

西南证券日新泽达 2 号集合资产管理计划 2023 年年度报告

管理人：西南证券股份有限公司

托管人：中国工商银行股份有限公司重庆市分行

报告期：2023年05月30日至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》及其他有关规定编制。

管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用集合计划资产，但不保证集合计划一定盈利，也不保证最低收益。

托管人已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。

管理人保证本报告中所载资料的真实性、准确性和完整性。

集合计划的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，请投资者在做出投资决策前，详细阅读本计划说明书及合同。

本报告书中的内容由管理人负责解释。

本报告未经审计。

本报告期起止时间：2023年01月01日至2023年12月31日。

目 录

一、集合计划概要	1
二、主要财务指标、收益分配和份额变动	2
(一) 主要财务指标	2
(二) 收益分配情况	2
(三) 份额变动表	2
三、管理人报告	3
(一) 业绩表现	3
(二) 投资经理简介	3
(三) 投资经理工作报告	3
(四) 风险控制报告	5
(五) 托管人履职情况的说明	6
四、财务会计报告	7
(一) 集合计划资产负债表	7
(二) 集合计划利润表	8
(三) 财务报表附注	8
五、资产管理计划的费用	11
(一) 管理费	11
(二) 托管费	12
(三) 业绩报酬	12
六、投资组合报告	14
(一) 报告期末资产组合情况	14
(二) 报告期末市值占集合计划资产净值前十名股票明细	14
(三) 报告期末市值占集合计划资产净值前十名债券明细	14
(四) 报告期末市值占集合计划资产净值前十名基金明细	15
(五) 报告期末股指期货、国债期货投资明细	15
(六) 报告期末其他投资明细	15
七、重大事项报告	16
八、信息披露的查阅方式	17

一、集合计划概要

名称	西南证券日新泽达2号集合资产管理计划
成立日期	2023年05月30日
成立总份额	13,350,246.97份
报告期末总份额	11,847,527.02份
存续期	9年
投资目标	在控制回撤的前提下获得超过业绩报酬计提基准的投资收益。
管理人	西南证券股份有限公司
托管人	中国工商银行股份有限公司重庆市分行

二、主要财务指标、收益分配和份额变动

(一) 主要财务指标

单位：人民币元

序号	主要财务指标	本期数
1	集合计划本期利润	-906,153.91
2	本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额	-735,093.51
3	期末集合计划资产净值	11,163,158.63
4	期末单位集合计划资产净值	0.9422
5	期末单位集合计划累计资产净值	0.9422
6	本期单位集合计划净值增长率	-5.78%
7	单位集合计划累计净值增长率	-5.78%
8	期末集合计划的杠杆比例	100.35%

注：主要财务指标中部分指标计算公式：

本期单位集合计划净值增长率=（报告期末单位集合计划累计资产净值-报告期初单位集合计划累计资产净值）/报告期初单位集合计划资产净值

单位集合计划累计净值增长率=（报告期末单位集合计划累计净值-1）/1

(二) 收益分配情况

本集合计划在本报告期末进行收益分配。

(三) 份额变动表

期初总份额	本期参与份额	本期退出份额	期末总份额
13,350,246.97	1,497,334.51	3,000,054.46	11,847,527.02

三、管理人报告

（一）业绩表现

截至 2023 年 12 月 31 日，本集合计划单位净值 0.9422 元，累计单位净值 0.9422 元，本报告期集合计划单位净值增长-5.78%。

（二）投资经理简介

曾勇，硕士研究生，FRM。2012 年 11 月加入西南证券股份有限公司，先后担任重庆大石坝营业部投资顾问，重庆北碚营业部投资顾问，风险控制部项目评估。2021 年 10 月加入西南证券资产管理事业部，任投资经理。

（三）投资经理工作报告

1、本年度投资总结

（1）投资组合表现回顾

西南证券日新泽达 2 号集合资产管理计划于 2023 年 5 月 30 日成立，截至 2023 年 12 月 31 日单位净值为 0.9422 元，较发行时单位净值下降 5.78%。

（2）投资组合与前期投资报告中投资方案/策略的偏差情况

策略上，严格遵循产品的整体投资策略及 2023 年全年及 2023 年各季度投资策略。

（3）投资组合运行中的调整情况

在实际操作中，日新泽达 2 号本年主要持有的是低估中高成长类公司，持仓主要是各行业或者细分行业龙头企业，但全年表现不佳，贡献了负收益。

2、本年回顾、后续投资策略与执行计划

（1）本年回顾

2023 年上证指数、深证成指、中小板综、创业板指与万得全 A 皆收跌，跌幅在 13.54%到 3.70%之间，同时波动偏大。同期 A 股全市场成交额 212.29 万亿，较上年减少 11.63 万亿，整体是持续下行走势。从行业看，中信三十个一级行业里有 11 个行业在全年获得正回报，其中涨幅前五名行业有：通信、传媒、煤炭、家电、石油石化，涨幅在 9.03%至 24.78%之间；涨幅后五名行业为：基础化工、建材、电力设备及新能源、房地产、消费者服务，跌幅在 17.50%至 41.18%之间。从行业风格看：中信稳定风格指数表现略好，上涨 2.14%，中信周期风格指数、

中信金融风格指数、中信成长风格指数和中信消费风格指数皆收跌，分别下跌 2.44%、3.86%、6.75%和 7.90%。此外，价值风格型基金指数下跌 1.95%，平衡风格型基金指数下跌 5.87%，成长风格型基金指数下跌 6.75%；主要赛道股指数如茅指数和宁组合分别下跌 14.29%和 25.58%。

国内方面，由于前期宏观经济政策的支持力度明显逊于预期，使得中国宏观经济经历了一季度的复苏后，在二季度转而下滑，三季度略微反弹，但仍差强人意。四季度并未有新的刺激政策出台，经济整体呈现出疲软的态势。

海外方面，欧美制造业有“补库”迹象，至少能部分对冲服务业的边际走软，同时物价水平黏性仍然较强。在此背景下，欧美央行有较强的决心持续保持鹰派的货币政策，这对风险资产不是一个好消息。相关溢出效应会给国内带来冲击。

(2) 后续投资策略与执行计划

对于未来的市场，本人十分看好 a 股反转行情，原因有四：

首先，展望外围市场，美联储加息将告一段落将进入降息通道，不确定的将是降息的幅度与频率，美国 10 年期国债收益率已经走在下降通道，从最高超过 5%降到目前 3.9%左右，从收益角度考量，外资有望流入新兴市场，特别是流入国内，权益资金通过沪深港通与 qfii 进入 a 股将使得绩优蓝筹受益；

再者，a 股各大指数经过两年的深度下跌，整体估值已经跌到历史最低区间范围，整体股息率也已经有了很大的提升，在国内整体利率下降的背景下，绩优高股息资产极具性价比，向下空间极小；

然后，目前投资者情绪极低，经过三年的整体向下行情，以及实体经济整体不景气，投资者对未来预期不高，情绪降至冰点，但未来行情快速变化，随时可能反转向上调动投资者情绪，使得投资者情绪经历大的过山车；

最后，经济基本面螺旋式改善的情况并未改变，虽然经历疫情三年以及地产暴雷，各行各业目前并未有明显复苏，但经济政策陆续出台，居民资产负债表逐渐修复是可以预见的，整体宏观经济也将经历走走停停的过程，不会一蹴而就，但是向上光明的前景并未改变。

日新泽达 2 号将高仓位运作，投资组合仓位主要布局在：汽车零部件、电子、轮胎、券商、造纸、稀有金属、医药、化工等行业。汽车零部件整体处于国产替代周期，国内零部件企业将有可能替代国际 tire1 厂商获得更大份额；电子行业

整体处于集中度快速提升，上游原材料逐步降价，下游需求逐步恢复，估值由于股价持续大跌处于历史底部位置。轮胎则受益于欧洲能源价格高企，国内出口类化工具有显著成本优势的情况，且海运价格进入长周期下跌，具有长期的逻辑。券商则处于大周期底部区域，将长久受益于注册制改革；造纸行业则长期受益于纸浆价格下跌，且人民币升值周期，工业自动装备则是在人力成本高企下，企业的最佳选择，具有低渗透率，高成长属性。医药板块经过长期大幅下跌，具有远大前景的医药企业已经显示出很好的投资价值。化工则受益于经济逐渐复苏，表现出极好的弹性。

（3）组合构建方案及投资工具运用

本组合的构建，主要是在既有的风控约束下，力求在收益与风险之间取得最佳平衡。主要的投资工具包含股票、基金和各类货币市场工具。

3、重大风险事件报告及处置（如有）

无。

（四）风险控制报告

1、集合计划运作合规性声明

本报告期内，集合计划管理人严格遵守《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》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集合计划资产，在严格控制风险的基础上，为集合计划持有人谋求最大利益。报告期内，本集合计划运作合法合规，无损害集合计划持有人利益的行为。

2、风险控制报告

本报告期内，集合计划管理人建立了完备的风险控制指标体系和科学合理、行之有效的风险控制系统，对集合理财业务进行事前审核、事中监控，对业务授权、投资交易的执行情况进行监控，对重大事项进行风险评估，控制业务运作过程中存在的风险。同时，本集合计划也接受管理人以外的合作机构、监管机构以及委托人的监管，确保集合计划资产实现较高的长期稳定增值的投资目标。

本报告期内，本集合计划管理人严格按照有关法律法规、公司相关制度和集合计划合同及说明书要求进行投资运作。本集合计划的投资决策、投资交易程序、

投资权限等各方面均符合规定的要求；交易行为合法合规，未出现异常交易、操纵市场的现象；未发现内幕交易情况；相关的信息披露和财务数据皆真实、准确、及时。

（五）托管人履职情况的说明

报告期内，托管人的履职情况详见托管报告。

四、财务会计报告

(一) 集合计划资产负债表

资 产	期末余额	负债和所有者权益	期末余额
资 产：		负 债：	
货币资金	2,268,762.10	短期借款	
结算备付金		交易性金融负债	
存出保证金		衍生金融负债	
衍生金融资产		卖出回购金融资产款	
应收清算款		应付管理人报酬	32,928.17
应收利息		应付托管费	658.51
应收股利		应付销售服务费	
应收申购款		应付投资顾问费用	
买入返售金融资产	-246.79	应交税费	
发放贷款和垫款		应付清算款	
交易类金融资产	8,933,230.00	应付赎回款	
债权投资		应付利息	
其他债权投资		应付利润	
其他权益工具投资		其他负债	5,000.00
长期股权投资		负债合计	38,586.68
其他资产		净资产：	
		实收基金	11,847,527.02
		其他综合收益	
		未分配利润	-684,368.39
		净资产合计	11,163,158.63
资产合计：	11,201,745.31	负债与净资产总计：	11,201,745.31

(二) 集合计划利润表

项目	本期金额
一、营业总收入	-819,065.37
利息收入	34,798.61
投资收益（损失以“-”填列）	-682,803.58
其中：以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益	
公允价值变动收益（损失以“-”填列）	-171,060.40
汇兑收益（损失以“-”填列）	
其他业务收入	
二、营业总支出	87,088.54
管理人报酬	79,789.63
其中：暂估管理人报酬	
托管费	1,595.68
销售服务费	
投资顾问费	
利息支出	
信用减值损失	
税金及附加	303.23
其他费用	5,400.00
三、利润总额	-906,153.91
减：所得税费用	
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-906,153.91
五、其他综合收益的税后净额	
六、综合收益总额	-906,153.91

(三) 财务报表附注

1、资产管理计划基本情况

本计划由管理人依据《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》等有关规定和《资产管理计划资产管理合同内容与格式指引》的约定设立，并负责开展投资管理和后续服务活动。

本计划于 2023 年 5 月 30 日成立，管理人为西南证券股份有限公司，托管人为中国工商银行股份有限公司重庆市分行。

2、财务报表编制基础

本计划的财务报表按照资产管理合同规定的资产估值、会计核算方法编制。如会计期间监管要求调整的，本计划财务报表也将按照新规要求编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

3、遵循企业会计准则的声明

本计划财务报表的编制符合企业会计准则和相关监管机构发布的关于资产管理行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本计划 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年 5 月 30 日至 2023 年 12 月 31 日期间的经营成果和资产管理计划净值变动情况等有关信息。

4、重要会计政策和会计估计

(1) 会计年度

本计划会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

(2) 记账本位币

本计划的记账本位币为人民币。

(3) 估值方法

本计划投资品种的估值方法以产品合同约定为准。如会计期间监管要求调整的，本计划估值方法也将按照新规要求调整。

(4) 金融资产和金融负债的分类和计量

本资产管理计划参考《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》（财会〔2017〕7 号）进行初始确认、后续计量和终止确认，依据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征进行分类。

5、会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

(1) 会计政策变更的说明

本计划本报告期未发生会计政策变更。

(2) 会计估计变更的说明

本计划本报告期未发生会计估计变更。

(3) 差错更正的说明

本计划在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6、财务报表重要项目说明

(1) 管理人报酬

管理人报酬详见本报告“五、资产管理计划的费用”。

报告期末，暂估业绩报酬金额 934.18 元，本计划资产净值（暂估业绩报酬前）11,163,158.63 元，本计划资产净值（暂估业绩报酬后）11,162,224.45 元。

实际计提的业绩报酬金额可能会与此处暂估业绩报酬金额有差异。其中，本计划资产净值（暂估业绩报酬后）=本计划资产净值（暂估业绩报酬前）-暂估业绩报酬金额；暂估业绩报酬为假设本计划于报告期内最后一个工作日按照当日的计划净值（计提业绩报酬前）清算，根据计划持有人持有的计划份额（包括未到期份额）至该日持有期间的收益情况估算的业绩报酬。该金额是所有持有人的暂估业绩报酬的合计，各持有人实际应承担的业绩报酬金额根据其持有期间的实际收益情况计算确认。

(2) 公允价值计量

计划根据《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》，通过以下三个层次的输入值进行相关金融工具的计量：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

7、或有事项、资产负债表日后事项的说明

(1) 或有和承诺事项

截至资产负债表日，本计划无需要披露的或有和承诺事项。

(2) 资产负债表日后非调整事项

截至本会计报表批准报出日，本计划无需要披露的资产负债表日后事项。

8、关联方关系和关联方交易

(1) 关联方关系

关联方名称	与本计划的关系
西南证券股份有限公司	管理人
中国工商银行股份有限公司重庆市分行	托管人

(2) 关联方交易

本计划关联交易情况详见本报告“七、重大事项报告”。

9、金融工具风险及管理

(1) 信用风险

信用风险是指资产管理计划在交易过程中因交易对手未履行合约责任,或者资产管理计划所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况,导致资产管理计划资产损失和收益变化的风险。

管理人建立健全信用风险管理制度,对信用风险进行准确识别、审慎评估、动态监控、及时应对和全程管理。对投资对象、交易对手开展必要的尽职调查,实施严格的准入管理和交易额度管理,评估并持续关注证券发行人、融资主体和交易对手的资信状况,以及担保物状况、增信措施和其他保障措施的有效性。出现可能影响投资者权益的事项,管理人及时采取申请追加担保、依法申请财产保全等风险控制措施。

(2) 流动性风险

流动性风险是指资产管理计划在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险,本计划的流动性风险主要来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。本计划的管理人采取了一系列管理措施,如制定应急处理机制等,以控制相应的流动性风险。

(3) 市场风险

市场风险是指资产管理计划所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险,包括利率风险、外汇风险和其他价格风险,本计划存在一定的市场风险。本计划的资产管理人严格遵循谨慎、分散风险的原则,充分考虑投资者财产的安全性和流动性,实行专业化管理和控制,防范、化解市场风险。

五、资产管理计划的费用

(一) 管理费

本集合计划的管理费按前一自然日集合计划的资产净值计提,管理费的年费

率为【1】%。计算方法如下：

$$H=E*【1】\%/365$$

H 为每日应计提的集合计划管理费

E 为前一自然日集合计划资产净值

集合计划管理费自计划成立日起于每个自然日计提，逐日累计至每季度末，按季支付。由管理人于本集合计划成立后的每自然季度的次季度首日起 5 个工作日内向托管人出具划款指令，托管人依据管理人划款指令从集合计划资产中扣划管理费一次性支付给管理人，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

（二）托管费

本集合计划托管人托管费按前一自然日集合计划资产净值的【0.02】%年费率（含税）计提，计算方法如下：

$$H = E*【0.02】\%/365$$

H 为每日应计提的托管费；

E 为前一自然日集合计划资产净值。

集合计划托管费自计划成立日起于每个自然日计提，逐日累计至每季度末，按季支付。由管理人于本集合计划成立后的每自然季度的次季度首日起 5 个工作日内向托管人出具划款指令，托管人依据管理人划款指令从集合计划资产中扣划托管费一次性支付给托管人，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

（三）业绩报酬

1、管理人收取业绩报酬的原则

（1）同一投资者不同时间多次参与本集合计划份额的，对投资者每次参与的份额分别计算应当计提的业绩报酬。

（2）业绩报酬提取频率不超过 6 个月一次，但因投资者退出本集合计划或本集合计划终止情形的除外。

在分红权益登记日、投资者退出日或集合计划清算终止时，管理人对符合业绩报酬提取条件的份额提取业绩报酬。

（3）在分红权益登记日提取业绩报酬的，业绩报酬从分红金额中扣除；在投资者退出或集合计划清算终止时提取业绩报酬的，业绩报酬从退出资金中扣除。

2、业绩报酬的计提方法

在分红权益登记日、投资者退出日或集合计划清算终止日，如集合计划年化收益率 R 超过【10】%/年的，管理人提取超额收益的 20%作为业绩报酬。

年化收益率 R 的计算公式为：

$$R=(A-B)/C/D\times 365\times 100\%$$

管理人计提的业绩报酬 H 的计算公式为：

$$H=\text{MAX}【R-【10】\%，0】\times C\times D/365\times M\times 20\%$$

其中：

A 为业绩报酬提取日的累计单位净值；

B 为上一业绩报酬提取日（若无上一业绩报酬提取日的，则为集合计划成立日或投资者该笔份额申购日）的累计单位净值；

C 为上一业绩报酬提取日（若无上一业绩报酬提取日的，则为集合计划成立日或投资者该笔份额申购日）的单位净值；

D 为投资者所持有的每笔份额上一业绩报酬提取日（不含）（若无上一业绩报酬提取日的，则为集合计划成立日（含）或投资者该笔份额申购日（不含））到本次业绩报酬提取日（含）的实际天数；

M 为计提业绩报酬的份额数。

管理人对于业绩报酬计算结果四舍五入保留至小数点后两位，因四舍五入产生的差额由集合计划承担。

3、业绩报酬的支付

在业绩报酬计提后，托管人根据管理人的指令完成业绩报酬的划拨支付。若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。业绩报酬一经计提，不得转回。

业绩报酬的计算和复核工作由管理人完成。业绩报酬收取账户为本合同约定的资产管理人管理费收取账户。

4、业绩报酬计提基准不是管理人向全体投资者保证其资产本金不受损失或者保证其取得最低收益的承诺，集合计划份额也可能出现本金或收益的损失。

六、投资组合报告

（一）报告期末资产组合情况

项目	金额（人民币元）	占总资产的比例（%）
银行存款及结算备付金	2,268,762.10	20.25%
股票	8,933,230.00	79.75%
债券	---	---
基金	---	---
其他投资	---	---
金融衍生品投资	---	---
买入返售金融资产	-246.79	0.00%
其他资产	---	---
合计	11,201,745.31	100%

注：①“其他资产”包括证券清算款、存出保证金、应收利息和应收股利和其他资产等项目。

②部分项目可能存在小数点位差调整。

（二）报告期末市值占集合计划资产净值前十名股票明细

序号	证券代码	证券名称	持仓量	证券市值（元）	市值占净值比
1	605377 SH	华旺科技	80,000.00	1,527,200.00	13.68%
2	000513 SZ	丽珠集团	28,000.00	980,280.00	8.78%
3	601233 SH	桐昆股份	60,000.00	907,800.00	8.13%
4	002984 SZ	森麒麟	30,000.00	865,500.00	7.75%
5	603225 SH	新凤鸣	60,000.00	852,000.00	7.63%
6	300059 SZ	东方财富	60,000.00	842,400.00	7.55%
7	600690 SH	海尔智家	32,000.00	672,000.00	6.02%
8	600030 SH	中信证券	30,000.00	611,100.00	5.47%
9	603035 SH	常熟汽饰	25,000.00	471,750.00	4.23%
10	600309 SH	万华化学	5,000.00	384,100.00	3.44%

（三）报告期末市值占集合计划资产净值前十名债券明细

本集合计划报告期末未持有债券。

(四) 报告期末市值占集合计划资产净值前十名基金明细

本集合计划报告期末未持有基金。

(五) 报告期末股指期货、国债期货投资明细

本集合计划期末未持有期货。

(六) 报告期末其他投资明细

本集合计划报告期末未持有其他投资。

七、重大事项报告

（一）投资经理变更情况

本报告期内，本集合计划未发生投资经理变更。

（二）关联交易情况

1、重大关联交易情况

本报告期内，本集合计划不存在重大关联交易情况。

2、一般关联交易情况

2023年6月14日，本集合计划与西南期货股份有限公司签订服务协议并开立衍生品账户，本报告期内，本集合计划根据投资安排，根据服务协议约定向其支付相关费用（如有）。

（三）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情况

报告期末本集合计划不存在董事、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情况。

报告期内，本集合计划详细的董事、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情况详见管理人网站公告。

（四）其他涉及投资者权益的重大事项

2023年10月31日，管理人发布了《关于西南证券股份有限公司总经理变更的公告》，公告西南证券股份有限公司总理由吴坚先生变更为杨雨松先生。

本报告期内，本集合计划其他涉及投资者权益情况的重大事项详见管理人网站公告。

八、信息披露的查阅方式

投资者可通过管理人公司网站查阅公司网站地址为：www.swsc.com.cn

公司地址：重庆市江北区金沙门路32号西南证券总部大楼

邮编：400025

客服热线：95355



中国工商银行（资产托管部）

托管人履职报告

本报告期内，本托管人在对西南证券日新泽达2号集合资产管理计划的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和资产管理合同的有关规定，不存在任何损害资产管理计划份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了托管人应尽的义务。

本报告期内，托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、资产管理合同和托管协议的规定，对本资产管理计划管理人的投资运作进行了必要的监督，对资产净值的计算、份额参与与退出价格计算、以及费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本计划管理人存在损害份额持有人利益的行为。

本报告期内，本托管人依法对西南证券资产管理有限公司编制和披露的西南证券日新泽达2号集合资产管理计划2023年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

中国工商银行资产托管部

2024年4月17日