

# 信达证券睿丰9号集合资产管理计划

## 2023年第4季度报告



管理人：信达证券股份有限公司

托管人：中国工商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1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2023年10月1日起至2023年12月31日止。

## § 2 资产管理计划产品概况

资产管理计划简称	信达证券睿丰9号
资产管理计划编码	C20367
资产管理计划合同生效日	2019年12月17日
报告期末资产管理计划份额总额	14,438,014.64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
资产管理计划管理人	信达证券股份有限公司
资产管理计划托管人	中国工商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（2023年10月1日-2023年12月31日）
本期已实现收益	-490,436.18
本期利润	-237,416.72
加权平均资产管理计划份额本期利润	-0.0157
期末资产管理计划资产净值	15,847,630.63
期末资产管理计划份额净值	1.0976

### 3.2 资产管理计划净值表现

报告期间，本资产管理计划的净值季度增长率为-1.35%。

## § 4 管理人报告

### 4.1 投资经理（或投资经理小组）简介

连永龙，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，曾在中邮证券、开源证券等公司担任投资经理，从事资产管理工作。累计管理规模超200亿，具有丰富的投资管理经验，经历多个债券市场的牛熊周期，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。

唐国磊，物理学博士，毕业于法国巴黎第十一大学。2015年6月加入信达证券资产管理部。先后在期货公司资产管理部担任量化分析师，投资经理，管理过多款CTA量化产品。在量化投资方面积累了比较丰富的实战经验，擅长多市场分散化投资以及多策略组合投资。具有良好的自律性和职业操守。自2023年11月7日起担任本资产管理计划的投资经理。

张翥，北京大学应用统计硕士，理学学士。2022年1月加入信达证券资产管理事业部，曾在中信信托担任信托经理，从事资产管理工作。对资产配置、量化交易、FOF组合投资等有较好把握；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，及集合资产管理计划合同、说明书等集合资产管理计划法律文件的约定，本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运用集合资产管理计划资产，在控制风险的前提下，为集合资产管理计划份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，集合资产管理计划运作合法合规，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

统中的公平交易模块，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

2023年四季度，权益市场仍以结构性行情为主，主要宽基指数整体呈下行趋势，市场陷入震荡探底阶段。近期国内经济数据表明供给侧和需求侧稳步恢复中，12月中央经济工作会议为明年发展指明了方向，后续稳增长政策有望持续出台。

四季度，上证指数下跌5.17%，深证成指下跌9.14%，创业板指下跌10.66%，A股持续走低，北向资金净流出594.89亿元。在权益走弱下，转债市场热度同样降低，中证转债指数下跌3.94%。

后续关注政策发力方向及强度，基本面数据恢复节奏，并通过自下而上的方式选择投资标的。在控制回撤的同时，追求长期稳健的投资收益，在做好基本面研究的基础上，及时把握投资机会。

#### 4.5 报告期内资产管理计划的投资表现

报告期间，本资产管理计划净值季度增长率为-1.35%。

#### 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100.71%，其中正回购资金余额为0。

### § 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	5,043,055.90	31.60

3	固定收益投资	7,147,875.78	44.79
	其中：债券	7,147,875.78	44.79
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	3,199,677.91	20.05
	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	529,779.94	3.32
8	其他资产	39,045.42	0.24
9	合计	15,959,434.95	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证券投资明细

序号	证券代码	证券名称	公允价值（元）	占资产管理计划资产净值比例（%）
1	511660	建信添益	3,011,371.00	19.00
2	511880	银华日利	2,031,684.90	12.82
3	128133	奇正转债	154,251.75	0.97
4	113616	韦尔转债	110,697.31	0.70
5	123100	朗科转债	105,074.77	0.66

### 5.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	2,850.52
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	36,194.90
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	39,045.42

## § 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	15,237,637.32
报告期期间资产管理计划总申购份额	-
减：报告期期间资产管理计划总赎回份额	799,622.68
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	14,438,014.64

## § 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	1.2%/年
计提方式	前一日集合计划资产净值 $\times$ 1.2% $\div$ 365，按日累计。
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。延期支付管理费不计利息，仍按原价支付。

## 7.2 托管费

计提基准	0.02%/年
计提方式	前一日集合计划资产净值 $\times$ 0.02% $\div$ 365，按日累计。
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。延期支付托管费不计利息，仍按原价支付。

## 7.3 业绩报酬

计提基准	管理人对份额年化收益率(R)超过6%(含)至6.8%(不含)部分，可提取25%作为管理人业绩报酬；对份额年化收益率(R)超过6.8%(含)以上部分，可提取50%作为管理人业绩报酬。
计提方式	在每个集合计划业绩报酬提取日(指份额退出申请日、收益分配日或集合计划终止日)，管理人根据本集合计划份额年

	化收益率(R)提取业绩报酬,一类是委托人申请退出或本集合计划期满清算或结算时提取业绩报酬,称为退出提取;另一类是份额收益分配时提取业绩报酬,称为分红提取。
支付方式	业绩报酬在业绩报酬提取日计提并支付,由于涉及注册登记数据,业绩报酬由管理人计算和复核,托管人不承担复核责任,托管人依据管理人发送的投资指令将业绩报酬划拨给注册登记机构,由注册登记机构将业绩报酬支付给管理人,并将扣除业绩报酬的款项转入委托人的交易账户。若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。

#### 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	50,350.74	63,458.44
托管费	839.16	1,057.71
业绩报酬	-	-

### § 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,管理人以自有资金参与本集合计划的份额为2,873,164.91份,占本集合计划总份额的19.90%;无管理人董事、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。

#### 8.2 本报告期内投资经理变更情况

自2023年11月7日起,本集合计划投资经理由连永龙先生和张翥先生变更为连永龙先生、唐国磊先生和张翥先生。

#### 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

2023年11月7日，管理人通过公司网站发布了《关于信达证券睿丰系列集合资产管理计划变更投资经理的公告》。

2023年12月28日，管理人通过公司网站发布了《关于管理人自有资金部分退出信达证券睿丰9号集合资产管理计划份额情况的结果公告》。

报告期内本资产管理计划管理人向中国证监会提交了设立资产管理子公司的申请。如后续中国证监会审批同意管理人设立资产管理子公司，管理人将按照本资产管理计划资产管理合同的约定履行相应的管理人变更程序。

## §9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

信达证券睿丰9号集合资产管理计划成立公告  
信达证券睿丰9号集合资产管理计划说明书  
信达证券睿丰9号集合资产管理计划资产管理合同  
信达证券睿丰9号集合资产管理合同之补充协议  
信达证券睿丰9号集合资产管理合同之补充协议（二）  
信达证券睿丰9号集合资产管理计划风险揭示书

### 9.2 存放地点

北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

### 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)

投资人对本报告书如有任何疑问，可通过以上方式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。