

国金慧多利债券 5 号集合资产管理计划 2023 年第三季度资产管理报告

管理人:国金证券资产管理有限公司

托管人:招商银行股份有限公司上海分行

重要提示

本报告由管理人国金证券资产管理有限公司（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。

托管人已复核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资管计划资产，但不保证本资管计划一定盈利，也不保证最低收益。

本资管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资管计划说明书。

本报告期间：2023 年 07 月 01 日至 2023 年 09 月 30 日

本报告中的内容由管理人负责解释。

1、产品概况

1.1 资管计划基本情况

资管计划名称	国金慧多利债券 5 号集合资产管理计划
资管计划编码	DB3010
运作方式	开放式
成立日期	2018年11月28日
管理人	国金证券资产管理有限公司
托管人（如有）	招商银行股份有限公司上海分行
投资顾问（如有）	-
期末总份额（份）	135,789,627.78
资管计划到期日期	2026年11月27日
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。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。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，2023年4月加入国金证券资产管理有限公司；现任公司固定收益投资部投资经理。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。
注册登记机构	国金证券资产管理有限公司

2、主要财务指标、净值表现及利润分配情况

2.1 主要会计数据和财务指标

期间数据和指标	本期期间
本期已实现收益	1,896,993.26
本期利润	2,380,503.22
期末数据和指标	本期期末
期末基金净资产	138,969,559.58
报告期期末单位净值	1.0234
报告期期末累计单位净值	1.2806

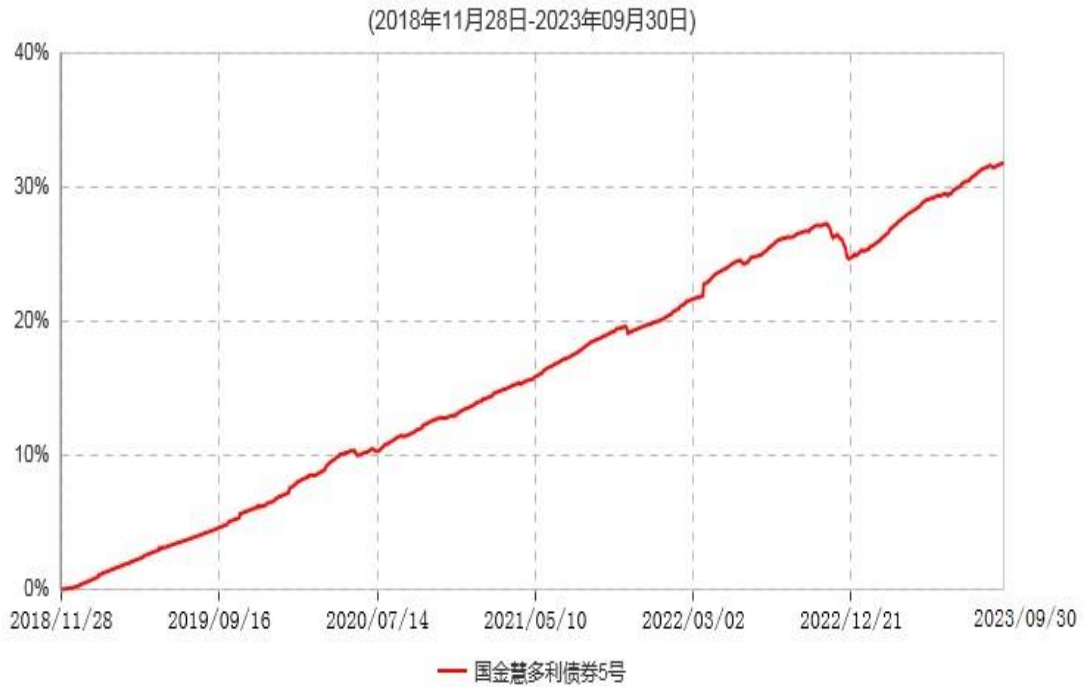
2.2 资管计划净值表现

阶段	净值增长率(%)
----	----------

当期	1.74
自成立之日起至今	31.81

2.3 累计净值增长率历史走势图（数据截至报告期末）

国金慧多利债券5号集合资产管理计划累计净值增长率走势图



2.4 资管计划的收益分配情况

本报告期内，本资管计划向全体委托人累计分配金额0.00元。

3、资管计划份额变动情况

单位：份/元

报告期期初份额总额	135,789,627.78
报告期期间总申购份额	0.00
减：报告期期间总赎回份额	0.00
报告期期间拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	0.00
期末总份额/期末实缴总额	135,789,627.78

4、报告期末投资杠杆、收费及账户信息披露

4.1 投资杠杆水平

本报告期末，本资管计划投资杠杆率为100.1%。

投资杠杆率=期末资产总值÷期末资产净值*100%

4.2 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报酬计提基准的部分计提60%作为管理人业绩报酬	收益分配基准日、委托人退出日及计划清算结束日计提	发生时支付
投资顾问固定服务费	-	-	-

4.3 投资账户信息披露

账户的开立单位	账号/代码	用途
招商银行上海分行东方支行	955102473333333	托管账户
中国证券登记结算有限责任公司上海分公司	D890158163	交易用途
中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司	0899183108	交易用途
国金期货有限责任公司	801111098	交易用途
银行间市场清算所股份有限公司	B2177561	交易用途

5、管理人、托管人履职情况

5.1 管理人履职情况

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。本资管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。

5.2 托管人履职情况

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5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。

6、季度财务报表

6.1 资产负债表

金额单位：元

资 产	本期末 2023年09月30日
资 产：	
银行存款	291,744.69
结算备付金	0.00
存出保证金	0.00
衍生金融资产	0.00
交易性金融资产	124,536,702.98
买入返售金融资产	3,542,056.44
发放贷款和垫款	0.00
债权投资	0.00
其他债权投资	0.00
应收清算款	10,000,000.00
应收利息	735,000.00
应收股利	0.00
应收申购款	0.00
其他资产	0.00
资产总计	139,105,504.11
	本期末 2023年09月30日
负 债 和 所 有 者 权 益	
负 债：	
短期借款	0.00
交易性金融负债	0.00
衍生金融负债	0.00
卖出回购金融资产款	0.00
应付清算款	0.00
应付赎回款	0.00
应付管理人报酬	104,362.44
应付托管费	3,478.76
应付销售服务费	0.00
应付投资顾问费	0.00
应交税费	23,074.83
应付利息	0.00
应付利润	0.00

其他负债	5,028.50
负债合计	135,944.53
所有者权益：	
实收基金	135,789,627.78
未分配利润	3,179,931.80
所有者权益合计	138,969,559.58
负债和所有者权益总计	139,105,504.11

6.2 利润表

项 目	本期
	2023 年 07 月 01 日至 2023 年 09 月 30 日
一、收入	2,561,972.49
1. 利息收入	6,304.96
2. 投资收益（损失以“-”填列）	2,071,653.08
其中：以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益（若有）	0.00
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	484,014.45
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	0.00
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	0.00
减：二、费用	181,469.27
1. 管理人报酬	104,362.44
2. 托管费	3,478.76
3. 销售服务费	0.00
4. 投资顾问费	0.00
5. 利息支出	59,179.64
其中：卖出回购金融资产支出	59,179.64
6. 信用减值损失	0.00
7. 税金及附加	6,853.93
8. 其他费用	7,594.50
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	2,380,503.22
减：所得税费用	0.00
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	2,380,503.22
五、其他综合收益的税后净额	0.00
六、综合收益总额	2,380,503.22

7、期末投资组合情况

7.1 期末资管计划资产组合情况

金额单位：元

项目	金额
----	----

现金类资产	银行存款	291,744.69
境内未上市、未挂牌公司股权投资	股权投资	0.00
	其中：优先股	0.00
	其他股权类投资	0.00
上市公司定向增发投资	上市公司定向增发股票投资	0.00
新三板投资	新三板挂牌企业投资	0.00
境内证券投资规模	结算备付金	0.00
	存出保证金	0.00
	其中：期货及衍生品交易保证金	0.00
	股票投资	0.00
	债券投资	118,521,059.99
	资产支持证券	6,015,642.99
	基金投资（公募基金）	0.00
	其中：货币基金	0.00
	买入返售金融资产	3,542,056.44
	其他证券类标的	0
资管计划投资	商业银行理财产品投资	0.00
	信托计划投资	0.00
	基金公司及其子公司资产管理计划投资	0.00
	保险资产管理计划投资	0.00
	证券公司及其子公司资产管理计划投资	0.00
	期货公司及其子公司资产管理计划投资	0.00
	私募基金产品投资	0.00
	未在协会备案的合伙企业份额	0.00
另类投资	另类投资	0.00
境内债权类投资	银行委托贷款规模	0.00
	信托贷款	0.00
	应收账款投资	0.00
	各类受（收）益权投资	0.00
	票据（承兑汇票等）投资	0.00

	其他债权投资	0.00
境外投资	境外投资	0.00
其他资产	其他资产	10735000
负债情况	债券回购总额	0.00
	融资、融券总额	0.00
	其中：融券总额	0.00
	银行借款总额	0.00
	其他融资总额	0.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：元

序号	行业类别	公允价值	占资管计划资产净值的比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	0.00	0.00
B	采矿业	0.00	0.00
C	制造业	0.00	0.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	0.00	0.00
E	建筑业	0.00	0.00
F	批发和零售业	0.00	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	0.00	0.00
H	住宿和餐饮业	0.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	0.00	0.00
J	金融业	0.00	0.00
K	房地产业	0.00	0.00
L	租赁和商务服务业	0.00	0.00
M	科学研究和技术服务业	0.00	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	0.00	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	0.00	0.00
P	教育	0.00	0.00
Q	卫生和社会工作	0.00	0.00
R	文化、体育和娱乐业	0.00	0.00

S	综合	0.00	0.00
	合计	0.00	0.00

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合（如有）

行业类别	公允价值（人民币）	占资管计划资产净值的比例（%）
港股通	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

7.3 报告期末本资管计划投资期货交易情况说明

7.3.1 报告期末本资管计划投资的股指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。

7.3.2 报告期末本资管计划投资的国债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。

8、重要事项提示

注：如为首次出具报告，本章节统计区间为产品成立之日起至报告期末。

8.1 关联交易情况

8.1.1 本资管计划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的情形

无

8.1.2 本资管计划发生投资于管理人、托管人及其关联方发行的证券的情形

无

8.1.3 本资管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	资管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	252082	23即旅03	60,000.00	5,999,360.55

8.1.4 本资管计划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情形

无

8.1.5 本资管计划发生的重大关联交易的情形

无

8.1.6 关联方参与本资管计划的情形

本报告期内，本资管计划未发生管理人董事、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。

8.2 本资管计划相关诉讼情况

本资管计划没有发生与本资管计划相关的诉讼事项。

8.3 其他相关事项

无

9、信息披露的查阅方式

网址：www.gjzq-zg.com.cn

电话：021-60935621

国金证券资产管理有限公司

2023年10月31日