

国信转债增强集合资产管理计划

2023年第3季度管理报告

(2023年07月01日---2023年09月30日)

重要提示

本报告依据《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》、《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》及其他有关规定制作。

管理人承诺以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用本计划资产，但不保证本计划一定盈利，也不保证最低收益。

托管人已复核了本报告。

本报告相关数据未经会计师事务所审计。

管理人保证本报告中所载资料的真实性、准确性和完整性。

本报告中的内容由管理人负责解释。

一、本计划简介

名称：国信转债增强集合资产管理计划

类型：集合资产管理计划

成立日：2017年10月31日

报告期末计划总份额：6,617,345.77份

管理人：国信证券股份有限公司

托管人：平安银行股份有限公司

二、本计划投资表现

主要财务指标

序号	主要财务指标	本报告期
1	本期利润（元）	77,268.11

2	本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额（元）	-216,127.15
3	期末资产净值（元）	8,332,808.24
4	期末单位资产净值（元）	1.2590
5	期末单位累计资产净值（元）	1.2590
6	本期本计划净值增长率（%）	0.2389

三、管理人履职报告

（一）投资经理简介

姜寅梁，上海财经大学经济学、管理学双学士，上海交通大学工商管理硕士，7年以上证券从业经验。曾任中诚信证券评估有限公司信用分析师，国联安基金管理有限公司固收研究员、投资经理。现任国信证券资产管理总部投资经理，无其他兼职情况。已取得证券从业资格、基金从业资格。最近三年未曾被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚。

（二）投资经理工作报告

1、投资回顾

2023年三季度主要权益指数继续震荡下行，尽管政治局会议后相关地产、地方化债、活跃资本市场等领域政策不断落地，但经济基本面修复仍需时日，市场信心仍有待恢复，叠加人民币贬值压力处于高位，市场整体资金活跃度及成交量均维持在较低水平，北向资金大幅净流出而国内增量资金有限的背景下，股市表现乏善可陈，多数行业板块下跌，仅煤炭、非银、银行、石油石化等个别板块收红。转债市场方面，中证转债指数整体表现强于权益指数，全季小跌0.52%，债市强势震荡叠加流动性相对充裕背景下，转债估值（转股溢价率）继续维持高位，成交量与上季基本持平。报告期内，本集合计划以投资可转债为主，通过自上而下与自下而上相结合的研究方式，把握宏观及市场节奏，挖掘投资机会，本季持仓结构进行了较大幅度的调整，同时借市场调整之机提升了整体仓位水平，以为市场转暖做好充足准备。

2、投资展望

展望四季度，国内经济修复及政策空间仍可期待，美元加息步伐步入尾声，人民币贬值压力或将缓解，权益市场整体向下空间有限，转债在流动性和期权价值支撑下估值风险不大，后续重点关注资金面及增量政策，方向上关注政策落地方向以及调整充分的TMT相关品种，如地产链、汽车、金融、TMT等板块相关品种可继续重点关注。操作上后续账户将继续把握转债市场机会，挖掘个券价值，力争寻求相对

确定性的投资机会，以期实现较好的投资回报。

（三）运作合规性声明

本报告期内，管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《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》、《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》及其他法律法规的规定，本着诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用本计划资产，在严格控制风险的基础上，为持有人谋求最大利益。本报告期内，本计划运作合法合规，无损害计划持有人利益的行为，本计划的投资管理符合有关法规的规定。

（四）风险控制报告

本报告期内，管理人通过独立的风险控制部门，加强对各项业务风险的事前、事中监控和事后评估，对本计划重大事项进行风险评估，并提出风险控制措施。

风险控制部门采用授权管理、逐日监控、定期与不定期检查等多种方法对资产管理计划的管理运作进行风险控制。

在本报告期内，管理人对本计划的管理始终都能按照有关法律法规、公司相关制度和本计划合同及风险揭示书的要求进行。本计划的投资决策、投资交易程序、投资权限等各方面均符合规定的要求，运作合法合规，未出现违反相关规定的情况，也未发生损害投资者利益的行为。

四、托管人履职报告

托管人履职报告由托管人出具，管理人根据本计划资产管理合同约定进行披露。

五、投资组合报告（2023年09月30日）

（一）资产组合情况

资产项目	期末市值（人民币元）	占总资产比例（%）
银行存款、结算备付金、存出保证金和应收清算款	423,168.02	3.51
衍生金融资产	0.00	0.00
交易性金融资产	11,635,394.28	96.49
买入返售金融资产	0.00	0.00
发放贷款和垫款	0.00	0.00

债权投资	0.00	0.00
其他债权投资	0.00	0.00
应收利息、红利、申购款	0.00	0.00
其他资产	0.00	0.00
合计	12,058,562.30	100.00

(二) 按市值占净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	代码	简称	期末数量(股)	期末市值(元)	占期末计划净值的比例(%)
1	600919	江苏银行	54,744	393,061.92	4.72
合计				393,061.92	4.72

(三) 按市值占净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本报告期末基金投资余额为零。

(四) 按市值占净值比例大小排序的前十名私募基金投资明细

本报告期末其他私募基金投资余额为零。

(五) 按市值占净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	代码	简称	期末数量(张)	期末市值(元)	占期末计划净值的比例(%)
1	113050	南银转债	8,000	909,736.99	10.92
2	113043	财通转债	7,500	845,961.99	10.15
3	113650	博22转债	7,000	753,732.19	9.05
4	113061	拓普转债	5,000	661,582.88	7.94
5	128134	鸿路转债	5,000	620,775.41	7.45
6	113024	核建转债	5,000	573,539.73	6.88
7	127030	盛虹转债	4,490	552,926.71	6.64
8	113065	齐鲁转债	5,000	514,238.36	6.17
9	110062	烽火转债	4,000	494,140.82	5.93
10	113021	中信转债	4,000	465,959.45	5.59
合计				6,392,594.53	76.72

(六) 按市值占净值比例大小排序的前十名衍生工具投资明细

本报告期末其他衍生工具投资余额为零。

(七) 按市值占净值比例大小排序的前十名其他固定收益品种投资明细

本报告期末其他固定收益品种投资余额为零。

六、运用杠杆情况

截至2023年09月30日资产总值与资产净值比例为1.45。

(以上数据四舍五入,保留两位小数)

七、主要费用及业绩报酬(如有)(详见本计划合同约定)

项目	费率或计提基准	计提方式	支付方式
管理费	管理费按前一日集合计划资产净值计提,管理费的年费率为0.4%。	每日计提	按月支付
托管费	托管费按前一日集合计划资产净值计提,托管费的年费率为0.08%/年。	每日计提	按月支付
业绩报酬	业绩报酬计提日为本集合计划委托人退出日和集合计划清算结束日,以份额参与日(如份额为推广期参与,则参与日为集合计划成立日)到本次业绩报酬计提日的年化收益率,作为计提业绩报酬的基准。管理人以超额比例的方式提取业绩报酬。(详见产品合同约定)	业绩报酬在业绩报酬计提日计提,由管理人向托管人发送业绩报酬划付指令,托管人于5个工作日内从集合计划资产中将计提的业绩报酬一次性支付给管理人	在符合业绩报酬计提条件时,在本集合计划委托人退出日和本集合计划终止日计提业绩报酬

备注:上述为合同约定的费用支付标准和计算方法,管理人有权通过在管理人网站公告的方式对上述费用在一定期间内进行下调。具体详见公告。

八、投资收益分配

本报告期内本计划未进行收益分配。

九、本计划份额变动情况

单位:份

项目	本报告期
期初份额总额	10,517,611.39
报告期间总参与份额	0.00
其中:红利再投资份额	0.00

报告期间总退出份额	3,900,265.62
报告期末份额总额	6,617,345.77

十、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

(一) 报告期内本计划未调整投资经理。

(二) 重大关联交易状况

本报告期，本计划未发生重大关联交易。

(三) 报告期内，本计划存在管理人董事、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的情况，参与方式符合本计划合同约定。报告期末，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持有本计划份额共计 235,499.62 份。

(四) 报告期内，本计划不存在管理人以自有资金参与的情况。

(五) 其他涉及投资者权益的重大事项
暂无。

十一、信息披露文件存放地点及查阅方式

查阅地址：深圳市福田区福华一路125号国信金融大厦31楼

网址：www.guosen.com.cn

客服热线：95536

