提升，债券的确定性溢价可能继续压缩，债市总体保持中性偏谨慎判断。

#### 4.5 资产管理计划运用杠杆情况

截止2022年12月31日杠杆比例146.06%。

## § 5 托管人履职报告

本报告期内，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对西部利得安享收益6个月持有期集合资产管理计划的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、资产管理合同、托管协议的规定，不存在损害资产份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了资产托管人应尽的义务。

本报告期内，本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、资产管理合同、托管协议的规定，对西部利得安享收益6个月持有期集合资产管理计划的投资运作进行了监督，对资产管理计划资产净值的计算、资产管理计划份

额申购赎回价格的计算以及资产管理计划费用开支等方面进行了认真的复核，未发现资产管理人存在损害资产份额持有人利益的行为。

本报告期内，由西部利得基金管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的主要财务指标、资产管理计划产生的管理费、托管费、业绩报酬（如有）等费用、计划的投资收益分配情况中的财务数据真实、准确、完整。

## § 6 投资组合报告

### 6.1 报告期末资产组合情况

金额单位：人民币元

	项目	金额	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	10,000,000.00	3.27
3	固定收益投资	251,699,329.03	82.42
	其中：债券	251,699,329.03	82.42
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	23,829,981.70	7.80
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	19,865,670.33	6.50
7	其他各项资产	3,656.42	0.00
8	合计	305,398,637.48	100.00

### 6.2 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十名股票投资明细

报告期末本资产管理计划未持有股票。

### 6.3 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	101800023	18昆交产MTN001	320,000.00	34,089,512.33	16.30
2	112515	17昆投01	250,000.00	25,444,178.08	12.17
3	163172	20豫园01	246,000.00	25,083,844.93	12.00
4	194968	22滨海D8	240,000.00	24,562,257.54	11.75
5	012283252	22津南城投SCP002	170,000.00	17,161,849.32	8.21
6	102001060	20银川通联MTN001	120,000.00	12,003,353.42	5.74
7	152398	20云建01	115,000.00	11,849,221.92	5.67
8	012200168	22武清经开SCP003	100,000.00	10,128,972.60	4.84
9	182725	22滨D10	90,000.00	9,056,847.95	4.33
10	101800094	18津保投MTN001	80,000.00	8,464,043.84	4.05

### 6.4 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五名资产支持证券投资明细

报告期末本资产管理计划未持有资产支持证券。

### 6.5 报告期末按公允价值占资产管理计划净值比例大小排序的前十名基金投资明细

序号	基金代码	基金名称	数量（份）	公允价值(元)	占投资组合资产净值比例（%）
1	001871	前海开源货币B	10,000,000.00	10,000,000.00	4.78

## § 7 重大事项揭示

### 7.1 资产管理人从业人员持有本计划份额情况

#### 7.1.1 资产管理人从业人员持有本计划份额变动情况

2022年4季度资产管理人从业人员持有本计划份额无变化，未进行申购或赎回。

#### 7.1.2 报告期末资产管理人从业人员持有份额情况

项目	持有份额总额	持有份额占计划总份额比例 (%)
资产管理人从业人员	300,000.00	0.15

截至报告期期末，（除上述情况外）不存在未披露的本公司董事、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参与本计划的情况。



投资经理：张婉君

督察长：[Signature]

总经理：贺燕萍

西部利得基金管理有限公司

2023年01月31日

