

# 日信证券长安 2 号集合资产管理计划

## 2020 年第三季度报告

### 一、重要提示

本报告由日信证券长安 2 号集合资产管理计划（“本集合计划”）管理人国融证券股份有限公司（“国融证券”）编制。

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。

本集合计划的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本集合资产管理计划管理合同、说明书及风险揭示书。

本报告相关财务资料未经审计。

本报告期间：2020 年 7 月 1 日至 2020 年 9 月 30 日。

本报告内容由管理人负责解释。

### 二、集合计划概况

产品名称	日信证券长安 2 号集合资产管理计划
产品类型	固定收益类集合资产管理计划
成立日期	2015 年 11 月 3 日
存续期限	15 年
管理人	国融证券股份有限公司（原日信证券有限责任公司）
托管人	渤海银行股份有限公司
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司



### 三、管理人履职报告

#### (一) 投资经理简介

杨光玉，南京理工大学金融学学士，多年债券投资方面从业经历。曾供职于天津信唐货币经纪有限责任公司，2017年8月入职国融证券，负责国融资管小集合产品的投资运作。在信用债标的筛选、利率债波段操作等方面具有丰富的实战经验。

#### (二) 管理人履职情况

管理人在本报告期内严格依据法律法规、合同的约定，遵循自愿、公平、诚实信用和客户利益至上原则，恪尽职守、勤勉尽责地履行管理人各项合同义务。

管理人本着诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用本集合计划财产，在严格控制风险的基础上，为本集合计划持有人谋求最大利益，本集合计划运作合法合规，无损害持有人利益的行为。

#### (三) 报告期内投资经理工作报告

2020年三季度，新型冠状病毒对国内的影响程度明显降低，经济出现较大幅度的反弹，经济数据来看，8月国内主要经济指标均有改善。9月PMI显示9月制造业继续复苏，新订单指数回升显示外需继续改善，服务业PMI提速改善。从9月以来的中观高频数据显示，终端需求好坏参半，工业生产仍在高位。物价方面，9月CPI与PPI同比或纷纷回落。根据社融增速对经济的领先性，预计本轮经济复苏有望延续到明年上半年。近期来看，9月央行加大公开市场投放力度，净释放6100亿元跨季资金，结构性存款压降压力暂缓，存单量缩价升，利率债供给回落，季末财政投放加快，以及我国国债将被纳入WGBI指数等利好债市情绪，但经济稳步恢复，社融大超预期，消费增速首次转正，整体来看，债市熊市延续，总体震荡下跌。

展望四季度，债市利多因素主要包括PPI短期回落、四季度债市供需格局改善、临近美国大选全球资本市场不确定因素增加。但利空因素主要包括：第一，基本面对债市整体不利，9月PMI与高频数据均显示经济稳步恢复，外需持续向好，社融与M2增速拐点可能出现在11-12月；第二，10月资金面依然面临挑战，10月是缴税大月，财政支出在季初或较9月放缓，结构性存款压降压力仍大，且1.9万亿存单将集中到期；第三，从过去几轮熊尾利率调整位路、隐含税率以及社融-M2增速差领先关系来看，利率拐点未至。因此，四季度债券市

场机遇与风险并存。我们将继续稳健运作，在保持良好流动性、严控信用风险的基础上，提高产品收益，以良好的业绩回馈广大投资者。

#### 四、托管人履职报告

托管人在本报告期内严格遵守《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》和《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》等有关法律法规规定并按照本资管计划合同和托管协议的约定，诚信、尽责地履行了托管人义务，不存在损害本集合计划投资人利益的行为。本资管计划托管人渤海银行股份有限公司于2020年10月复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

#### 五、资产管理计划投资表现

##### （一）净值表现（2020.7.1-2020.9.30）

截至2020年9月30日，集合资产管理计划单位净值为1.0067元，累计单位净值为1.4550元，报告期间累计单位净值增长率为：1.32%。

##### （二）主要财务指标（2020.7.1-2020.9.30）

单位：元

本期已实现收益	3,984,734.39
本期利润	4,064,814.90
期末资产净值	243,290,097.82
期末单位份额净值	1.0067
本期累计单位净值增长率	1.32%
期末单位份额累计净值	1.4550

(三) 财务报表

## 资产负债表

国融证券\_\_日信证券长安2号集合资产管理计划\_\_专用表

日期：2020-09-30

单位：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
<b>资产：</b>			<b>负债：</b>		
银行存款	2,756,032.93	1,284,230.27	短期借款	0.00	0.00
结算备付金	84,638.73	742,917.57	交易性金融负债	0.00	0.00
存出保证金	16,060.57	2,189.14	衍生金融负债	0.00	0.00
交易性金融资产	295,548,209.49	92,387,168.72	卖出回购金融资产款	60,209,408.58	0.00
其中：股票投资	0.00	0.00	应付证券清算款	1,902,151.37	0.00
债券投资	287,565,645.00	92,162,768.72	应付赎回款	0.00	0.00
基金投资	7,982,564.49	224,400.00	应付管理人报酬	455,872.11	187,189.87
权证投资	0.00	0.00	应付托管费	17,093.15	7,019.63
资产支持证券投资	0.00	0.00	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	29,950.46	4,358.37
买入返售金融资产	0.00	9,000,090.00	应交税费	208,834.55	75,226.14
应收证券清算款	0.00	1,521.37	应付利息	56,467.91	0.00
应收利息	7,464,934.23	2,210,548.47	应付利润	0.00	0.00
应收股利	0.00	0.00	其他负债	0.00	0.00
应收申购款	300,000.00	0.00	负债合计	62,879,778.13	273,794.01
其他资产	0.00	0.00			
			<b>所有者权益：</b>		
			实收基金	241,670,868.88	102,138,068.16
			未分配利润	1,619,228.94	3,216,803.37
			所有者权益合计	243,290,097.82	105,354,871.53
<b>资产合计</b>	<b>306,169,875.95</b>	<b>105,628,665.54</b>	<b>负债和所有者权益总计</b>	<b>306,169,875.95</b>	<b>105,628,665.54</b>

# 损益表

国融证券\_\_日信证券长安2号集合资产管理计划\_\_专用表

日期：2020年07月 — 2020年09月

单位：元

序号	项目	本期数	本年累计数
1	一、收入	5,037,044.87	11,343,454.51
2	1、利息收入	4,054,196.58	9,261,814.41
3	其中：存款利息收入	10,606.40	28,815.31
4	债券利息收入	4,028,822.50	9,175,306.52
5	资产支持证券利息收入	0.00	0.00
6	买入返售证券收入	14,767.68	57,692.58
7	2、投资收益	878,241.39	1,615,318.18
8	其中：股票投资收益	0.00	0.00
9	债券投资收益	633,346.48	1,330,907.89
10	基金投资收益	244,894.91	284,410.29
11	权证投资收益	0.00	0.00
12	资产支持证券投资收益	0.00	0.00
13	衍生工具收益	0.00	0.00
14	股利收益	0.00	0.00
15	个股期权收益	0.00	0.00
16	3、公允价值变动收益	81,074.69	442,789.71
17	4、其他收入	23,532.21	23,532.21
18	二、费用	972,229.97	2,108,574.84
19	1、管理人报酬	455,818.07	1,039,494.94
20	2、托管费	17,093.15	38,981.01
21	3、销售服务费	0.00	0.00
22	4、交易费用	33,744.73	55,514.31
23	5、利息支出	440,723.52	902,633.77
24	其中：卖出回购金融资产支出	440,723.52	902,633.77
25	6、其他费用	24,850.50	71,950.81
26	三、利润总和	4,064,814.90	9,234,879.67

## 六、投资组合报告（2020年9月30日）

### （一）投资组合情况<sup>①</sup>

资产品种	金额（元）	金额占总资产比例（%）
银行存款	2,756,032.93	0.90
结算备付金	84,638.73	0.03
存出保证金	16,060.57	0.01
债券投资	287,565,645.00	93.92
基金投资	7,982,564.49	2.61
其他资产 <sup>②</sup>	7,764,934.23	2.54
合计	306,169,875.95	100.00

注：①、因四舍五入原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

②、其他资产包括：应收利息+应收申购款。

### （二）本报告期内份额变动情况

单位：份

期初份额总额	192,739,429.53
报告期间总参与份额	91,557,796.83
报告期间总退出份额	42,626,357.48
报告期末份额总额	241,670,868.88

## 七、资产管理计划运用杠杆情况

截至本报告期末，本集合计划的正回购资金余额占净资产的比例为 24.75%。



## 八、资产管理计划支付的管理费、托管费、业绩报酬等费用的计提基准、计提方式和支付方式

费用类别	计提基准	计提方式	支付方式
管理费	$H = E \times 0.8\% \div 365$ H 为每日应计提的固定管理费； E 为前一日集合计划资产净值	每日计提	按自然季度支付
托管费	$H = E \times 0.03\% \div 365$ H 为每日应计提的托管费； E 为前一日集合计划资产净值	每日计提	按自然季度支付
管理人业绩报酬	管理人公布计提基准，超出部分的 60%	收益分配日、投资者份额退出确认日和计划终止清算确认日	不超过 6 个月一次，因投资者退出资产管理计划，不受前述提取频率的限制

## 九、资产管理计划投资收益分配情况

单位：元

报告期委托人收益分配	8,752,262.43
报告期管理人业绩报酬分配	1,523,128.24

## 十、投资经理变更、重大关联交易等涉及投资者权益的重大事项

- 1、本集合计划管理人及托管人报告期内没有发生任何涉及本集合计划管理、财产以及托管业务的诉讼事项。
- 2、投资经理变更：无。
- 3、报告期末，本计划投资于本机构、托管人及前述机构的控股股东、实际控制人或者其他关联方发行的证券或者承销期内承销的证券的情况：无。
- 4、报告期末，管理人的董事、监事、从业人员及其配偶、控股股东、实际控制人或者其他

关联方参与本资产管理计划的情况：无。

5、其他涉及投资者权益的重大事项：无。

## 十一、信息披露的查阅方式

网址：<http://www.grzq.com/soa/views/index.html>

热线电话：95385



国融证券股份有限公司

2020年10月29日



日信证券长安 2 号集合资产管理计划  
托管人报告 ( 2020.07.01 -2020.09.30 )

本托管人依据《日信证券长安 2 号集合资产管理计划合同》，自 2013 年 11 月 03 日起托管日信证券长安 2 号集合资产管理计划 ( 以下称“本计划”) 资产。

本报告期间，渤海银行股份有限公司及时准确地执行了管理人的投资和清算指令，办理了本计划名下的资金往来。

本报告期间，渤海银行股份有限公司对管理人的投资运作行为按合同约定进行了监督，未发现存在损害委托人利益的行为。

本报告期间，渤海银行股份有限公司对报告期内资产净值的计算、费用开支方面进行了复核，未发现管理人存在损害委托人利益的行为。

渤海银行股份有限公司复核了本计划资产管理报告(2019 年第三季度报告)中的有关财务数据部分，内容真实、准确和完整。



渤海银行股份有限公司托管业务部

2020 年 10 月 24 日

