

信达证券睿丰9号集合资产管理计划

2023年第3季度报告

项目	金额/比例
总资产	
净资产	
流动资产	
非流动资产	
负债	
所有者权益	

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



项目	金额/比例
流动资产	
非流动资产	
负债	
所有者权益	

§ 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2023年10月13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7月1日起至2023年9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	15,237,637.32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7月1日-2023年9月30日）
本期已实现收益	33,049.69
本期利润	22,707.67
加权平均资产管理计划份额本期利润	0.0012
期末资产管理计划资产净值	16,953,677.47
期末资产管理计划份额净值	1.1126

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-0.16%。

§ 4 管理人报告

4.1 投资经理（或投资经理小组）简介

陈巧玲，哥伦比亚大学金融工程硕士。2021年4月加入信达证券资产管理事业部；曾就职于国信证券担任投资总监、招商证券担任投资经理；在量化策略、多因子模型、衍生品投资等具备多年经验。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。自2023年8月15日起不再担任本资产管理计划的投资经理。

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。自2023年8月15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。自2023年8月15日起担任本资产管理计划的投资经理。

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，本着诚实信用、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

2023年前三季度，权益市场以结构化行情为主，年初国内疫后修复性需求释放经济快速修复。二季度经济复苏动能放缓，美联储加息预期升温，国内宽基指数表现分化。三季度美元走强，人民币汇率持续贬值，同时叠加基本面数据修复较弱，市场陷入震荡探底阶段。

当前A股市场调整较为明显，稳增长政策持续出台，提振信心。7月底政治局会议提出“活跃资本市场，提振投资者信心”。8月底印花税减半、降低两融成本、阶段性收紧IPO、完善大股东减持制度。政策发力正向基本面逐步传导。

前三季度，上证指数跌2.86%，深证成指跌8.32%，创业板指跌9.53%，A股整体先扬后抑，8月份北向资金累计减仓接近900亿元，单月净卖出额创历史新高。中证转债指数下跌0.52%。10年期国债收益率从年初高点下行近20bp。

后续关注政策发力方向及强度，基本面数据恢复节奏，以政策引领为主线兼顾科技成长细分领域，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-0.16%。

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100.45%，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
----	----	-------	------------

			产的比例 (%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	2,059,754.01	12.10
3	固定收益投资	11,663,650.69	68.49
	其中：债券	11,663,650.69	68.49
	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	2,697,469.44	15.84
	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	553,623.09	3.25
8	其他资产	54,633.69	0.32
9	合计	17,029,130.92	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	511880	银华日利	2,059,353.80	12.15
2	110079	杭银转债	209,515.81	1.24
3	113549	白电转债	185,677.25	1.10
4	123114	三角转债	181,975.38	1.07
5	128090	汽模转2	161,642.53	0.95

5.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	3,694.04
2	应收证券清算款	50,939.65
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	54,633.69

§ 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	25,780,397.67
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	10,542,760.35
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	15,237,637.32

§ 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	63,458.44	251,912.91
托管费	1,057.71	4,198.58
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3,032,289.83份,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,管理人自有资金占本集合计划总份额的19.90%。

8.2 本报告期内投资经理变更情况

自2023年8月15日起,本集合计划投资经理由陈巧玲女士变更为连永龙先生和张翥先生。

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7月27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（2023年7月）》。

2023年8月15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8月31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》。

2023年9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》。

§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

客户服务电话：95321

邮箱（EMAIL）：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。