

# 国金慧多利债券 1 号集合资产管理计划

## 2022 年第三季度资产管理报告

### 第一节 重要提示

本报告由管理人国金证券股份有限公司（以下简称“管理人”）编制。管理人保证本报告所载资料的真实性、准确性和完整性。

本集合计划托管人招商银行股份有限公司上海分行（以下简称“托管人”）于 2022 年 10 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现及投资组合报告等数据，认为复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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计划说明书。

本报告相关财务资料未经审计。

本报告期间：2022 年 7 月 1 日至 2022 年 9 月 30 日

本报告中的内容由管理人负责解释。

### 第二节 管理人、托管人履职情况

本报告期内，管理人严格遵守《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》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照《国金慧多利债券 1 号集合资产管理计划资产管理合同》等文件的约定进行，不存在损害委托人利益的行为。本集合计划资产独立于其自身固有财产、所管理的其他资管计划资产和客户资产，对资管计划资产单独记账、独立核算，不存在管理

人管理、运用和处分资管计划资产所产生的债权与其自身固有财产、所管理的其他资管计划资产和客户资产产生的债务相抵销等情况。

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，在对国金慧多利债券 1 号集合资产管理计划托管的过程中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

### 第三节 集合计划概况

集合计划名称:	国金慧多利债券 1 号集合资产管理计划
集合计划类型:	固定收益类
成立日:	2018 年 1 月 5 日
到期日:	2026 年 1 月 5 日
报告期末集合计划总份额:	269,695,483.11 份 (其中含管理人持有份额 0.00 份, 占比 0.00%)
管理人:	国金证券股份有限公司
托管人:	招商银行股份有限公司上海分行
注册登记机构:	国金证券股份有限公司
投资经理:	崔婧女士: 吉林大学经济学学士、厦门大学经济学硕士, 风险管理师。2016 年加入国金证券股份有限公司上海证券资产管理分公司, 曾任职于天治基金监察稽核部担任合规专员、交易部担任债券交易员。已取得基金从业资格, 且最近三年不存在被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚的情况。

### 第四节 主要财务指标和投资表现

#### 一、主要财务指标（单位：人民币元）

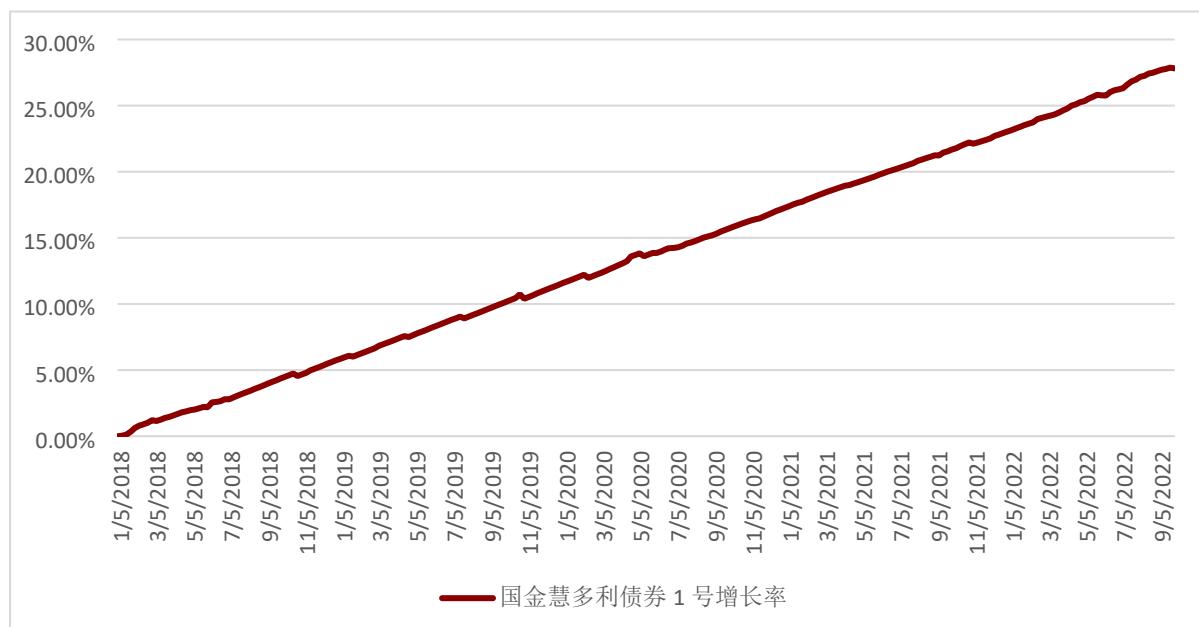
本期利润	1,542,620.71
本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额	1,187,382.52

加权平均每份额本期利润	0.0064
期末资产净值	272, 273, 727.94
期末每份额净值	1.0096
期末每份额累计净值	1.2782

## 二、业绩表现

截至 2022 年 9 月 30 日，本集合计划单位净值为 1.0096 元，累计单位净值 1.2782 元，本期集合计划净值增长率为 1.5884%。

## 三、集合计划累计净值增长率历史走势图（数据截至2022年9月30日）



## 第五节 报告期末投资杠杆、收费及账户信息披露

### 一、投资杠杆水平

本报告期末，本集合计划投资杠杆率为 115.86%。

投资杠杆率 = 期末资产总值 ÷ 期末资产净值 \*100%

## 二、管理费、托管费及业绩报酬（如有）情况

项目	计提基准或费率	计提方式	支付方式
管理费	0.3%/年	每日计提	按季支付
托管费	0.01%/年	每日计提	按季支付
业绩报酬	对每个封闭期内参与份额超过当期业绩比较基准的部分计提 60%作为管理人业绩报酬	分红日及退出日计提	发生时支付

## 三、投资账户信息披露

账户的开立单位	账号/代码	用途
中国证券登记结算有限责任公司上海分公司	D890117434	交易用途
中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司	0899163404	交易用途
国金期货有限责任公司	801111092	交易用途
招商银行上海分行东方支行	128902045410156	托管户
银行间市场清算所股份有限公司	B2157699	交易用途
中央国债登记结算有限公司	00000030297	交易用途

## 第六节 投资组合报告

### 一、报告期末资产组合情况

项目名称	项目市值（元）	占总资产比例
股票	0.00	0.00%
债券 <sup>①</sup>	314,381,086.07	99.66%

基金	0.00	0.00%
回购	0.00	0.00%
证券理财产品	0.00	0.00%
银行存款及清算备付金合计	1,065,463.38	0.34%
其他 <sup>②</sup>	0.07	0.00%
合计	315,446,549.52	100.00%

注：①债券包括：国债、金融债、央行票据、（超）短期融资券、中期票据、企业债、公司债、非公开定向债务融资工具PPN、资产支持证券、可转换债券、可分离交易债券、可交换债券等。

②其他包括：存出保证金、应收利息、应收股利、证券清算款等。

## 1、报告期末市值占集合计划资产净值前五名债券明细

序号	代码	名称	数量（张）	市值（元）	占净值比例
1	166955	20 仙游 02	260,000.00	26,809,316.60	9.85%
2	178403	21 安溪 01	200,000.00	21,080,186.58	7.74%
3	177240	20 昌新 01	170,000.00	18,418,733.37	6.76%
4	166284	20 天生债	170,000.00	17,710,422.08	6.50%
5	166597	20 天运 01	150,000.00	15,604,710.62	5.73%

## 二、报告期末本计划投资期货交易情况说明

### 1、报告期末本集合计划投资的期货持仓和损益明细

本集合计划本报告期末未持有期货投资。

### 2、本集合计划投资期货的投资政策

本集合计划本报告期末未持有期货投资。

### 三、报告期末本计划投资期权交易情况说明

#### 1、报告期末本集合计划投资的期权持仓和损益明细

本集合计划本报告期末未持有期权投资。

#### 2、本集合计划投资期权的投资政策

本集合计划本报告期末未持有期权投资。

### 四、场外衍生品交易情况说明

#### 1、报告期末本集合计划投资的场外衍生品持仓和损益明细

本报告期末，本集合计划未持有场外衍生品投资。

#### 2、本集合计划投资场外衍生品的投资政策

本报告期末，本集合计划未持有场外衍生品投资。

## 第七节 集合计划财务报告

### 一、集合资产管理计划资产负债表

日期：2022-09-30

单位：人民币元

资产	期末余额	年初余额
资产：		
银行存款	1,017,713.94	1,979,022.39
结算备付金	47,749.44	92,944.19
存出保证金	0.07	0.00

衍生金融资产	0.00	0.00
交易性金融资产	314,381,086.07	243,835,365.98
买入返售金融资产	0.00	0.00
发放贷款和垫款		
债权投资	0.00	0.00
其他债权投资		
应收清算款	0.00	0.00
应收利息	0.00	6,620,241.10
应收股利	0.00	0.00
应收申购款	0.00	0.00
其他资产	0.00	0.00
资产总计	315,446,549.52	252,527,573.66

集合计划资产负债表（续）

单位：人民币元

负债和所有者权益	期末余额	年初余额
负 债：		
短期借款	0.00	0.00
交易性金融负债	0.00	0.00
衍生金融负债	0.00	0.00
卖出回购金融资产款	42,860,404.56	11,039,863.44
应付清算款	0.00	0.00

应付赎回款	0.00	0.00
应付管理人报酬	187,394.07	189,729.67
应付托管费	6,246.51	6,324.29
应付销售服务费	0.00	0.00
应付投资顾问费	0.00	0.00
应交税费	106,893.94	31,130.56
应付利息	0.00	4,786.74
应付利润	0.00	0.00
其他负债	11,882.50	6,725.84
负债合计	43,172,821.58	11,278,560.54
所有者权益		
实收资金	269,695,483.11	240,649,285.82
其他综合收益		
未分配利润	2,578,244.83	599,727.30
所有者权益合计	272,273,727.94	241,249,013.12
负债和所有者权益总计	315,446,549.52	252,527,573.66

## 二、集合资产管理计划经营业绩表

日期：2022年07月-2022年09月

单位：人民币元

序号	项目	本期数	上期金额
1	一、收入	4,447,829.40	4,121,000.01
2	1. 利息收入	1,694.13	6,700.94
3	2. 投资收益（损失以“-”号填列）	4,089,178.48	3,408,005.53
4	其中：以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益	0.00	0.00
5	3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	356,956.79	706,293.54
6	4. 汇兑损益（损失以“-”号填列）	0.00	0.00

7	5. 其他业务收入	0.00	0.00
8	二、费用	2,905,208.69	278,281.39
9	1. 管理人报酬	2,527,738.11	181,925.00
10	2. 托管费	6,246.51	6,064.11
11	3. 销售服务费	0.00	0.00
12	4. 投资顾问费	0.00	0.00
13	5. 利息支出	342,814.60	65,792.61
14	其中：卖出回购金融资产利息支出	342,814.60	65,792.61
15	6. 信用减值损失	0.00	0.00
16	7. 税金及附加	16,008.02	14,469.62
17	8. 其他费用	12,401.45	10,030.05
18	三、利润总额	1,542,620.71	3,842,718.62
19	减：所得税费用		
20	四、净利润	1,542,620.71	3,842,718.62
21	五、其他综合收益		
22	六、综合收益总额	1,542,620.71	3,842,718.62
23	制 表：杨丹		
24	打 印：杨丹		

## 第八节 集合计划收益分配情况

### 一、收益分配情况

本报告期内，本集合计划共进行了 1 次收益分配，向全体委托人累计分配金额 4,668,495.63 元。

## 第九节 集合计划份额变动

单位：份

期初份额总额	239, 547, 018. 34
红利再投资份额	252, 140. 78
报告期内参与份额	69, 660, 362. 33
报告期内退出份额	39, 764, 038. 34
报告期末份额总额	269, 695, 483. 11

## 第十节 重要事项提示

### 一、关联交易情况

#### 1、本集合计划投资于管理人及其关联方管理的资产管理计划或资产支持证券的情形

本报告期内，本集合计划未发生投资于管理人及其关联方管理的资产管理计划或资产支持证券。

#### 2、本集合计划投资于管理人、托管人及其关联方发行的证券的情形

本报告期内，本集合计划未发生投资于管理人、托管人及其控股股东、实际控制人或者其他关联方发行的证券。

#### 3、本报告期内，本集合计划发生投资于管理人、托管人及其关联方承销期内承销的证券的情形

承销商名称	证券代码	证券名称	集合计划在承销期内买入	
			数量（股/张）	总金额（元）
国金证券股份有限公司	182723	22温国01	100, 000. 00	9, 998, 876. 71

国金证券股份有限公司	194902	22圆山V1	100,000.00	9,998,772.60
------------	--------	--------	------------	--------------

注：托管人关联方以托管人所提供名单为准。

#### 4、本集合计划与管理人及其关联方、托管人及其关联方作为交易对手方的情形

本报告期内，本集合计划未发生与管理人及其关联方、托管人及其关联方作为交易对手方的交易。

#### 5、本集合计划直接或间接为关联方提供或者变相提供融资的情形

本集合计划不存在直接或间接为管理人、托管人及其控股股东、实际控制人或者其他关联方提供或者变相提供融资的情形。

#### 6、关联方参与本集合计划的情形

本报告期内，本集合计划发生管理人董事、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，参与份额合计 2,871,571.41 份。

### 二、本集合计划相关诉讼情况

本集合计划没有发生与本集合计划相关的诉讼事项。

### 三、其他相关事项

2022 年 09 月 29 日发布了《国金慧多利债券 1 号集合资产管理计划 2022 年第二次收益分配公告》。

## 第十一节 信息披露的查阅方式

网址: [www.gjzq.com.cn](http://www.gjzq.com.cn)

电话: 021-60935621

国金证券股份有限公司

二〇二二年十月三十一日