

## 管理报告

产品名称：中国龙价值（二）资本市场集合资金信托计划

成立时间：2007年7月17日

报告期间：2022年度

报告人：云南国际信托有限公司

本报告书是依据《中华人民共和国信托法》《信托公司管理办法》及本信托文件规定完成。在信托存续期间，云南国际信托有限公司（以下简称云南信托）认真履行了受托人职责，诚实、信用、谨慎和有效地对信托财产进行了管理。

### 第一节 信托产品概况及信托资金管理情况

信托成立于2007年7月17日，成立时信托规模为人民币叁仟贰佰叁拾万（小写：32300000.00），信托期限不少于12个月。信托项目自成立到报告期已存续185个月。

### 第二节 信托财产专户开立情况

信托财产专户名：云南国际信托有限公司

信托财产专户账号：1202020129900105872

信托财产专户开户行：中国工商银行杭州羊坝头支行

### 第三节 信托资金管理、运用、处分及收益情况

受托人严格按照信托合同的约定，对信托资金进行管理、运用及处分。截止报告期信托资金管理、运用、处分及收益情况如下：

# 资产负债表

云南国际信托有限公司\_\_（中国龙价值（二）资本市场集合资金信托计划）  
\_\_专用表（2022-12-31）

单位：元

项目	年初数	期末数
信托资产：		
货币资金	1,574,340.78	182,574.29
拆出资金	0.00	0.00
存出保证金	2,000.00	2,000.00
交易性金融资产	12,659,923.09	1,040,179.00
衍生金融资产	0.00	0.00
买入返售金融资产	999,606.01	13,296,208.13
其中：买入返售证券	999,606.01	13,296,208.13
买入返售信贷资产	0.00	0.00
应收款项	0.00	0.00
贷款	0.00	0.00
其他债权投资	0.00	0.00
债权投资	0.00	0.00
其他债权投资 1	0.00	0.00
长期应收款	0.00	0.00
长期股权投资	0.00	0.00
投资性房地产	0.00	0.00
固定资产	0.00	0.00
无形资产	0.00	0.00
长期待摊费用	0.00	0.00
其他资产	0.00	0.00
信托资产总计	15,235,869.88	14,520,961.42
信托负债：		
交易性金融负债	0.00	0.00
衍生金融负债	0.00	0.00
应付受托人报酬	2,559.26	2,462.97
应付托管费	2,559.26	2,462.97

应付受益人收益	0.00	0.00
应交税费	441.00	0.00
应付销售服务费	0.00	0.00
其他应付款项	23,825.87	22,959.33
其他负债	0.00	0.00
信托负债合计	29,385.39	27,885.27
信托权益：		
实收信托	6,197,713.00	6,197,713.00
其中：资金信托	6,197,713.00	6,197,713.00
财产信托	0.00	0.00
资本公积	0.00	0.00
其他综合收益	0.00	0.00
未分配利润	9,008,771.49	8,295,363.15
信托权益合计	15,206,484.49	14,493,076.15
信托负债及信托权益总计	15,235,869.88	14,520,961.42

## 信托项目利润及利润分配表

云南国际信托有限公司\_\_\_（中国龙价值（二）资本市场集合资金信托计划）  
\_\_\_专用表（2022-12-31）

单位：元

项目	上期金额	本期金额
1. 营业收入	-542,675.01	-392,774.70
1.1 利息收入	27,620.52	130,658.14
1.2 投资收益	640,748.39	-1,130,567.67
其中：交易性债券利息收入	40.92	0.99
交易费用	-11,718.23	-49,323.50
1.3 公允价值变动损益	-1,211,043.92	607,134.83
1.4 租赁收入	0.00	0.00
1.5 汇兑损益	0.00	0.00
1.6 其它收入	0.00	0.00
2. 支出	341,385.33	320,633.64
2.1 营业税金及附加	-1,104.29	0.00
2.2 受托人报酬	30,648.16	28,912.93

其中：暂估受托人报酬	0.00	0.00
2.3 托管费	30,648.16	28,912.93
2.4 投资管理费	275,833.30	260,215.78
2.5 销售服务费	0.00	0.00
2.6 信用减值损失	0.00	0.00
2.7 其它费用	5,360.00	2,592.00
3. 信托净利润	-884,060.34	-713,408.34
4. 其它综合收益	0.00	0.00
5. 综合收益	-884,060.34	-713,408.34
加：期初未分配信托利润	9,892,831.83	9,008,771.49
加：未分配信托利润平准金	0.00	0.00
6. 可供分配的信托利润	9,008,771.49	8,295,363.15
减：本期已分配信托利润	0.00	0.00
7. 期末未分配信托利润	9,008,771.49	8,295,363.15

## 净资产变动表

云南国际信托有限公司\_\_（中国龙价值（二）资本市场集合资金信托计划）  
\_\_专用表（2022-12-31）

单位：元

项目	本期金额 _实收资金	本期金额_其 他综合收益	本期金额 _未分配利润	本期金额 _净资产合计
一、上期期末余额	6,197,713.00	0.00	9,008,771.49	15,206,484.49
加：会计政策变更	0.00	0.00	0.00	0.00
前期差错更正	0.00	0.00	0.00	0.00
其他	0.00	0.00	0.00	0.00
二、本期期初余额	6,197,713.00	0.00	9,008,771.49	15,206,484.49
三、本期增减变动 额（减少以“-”号填列）	0.00	0.00	-713,408.34	-713,408.34
（一）综合收益总	0.00	0.00	-713,408.34	-713,408.34

额				
(二) 产品持有人 申购和赎回	0.00	0.00	0.00	0.00
其中：1、产品申购	0.00	0.00	0.00	0.00
2、产品赎回	0.00	0.00	0.00	0.00
(三) 利润分配	0.00	0.00	0.00	0.00
(四) 其他综合收 益结转留存收益	0.00	0.00	0.00	0.00
四、本期期末余额	6,197,713 .00	0.00	8,295,363.1 5	14,493,076. 15

项目	上期金额 _实收资金	上期金额_其 他综合收益	上期金额 _未分配利润	上期金额 _净资产合计
一、上期期末余额	6,197,713 .00	0.00	9,892,831.8 3	16,090,544. 83
加：会计政策变更	0.00	0.00	0.00	0.00
前期差错更正	0.00	0.00	0.00	0.00
其他	0.00	0.00	0.00	0.00
二、本期期初余额	6,197,713 .00	0.00	9,892,831.8 3	16,090,544. 83
三、本期增减变动 额（减少以“-”号填列）	0.00	0.00	-884,060.34	-884,060.34
(一) 综合收益总 额	0.00	0.00	-884,060.34	-884,060.34
(二) 产品持有人 申购和赎回	0.00	0.00	0.00	0.00
其中：1、产品申购	0.00	0.00	0.00	0.00
2、产品赎回	0.00	0.00	0.00	0.00
(三) 利润分配	0.00	0.00	0.00	0.00
(四) 其他综合收 益结转留存收益	0.00	0.00	0.00	0.00
四、本期期末余额	6,197,713	0.00	9,008,771.4	15,206,484.

	.00		9	49
--	-----	--	---	----

#### 第四节 信托经理变更情况

以信托经理变更临时信息披露公告为准。

#### 第五节 重大变动说明及其它管理情况

本项目自成立以来，严格按照信托合同约定的投资方向进行投资运作，信托资金运用无重大变动。本报告系云南信托根据本报告期内所能知悉的公开信息或能够以合法手段获取的其他信息出具，本报告未尽事宜，以临时信息披露为准。

云南国际信托有限公司

（签章处）

2023-02-02