

国融证券安泰月月发1号集合资产管理计划

2021年年度报告

计划管理人：国融证券股份有限公司

计划托管人：兴业证券股份有限公司

报告期间：2021年9月24日至2021年12月31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. 9. 24-2021. 12. 31)	3
(二) 主要财务指标 (2021. 9. 24-2021. 12. 31)	3
六、投资组合报告 (2021 年 12 月 31 日)	3
(一) 投资组合情况 ^①	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
(三) 所有者权益变动表.....	7
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.....	8
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.....	9

一、重要提示

本报告由国融证券安泰月月发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已经审计。

本报告期间：2021年9月24日至2021年12月31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	国融证券安泰月月发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	2021年9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	兴业证券股份有限公司
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

2021年，新冠病毒变异、疫情不断反复扰动全球经济，全球经济艰难复苏。与此同时，各国央行的应对态度出现分化。部分央行有意采取加息政策，然而亚洲国家大多并未紧缩货币。整体来看，受宏观因素影响，2021年主要经济体债券市场收益率走势呈现抬升趋势。而在国内疫情反复、宏观经济金融数据不佳、货币政策宽松等因素的影响下，我国债券收益率整体呈震荡下行态势。

具体来看，2021年我国债券发行量再创新高，净融资额同比小幅减少，债券市场存量规模继续保持扩张势头，债券现券交易规模有所下滑。新增首次违约企业数量和新增债券违约金额均下降，但个别违约趋势不容忽视。同时，由于海外疫情周期性反复和中美经贸关系边际改善，2021年人民币汇率表现强势，人民币资产吸引力显著增强，境内外债券市场互联互通得到深化，债券市场双向开放稳步推进，人民币债券持续获外资青睐。

展望2022年，疫情对经济生活的影响仍会持续。主要国家货币政策逐步收紧，使得主要发达经济体国债收益率波动性较大，部分新兴经济体长期国债收益率或将进一步上升。我国央行坚持稳健的货币政策灵活适度，增强前瞻性、精准性和自主性，发挥好货币政策工具的总量和结构调控的双重功能。预计2022年10年期国债收益率走势将前低后高，债券发行量将较2021年有所增加，存量债券规模将继续保持增长，债券市场交易金额也有望得到增加。考虑到越来越多企业选择债券展期作为风险缓释的出口，2022年实质违约的规模或将下降。人民币资产对外资的吸引力将不断增强。

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。本资管计划托管人兴业证券股份有限公司于2022年3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（2021.9.24-2021.12.31）

截至2021年12月31日，集合资产管理计划单位净值为1.0168元，累计单位净值为1.0168元，报告期间累计单位净值增长率为：1.68%

（二）主要财务指标（2021.9.24-2021.12.31）

单位：元

本期已实现收益	176,701.37
本期利润	236,168.73
期末资产净值	23,626,664.73
期末单位份额净值	1.0168
本期累计单位净值增长率	1.68%
期末单位份额累计净值	1.0168

六、投资组合报告（2021年12月31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	229,774.16	0.89
结算备付金	18,442.25	0.07
债券投资	12,175,480.00	47.25

买入返售金融资产	13,020,000.00	50.53
其他资产②	324,013.70	1.26
合计	25,767,710.11	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	10,000,216.00
报告期间总参与份额	14,936,135.96
报告期间总退出份额	1,700,000.00
报告期末份额总额	23,236,351.96

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 8.89%。

八、财务会计报告

(一) 资产负债表

资产负债表

国融证券____国融证券安泰月月发1号集合资产管理计划____专用表

日期：2021-12-31

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	229,774.16	0.00	短期借款	0.00	0.00
结算备付金	18,442.25	0.00	交易性金融负债	0.00	0.00
存出保证金	749.23	0.00	衍生金融负债	0.00	0.00
交易性金融资产	12,175,480.00	0.00	卖出回购金融资产 款	2,100,000.00	0.00
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	12,175,480.00	0.00	应付赎回款	0.00	0.00
基金投资	0.00	0.00	应付管理人报酬	26,534.85	0.00
权证投资	0.00	0.00	应付托管费	663.36	0.00
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	4,691.19	0.00
买入返售金融资 产	13,020,000.00	0.00	应交税费	6,854.54	0.00
应收证券清算款	0.00	0.00	应付利息	2,301.44	0.00
应收利息	323,264.47	0.00	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	2,141,045.38	0.00
其他资产	0.00	0.00			
			所有者权益：		
			实收基金	23,236,351.96	0.00
			未分配利润	390,312.77	0.00
			所有者权益合计	23,626,664.73	0.00
资产合计	25,767,710.11	0.00	负债和所有者权益 总计	25,767,710.11	0.00

(二) 损益表

损益表

国融证券__国融证券安泰月月发1号集合资产管理计划__专用表

日期：2021年9月—2021年12月

单位：元

序号	项目	本期数	上年同期数
1	一、收入	285,236.10	0.00
2	1、利息收入	197,849.58	0.00
3	其中：存款利息收入	3,073.60	0.00
4	债券利息收入	114,425.59	0.00
5	资产支持证券利息收入	0.00	0.00
6	买入返售证券收入	80,350.39	0.00
7	2、投资收益	27,740.22	0.00
8	其中：股票投资收益	0.00	0.00
9	债券投资收益	14,968.69	0.00
10	基金投资收益	1,010.23	0.00
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	11,761.30	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	59,646.30	0.00
18	4、其他收入	0.00	0.00
19	二、费用	49,067.37	0.00
20	1、管理人报酬	27,849.98	0.00
21	2、托管费	696.24	0.00
22	3、销售服务费	0.00	0.00
23	4、交易费用	4,969.48	0.00
24	5、利息支出	14,737.53	0.00
25	其中：卖出回购金融资产支出	14,737.53	0.00
26	6、税金及附加	814.14	0.00
27	7、其他费用	0.00	0.00
28	三、利润总和	236,168.73	0.00

(三) 所有者权益变动表

所有者权益变动表

国融证券__国融证券安泰月月发1号集合资产管理计划__专用表

日期：2021年09月 - 2021年12月

单位：元

项目	本期金额			上期金额		
	实收基金	未分配利润	所有者权益	实收基金	未分配利润	所有者权益
一、期初所有者权益（基金净值）	10,000,216.00	0.00	10,000,216.00	0.00	0.00	0.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	0.00	236,168.73	236,168.73	0.00	0.00	0.00
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（减少以“-”号填列）	13,236,135.96	154,144.04	13,390,280.00	0.00	0.00	0.00
其中：1. 基金申购款	14,936,135.96	173,864.04	15,110,000.00	0.00	0.00	0.00
2. 基金赎回款	-1,700,000.00	-19,720.00	-1,719,720.00	0.00	0.00	0.00
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动数	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
五、期末所有者权益（基金净值）	23,236,351.96	390,312.77	23,626,664.73	0.00	0.00	0.00

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

报告期委托人收益分配	0.00
报告期管理人业绩报酬分配	1,142.96

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
3	8,497,883.52	36.57%

- 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/soa/views/index.html>

热线电话：95385



国融证券安泰月月发1号集合资产管理计划 2021年年度托管人报告

国融证券股份有限公司：

托管人声明，在本报告期间，资产托管人——兴业证券股份有限公司不存在任何损害计划份额持有人利益的行为，严格遵守了相关法律法规、资产管理合同和托管协议，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

本报告期间资产管理人在投资运作、计划资产净值的计算、利润分配、计划份额申购赎回价格的计算、计划费用开支等问题上，不存在损害计划份额持有人利益的行为，遵守了相关法律法规，在各重要方面的运作严格按照资产管理合同的规定进行。

资产管理人报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等财务数据内容真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

特此报告。



