

国融证券国融安盛 1 号集合资产管理计划 2023 年第三季度报告

计划管理人：国融证券股份有限公司

计划托管人：上海浦东发展银行股份有限公司

报告期间：2023年7月1日至2023年9月30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	3
五、资产管理计划投资表现	3
(一) 净值表现 (2023. 7. 1-2023. 9. 30)	3
(二) 主要财务指标 (2023. 7. 1-2023. 9. 30)	3
六、投资组合报告 (2023 年 9 月 30 日)	4
(一) 投资组合情况 ^①	4
(二) 本报告期内份额变动情况	5
七、资产管理计划运用杠杆情况	5
八、财务会计报告	6
(一) 资产负债表	6
(二) 损益表	7
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	8
十、资产管理计划投资收益分配情况	8
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	8
十二、信息披露的查阅方式	9

一、重要提示

本报告由国融证券国融安盛1号集合资产管理计划（“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：2023年7月1日至2023年9月30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	国融证券国融安盛1号集合资产管理计划
产品类型	固定收益类集合资产管理计划
成立日期	2018年4月24日
存续期限	10年
管理人	国融证券股份有限公司
托管人	上海浦东发展银行股份有限公司
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

李海宸，男，美国俄克拉荷马城市大学MBA，多年债券投资相关经验，曾任职于联合资信评估股份有限公司，从事债券信用分析工作；2019年6月加入国融证券股份有限公司研究与战略发展部，从事债券研究工作，2021年2月加入国融证券资产管理业务总部，从事债券投资工作。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。

陈丽丽，女，对外经济贸易大学金融学硕士，12年资产管理行业从业经验。曾先后就职于民生证券资产管理总部、渤海证券资产管理总部及其资产管理子公司、德邦证券资产管理总部及其资产管理子公司，从事股票行业研究、基金产品设计及研究、固收类资产配置及研究等工作，对股票、债券、基金等大类资产配置有较为深入的理解和研究。现就职于国融证券股份有限公司资产管理业务总部，从事资管产品投资工作。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

2023年三季度以来经济修复弱于预期，呈现供需两弱格局。但8月以来呈现触底回升的特征。从需求端来看，投资增速继续下滑，但制造业增速小幅上行；消费逐步企稳，地产、汽车及可选消费类上行；出口边际改善。生产端8月加速，制造业和高技术产业较为明显。失业率小幅回落，中小企业用人需求回升。制造业PMI也连续回升，显示经济有底部回升的迹象。从通胀来看，8月CPI和PPI均上行，四季度预计延续这一趋势。8月底以来，多项稳增长政策陆续落实，预计将提高居民可支配收入、促进地产销售企稳，经济修复趋势有望延续。

三季度央行超预期降息后资金面由偏宽逐步收敛。央行公开市场操作保持弹性，在资金面有所收敛时及时降准投放资金，维护流动性合理充裕，助力宽信用。从央行态度来看，在近期连续降息和降准后，结构性政策预计接力，支持重要领域和薄弱环节，持续提振内需。整体来看，基本面对资金面的利空有限，央行呵护资金面的态度较为强烈，在信贷增长持续改善之前，资金面预计持稳。

账户配置方面，随着各项刺激政策密集推出，信用债收益率跟随利率债出现回调。信用债表现优于利率债，信用利差全面压缩，拉长久期性价比下降。随着化债政策陆续落地，尾部区域债务风险降低，可适当挖掘城投债票息收益，纳入“隐债化解试点”的区县或地市级城

投债。因此 2023 年四季度将继续以中短久期的城投债为主。同时，随着经济复苏的进程，权益市场会出现更多机会，因此将通过转债等工具以绝对收益的思路努力增厚账户收益。

未来，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争取实现更大的突破。

四、托管人履职报告

本报告期内，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对国融证券国融安盛 1 号集合资产管理计划的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、资产管理合同的规定，不存在损害资产份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了资产托管人应尽的义务。

本报告期内，本托管人依照《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》及其他有关法律法规、资产管理合同的规定，对国融证券国融安盛 1 号集合资产管理计划的投资运作进行了监督，对资产管理计划资产净值的计算、资产管理计划份额申购赎回价格的计算以及资产管理计划费用开支等方面进行了认真的复核，未发现资产管理人存在损害资产份额持有人利益的行为。

本报告期内，由国融证券股份有限公司编制本托管人复核的本报告中的资产管理计划投资表现、投资组合报告、投资收益分配情况财务数据真实、准确、完整。

五、资产管理计划投资表现

（一）净值表现（2023.7.1-2023.9.30）

截至 2023 年 9 月 30 日，集合资产管理计划单位净值为 1.0073 元，累计单位净值为 1.3956 元，报告期间累计单位净值增长率为：0.85%。

（二）主要财务指标（2023.7.1-2023.9.30）

单位：元

本期已实现收益	5,420,286.91
本期利润	3,433,823.59
期末资产净值	400,881,979.61

期末单位份额净值	1.0073
本期累计单位净值增长率	0.85%
期末单位份额累计净值	1.3956

注：本期累计单位净值增长率=（期末累计单位净值-期初累计单位净值）/期初累计单位净值*100%

六、投资组合报告（2023年9月30日）

（一）投资组合情况^①

序号	项目	金额（元）	占总资产的比例（%）
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金	29,529,534.16	6.02
3	固定收益投资	455,705,154.50	92.84
	其中：债券	455,705,154.50	92.84
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的 买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付 金合计	4,151,018.05	0.85
7	其他资产 ^②	1,486,354.57	0.30
8	合计	490,872,061.28	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、应收清算款、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	406,814,566.15
报告期间总参与份额	58,256,411.05
报告期间总退出份额	67,102,305.84
报告期末份额总额	397,968,671.36

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 21.87%。

八、财务会计报告

(一) 资产负债表

资产负债表

国融证券__国融证券国融安盛1号集合资产管理计划__专用表

日期：2023-09-30

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	3,522,227.16	2,241,055.44	短期借款	0.00	0.00
结算备付金	628,790.89	2,645,286.81	交易性金融负债	0.00	0.00
存出保证金	13,887.45	72,856.60	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	87,668,039.10	217,404,509.96
交易性金融资产	485,234,688.66	603,367,496.50	应付清算款	814,032.54	21,559.21
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	815,005.11	814,016.04
债权投资	0.00	0.00	应付托管费	30,566.08	30,525.62
其他债权投资			应付销售服务费	0.00	0.00
应收清算款	822,467.12	0.00	应付投资顾问费	0.00	0.00
应收利息	650,000.00	0.00	应交税费	631,824.54	465,891.37
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	30,524.30	175,049.01
			负债合计	89,990,081.67	218,911,552.11
			所有者权益		
			实收资金	397,968,671.36	381,047,363.51
			其他综合收益		
			未分配利润	2,913,308.25	8,367,779.73
			所有者权益合计	400,881,979.61	389,415,143.24
资产总计	490,872,061.28	608,326,695.35	负债和所有者权益总计	490,872,061.28	608,326,695.35

(二) 损益表

损益表

国融证券 国融证券国融安盛1号集合资产管理计划 专用表

日期：2023年07月 - 2023年09月

单位：元

项目	本期金额	上期金额
一、收入	6,121,214.57	8,512,608.29
1. 利息收入	9,843.85	21,952.04
2. 投资收益（损失以“-”填列）	8,103,811.36	10,717,264.59
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）	-1,992,440.64	-2,226,608.34
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	2,687,390.98	2,011,628.25
1. 管理人报酬	2,045,619.34	830,456.38
2. 托管费	30,566.08	30,477.05
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	582,137.09	1,104,611.34
其中：卖出回购金融资产利息支出	582,137.09	1,104,611.34
6. 信用减值损失	0.00	0.00
7. 税金及附加	18,007.86	23,590.48
8. 其他费用	11,060.61	22,493.00
三、利润总额	3,433,823.59	6,500,980.04
减：所得税费用	—	—
四、净利润	3,433,823.59	6,500,980.04
五、其他综合收益		
六、综合收益总额	3,433,823.59	6,500,980.04

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	$H = E \times 0.03\% \div 365$ 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

报告期委托人收益分配	11,098,604.67
报告期管理人业绩报酬分配	1,230,524.23

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，本集合计划投资于本机构、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
4	4,997,605.75	1.26%

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





国融证券国融安盛 1 号集合资产管理计划 2023 年第三季度托管报告

(报告期间： 2023 年 07 月 01 日-2023 年 09 月 30 日)

本托管人依据《国融证券国融安盛 1 号集合资产管理计划资产管理合同》(以下简称《管理合同》)、《国融证券国融安盛 1 号集合资产管理计划托管协议》(以下简称《托管协议》),自 2018 年 04 月 24 日起托管国融证券国融安盛 1 号集合资产管理计划(以下简称“本投资组合”)资产。现根据《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》及其他相关规定,出具本期托管报告。

本托管人在报告期间,严格遵守上述法律法规、《管理合同》、《托管协议》的规定,尽职尽责履行了托管人义务,不存在损害资产委托人利益的行为。

本报告期内,本托管人依照上述法律法规及《管理合同》、《托管协议》的规定,对本投资组合的投资运作进行了监督,对资产净值计算、费用开支等方面进行了认真的复核,未发现资产管理人存在损害资产持有人利益的行为。

托管人对管理人编制的该产品 2023 年第三季度报告中的资产管理计划投资表现,投资组合报告,资产管理计划运用杠杆情况,财务会计报告,资产管理计划投资收益分配情况进行了复核,认为上述复核内容中的财务数据真实、准确和完整。

上海浦东发展银行资产托管部

2023 年 10 月 20 日

业务专用章

(1)

