

国金慧多利债券 1 号集合资产管理计划 2023 年年度资产管理报告

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 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 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1号集合资产管理计划
资管计划编码	DB3006
运作方式	开放式
成立日期	2018年01月05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）	无
期末总份额（份）	161,050,875.40
资管计划到期日期	2026年01月05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，无兼职情形。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	6,462,410.74
本期利润	12,930,860.81
期末数据和指标	本期期末
期末基金净资产	165,307,937.98
报告期期末单位净值	1.0264
报告期期末累计单位净值	1.3355

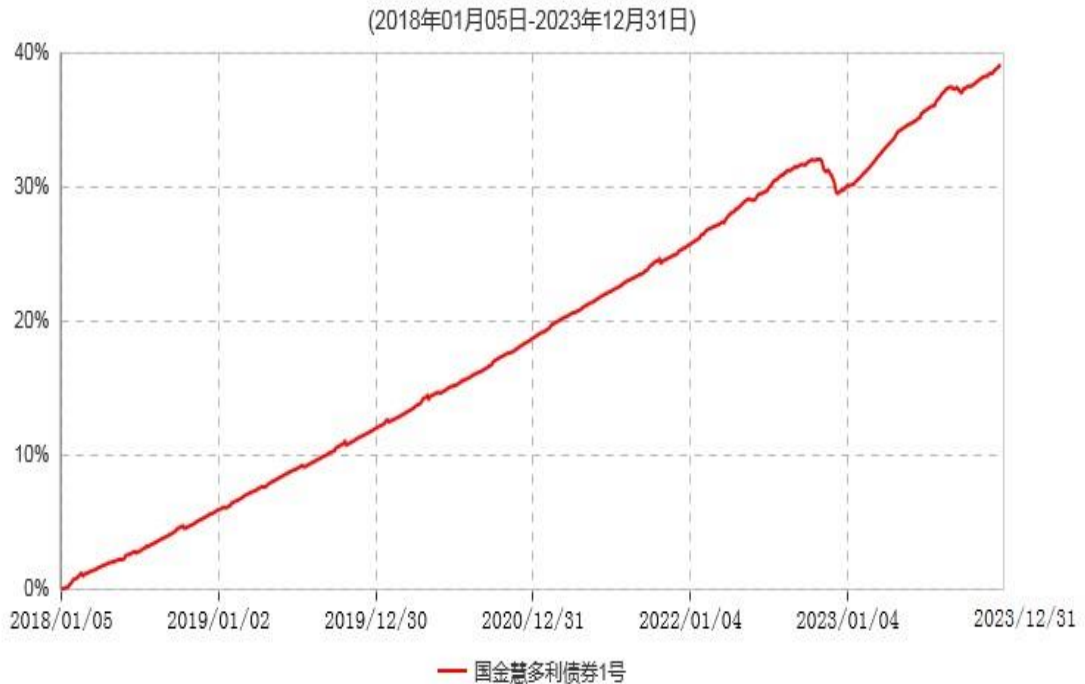
2.2 资管计划净值表现

阶段	净值增长率(%)
----	----------

当期	7.25
自成立之日起至今	39.28

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1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，本资管计划向全体投资者累计分配金额7,271,774.82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	269,695,483.11
报告期期间总申购份额	62,248,300.63
减：报告期期间总赎回份额	170,892,908.34
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	161,050,875.40

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100.11%。

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比较基准的部分计提60%作为管理人业绩报酬	收益分配基准日、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	128902045410111	托管账户
中国证券登记结算有限责任公司上海分公司	D890117434	交易用途
中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司	0899163404	交易用途
国金期货有限责任公司	801111092	交易用途
银行间市场清算所股份有限公司	B2138582	交易用途
中央国债登记结算有限公司	00000028539	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，不存在损害投资者利益的行为。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1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、年度财务报表

6.1 资产负债表

金额单位：元

资 产	本期末 2023年12月31日
资 产：	
银行存款	290,204.34
结算备付金	48,943.08
存出保证金	0.00
衍生金融资产	0.00
交易性金融资产	161,394,610.00
买入返售金融资产	3,001,256.46
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	750,234.66
应收利息	0.00
应收股利	0.00
应收申购款	0.00
其他资产	0.00
资产总计	165,485,248.54
负 债 和 所 有 者 权 益	本期末 2023年12月31日
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	123,903.40
应付托管费	4,130.11
应付销售服务费	0.00
应付投资顾问费	0.00
应交税费	42,975.24
应付利息	0.00
应付利润	0.00

其他负债	6,301.81
负债合计	177,310.56
所有者权益：	
实收基金	161,050,875.40
未分配利润	4,257,062.58
所有者权益合计	165,307,937.98
负债和所有者权益总计	165,485,248.54

6.2 利润表

金额单位：元

项 目	本期
	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日
一、收入	15,871,844.13
1. 利息收入	86,757.63
2. 投资收益（损失以“-”填列）	9,314,473.00
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）	6,470,613.50
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	2,940,983.32
1. 管理人报酬	2,321,769.17
2. 托管费	20,481.80
3. 销售服务费	0.00
4. 投资顾问费	0.00
5. 利息支出	503,164.63
其中：卖出回购金融资产支出	503,164.63
6. 信用减值损失	0.00
7. 税金及附加	39,708.96
8. 其他费用	55,858.76
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	12,930,860.81
减：所得税费用	0.00
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	12,930,860.81
五、其他综合收益的税后净额	0.00
六、综合收益总额	12,930,860.81

6.3 财务报表附注

6.3.1 资产管理产品的基本情况

国金慧多利债券1号集合资产管理计划(以下简称本资管计划)于2018年01月05日成立,本资管计划类型为固定收益类资产管理计划,管理期限为8年。本资管计划合同等相关文件已按规定报中国证券投资基金业协会备案。本资管计划的管理人为国金证券资产管理有限公司,托管人为招商银行股份有限公司上海分行,份额注册登记机构为国金证券资产管理有限公司。本资管计划投资范围以《资产管理合同》中列示的为准。

6.3.2 财务报表的编制基础

本财务报表以持续经营为基础,基于以下所述重要会计政策和会计估计进行编制。

6.3.3 遵循企业会计准则的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本资管计划本报告期末的财务状况,以及本报告期间的经营成果和资管计划净值变动情况等有关信息。

6.3.4 重要会计政策和会计估计

本资管计划财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》《证券公司客户资产管理业务估值方法指引》和其他相关规定所制定的重要会计政策和会计估计编制。

6.3.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

本报告期内,本资管计划未发生会计政策变更、会计估计变更,无重大会计差错的内容和更正金额。

6.3.5.1 会计年度

本资管计划会计年度为公历1月1日起至12月31日止。

6.3.5.2 记账本位币

本资管计划记账本位币和编制本财务报告所采用的货币为人民币。除有特别说明外,均以人民币元为单位表示。

6.3.6 管理人报酬的确定方法、暂估管理人报酬与投资者实际承担的管理人报酬可能存在差异的事实,以及公允价值计量的相关信息

根据本资管计划合同约定的管理人业绩报酬计算方法,以本报告期末为基准日计算,本资管计划暂估管理人业绩报酬560,396.53元。暂估管理人业绩报酬并不代表投资者实际承担的管理人业绩报酬,管理人业绩报酬暂估不会减损投资者

利益。本资管计划实际需承担的管理人业绩报酬数值最终以实际提取日核算的数值为准。

本资管计划持有的金融资产均以公允价值计量。

6.3.7 或有事项、承诺事项、资产负债表日后事项的说明

本报告期内，本资管计划无需要披露的重大或有事项、无需要说明的承诺事项；截至本报告日，无需要披露的资产负债表日后事项。

6.3.8 关联交易情况等需要说明的事项

关联交易情况详见8.1。

6.3.9 与金融工具相关的流动性风险、信用风险、市场风险的信息

本资管计划管理人建立了健全的内控和风险管理体系，制定了相应政策和程序识别及分析本资管计划在运营过程中产生的风险，并通过可靠的管理及信息系统持续监控流动性风险、信用风险、市场风险。

6.3.9.1 流动性风险

流动性风险是指资管计划所持金融工具变现的难易程度。本资管计划的流动性风险一方面来自于资管计划份额持有人可随时要求赎回其持有的资管计划份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

本资管计划管理人审慎评估各类资产流动性，并通过监控集中度、流动性受限资产比例、7个工作日可变现资产占比等指标以及压力测试等方式防范流动性风险，同时对申赎情况监测，以保持资产变现能力与赎回需求相匹配。

6.3.9.2 信用风险

信用风险是指资管计划在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者资管计划所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致资管计划资产损失和收益变化的风险。

本资管计划管理人通过对发行人及交易对手进行内部评级，对资信状况进行充分评估和授信额度管理，并通过分散化投资以控制可能的信用风险。

6.3.9.3 市场风险

市场风险是指因受各种因素影响而引起的资管计划所持证券及其衍生品市场价格不利波动，使资管计划资产面临损失的风险。本资管计划所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险、其他价格风险。

6.3.9.3.1 利率风险

利率风险是指本资管计划的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本资管计划的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。

6.3.9.3.2 外汇风险

本资管计划持有的金融工具以人民币计价，无重大外汇风险。

6.3.9.3.3 其他价格风险

其他价格风险为除市场利率和外汇汇率以外的市场因素发生变动时产生的价格波动风险，主要为市场价格变化或波动所引起的所持证券损失的可能性。本资管计划通过投资组合的分散化降低市场价格风险，本资管计划管理人对本资管计划所持证券价格实施监控，并运用定量方法进行风险度量和分析，以对风险进行跟踪和控制。

6.3.10 资产管理产品启用侧袋机制的，应当披露扣除侧袋机制影响后的期末净资产金额及其计算方法，以及侧袋账户的有关情况

本资管计划不涉及侧袋机制。

6.3.11 其他信息

无

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	290,204.34
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	48,943.08
	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	141,113,096.16
	资产支持证券	20,281,513.84
	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	3,001,256.46
	其他证券类标的	0.00
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	750,234.66
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 报告期内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报告期内损益明细

无

7.3.2 报告期末本资管计划投资的国债期货持仓和报告期内损益明细

无

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	133550	23方洋Y1	70,000.00	6,998,945.21
国金证券股份有限公司	251551	23荷投D2	50,000.00	4,999,342.47
国金证券股份有限公司	252757	23恒业D1	50,000.00	4,999,246.58
国金证券股份有限公司	252082	23即旅03	70,000.00	6,999,253.97

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

代码	名称	数量(股/张)	市值(元)	交易对手
032100531	21荔城国投PPN001	150,000.00	15,037,530.00	中信建投证券股份有限公司
151361	19绵控02	100,000.00	10,068,400.00	中信证券股份有限公司

			0	
--	--	--	---	--

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,参与份额合计5090001份

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

序号	事项
1	2023年03月30日发布了《国金慧多利债券1号集合资产管理计划2023年第一次收益分配公告》。
2	2023年04月10日发布了《关于国金证券股份有限公司管理的资产管理计划变更管理人的公告》。
3	2023年04月11日发布了《关于国金证券资产管理有限公司取得经营证券期货业务许可证及资产管理计划变更管理人的公告》。
4	2023年05月22日发布了《关于管理人官方网站地址变更的公告》。
5	2023年09月28日发布了《国金慧多利债券1号集合资产管理计划2023年第二次收益分配公告》。
6	2023年12月01日发布了《关于国金证券慧多利债券1号集合资产管理计划调整销售机构的公告》。

9、信息披露的查阅方式

网址: www.gjqz-zg.com.cn

电话: 021-60935621

国金证券资产管理有限公司

2024年04月26日