

紫金信托-现金稳利集合资金信托计划

信托资金管理报告

(2022 年 11 月 1 日-2023 年 1 月 31 日)

项目编号：ZJT(2017)TZYH-JH064

尊敬的委托人/受益人：

感谢您投资我公司作为受托人设立的“紫金信托-现金稳利集合资金信托计划”（以下简称“本信托计划”或“紫金现金稳利”），本信托计划自 2019 年 4 月 30 日成立以来，持续稳健运作。按照《中华人民共和国信托法》、《信托公司管理办法》等法律法规的规定，以及《紫金信托-现金稳利集合资金信托计划信托合同》（编号：ZJT(2017)TZYH-JH064-02）（以下简称“《信托合同》”）的约定，现将 2022 年 11 月 1 日-2023 年 1 月 31 日期间本信托计划信托财产管理情况报告如下：

一、本信托计划概况

1. 期限及规模

本信托计划于 2019 年 4 月 30 日成立。预计存续期限为 10 年，自信托计划成立之日起计算，信托计划根据《信托合同》第十六条的规定可以提前终止或延期。

本信托计划为开放式信托计划，成立时实际募集资金规模为人民币（大写）壹佰万元，（小写）¥1,000,000.00 元。

截至报告期末，本信托计划存续资金总规模为人民币（大写）贰拾捌亿陆仟玖佰叁拾万元 /（小写）¥2,869,300,000.00 元。

2. 信托计划开放日

报告期内，本信托计划共开放 16 次，信息如下：

开放日	信托份额变动日	新增信托单位对应的净值

2022/11/1	2022/11/2	1. 190235
2022/11/8	2022/11/9	1. 190983
2022/11/14	2022/11/15	1. 191202
2022/11/15	2022/11/16	1. 190542
2022/11/22	2022/11/23	1. 189452
2022/11/29	2022/11/30	1. 18994
2022/12/6	2022/12/7	1. 189412
2022/12/12	2022/12/13	1. 188216
2022/12/13	2022/12/14	1. 188074

2022/12/18	2022/12/19	1.187212
2022/12/20	2022/12/21	1.187364
2022/12/27	2022/12/28	1.187855
2022/12/28	2022/12/29	1.187954
2023/1/4	2023/1/5	1.189233
2023/1/10	2023/1/11	1.190509
2023/1/17	2023/1/18	1.191514

3. 信托财产专户

户名：紫金信托有限责任公司

账号：0120090000000003000081

开户行：南京银行南京分行营业部

4. 保管人

本信托计划保管人为南京银行股份有限公司。

二、信托财产的管理、运用、处分

1. 信托财产运用、处分

本报告期间，受托人按照《信托合同》的约定，基于诚实、信用、谨慎、有效管理的原则，以受益人最大利益为宗旨，管理、运用、处分信托财产，履行了受托义务。

2. 管理情况

2.1 信托资金募集情况

本报告期间，新增认购信托资金金额 2,416,818 万元，到期分配信托本金金额 2,456,390 万元。

截至报告期末，信托资金加权平均剩余期限为 21.47 天。

2.2 投资组合配置情况

本报告期间，受托人已按照《信托合同》的约定，将信托资金投资于我国银行间市场和交易所市场的固定收益品种（包括但不限于国债、政策性金融债、地方政府债、央行票据、中期票据、短期融资券、企业债、公司债、可转债、金融机构次级债、资产支持证券、非公开定向债务融资工具等）、债券回购、银行同业存款、场内及场外公募基金（包括但不限于货币基金、债券基金等）以及法律法规允许投资的其他金融工具。

报告期末资产市值情况如下：

序号	项目	金额（万元）	占比
1	现金管理类资产投	61,344.48	21.21%

	放		
2	银行间 / 交易所债券	181,254.35	62.68%
3	账户现金余额	462.03	0.16%
4	信托业保障基金	2,724.92	0.94%
5	资管产品投	43,381.80	15.00%

	资		
	总计	289,167.58	100.00%

2.3 投资组合平均剩余期限

报告期末，信托财产加权平均剩余期限为 220.12 天，具体分布如下：

序号	平均剩余期限	金额（万元）	占比
1	30 天（含）以内	116,289.76	40.50%
2	30-180 天（含）	42,038.16	14.64%
3	180-365 天（含）	50,663.71	17.64%
	365 天		

4	以上	78,171.95	27.22%
---	----	-----------	--------

三、信托财产收入及信托利益分配

本报告期间，受托人按照《信托合同》的约定进行投资，取得投资收益 47,459,003.14 元。

本报告期间，受托人依据《信托合同》约定向投资人共计分配 34,201,837.67 元信托收益。

四、其他事项披露

1. 本报告期间无信托经理变更情况。
2. 本报告期间无信托资金运用重大变动情况。
3. 本报告期间无涉及诉讼或者损害信托计划财产、受益人利益的情形发生。
4. 本报告期间无依据《信托合同》需要披露的其他重大事项。

五、结论

本报告期间，信托资金运用规范，信托计划运行稳定，没有发现信托计划有异常情况或不利情况。

紫金信托作为本信托计划的受托人，今后将继续严格按照信托文件的约定，勤勉尽责，谨慎、有效管理，努力实现受益人利益最大化。

紫金信托有限责任公司（公章）

二〇二三年二月一日