

国融证券国融安鑫 5 号集合资产管理计划

2021 年第二季度报告

计划管理人：国融证券股份有限公司

计划托管人：招商银行股份有限公司杭州分行

报告期间：2021年4月1日至2021年6月30日



目录

| | |
|--|---|
| 一、重要提示..... | 1 |
| 二、集合计划概况..... | 1 |
| 三、管理人履职报告..... | 1 |
| (一)投资经理简介..... | 1 |
| (二)管理人履职情况..... | 2 |
| (三)报告期内投资经理工作报告..... | 2 |
| 四、托管人履职报告..... | 2 |
| 五、资产管理计划投资表现..... | 3 |
| (一)净值表现(2021.4.1-2021.6.30)..... | 3 |
| (二)主要财务指标(2021.4.1-2021.6.30)..... | 3 |
| 六、投资组合报告(2021年6月30日)..... | 3 |
| (一)投资组合情况..... | 3 |
| (二)本报告期内份额变动情况..... | 4 |
| 七、资产管理计划运用杠杆情况..... | 4 |
| 八、财务会计报告..... | 4 |
| (一)资产负债表..... | 4 |
| (二)损益表..... | 5 |
| 九、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..... | 7 |
| 十、资产管理计划投资收益分配情况..... | 7 |
| 十一、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..... | 7 |
| 十二、信息披露的查阅方式..... | 8 |

一、重要提示

本报告由国融证券国融安鑫5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：2021年4月1日至2021年6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 | 国融证券国融安鑫5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 | 2018年4月2日 |
| 存续期限 | 10年 |
| 管理人 | 国融证券股份有限公司 |
| 托管人 | 招商银行股份有限公司杭州分行 |
| 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

王金蕾，女，南开大学金融学硕士，多年债券投资相关经验，曾先后供职于渤海证券、华创证券和威海市商业银行等机构，2019年6月入职国融证券资产管理业务总部，从事债券投资工作。投资经理已取得基金从业资格，且最近三年未被监管机构采取重大行政监管措施、

行政处罚。

（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、诚实信用和投资者利益至上原则，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

经历了 2020 年延续至今的新冠疫情冲击，各国都积极进行了货币和财政政策的应对，需求端得到了一定刺激，但是供给方面，印度、南非、巴西等生产国和原材料国的疫情或居高不下或出现反复，供给侧方面恢复整体弱于需求侧恢复。

不光供给和需求出现了结构性的特征，国别之间疫情防控进度和刺激手段的不同，也带来了国别之间恢复进度的结构性特征，美国出现了从 PPI 到 CPI 的普遍升高，而中国 PPI 传导到 CPI 的影响有限，目前美国侧重“涨”而中国侧重“滞”，带来两国货币政策的微妙差别。

上述的结构化特征，给投资带来了一定的挑战，在错综复杂的形势和多样化信息中，投资继续回归本源，关注总需求和总供给的缺口。债券方面，广义上的总需求一定时间内依然弱于总供给，债券依然具备配置价值，可以适当久期+杠杆的操作。权益方面，谨防美联储“急刹车”、高估值品种的高位回落以及美元回流带来的压力，目前看依然是震荡为主，谨慎配置，找结构化方面要收益，可以考虑新基建、消费以及互联网等板块的结构化机会。

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。本资管计划托管人招商银行股份有限公司杭州分行于 2021 年 7 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 (2021. 4. 1-2021. 6. 30)

截至2021年6月30日，集合资产管理计划单位净值为1.0277元，累计单位净值为1.2542元，报告期间累计单位净值增长率为：2.41%。

(二) 主要财务指标 (2021. 4. 1-2021. 6. 30)

单位：元

| | |
|-------------|----------------|
| 本期已实现收益 | 2,409,563.87 |
| 本期利润 | 3,683,629.11 |
| 期末资产净值 | 128,507,168.83 |
| 期末单位份额净值 | 1.0277 |
| 本期累计单位净值增长率 | 2.41% |
| 期末单位份额累计净值 | 1.2542 |

六、投资组合报告 (2021年6月30日)

(一) 投资组合情况^①

| 资产品种 | 金额(元) | 金额占总资产比例(%) |
|-------------------|----------------|-------------|
| 银行存款 | 583,627.90 | 0.27 |
| 结算备付金 | 707,943.18 | 0.33 |
| 债券投资 | 175,574,601.00 | 82.09 |
| 基金投资 | 8,768,268.02 | 4.10 |
| 买入返售金融资产 | 21,550,000.00 | 10.08 |
| 其他资产 ^② | 6,687,736.19 | 3.13 |
| 合计 | 213,872,176.29 | 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。

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、应收证券清算款、存出保证金。

（二）本报告期内份额变动情况

单位：份

| | |
|-----------|----------------|
| 期初份额总额 | 131,788,590.79 |
| 报告期间总参与份额 | 16,856,554.34 |
| 报告期间总退出份额 | 23,603,488.68 |
| 报告期末份额总额 | 125,041,656.45 |

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 66.02%。

八、财务会计报告

（一）资产负债表

资产负债表

国融证券__国融证券国融安鑫5号集合资产管理计划__专用表

日期：2021-06-30

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 |
|-------------|-----------------------|-----------------------|-------------------|-----------------------|-----------------------|
| 资产： | | | 负 债： | | |
| 银行存款 | 583,627.90 | 1,105,660.55 | 短期借款 | 0.00 | 0.00 |
| 结算备付金 | 707,943.18 | 344,939.21 | 交易性金融负债 | 0.00 | 0.00 |
| 存出保证金 | 5,379.19 | 298,404.51 | 衍生金融负债 | 0.00 | 0.00 |
| 交易性金融资产 | 184,342,869.02 | 137,829,645.00 | 卖出回购金融资产款 | 84,834,403.64 | 36,839,824.00 |
| 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 | 175,574,601.00 | 134,324,705.00 | 应付赎回款 | 0.00 | 0.00 |
| 基金投资 | 8,768,268.02 | 3,504,940.00 | 应付管理人报酬 | 253,474.42 | 220,542.93 |
| 权证投资 | 0.00 | 0.00 | 应付托管费 | 6,336.90 | 5,513.53 |
| 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 | 37,959.24 | 33,488.37 |
| 买入返售金融资产 | 21,550,000.00 | 4,980,000.00 | 应交税费 | 173,413.92 | 130,259.76 |
| 应收证券清算款 | 1,751,171.19 | 0.00 | 应付利息 | 59,419.34 | 11,009.42 |
| 应收利息 | 4,931,185.81 | 4,291,220.59 | 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 | 0.00 | 0.00 | 负债合计 | 85,365,007.46 | 37,240,638.01 |
| 其他资产 | 0.00 | 2,957,413.25 | | | |
| | | | 所有者权益： | | |
| | | | 实收基金 | 125,041,656.45 | 108,258,361.21 |
| | | | 未分配利润 | 3,465,512.38 | 6,308,283.89 |
| | | | 所有者权益合计 | 128,507,168.83 | 114,566,645.10 |
| 资产合计 | 213,872,176.29 | 151,807,283.11 | 负债和所有者权益总计 | 213,872,176.29 | 151,807,283.11 |

(二) 损益表

损益表

国融证券__国融证券国融安鑫5号集合资产管理计划__专用表

日期：2021-06-30

单位：元

| 序号 | 项目 | 本期数 | 本年累计数 |
|----|---------------|--------------|--------------|
| 1 | 一、收入 | 4,506,449.38 | 6,316,256.59 |
| 2 | 1、利息收入 | 2,694,186.05 | 5,264,541.14 |
| 3 | 其中：存款利息收入 | 3,218.37 | 7,803.37 |
| 4 | 债券利息收入 | 2,480,388.35 | 4,792,081.35 |
| 5 | 资产支持证券利息收入 | 0.00 | 0.00 |
| 6 | 买入返售证券收入 | 210,579.33 | 464,656.42 |
| 7 | 2、投资收益 | 538,594.29 | 727,023.06 |
| 8 | 其中：股票投资收益 | 0.00 | 0.00 |
| 9 | 债券投资收益 | 491,631.79 | 659,252.66 |
| 10 | 基金投资收益 | 20,412.50 | -16,579.60 |
| 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 | 26,550.00 | 84,350.00 |
| 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 | 1,276,034.97 | 327,058.32 |
| 17 | 4、其他收入 | -2,365.93 | -2,365.93 |
| 18 | 二、费用 | 822,820.27 | 1,615,338.26 |
| 19 | 1、管理人报酬 | 253,474.42 | 521,964.22 |
| 20 | 2、托管费 | 6,336.90 | 13,049.16 |
| 21 | 3、销售服务费 | 0.00 | 0.00 |
| 22 | 4、交易费用 | 29,779.93 | 83,412.87 |
| 23 | 5、利息支出 | 508,315.49 | 951,121.97 |
| 24 | 其中：卖出回购金融资产支出 | 508,315.49 | 951,121.97 |
| 25 | 6、其他费用 | 24,913.53 | 45,790.04 |
| 26 | 三、利润总和 | 3,683,629.11 | 4,700,918.33 |

九、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 | $H = E \times 0.02\% \div 365$ 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 |

十、资产管理计划投资收益分配情况

单位：元

| | |
|--------------|--------------|
| 报告期投资者收益分配 | 5,611,511.20 |
| 报告期管理人业绩报酬分配 | 335,394.72 |

十一、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：

| 关联方债券持仓简称 | 持仓金额（万元） |
|-----------|----------|
| 18 长安 03 | 700 |

4、 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。

十二、信息披露的查阅方式

网址：<http://www.grzq.com>

热线电话：95385

国融证券股份有限公司
2021年7月29日



国融证券国融安鑫 5 号集合资产管理计划

2021 年二季度托管人报告

托管人声明,在本报告期内,资产托管人——招商银行股份有限公司杭州分行严格遵守有关法律法规、资产管理合同关于托管人职责的约定,尽职尽责地履行了托管职责。

在管理人提供的各项数据和信息真实、准确、有效的前提下,在我行能够知悉和掌握的情况范围内,我行对资产管理人报告中的财务指标、净值表现、投资组合等财务数据进行了复核,未发现存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏的情形。

特此报告。

招商银行杭州分行资产托管部

二〇二一年七月十九日



