

# 信达证券睿享4号周周盈集合资产管理计划

## 2024年第2季度报告



管理人：信达证券股份有限公司

托管人：中国建设银行股份有限公司北京市分行

## § 1 重要提示

本报告依据《证券期货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资产管理计划资产，但不保证本资产管理计划一定盈利，也不保证本金不受损失。

托管人已于2024年7月12日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、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2024年4月1日起至2024年6月30日止。

## § 2 资产管理计划产品概况

资产管理计划简称	信达证券睿享4号
资产管理计划编码	C20411
资产管理计划合同生效日	2022年11月22日
报告期末资产管理计划份额总额	179,874,631.75份
资产管理计划合同存续期	本集合计划存续期为10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	中国建设银行股份有限公司北京市分行

## § 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（2024年4月1日 - 2024年6月30日）
本期已实现收益	1,318,292.73
本期利润	1,057,961.53
加权平均资产管理计划份额本期利润	0.0057
期末资产管理计划资产净值	190,179,670.60
期末资产管理计划份额净值	1.0573

### 3.2 资产管理计划净值表现

本报告期间，本资产管理计划的净值季度增长率为0.57%。

## § 4 管理人报告

### 4.1 投资经理（或投资经理小组）简介

连永龙先生，哈尔滨工业大学理学硕士。2021年7月加入信达证券资产管理事业部，曾任职中邮证券、开源证券等投资经理，从事资产管理工作。管理规模超200亿，产品类型包括私募集合资管产品、TOF产品、结构化产品等。具有丰富的投资管理经验，经历债券市场的牛熊切换，对资本运作有一定的理解，擅长资产配置和交易性机会把握；已经取得基金从业资格，最近三年未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚。

### 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，及本集合计划合同、计划说明书等法律文件的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用本集合计划资产，在控制风险的前提下，为集合计划份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，本集合计划运作合法合规，无损害份额持有人利益的行为。

### 4.3 公平交易专项说明

#### 4.3.1 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。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，投资经理在资产管理业务投资决策委员会授权范围内独立决策，未发现本资产管理计划有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

### 4.4 报告期内资产管理计划的投资报告

二季度以来，宏观政策延续相对宽松的基调，随着季末临近及央行连续地量投放OMO以及MLF在16个月后首次净回笼，引发市场对于“防止资金空转”的进

一步担忧，带动资金利率走高。4月以来，随着“手工补息”被禁止，资金从银行向非银传导过程中出现资金淤积，4月下旬至5月期间资金面分层大幅减弱甚至阶段性消失，6月随着理财逐步回表及缴税、跨季扰动，资金利率有所走高，资金面分层重回视野。虽然6月下旬资金利率走高，但同业存单收益率持续下行，或体现银行负债端压力可控，提价发行诉求不高，预测三季度资金面仍相对较为乐观。

当前信用债市场各板块处于历史低位，基本面改善预期相对较弱，信用债风险在政策支持下得到明显缓释，供需关系仍为市场关注焦点，债市收益以票息策略占优，资产荒持续。在强预期和弱现实相互影响的背景前提下，伴随市场下沉，债券市场聚焦收益挖掘，在各板块中寻找可循的收益空间。

展望三季度，债市仍面临诸多扰动。当前收益率位于相对底部位置，后续利率下行空间相对有限，下半年利率呈现震荡偏空趋势，央行预计会延续稳健宽松的货币政策，但同时需要关注利率风险，以及央行对于逆回购的操作与态度。对于七月到八月期间政府债的供给高峰期，同时可能会对债市产生短期扰动。产品配置中，仍以中短久期债券或中短久期的纯债基金为主，同时进一步挖掘债券市场，择机配置优质资产增厚产品收益。

#### 4.5 报告期内资产管理计划的投资表现

报告期间，本资产管理计划的净值季度增长率为0.57%。

#### 4.6 报告期内资产管理计划投资收益分配情况

本报告期内，本资产管理计划未进行收益分配。

#### 4.7 产品运用杠杆情况

本报告期末，本资产管理计划资产总值与资产净值的比例为142.61%，其中正回购资金余额为77,323,984.72元。

### § 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	-	-
3	固定收益投资	266,842,829.79	98.39

	其中：债券	240,866,793.93	88.81
	资产支持证券	25,976,035.86	9.58
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	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	4,373,732.19	1.61
8	其他资产	2,300.69	0.00
9	合计	271,218,862.67	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	185176	21天风05	200,000	20,640,246.58	10.85
2	012480288	24鲁商SC P002	200,000	20,413,726.78	10.73
3	114529	19泾河01	100,000	10,729,813.70	5.64
4	252218	23漯河02	100,000	10,624,328.77	5.59
5	162141	19翠屏01	100,000	10,563,301.37	5.55

## 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五名股票投资明细

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

本报告期末未持有基金。

## 5.5 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资产支持证券投资明细

序	证券代	证券名称	数量(份)	公允价值(元)	占资产管
---	-----	------	-------	---------	------

号	码				理计划资产净值比例 (%)
1	082400485	24物产中大ABN001优先(乡村振兴)	100,000	10,037,164.38	5.28
2	262138	美歆2A	55,000	5,508,189.73	2.90
3	144304	荟享162B	50,000	5,005,960.27	2.63
4	144197	G易易1A1	60,000	2,600,961.92	1.37
5	260944	徐租02A1	50,000	2,209,853.92	1.16

### 5.6 其他资产构成

序号	名称	金额 (元)
1	存出保证金	2,300.69
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	2,300.69

### § 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	153,649,084.25
报告期期间资产管理计划总申购份额	133,106,071.86
减：报告期期间资产管理计划总赎回份额	106,880,524.36
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	179,874,631.75

### § 7 资产管理计划支付的费用计提基准、计提方式和支付方式

#### 7.1 管理费

计提基准	0.3%/年（自2024年7月2日（含）起，本计划管理费率为0.5%变更为0.3%，2024年7月2日（不含）前，本计划管理费率为0.5%）
计提方式	前一日集合计划资产净值 $\times 0.3\% \div 365$ ，按日累计（2024年7月2日（含）起）。 前一日集合计划资产净值 $\times 0.5\% \div 365$ ，按日累计（2024年7月2日（不含）前）。
支付方式	按季支付，经管理人和托管人核对一致后，由托管人根据管理人划款指令于每季度结束后次月首日起5个工作日内从集合计划资产中扣划支付给管理人。若集合计划现金资产不足以支付当期管理费，可顺延至有足额现金资产后支付。

## 7.2 托管费

计提基准	0.01%/年（自2024年7月2日（含）起，本计划托管费率由0.015%变更为0.01%，2024年7月2日（不含）前，本计划托管费率为0.015%）
计提方式	前一日集合计划资产净值 $\times 0.01\% \div 365$ ，按日累计（2024年7月2日（含）起）。 前一日集合计划资产净值 $\times 0.015\% \div 365$ ，按日累计（2024年7月2日（不含）前）。
支付方式	按季支付，经管理人和托管人核对一致后，由托管人根据管理人划款指令于每季度结束后次月首日起5个工作日内从集合计划资产中支付给托管人。若集合计划现金资产不足以支付当期托管费，则可顺延至有足额现金资产后支付。

## 7.3 业绩报酬

计提基准	管理人对份额年化收益率（R）超过业绩报酬计提基准（3.5%）的部分，可提取60%作为管理人业绩报酬。
计提方式	管理人于业绩报酬计提日，将按份额认（申）购时间的不同，针对委托人每笔份额分别核算其业绩报酬核算期。管理人根据当个业绩报酬核算期的委托人每笔份额实际年化收益率情况，分段计提业绩报酬，委托人所持份额以认（申）购时间的不同分别进行业绩报酬的核算和计提。业绩报酬计提日为收益分配日和本集合计划终止清算日的，管理人的业绩报酬为符合业绩报酬计提条件的全部份额根据上述约定计算的业绩报酬之和；业绩报酬计提日为委托人份额退出日的，

	管理人的业绩报酬为符合业绩报酬计提条件的全部退出份额根据上述约定计算的业绩报酬之和。
支付方式	管理人的业绩报酬的计算和复核工作由管理人完成，托管人不承担复核责任。业绩报酬计提结束后，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一次性支付给注册登记机构或管理人。

自2024年7月2日起，本集合计划不计提业绩报酬。

#### 7.4 业绩报酬及费用的计提和支付

	报告期间计提金额（元）	报告期间支付金额（元）
管理费	241,537.92	193,075.95
托管费	7,246.10	5,792.29
业绩报酬	32,559.39	32,559.39

### § 8 重大事项揭示

#### 8.1 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资产管理计划

报告期末，本集合计划总份额为179,874,631.75份，其中自有资金参与本集合计划的份额占总份额的2.22%，从业人员及其配偶参与本集合计划份额占总份额的2.89%。

#### 8.2 本报告期内投资经理变更情况

无。

#### 8.3 本报告期内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重大诉讼

无。

#### 8.4 本报告期内管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

无。

#### 8.5 其他重大事项

2024年4月12日，管理人通过公司网站发布了《关于信达证券睿享4号周周盈集合资产管理计划新增代理推广机构的公告》。

2024年6月24日，管理人通过公司网站发布了《信达证券睿享4号周周盈



集合资产管理计划合同变更的征询公告》。

2024年6月28日，管理人通过公司网站发布了《信达证券睿享4号周周盈集合资产管理计划临时开放退出的公告》。

## §9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

信达证券睿享4号周周盈集合资产管理计划成立公告

信达证券睿享4号周周盈集合资产管理计划说明书（第一次合同变更后）

信达证券睿享4号周周盈集合资产管理计划资产管理合同（第一次合同变更后）

信达证券睿享4号周周盈集合资产管理计划风险揭示书（第一次合同变更后）

### 9.2 存放地点

北京市西城区宣武门西大街甲127号金隅大厦B座8层

### 9.3 查阅方式

网址：[www.cindasc.com](http://www.cindasc.com)

客户服务电话：95321

邮箱（EMAIL）：[csc@cindasc.com](mailto:csc@cindasc.com)

投资人对本报告如有任何疑问，可咨询管理人信达证券股份有限公司。



## 免责声明

本报告并非宣传推介材料，所载内容仅供投资者参考。任何人不得对本报告进行任何形式的发布、复制或删改，否则将构成侵权。

投资有风险，请理性选择、谨慎投资。管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用委托资产，但不保证本资产管理计划一定盈利，也不保证本金不受损失。本资产管理计划的过往业绩及净值高低并不预示其未来业绩表现，管理人管理的其他产品的业绩也不构成本资产管理计划业绩表现的保证。本资产管理计划的具体情况以资产管理合同等法律文件为准，请仔细阅读。

