

国信转债增强集合资产管理计划
2023年第4季度管理报告
(2023年10月01日—2023年12月31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：6,195,404.84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）	-492,520.79

2	本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额（元）	-412,114.87
3	期末资产净值（元）	7,325,519.52
4	期末单位资产净值（元）	1.1820
5	期末单位累计资产净值（元）	1.1820
6	本期本计划净值增长率（%）	-6.1160

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年四季度主要权益指数继续下探，政策面利好下基本面及市场信心仍有待修复，市场资金活跃度及成交量均维持在较低水平，多数行业板块下跌。转债市场方面，中证转债指数跟随权益下跌，期权价值压缩下不同平价转债估值（转股溢价率）均有所回落。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，本季组合继续在市场调整过程中优化持仓结构，配置相对前期更为均衡，以尽可能在震荡行情中提高风险调整后的收益水平。

2、投资展望

展望2024年一季度，存款利率下调后货币政策进一步发力的预期有所提升，叠加积极的财政政策有望逐步落地，国内经济修复态势或将延续；另一方面，美国加息步伐结束后人民币贬值压力有所缓解，外围不确定性或有所下降，叠加各类中长期资金逐步入市，预计权益市场整体向下空间有限。转债方面，市场悲观预期在2023年四季度有所释放，后续在流动性和期权价值支撑下估值有望得到一定支撑，继续关注资金面及股市成交量情况，方向上，高股息以及前期调整充分的部分汽车、TMT等相关品种可继续重点关注。

（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12月31日）

（一）资产组合情况

资产项目	期末公允价值（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	363,113.45	3.94
衍生金融资产	0.00	0.00
交易性金融资产	8,621,825.41	93.56
买入返售金融资产	229,990.48	2.50
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	9,214,929.34	100.00

(二) 按公允价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)	期末公允价值(元)	占期末计划净值的比例(%)
1	600926	杭州银行	30,000	300,300.00	4.10
2	601881	中国银河	8,000	96,400.00	1.32
3	002050	三花智控	3,000	88,200.00	1.20
4	600919	江苏银行	12,000	80,280.00	1.10
5	601689	拓普集团	1,000	73,500.00	1.00
合计				638,680.00	8.72

(三) 按公允价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) 按公允价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) 按公允价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)	期末公允价值(元)	占期末计划净值的比例(%)
1	128134	鸿路转债	4,000	441,552.82	6.03
2	110062	烽火转债	3,900	435,816.99	5.95
3	127032	苏行转债	3,500	406,718.51	5.55
4	110090	爱迪转债	3,000	395,060.96	5.39
5	127050	麒麟转债	3,048	385,507.15	5.26
6	127056	中特转债	3,500	361,556.04	4.94
7	110079	杭银转债	3,000	324,777.95	4.43
8	127015	希望转债	3,000	324,319.27	4.43
9	113061	拓普转债	2,500	321,768.49	4.39
10	113050	南银转债	3,000	318,040.68	4.34
合计				3,715,118.86	50.71

(六) 按公允价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) 按公允价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

序号	代码	简称	期末公允价值 (元)	占期末计划净值的比例 (%)
1	204001	GC001	229,990.48	3.14
合计			229,990.48	3.14

六、运用杠杆情况

截至2023年12月31日资产总值与资产净值比例为1.26。

(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	6,617,345.77
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	421,940.93
报告期末份额总额	6,195,404.84

十、投资经理变更、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）关联交易状况

本报告期，本计划未发生关联交易。

（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

国信证券股份有限公司

2024 年 1 月