

国融证券国融安盛 1 号集合资产管理计划 2021 年第三季度报告

计划管理人：国融证券股份有限公司

计划托管人：上海浦东发展银行股份有限公司

报告期间：2021 年 7 月 1 日至 2021 年 9 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. 7. 1-2021. 9. 30)	3
(二) 主要财务指标 (2021. 7. 1-2021. 9. 30)	3
六、投资组合报告 (2021 年 9 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	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盛 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 7 月 1 日至 2021 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	国融证券国融安盛 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	2018 年 4 月 24 日
存续期限	10 年
管理人	国融证券股份有限公司
托管人	上海浦东发展银行股份有限公司
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

李青华，女，武汉理工大学毕业，多年金融工作经验。2017 年加入国融证券，历任投资经理助理、投资经理。投资经理已取得基金从业资格，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 年三季度以来，债券市场呈现出先震荡再下行的走势。7 月 7 日，国常会意外提及降准；7 月 9 日，超预期的全面降准，均使得 10 年期国债收益率较大幅度下行。8 月及 9 月债市整体走势主要受经济及金融数据走弱及稳健的货币政策与待释放的政府债供给压力的综合扰动。8 月 10 日，央行二季度货币政策执行报告指出：“稳健的货币政策要灵活精准、合理适度，稳字当头，坚持实施正常的货币政策。”受此影响，10 年期国债收益率小幅上行。8 月 16 日，MLF 缩量等价续作，带动债券收益率小幅走高。9 月 8 日，央行货币政策司司长孙国峰表示“7 月降准后，金融机构运用降准释放的长期资金归还了一部分中期借贷便利，金融机构的流动性需求得到了充分满足。今后几个月流动性供求将保持基本平衡，不会出现大的缺口和大的波动。

展望四季度，经济基本面或成利率下行支撑，通胀继续维持高位震荡。狭义流动性下半年将出现边际宽松，资金中枢或有抬升，货币政策短期不会进行降准。广义流动性的收缩仍将持续，表外信贷继续向表内信贷回归。货币政策维持中性，依然保持灵活稳健，引导实际贷款利率下行。因此，四季度债券市场不应过度悲观，中期来看伴随着经济潜在增速的不断降低，利率的中枢也将不断下降，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

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”）在对国融证券国融安盛 1 号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、

资产管理合同的规定，对国融证券国融安盛 1 号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，由国融证券股份有限公司编制本托管人复核的本报告中的资产管理计划投资表现、投资组合报告、投资收益分配情况财务数据真实、准确、完整。

五、资产管理计划投资表现

（一）净值表现（2021.7.1-2021.9.30）

截至 2021 年 9 月 30 日，集合资产管理计划单位净值为 1.0127 元，累计单位净值为 1.2718 元，报告期间累计单位净值增长率为：1.48%。

（二）主要财务指标（2021.7.1-2021.9.30）

单位：元

本期已实现收益	5,489,066.28
本期利润	6,038,821.13
期末资产净值	346,299,716.03
期末单位份额净值	1.0127
本期累计单位净值增长率	1.48%
期末单位份额累计净值	1.2718

注：本期累计单位净值增长率=（期末累计单位净值-期初累计单位净值）/期初累计单位净值*100%

六、投资组合报告（2021 年 9 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	3,443,008.56	0.78

结算备付金	913,343.22	0.21
存出保证金	32,399.93	0.01
债券投资	396,594,050.00	89.76
基金投资	10,431,321.30	2.36
买入返售金融资产	15,200,000.00	3.44
其他资产	15,199,616.06	3.44
资产合计	441,813,739.07	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。

（二）本报告期内份额变动情况

单位：份

期初份额总额	299,175,389.51
报告期间总参与份额	93,249,256.79
报告期间总退出份额	50,450,998.43
报告期末份额总额	341,973,647.87

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 27.17%。

八、财务会计报告

(一) 资产负债表

资产负债表

国融证券__国融证券国融安盛1号集合资产管理计划__专用表

日期：2021-9-30

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	3,443,008.56	7,228,357.65	短期借款	0.00	0.00
结算备付金	913,343.22	338,138.80	交易性金融负债	0.00	0.00
存出保证金	32,399.93	6,959.09	衍生金融负债	0.00	0.00
交易性金融资产	407,025,371.30	397,880,680.10	卖出回购金融资产款	94,098,491.60	177,384,294.91
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	396,594,050.00	391,083,860.00	应付赎回款	0.00	0.00
基金投资	10,431,321.30	6,796,820.10	应付管理人报酬	668,407.16	607,621.20
权证投资	0.00	0.00	应付托管费	25,065.34	22,785.80
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	120,410.20	57,393.66
买入返售金融资产	15,200,000.00	68,800,197.70	应交税费	532,126.23	314,116.90
应收证券清算款	0.00	0.00	应付利息	69,522.51	209,038.80
应收利息	15,199,616.06	8,964,640.68	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	95,514,023.04	178,595,251.27
其他资产	0.00	0.00			
			所有者权益：		
			实收基金	341,973,647.87	295,826,190.53
			未分配利润	4,326,068.16	8,797,532.22
			所有者权益合计	346,299,716.03	304,623,722.75
资产合计	441,813,739.07	483,218,974.02	负债和所有者权益总计	441,813,739.07	483,218,974.02

(二) 损益表

损益表

国融证券____国融证券国融安盛1号集合资产管理计划____专用表

日期：2021-9-30

单位：元

序号	项目	本期数	本年累计数
1	一、收入	7,845,784.00	21,579,561.74
2	1、利息收入	6,848,346.98	19,095,298.26
3	其中：存款利息收入	7,338.10	23,541.78
4	债券利息收入	6,569,276.61	18,532,417.02
5	资产支持证券利息收入	0.00	0.00
6	买入返售证券收入	271,732.27	539,339.46
7	2、投资收益	446,653.67	-364,049.63
8	其中：股票投资收益	0.00	0.00
9	债券投资收益	924,845.90	40,389.45
10	基金投资收益	-71,317.23	-21,589.08
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	-406,875.00	-382,850.00
14	股利收益	0.00	0.00
15	个股期权收益	0.00	0.00
16	商品期货期权收益	0.00	0.00
17	3、公允价值变动收益	550,783.35	2,848,313.11
18	4、其他收入	0.00	0.00
19	二、费用	1,806,962.87	5,449,012.21
20	1、管理人报酬	668,407.16	1,760,924.82
21	2、托管费	25,065.34	66,034.76
22	3、销售服务费	0.00	0.00
23	4、交易费用	98,493.43	264,550.29
24	5、利息支出	983,244.30	3,259,665.58
25	其中：卖出回购金融资产支出	983,244.30	3,259,665.58
26	6、税金及附加	21,510.94	64,750.22
27	7、其他费用	10,241.70	33,086.54
28	三、利润总和	6,038,821.13	16,130,549.53

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	8,364,500.06
报告期管理人业绩报酬分配	1,124,752.67

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	占该产品份额比例
1	998,003.99	0.29%

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10月28日

国融证券国融安盛 1 号集合资产管理计划 2021 年第三季度托管报告

(报告期间： 2021 年 07 月 01 日-2021 年 09 月 30 日)

本托管人依据《国融证券国融安盛 1 号集合资产管理计划资产管理合同》(以下简称《管理合同》)、《国融证券国融安盛 1 号集合资产管理计划托管协议》(以下简称《托管协议》),自 2018 年 04 月 24 日起托管国融证券国融安盛 1 号集合资产管理计划(以下简称“本投资组合”)资产。现根据中国证券监督管理委员会令第 151 号《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》及其他相关规定,出具本期托管报告。

本托管人在报告期间,严格遵守上述法律法规、《管理合同》、《托管协议》的规定,尽职尽责履行了托管人义务,不存在损害资产委托人利益的行为。

本报告期内,本托管人依照上述法律法规及《管理合同》、《托管协议》的规定,对本投资组合的投资运作进行了监督,对资产净值计算、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持有人利益的行为。

托管人对管理人编制的该产品 2021 年第三季度报告中的投资表现、投资组合报告、财务会计报告、投资收益分配情况进行了复核,认为上述复核内容中的财务数据真实、准确和完整。

上海浦东发展银行资产托管部

2021 年 10 月 20 日

