

日信证券长安 2 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：渤海银行股份有限公司

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.....	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：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	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
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，女，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，负责集合资管产品的投资运作。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。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年二季度以来，随着美欧疫情持续好转，在财政大力支持带动下，发达经济体需求快速释放。但生产仍受疫情抑制，供给跟不上需求上涨步伐，加之发达经济体维持大幅宽松货币政策，全球大宗商品价格大幅走高，推动各国生产领域通胀大幅走高，全球通胀压力加大。出口保持强劲，国内经济持续恢复，央行货币政策维持中性，并继续向常态化回归，在结构性政策支持下，社融增速持续下降，而信贷质量维持向好，政策利率保持不变。债市收益率呈现缓慢下行的走势。尽管经济基本面继续复苏、通胀上行，但由于上半年利率债供给节奏偏慢，同时信用收缩导致可配资产较少，使得资金面较为宽松，带动收益率下行。10Y国债收益率再度下行至3.10%的低位，10Y国开收益率下行至3.50%附近。

展望三季度，预计三季度我国货币政策不会收紧，但货币政策力度不会像上半年那样大。今年国债和地方债发行节奏偏慢，三季度预计将提速。按照年初计划新增量测算，三季度月均新增额较一二季度有所提升，供需关系趋紧。此外，美联储退出QE逐步提上日程，海外货币政策收紧也对国内货币政策产生一定影响。城投债今年相关政策边际收紧，信用风险逐步释放，区域选择仍需慎重。目前，各类品种信用利差均下行至历史偏低位置，利差保护不足，进一步压缩空间有限，可适当获利了结，等待市场调整后再进行配置。我们将在策略上利率债和信用债均衡配置，继续等待全球经济的演化。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1.0631元，累计单位净值为1.5114元，报告期间累计单位净值增长率为：1.65%。

（二）主要财务指标（2021.4.1-2021.6.30）

单位：元

本期已实现收益	4,865,094.21
本期利润	5,638,881.37
期末资产净值	234,948,395.74
期末单位份额净值	1.0631
本期累计单位净值增长率	1.65%
期末单位份额累计净值	1.5114

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	1,672,413.27	0.47
结算备付金	409,274.66	0.11

债券投资	314,356,102.17	87.70
基金投资	9,546,219.35	2.66
其他资产 ^②	32,449,300.56	9.05
合计	358,433,310.01	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：买入返售金融资产+应收利息+应收证券清算款+应收申购款+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	233,166,901.99
报告期间总参与份额	22,550,004.95
报告期间总退出份额	34,721,252.46
报告期末份额总额	220,995,654.48

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 51.91%。

八、财务会计报告

(一) 资产负债表

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：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	1,672,413.27	1,321,986.88	短期借款	0.00	0.00
结算备付金	409,274.66	204,453.93	交易性金融负债	0.00	0.00
存出保证金	13,281.82	22,262.56	衍生金融负债	0.00	0.00
交易性金融资产	323,902,321.52	324,011,122.66	卖出回购金融资产款	121,959,252.02	110,039,597.50
其中：股票投资	0.00	0.00	应付证券清算款	500,835.53	0.00
债券投资	314,356,102.17	313,130,950.00	应付赎回款	0.00	1,080,882.00
基金投资	9,546,219.35	10,880,172.66	应付管理人报酬	480,447.27	501,324.72
权证投资	0.00	0.00	应付托管费	18,022.15	18,799.68
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	17,818.74	24,488.45
买入返售金融资产	19,800,000.00	20,100,000.00	应交税费	400,872.40	273,652.88
应收证券清算款	107,645.69	1,210,489.26	应付利息	107,666.16	98,386.62
应收利息	11,398,373.05	9,935,359.73	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	1,130,000.00	0.00	负债合计	123,484,914.27	112,037,131.85
其他资产	0.00	0.00			
			所有者权益：		
			实收基金	220,995,654.48	239,784,872.89
			未分配利润	13,952,741.26	4,983,670.28
			所有者权益合计	234,948,395.74	244,768,543.17
资产合计	358,433,310.01	356,805,675.02	负债和所有者权益总计	358,433,310.01	356,805,675.02

(二) 损益表

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：2021-06-30

单位：元

序号	项目	本期数	本年累计数
1	一、收入	7,302,904.47	13,251,950.14
2	1、利息收入	5,497,529.40	10,945,555.56
3	其中：存款利息收入	6,969.27	11,846.50
4	债券利息收入	5,141,999.89	10,235,529.95
5	资产支持证券利息收入	0.00	0.00
6	买入返售证券收入	348,560.24	698,179.11
7	2、投资收益	1,044,965.95	1,783,742.31
8	其中：股票投资收益	0.00	0.00
9	债券投资收益	939,873.95	1,234,731.03
10	基金投资收益	114,492.00	556,514.84
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	-9,400.00	-9,400.00
14	股利收益	0.00	1,896.44
15	个股期权收益	0.00	0.00
16	3、公允价值变动收益	774,259.12	536,502.27
17	4、其他收入	-13,850.00	-13,850.00
18	二、费用	1,664,023.10	3,403,795.08
19	1、管理人报酬	480,589.61	961,470.11
20	2、托管费	18,022.15	36,055.16
21	3、销售服务费	0.00	0.00
22	4、交易费用	10,577.26	23,955.29
23	5、利息支出	1,127,288.78	2,328,914.01
24	其中：卖出回购金融资产支出	1,127,288.78	2,328,914.01
25	6、其他费用	27,545.30	53,400.51
26	三、利润总和	5,638,881.37	9,848,155.06

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	$H = E \times 0.03\% \div 365$ 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

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
报告期管理人业绩报酬分配	152,836.74

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：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



日信证券长安2号集合资产管理计划

托管人报告（2021.04.01-2021.06.30）

本托管人依据《日信证券长安2号集合资产管理计划集合资产管理合同》，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(2021年第二季度报告)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

2021年07月15日



