

国融证券国融安钰进取 1 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.....	1
（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.....	5
（一）资产负债表.....	5
（二）损益表.....	6
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.....	8
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钰进取1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	国融证券国融安钰进取1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	2019年3月8日
存续期限	5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

赵国琳，女，英国曼切斯特大学管理学硕士，多年金融工作经验。2015年研究生毕业后任职于英国美银美林伦敦全球税务总部，亚欧地区税务核算小组担任税务分析助理。2017年加入国融证券，历任产品研发、投资经理助理和投资经理。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

2021 年上半年，我国宏观经济先进先出，周期领先于其他国家地区率先恢复。回顾二季度债券市场走势，整体债市收益率处于震荡反弹的态势中。资金面仍维持中性，货币利率中枢抬升，曲线有所走平。受到全球经济复苏的影响，PPI 在二季度连续走升，CPI 小幅反弹。通胀预期在二季度出现拐点，海外利率冲高回落，风险偏好有所抬升，股市也在 5 月中旬迎来一波情绪回暖的反弹。这个阶段 A 股的上涨结构分化明显，创业板在新能源的带动下强势反攻，周期板块则在监管释放大宗商品价格调控预期后出现分歧，顺周期虽然在二季度仍延续强势，但市场对于周期见顶的讨论升温。与此同时，中小市值标的为主的中证 1000 指数 5 月以来连续上涨，年初以来涨幅超越沪深 300 与上证 50，市场后续的“大切小”也值得关注。

上半年整体经济还是主要依赖于出口与房地产，近期经济数据显示工业生产边际降速，需求端房地产投资首度弱于季节性、基建投资同比转负、制造业投资温和修复，消费恢复持续偏弱，出口维持高增长但略低于预期与季节性。展望三季度，我们认为出口和房地产对经济的支撑作用将有所减弱，带动经济扩张动能的边际下降，全年大体呈前高后低的走势。策略上，预计三季度货币环境仍将以稳为主，但利率波动可能较之前将有所提高，可寻找波段交易机会。信用方面还是需提防主体资质较弱的标的，严控风险，不下沉资质。

权益方面，今年以来市场风格切换加速，对于传统周期板块汇总景气度有望持续改善的行业，如银行、证券，可在低位进行配置。7 月中报也是一个重要的业绩验证窗口，将重点关注行业景气度高，业绩有望超预期的板块，如化工、电子、半导体等。同时，需密切关注美联储 QE 退出的节奏，提防美股下跌给 A 股带来的冲击。

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1.0258元,累计单位净值为1.1664元,报告期间累计单位净值增长率为:1.75%。

(二) 主要财务指标 (2021.4.1-2021.6.30)

单位: 元

本期已实现收益	154,743.97
本期利润	315,272.89
期末资产净值	20,652,096.04
期末单位份额净值	1.0258
本期累计单位净值增长率	1.75%
期末单位份额累计净值	1.1664

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	142,079.94	0.57
结算备付金	327,175.83	1.31
股票投资	335,768.40	1.35
债券投资	14,954,008.90	60.08
基金投资	7,556,113.92	30.36
应收证券清算款	1,099,602.74	4.42
其他资产 ^②	474,519.77	1.91
合计	24,889,269.50	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、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	11,133,197.41
报告期间总参与份额	8,998,959.03
报告期间总退出份额	0.00
报告期末份额总额	20,132,156.44

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 19.85%。

八、财务会计报告

(一) 资产负债表

资产负债表

国融证券____国融证券国融安钰进取 1 号集合资产管理计划____专用表

日期：2021-6-30

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	142,079.94	199,317.34	短期借款	0.00	0.00
结算备付金	327,175.83	44,863.99	交易性金融负债	0.00	0.00
存出保证金	815.97	1,125.05	衍生金融负债	0.00	0.00
交易性金融资产	22,845,891.22	12,726,326.75	卖出回购金融资产款	4,099,959.00	399,996.00
其中：股票投资	335,768.40	97,664.00	应付证券清算款	63,769.32	5,245.72
债券投资	14,954,008.90	11,527,353.40	应付赎回款	0.00	0.00
基金投资	7,556,113.92	1,101,309.35	应付管理人报酬	47,353.78	24,607.88
权证投资	0.00	0.00	应付托管费	789.28	615.23
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	6,853.73	6,495.36
买入返售金融资 产	0.00	0.00	应交税费	18,448.35	14,854.59
应收证券清算款	1,099,602.74	6,837.80	应付利息	0.00	-147.66
应收利息	473,703.80	429,624.70	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	4,237,173.46	451,667.12
其他资产	0.00	0.00			
			所有者权益：		
			实收基金	20,132,156.44	12,353,817.23
			未分配利润	519,939.60	602,611.28
			所有者权益合计	20,652,096.04	12,956,428.51
资产合计	24,889,269.50	13,408,095.63	负债和所有者权益 总计	24,889,269.50	13,408,095.63

(二) 损益表

损益表

国融证券__国融证券国融安钰进取 1 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	403,075.93	801,955.16
2	1、利息收入	187,821.79	370,583.10
3	其中: 存款利息收入	744.94	1,472.59
4	债券利息收入	187,029.72	368,839.66
5	资产支持证券利息收入	0.00	0.00
6	买入返售证券收入	47.13	270.85
7	2、投资收益	54,377.87	109,703.44
8	其中: 股票投资收益	10,332.50	15,274.25
9	债券投资收益	21,720.03	30,970.31
10	基金投资收益	6,191.40	43,942.65
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	16,133.94	19,516.23
15	个股期权收益	0.00	0.00
16	3、公允价值变动收益	160,876.27	321,668.62
17	4、其他收入	0.00	0.00
18	二、费用	87,803.04	143,914.18
19	1、管理人报酬	47,353.78	74,906.49
20	2、托管费	789.28	1,409.12
21	3、销售服务费	0.00	0.00
22	4、交易费用	14,026.60	31,701.74
23	5、利息支出	18,626.27	25,744.58
24	其中: 卖出回购金融资产支出	18,626.27	25,744.58
25	6、其他费用	7,007.11	10,152.25
26	三、利润总和	315,272.89	658,040.98

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	$H = E \times 1.2\% \div 365$ 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 50%	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	0.00
报告期管理人业绩报酬分配	0.00

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：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：

人数	份额	占产品份额
1	2,000,000.00	9.93%

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

国融证券国融安钰进取 1 号集合资产管理计划

2021 年第二季度托管人报告

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、财务会计报告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

2021 年 07 月 15 日

