

日信证券日鑫多利（债券型）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：渤海银行股份有限公司

报告期间：2021年1月1日至2021年12月31日

目录

一、重要提示.....	3
二、集合计划概况.....	3
三、管理人履职报告.....	3
(一)投资经理简介.....	3
(二)管理人履职情况.....	3
(三)报告期内投资经理工作报告.....	4
四、托管人履职报告.....	4
五、资产管理计划投资表现.....	5
(一)净值表现(2021.1.1-2021.12.31).....	5
(二)主要财务指标(2021.1.1-2021.12.31).....	5
六、投资组合报告(2021年12月31日).....	6
(一)投资组合情况.....	6
(二)本报告期内份额变动情况.....	6
七、资产管理计划运用杠杆情况.....	6
八、财务会计报告.....	7
(一)资产负债表.....	7
(二)损益表.....	9
(三)所有者权益变动表.....	10
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.....	11
十、资产管理计划投资收益分配情况.....	11
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.....	11
十一、信息披露的查阅方式.....	12

一、重要提示

本报告由日信证券日鑫多利（债券型）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1月1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	日信证券日鑫多利（债券型）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	2013年5月31日
存续期限	本集合计划不设固定存续期限
管理人	国融证券股份有限公司（原日信证券有限责任公司）
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

郭鹏，男，中国人民大学会计硕士，多年工作经验，曾供职于中诚信国际信用评级有限公司，2017年9月入职国融证券资产管理业务总部，历任信用研究员、投资经理职位。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

回顾 2021 年，全年经济先升后降，下半年经济基本面超预期下行。2021 年 GDP 首破 110 万亿，全年同比 8.1%，两年平均增长 5.1%；Q4 经济环比如期好转，同比 4.0%，两年平均增长 5.2%，略好于预期。节奏上来看，上半年经济逐步复苏，下半年超预期下行。结构上，工业生产高位回落，地产先升后降，二者是经济波动的主因；出口保持强势，制造业稳步复苏，消费基建低迷。2021 年，信用债市场分层明显，整体信用偏紧，地产行业风险较大，债券市场操作难度很大，但我们通过深入研究，规避了受政策影响较大的行业，同时配置可转债等其他投资品种，把握市场风口，做高账户收益，回馈给广大投资者以良好的业绩表现。

展望 2022 年，我国经济面临较为严峻的挑战，三重压力仍大，尤其是需求收缩。2022 年主支撑是消费复苏、基建发力，主拖累是地产下行、出口回落。2022 年，货币财政宽松、房地产放松、基建发力应是必选项，宽信用周期是确定性的机会，2022 年信用债市场环境较 2021 年将有明显的好转。10 年期国债收益率或在 2.7-3.0 之间震荡，相较 2021 年，“稳增长”必要性提升，同时“去杠杆、稳杠杆”必要性降低，政策着重强调“防范化解重大风险”，违约风险将有缓释。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实现更大的突破。

四、托管人履职报告

托管人在本报告期内严格遵守《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 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. 1. 1-2021. 12. 31)

截至2021年12月31日,集合资产管理计划单位净值为1.0186元,累计单位净值为1.2684元,报告期间累计单位净值增长率为:3.44%。

(二) 主要财务指标 (2021. 1. 1-2021. 12. 31)

单位: 元

本期已实现收益	120,499,608.64
本期利润	152,946,266.49
期末资产净值	1,447,096,811.39
期末单位份额净值	1.0186
本期累计单位净值增长率	3.44%
期末单位份额累计净值	1.2684

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	3,069,292.54	0.20
结算备付金	7,286,741.76	0.47
存出保证金	1,175,322.37	0.08
债券投资	1,165,261,100.28	75.86
基金投资	39,686,000.00	2.58
买入返售金融资产	287,820,790.78	18.74
其他资产 ^②	31,712,788.27	2.06
合计	1,536,012,036.00	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、应收申购款、其他应收款。

（二）本报告期内份额变动情况

单位：份

期初份额总额	1,660,441,475.00
报告期间总参与份额	5,632,009,200.22
报告期间总退出份额	5,871,716,700.22
报告期末份额总额	1,420,733,975.00

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 5.87%。

八、财务会计报告

(一) 资产负债表

资产负债表

国融证券__日信证券日鑫多利（债券型）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	3,069,292.54	2,001,642.11	短期借款	0.00	0.00
结算备付金	7,286,741.76	8,318,750.06	交易性金融负债	0.00	0.00
存出保证金	1,175,322.37	266,038.29	衍生金融负债	0.00	0.00
交易性金融资产	1,204,947,100.28	1,945,839,665.65	卖出回购金融资产款	84,999,150.00	363,995,044.49
其中：股票投资	0.00	0.00	应付证券清算款	1,051,788.50	0.00
债券投资	1,165,261,100.28	1,580,707,745.67	应付赎回款	0.00	0.00
基金投资	39,686,000.00	365,131,919.98	应付管理人报酬	612,324.46	715,167.29
权证投资	0.00	0.00	应付托管费	61,232.46	71,516.72
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	258,427.82	984,331.57
买入返售金融资产	287,820,790.78	25,200,277.80	应交税费	1,214,022.72	2,726,414.01
应收证券清算款	0.00	433,002.16	应付利息	-32,207.99	298,017.54
应收利息	30,680,118.27	58,075,819.79	应付利润	0.00	0.00
应收股利	0.00	17,085.80	其他负债	750,486.64	750,486.64
应收申购款	1,020,000.00	0.00	负债合计	88,915,224.61	369,540,978.26
其他资产	12,670.00	14,292,670.00			
			所有者权益：		
			实收基金	1,420,733,975.00	1,660,441,475.00

			未分配利润	26,362,836.39	24,462,498.40
			所有者权益合计	1,447,096,811.39	1,684,903,973.40
资产合计	1,536,012,036.00	2,054,444,951.66	负债和所有者权益总计	1,536,012,036.00	2,054,444,951.66

(二) 损益表

损益表

国融证券__日信证券日鑫多利(债券型)集合资产管理计划__专用表

日期: 2021年01月 - 2021年12月

单位: 元

序号	项目	本期数	上年同期数
1	一、收入	167,647,958.52	43,812,306.17
2	1、利息收入	82,379,162.98	107,740,423.81
3	其中: 存款利息收入	152,163.55	285,204.66
4	债券利息收入	78,385,563.81	106,174,554.26
5	资产支持证券利息收入	0.00	0.00
6	买入返售证券收入	3,841,435.62	1,280,664.89
7	2、投资收益	52,867,323.98	59,862,235.64
8	其中: 股票投资收益	0.00	0.00
9	债券投资收益	-12,201,161.10	12,198,693.29
10	基金投资收益	64,508,759.58	44,956,869.08
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	388,750.00	0.00
14	股利收益	170,975.50	2,706,673.27
15	个股期权收益	0.00	0.00
16	3、公允价值变动收益	32,401,471.56	-123,791,105.74
17	4、其他收入	0.00	752.46
18	二、费用	14,701,692.03	22,246,064.48
19	1、管理人报酬	8,145,604.74	8,583,151.57
20	2、托管费	814,560.48	858,315.13
21	3、销售服务费	0.00	0.00
22	4、交易费用	1,260,186.91	964,626.63
23	5、利息支出	4,212,362.34	10,525,026.47
24	其中: 卖出回购金融资产支出	4,212,362.34	10,525,026.47
25	6、其他费用	268,977.56	1,314,944.68
26	三、利润总和	152,946,266.49	21,566,241.69

(三) 所有者权益变动表

所有者权益变动表

国融证券__日信证券日鑫多利(债券型)集合资产管理计划__专用表

日期: 2021年01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)	1,660,441,475.00	24,462,498.40	1,684,903,973.40	1,687,939,775.00	69,048,439.08	1,756,988,214.08
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	0.00	152,946,266.49	152,946,266.49	0.00	21,566,241.69	21,566,241.69
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)	-239,707,500.00	0.00	-239,707,500.00	-27,498,300.00	0.00	-27,498,300.00
其中: 1. 基金申购款	5,632,009,200.22	0.00	5,632,009,200.22	4,556,345,700.00	0.00	4,556,345,700.00
2. 基金赎回款	-5,871,716,700.22	0.00	-5,871,716,700.22	-4,583,844,000.00	0.00	-4,583,844,000.00
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	-151,045,928.50	-151,045,928.50	0.00	-66,152,182.37	-66,152,182.37
五、期末所有者权益(基金净值)	1,420,733,975.00	26,362,836.39	1,447,096,811.39	1,660,441,475.00	24,462,498.40	1,684,903,973.40

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	$H = E \times 0.5\% \div 365$ H 为每日应支付的管理费； E 为前一日集合计划资产净值。	每日计提	按月支付
托管费	$H = E \times 0.08\% \div 365$ H 为每日应支付的托管费； E 为前一日的集合计划资产净值。	每日计提	按月支付
管理人业绩报酬	无	无	无

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	62,778,004.56
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	占该产品份额比例
43	6,452,000.00	0.45%

5、其他涉及投资者权益的重大事项：我司按照整改方案的安排，以自有资金受让日鑫多利持仓的 15 华阳经贸 MTN001、15 信威通信 PPN001 以及 18 中融新大 MTN002，其中，15 华阳经贸 MTN001 已在上海清算所完成交易。18 中融新大 MTN002 以及 15 信威通信 PPN001 通过原产品持有的上述债券估值调整为 0 元，由我司自有资金持有的风险级份额承担相应亏损，同时签订相关协议将该债券所有权转让给我司，相关交易不存在任何虚假陈述、内幕交易和利益输送等违法违规行为，对优先级份额净值未产生任何影响。

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



日信证券日鑫多利（债券型）集合资产管理计划

托管人报告（2021.01.01-2021.12.31）

本托管人依据《日信证券日鑫多利（债券型）集合资产管理计划管理合同》，自2013年05月31日起托管日信证券日鑫多利（债券型）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年年度报告)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

2022年03月01日



