

# 国融证券安顺 3 号周周开集合资产管理计划 2022 年第四季度报告

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：2022 年 10 月 1 日至 2022 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 (2022. 10. 1-2022. 12. 31) .....	3
(二) 主要财务指标 (2022. 10. 1-2022. 12. 31) .....	3
六、投资组合报告 (2022 年 12 月 31 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

本报告由国融证券安顺3号周周开集合资产管理计划（“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：2022年10月1日至2022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	国融证券安顺3号周周开集合资产管理计划
产品类型	固定收益类集合资产管理计划
成立日期	2022年6月27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	国融证券股份有限公司

## 三、管理人履职报告

### （一） 投资经理简介

周雅娜，女，加拿大圣玛丽大学金融硕士，多年金融行业工作经验，曾供职于第一创业期货有限责任公司，2018年2月入职国融证券资产管理业务总部，历任产品经理、投资经理助理、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

2022年四季度，资金面明显收紧，资金价格中枢持续上行，防疫政策优化，地产政策大幅转向，债市预期转向，叠加短债基金和理财产品的破净赎回潮使得负反馈不断加强，收益率出现大幅快速调整，10年期国债收益率大幅上行至2.92%附近的年内高点。但12月经济数据依旧不好，基本面“弱现实”短期并未显著改善，预期充分定价和理财赎回压力企稳后，10年期国债收益率预计会处于震荡盘整态势。

展望2023年一季度，海外通胀高企，央行鹰派加息已对经济造成一定影响，23年出口转弱，基建投资和消费的增长将是下一年度的政策发力方向，预计宽信用、资金直达实体是明年重心，货币环境整体预计仍偏宽，但边际上大概率较2022年有所收敛，狭义流动性极度宽松的状态难以再现。海外市场需要关注的风险是美联储鹰派加息是否会造成美国经济超预期衰退。债券方面，在2022年四季度债市大幅回调之后，信用利差已达高位，目前中短期信用债券的配置性价比较高。中长期利率在经济复苏的过程中有一定的回升压力，但考虑到经济仍处于休养生息阶段，利率的回升幅度有限，但也无需过于悲观。我们将在策略上利率债和信用债均衡配置，仍然严控久期，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实现更大的突破。经济基本面的变化以及海内外政策的多样性，给投资带来的一定的难度和压力，在错综复杂的形势和多样化信息中，投资继续回归本源，关注总需求和总供给的缺口。债券方面，经济下行压力大，财政和货币政策的制定依旧主要受国内宏观经济的影响，在稳货币宽信用的情况下，债券依然具备配置价值，可以短久期+杠杆的操作。

未来，我们仍将继续稳健运作，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《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2023年1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（2022.10.1-2022.12.31）

截至2022年12月31日，集合资产管理计划单位净值为1.0256元，累计单位净值为1.0256元，报告期间累计单位净值增长率为：1.08%。

##### （二）主要财务指标（2022.10.1-2022.12.31）

单位：元

本期已实现收益	2,199,386.61
本期利润	2,525,913.59
期末资产净值	242,849,010.52
期末单位份额净值	1.0256
本期累计单位净值增长率	1.08%
期末单位份额累计净值	1.0256

#### 六、投资组合报告（2022年12月31日）

##### （一）投资组合情况<sup>①</sup>

资产品种	金额（元）	金额占总资产比例（%）
------	-------	-------------

银行存款和结算备付金合计	1,141,309.49	0.43
债券投资	266,390,806.56	99.36
买入返售金融资产	0.00	0.00
其他资产②	565,317.68	0.21
合计	268,097,433.73	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：存出保证金、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	213,056,944.53
报告期间总参与份额	160,900,728.52
报告期间总退出份额	137,164,465.99
报告期末份额总额	236,793,207.06

## 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 10.10%。

## 八、财务会计报告

### (一) 资产负债表

## 资产负债表

国融证券\_\_国融证券安顺3号周周开集合资产管理计划\_\_专用表

日期:

2022-12-31

单位: 元

资产	期末余额	上年年末余额	负债和所有者权益	期末余额	上年年末余额
资 产:			负 债:		
银行存款	1,060,502.60	0.00	短期借款	0.00	0.00
结算备付金	80,806.89	0.00	交易性金融负债	0.00	0.00
存出保证金	45,317.68	0.00	衍生金融负债	0.00	0.00
衍生金融资 产	0.00	0.00	卖出回购金融资 产款	24,518,798.67	0.00
交易性金融 资产	266,390,806.56	0.00	应付清算款	0.00	0.00
买入返售金 融资产	0.00	0.00	应付赎回款	0.00	0.00
发放贷款和 垫款			应付管理人报酬	474,706.53	0.00
债权投资	0.00	0.00	应付托管费	11,867.65	0.00
其他债权投 资			应付销售服务费	0.00	0.00
应收清算款	0.00	0.00	应付投资顾问费	0.00	0.00
应收利息	520,000.00	0.00	应交税费	79,246.64	0.00
应收股利	0.00	0.00	应付利息	0.00	0.00
应收申购款	0.00	0.00	应付利润	0.00	0.00
其他资产	0.00	0.00	其他负债	163,803.72	0.00
			负债合计	25,248,423.21	0.00
			所有者权益		
			实收资金	236,793,207.06	0.00
			其他综合收益		
			未分配利润	6,055,803.46	0.00
			所有者权益合计	242,849,010.52	0.00
资产总计	268,097,433.73	0.00	负债和所有者权益总 计	268,097,433.73	0.00

(二) 损益表

## 损益表

国融证券\_\_国融证券安顺3号周周开集合资产管理计划\_\_专用表

日期：2022年10月-2022年12月

单位：元

项目	本期金额	上期金额
一、收入	3,553,806.81	1,472,940.03
1. 利息收入	17,577.38	6,822.27
2. 投资收益（损失以“-”填列）	3,209,914.35	1,374,781.84
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
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	326,315.08	91,335.92
4. 汇兑损益（损失以“-”号填列）	0.00	0.00
5. 其他业务收入	0.00	0.00
二、费用	1,027,893.22	386,358.85
1. 管理人报酬	497,626.91	171,700.86
2. 托管费	11,867.65	4,150.54
3. 销售服务费	0.00	0.00
4. 投资顾问费	0.00	0.00
5. 利息支出	501,925.46	205,870.71
其中：卖出回购金融资产利息支出	501,925.46	205,870.71
6. 信用减值损失	0.00	0.00
7. 税金及附加	11,473.20	4,636.74
8. 其他费用	5,000.00	0.00
三、利润总额	2,525,913.59	1,086,581.18
减：所得税费用	—	—
四、净利润	2,525,913.59	1,086,581.18
五、其他综合收益		
六、综合收益总额	2,525,913.59	1,086,581.18



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

报告期投资者收益分配	0.00
报告期管理人业绩报酬分配	22,920.38

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	412,092.70	0.17%

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

2023年1月31日