

信达证券睿享1号集合资产管理计划2020年

第4季度报告

2020年12月31日



资产管理人:信达证券股份有限公司

资产托管人:兴业银行股份有限公司

§1 重要提示

本报告依据《证券期货及经营机构私募资产管理计划运作管理规定》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》及其他有关规定制作。

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资产管理计划资产，但不保证本集合资产管理计划一定盈利，也不保证最低收益或本金不受损失。

托管人已于2021年1月11日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

管理人保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

本报告中的内容由管理人负责解释。

本报告期自2020年10月1日起至2020年12月31日止。

§2 资产管理计划产品概况

资产管理计划简称	信达睿享1号
资产管理计划编码	C20369
资产管理计划合同生效日	2020年02月25日
报告期末资产管理计划份额总额	38,805,977.25份
资产管理计划合同存续期	本集合计划存续期为5年，自本集合计划成立之日起计算，可展期。
资产管理人	信达证券股份有限公司
资产托管人	兴业银行股份有限公司

§3 主要财务指标和资产管理计划净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2020年10月01日 - 2020年12月31日)
本期已实现收益	513,353.59
本期利润	376,224.55
加权平均资产管理计划份额本期利润	0.0063
期末资产管理计划资产净值	40,391,331.17
期末资产管理计划份额净值	1.0409

3.2 资产管理计划净值表现

阶段	净值增长率①	业绩比较基准收益率②	①-②
过去三个月	0.61%	0.00%	0.61%

§ 4 管理人报告

4.1 投资经理（或投资经理小组）简介

林碧波，天津大学金融博士。2010年加入信达证券。于信达证券资产管理事业部先后担任数量分析师、投资主办人、执行总监，从事产品设计及量化投资方面工作，主持完成量化投资策略系列研究，建立了部门量化投研体系，对量化对冲策略、期现套利策略等市场中性策略及事件驱动等另类投资策略有较深的研究和投资实践。

唐国磊，物理学博士，毕业于法国巴黎第十一大学。2015年6月加入信达证券资产管理事业部担任投资经理。从业年限8年，曾就职于中国国际期货有限公司资产管理部担任投资经理。投资经验较为丰富，在量化投资策、基本面选股等方面有较深的研究和投资实践。

谭吉祥金融数学主修，三硕士。有超过10年海外及境内的固定收益及衍生品交易，产品设计，及投研经验。擅长利用产品设计提高市场风险管理能力，对金融产品的定价，交易研究有很好的理解，能对市场趋势变化敏感，善于发现市场机会。

4.2 报告期内本资产管理计划运作合规守信情况说明

本报告期内，管理人严格遵守《证券期货及经营机构私募资产管理计划运作管理规定》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》等有关法律法规及集合资产管理计划合同、说明书等集合资产管理计划法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用集合资产管理计划资产，在控制风险的前提下，为集合资产管理计划份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，集合资产管理计划运作合法合规，无损害份额持有人利益的行为。

4.3 报告期内资产管理计划的投资策略和运作分析

今年第四季度，国内疫情得到基本控制，经济复苏态势持续向好，社会融资规模实现总量修复与结构性改善。临近年末，银行间隔夜利率创出0.5878%的历史新低，央行在市场利率持续下行的情况下仍持续进行逆回购，显示出央行稳定年末资金面的态度。年末债券发行量也有所下降，资金博弈年末及明年初的流动性行情，长端国债利率有所下行。

观望后市，经济企稳上行的概率较高，货币政策正常化节奏可能加快；同时，信用收缩也会带来信用债市场的波动，后续投资依旧采用短久期防御思路。

4.4 公平交易专项说明

4.4.1 公平交易制度的执行情况

管理人主要通过建立有纪律、规范化的投资研究和决策流程、交易流程，以及强化事后监控分析来确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。管理人制定了严格的投资权限管理制度和集中交易制度等，重视交易执行环节的公平交易措施，以“时间优先、价格优先”作为执行指令的基本原则，通过投资交易系统内的公平交易模块，以尽可能确保公平对待各投资组合。本报告期内，公平交易制度总体执行情况良好。

4.4.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，投资主办在资产管理业务投资决策委员会授权范围内各自独立决策，未发现本产品有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.5 报告期内资产管理计划投资收益分配情况

报告期内未进行收益分配。

4.6 报告期内资产管理计划的业绩表现

报告期末单位净值为 1.0409，期间收益率为 0.61%。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末资产管理计划资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占资产管理计划总资产的比例（%）
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	1,502,925.13	3.71
3	固定收益投资	27,709,829.22	68.33
	其中：债券	27,709,829.22	68.33
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	9,000,900.00	22.19
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,521,234.66	3.75
8	其他资产	819,902.14	2.02
9	合计	40,554,791.15	100.00

5.2 报告期末按公允价值占资产管理计划资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占资产管理计划资产净值比例(%)
1	101801469	18津保投MTN013	70,000	6,943,510.00	17.19
2	101754040	17易华录MTN001	70,000	6,940,220.00	17.18
3	163705	20钢联03	70,000	6,902,000.00	17.09
4	032000145	20长寿经开PPN001	50,000	4,995,500.00	12.37
5	127013	创维转债	4,030	401,283.22	0.99

5.3 报告期末按公允价值占资产管理计划资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本报告期末未持有股票

5.4 报告期末按公允价值占资产管理计划资产净值比例大小排序的前五名基金明细

序号	名称	类型	运作方式	管理人	公允价值(元)	占资产管理计划资产净值比例(%)
1	银华日利	ETF基金	契约型开放式	-	1,502,025.00	3.72
2	华宝添益	ETF基金	契约型开放式	-	900.13	0.00

5.5 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	50,971.84
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	30,225.00
4	应收利息	738,705.30
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	819,902.14

5.6 报告期末按公允价值占资产管理计划资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

本报告期末未持有基金

§ 6 资产管理计划份额变动

单位：份

报告期期初资产管理计划份额总额	77,579,510.63
报告期期间资产管理计划总申购份额	27,952,910.66
减：报告期期间资产管理计划总赎回份额	66,726,444.04
报告期期间资产管理计划拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末资产管理计划份额总额	38,805,977.25

§ 7 重大事项揭示

7.1 资产管理计划管理人、资产管理计划托管人的专门资产管理计划托管部门的重大人事变动

自2020年12月2日起，信达证券睿享1号集合资产管理计划投资经理由唐国磊变更为唐国磊、谭吉祥。

7.2 涉及资产管理计划管理人、资产管理计划财产、资产管理计划托管业务的诉讼

无

7.3 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

无

7.4 其他重大事项

无

7.5 证券期货经营机构董事、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证券期货经营机构设立的集合资产管理计划

报告期末本资产管理计划关联方参与份额为1,456,008.14份，其中管理人自有资金占比83.43%，其他关联方占比16.57%。

7.6 资产管理合同约定的应当披露的其他信息

无

§ 8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

集合资产管理计划成立公告
集合资产管理计划说明书
集合资产管理计划合同
集合资产管理计划风险揭示书

8.2 存放地点

北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

8.3 查阅方式

网址：www.cindasc.com

客户服务电话：95321

邮箱（EMAIL）：csc@cindasc.com

投资人对本报告书如有任何疑问，可咨询管理人信达证券股份有限公司。

信达证券股份有限公司

2021年1月11日

