

# 信托清算报告

---

**项目名称：** 重庆信托·中国量化全明星 2 号集合资金信托计划  
**合同编号：** 重庆信托（XT）字第 2103125 号  
**报告期间：** 2021 年 11 月 17 日 - 2024 年 3 月 20 日  
**受托人：** 重庆国际信托股份有限公司  
**地 址：** 重庆市渝北区嘉州路 88 号国信金融中心  
**信托经理：** 杜放  
**联系电话：** 021-50835799

---

致委托人（受益人）：

鉴于“重庆信托·中国量化全明星 2 号集合资金信托计划”（以下简称：本信托计划）于 2024 年 3 月 20 日提前终止，我公司依据国家相关法律、法规的规定和信托合同约定，出具信托清算报告。现将有关事项报告如下：

## 一、信托基本情况

（一）信托成立时间：2021 年 11 月 17 日。

（二）信托期限：共计 854 天。

（三）信托规模：产品成立初始信托份额为 35,100,000.00 份，现存续信托份额为 5,292,421.44 份。

（四）信托目的：信托计划项下信托资金总额的 1%用于认购信托业保障基金，剩余信托资金主要投资于私募基金管理人发行的私募证券投资基金，其中：市场中性策略私募证券投资基金占比不超过信托资金的 80%，CTA 策略私募证券投资基金占比不低于信托资金的 20%。如需投资法律法规、监管机构以后允许投资的其他品种，经受托人与委托人/受益人协商一致，受托人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。



## 二、信托财产的管理、运用情况

在信托存续期间，受托人本着诚实、信用、谨慎和有效管理的原则，严格按照信托合同的约定，对信托财产进行管理、运用和处分。

### （一）信托财产基本情况

报告期间，受托人已根据信托合同约定将信托资金的 1%用于认购信托业保障基金，剩余信托资金在投顾建议下投资认购基金产品，在投产品包括衍复天禄灵活对冲七号私募证券投资基金、千象 12 期私募证券投资基金、盛泉恒元量化套利 17 号私募证券投资基金等。

根据市场变化和策略运作情况，受托人决定于 2024 年 3 月 19 日提交底层标的私募基金赎回并于 2024 年 3 月 20 日提前终止本信托计划。

### （二）信托财产管理运作情况

信托计划存续期内，受托人严格按信托文件约定，对信托财产进行管理和运用，同时按相关法律法规及信托文件规定，建立完善的信托项目后续跟踪管理制度，配备专门的信托经理负责信托项目的具体管理工作，并定期进行信息披露。

投资策略概述：存续期内，国内权益市场整体震荡下行，交易量整体偏低，但截面波动率尚可，中小票行情整体利好量化策略，截至报告期末量化产品超额均有所修复，本信托计划配置的量化中性策略略有盈利；商品策略部分上涨，存续期内商品市场维持宽幅震荡，板块间分化明显，品种波动放大，本信托计划配置的量化商品策略净值在温和上涨后保持稳定；本信托计划配置的套利策略表现良好，与二级市场波动相关性较低，因此存续期收益贡献较为稳定。

截至 2024 年 3 月 20 日，信托单位净值 1.0931，信托财产总值 5,818,478.54 元，信托财产净值 5,785,295.72 元。

## 三、信托财产的收支、损益情况

本报告期内，信托财产收支情况如下：

#### （一）信托收入

信托收入为人民币 2,378,202.91 元（详见信托资金收益情况表）。

#### （二）信托支出

信托支出为人民币 672,947.19 元（详见信托资金收益情况表）。

#### （三）信托收益

信托收入扣除信托支出后，信托收益为人民币 1,705,255.72 元。

### 四、信托财产的分配

受托人将于本信托计划提前终止日后 10 个工作日内，按信托合同约定分配受益人信托财产并划付至受益人的指定银行账户。

信托专户自信托财产分配后，到销户期间的结余利息，作为受托人报酬，由受托人收取。

### 五、信息披露方式

信息披露时可选择如下任一方式进行：

1. 受托人营业场所存放备查；
2. 来函索取时寄送；
3. 在“重庆信托”电子交易平台公布；
4. 在受托人网址 <http://www.cqiti.com> 上公布；
5. 发送至信托合同项下委托人/受益人预留的电子邮箱；
6. 便于受益人知悉的其他方式。

### 六、受托人声明

在本报告期内，受托人本着诚实、信用、谨慎和有效管理的原则，在控制风险的前提下，为信托财产受益人谋求利益，严格遵守了《信托法》及其他有关法律法规、信托合同的规定，不存在损害信托委托人、受益人权益的行为。

七、自本报告披露之日起5个工作日内,如果受托人没有收到受益人或信托财产的权利归属人的书面异议,受托人就信托合同及本报告所列事项解除责任。

附:信托资金收益情况表

重庆国际信托股份有限公司  
2024年3月28日



## 信托资金收益情况表

报告期：2021 年 11 月 17 日 - 2024 年 3 月 20 日

编制单位：重庆国际信托股份有限公司 单位：元

	项目	本期金额
一	信托收入	2,378,202.91
1	投资收益	2,341,393.19
2	银行存款利息收入	30,361.79
3	信保基金收益	6,447.93
二	信托支出	672,947.19
1	固定管理费	345,888.51
2	银行保管费	2,305.90
3	律师费	2,500.00
4	印刷费	96.00
5	代理销售服务费	322,156.78
三	信托收益	1,705,255.72