

紫金信托-现金稳利集合资金信托计划

信托资金管理报告

(2023 年 8 月 1 日-2023 年 10 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 2023 年 8 月 1 日-2023 年 10 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）贰拾玖亿肆仟贰佰零叁万元/(小写) ¥2,942,030,000.00 元。

2. 信托计划开放日

报告期内，本信托计划共开放 17 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
2023/8/1	2023/8/2	1.22615
2023/8/2	2023/8/3	1.226376

2023/8/8	2023/8/9	1. 227386
2023/8/15	2023/8/16	1. 228607
2023/8/22	2023/8/23	1. 229754
2023/8/29	2023/8/30	1. 230852
2023/8/30	2023/8/31	1. 230945

2023/9/5	2023/9/6	1. 231887
2023/9/12	2023/9/13	1. 231847
2023/9/19	2023/9/20	1. 233029
2023/9/26	2023/9/27	1. 234403
2023/10/10	2023/10/11	1. 23608
2023/10/16	2023/10/17	1. 237271

2023/10/17	2023/10/18	1.237511
2023/10/18	2023/10/19	1.237655
2023/10/24	2023/10/25	1.238411
2023/10/30	2023/10/31	1.239171

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 17,687,429.57 万元，到期分配信托本金金额 27,212,443.81 万元。

截至报告期末，信托资金加权平均剩余期限为 7.12 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（元）	占比
1	现金管理类资产投放	283,914,584.00	9.44%

2	银行间 / 交易所债券	1, 927, 663, 085. 71	64. 08%
3	账户现金余额	1, 280, 068. 85	0. 04%

4	信 托 业 保 障 基 金	20,350,299.18	0.68%
5	资 管 产 品 投 资	774,819,420.00	25.76%
	总 计	3,008,027,457.74	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 172.43 天，具体分布如下：

序号	平均剩余期限	金额（元）	占比
1	30 天 （含） 以内	1,241,894,457.86	41.29%
2	30- 180 天 （含）	760,707,530.00	25.29%

3	180- 365 天 (含)	445,411,769.88	14.81%
4	365 天 以上	560,013,700.00	18.62%

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 17,687,429.57 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 27,212,443.81 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）

二〇二三年十一月一日