

重庆信托·廊信稳享1号集合资金信托计划 2023年第3季度报告



受托人：重庆国际信托股份有限公司
保管人：兴业银行股份有限公司
报告期间：2023年7月1日—2023年9月30日

§ 1 重要提示

本报告依据《中华人民共和国信托法》、《信托公司集合资金信托计划管理办法》和《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》及其他有关规定制作。

本报告由受托人重庆国际信托股份有限公司编制，报告书中的内容由受托人重庆国际信托股份有限公司负责解释。

受托人承诺以诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运用集合信托计划资产，但受托人在管理和运用信托资产过程中可能面临多种风险，包括但不限于政策风险、市场风险、流动性风险、管理风险等，受托人不保证集合计划一定盈利，也不保证最低收益，委托人已充分知悉并自愿承担相应风险。

受托人保证本报告书中所载资料的真实性、准确性和完整性。本报告书中的内容由受托人负责解释。

§ 2 产品概况

| | |
|----------|------------------------|
| 产品名称 | 重庆信托·廊信稳享1号集合资金信托计划 |
| 开始运作日 | 2023年3月22日 |
| 信托财产专户账号 | 5720 1010 0101 7356 29 |
| 期末总份额 | 38,240,000.00份 |
| 受托人名称 | 重庆国际信托股份有限公司 |
| 保管人名称 | 兴业银行股份有限公司 |

§ 3 主要财务指标和本计划业绩及风险

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） |
|------------|---------------------------|
| 1. 本期已实现收益 | 586,058.88 |
| 2. 本期利润 | 610,443.60 |
| 3. 期末资产净值 | 39,445,378.38 |
| 4. 期末单位净值 | 1.0315 |

3.2 本报告期份额净值增长率

| 阶段 | 净值增长率 | 净值增长率标准差 |
|--------------------------|-------|----------|
| 2023年7月1日 -2023年9月30日 | 1.57% | 0.02% |

§ 4 投资组合报告

4.1 报告期末资产组合情况

| 项目 | 估值金额（元） | 占信托总资产比例（%） |
|----|---------|-------------|
|----|---------|-------------|

| | | |
|--------------|---------------|--------|
| 股票 | - | - |
| 债券 | 38,878,507.11 | 98.19 |
| 证券投资基金 | - | - |
| 权证 | - | - |
| 资产支持证券 | - | - |
| 买入返售金融资产 | - | - |
| 资产管理计划 | - | - |
| 银行存款和清算备付金合计 | 33,690.77 | 0.09 |
| 其他资产 | 684,500.53 | 1.73 |
| 合计 | 39,596,698.41 | 100.00 |

4.2 报告期末按公允价值占本计划资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

注：无。

4.3 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 估值金额（元） | 占信托资产净值比例（%） |
|----|-----------|---------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | - | - |
| | 其中：政策性金融债 | - | - |
| 4 | 地方政府债 | - | - |
| 5 | 企业债券 | 38,878,507.11 | 98.56 |
| 6 | 企业短期融资券 | - | - |
| 7 | 中期票据 | - | - |
| 8 | 可转债（可交换债） | - | - |
| 9 | 同业存单 | - | - |
| 10 | 其他 | - | - |
| 11 | 合计 | 38,878,507.11 | 98.56 |

4.4 报告期末按公允价值占本计划资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量(张) | 估值金额(元) | 占信托计划资产净值比例(%) |
|----|--------|----------|--------|--------------|----------------|
| 1 | 114023 | 22 津保 D5 | 90,000 | 9,467,442.74 | 24.00 |
| 2 | 114287 | 22 津保 D6 | 90,000 | 9,433,796.30 | 23.92 |
| 3 | 250120 | 23 津保 01 | 90,000 | 9,320,423.42 | 23.63 |
| 4 | 250446 | 23 滨海 D5 | 90,000 | 9,281,633.42 | 23.53 |
| 5 | 115189 | 23 津投 07 | 13,000 | 1,375,211.23 | 3.49 |

4.5 报告期末按公允价值占本计划资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

注：无。

4.6 报告期末按公允价值占本计划资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

注：无。

4.7 报告期末按公允价值占本计划资产净值比例大小排名的前十名基金投资明细

注：无。

4.8 投资组合报告附注

4.8.1 其他资产构成（含其他流动性资产）

| 序号 | 名称 | 估值金额（元） |
|-----|----------|------------|
| 1 | 存出保证金 | 299,583.59 |
| 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 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | 384,916.94 |
| 8-1 | -资产管理计划 | - |
| 8-2 | -信托业保障基金 | 384,916.94 |
| 8-3 | -货币基金 | - |
| 8-4 | -其他 | - |
| | 合计 | 684,500.53 |

4.8.2 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：无。

4.8.3 投资组合报告附注的其他文字描述

估值金额为依据信托合同约定的估值方法计算的金额；

由于四舍五入的原因，各比例分项之和与合计可能有尾差。

§ 5 资产负债情况

5.1 资产负债表

报告截止日期：2023 年 9 月 30 日

单位：人民币元

| 资 产 | 期 末 余 额 | 负债和所有者权益 | 期 末 余 额 |
|----------|---------------|-----------|---------------|
| 银行存款 | 33,690.77 | 短期借款 | - |
| 结算备付金 | - | 交易性金融负债 | - |
| 存出保证金 | 299,583.59 | 衍生金融负债 | - |
| 交易性金融资产 | 38,878,507.11 | 卖出回购金融资产款 | - |
| 其中：股票投资 | - | 应付清算款 | - |
| 基金投资 | - | 应付赎回款 | - |
| 债券投资 | 38,878,507.11 | 应付管理人报酬 | 48,684.27 |
| 资产支持证券投资 | - | 应付托管费 | 1,947.37 |
| 贵金属投资 | - | 应付销售服务费 | 77,895.09 |
| 其他投资 | - | 应付投资顾问费 | - |
| 衍生金融资产 | - | 应交税费 | 22,793.30 |
| 买入返售金融资产 | - | 应付利润 | - |
| 债权投资 | - | 递延所得税负债 | - |
| 其中：债券投资 | - | 其他负债 | - |
| 资产支持证券投资 | - | 负债合计 | 151,320.03 |
| 其他投资 | - | 所有者权益： | |
| 其他债权投资 | - | 实收信托 | 38,240,000.00 |
| 其他权益工具投资 | - | 其他综合收益 | - |
| 应收清算款 | - | 未分配利润 | 1,205,378.38 |
| 应收股利 | - | 所有者权益合计 | 39,445,378.38 |
| 应收申购款 | - | 负债和所有者权益总 | |
| 递延所得税资产 | - | 计： | 39,596,698.41 |
| 其他资产 | 384,916.94 | | |
| 资产合计： | 39,596,698.41 | | |

§ 6 运用杠杆情况

2023年09月30日，本资产管理计划未运用杠杆。本报告期内，本资产管理计划未出现杠杆比例超过200%的情况。

注：杠杆比例计算公式： $(\text{资产净值} + \text{卖出返售金融资产}) / \text{资产净值}$

§ 7 费用报告

7.1 报告期资产管理计划支付的费用

| 项目 | 费用金额 | 计提基准 | 计提方式 |
|------|------|-------------|--------------------------------|
| 管理费 | - | 前一日信托计划财产净值 | 自信托计划成立日起，每日按前一日信托计划财产净值的年费率计提 |
| 托管费 | - | 前一日信托计划财产净值 | 自信托计划成立日起，每日按前一日信托计划财产净值的年费率计提 |
| 业绩报酬 | - | 前一日信托计划财产净值 | 自信托计划成立日起，每日按前一日信托计划财产净值的年费率计提 |

7.2 报告期信托计划业绩报酬计提

报告期末信托计划收益平滑准备金余额为0元；
报告期间信托计划未计提业绩报酬。

§ 8 收益分配情况

8.1 报告期投资收益分配情况

注：无。

§ 9 重大关联交易情况

9.1 重大关联交易情况

注：无。

§ 10 受托人履职报告

10.1 投资经理（或投资经理小组成员）情况

| 姓名 | 职务 | 任本信托计划的投资经理期限 | | 证券从业 | 说明 |
|----|----|---------------|------|------|----|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |

| | | | | 年限 | |
|-----|------|------------|---|-----|---|
| 张文泉 | 投资经理 | 2023-03-22 | - | 15年 | 经济学硕士，首都经济贸易大学硕士研究生导师。历任国泓资产管理有限公司总经理助理；益民基金管理有限公司专户投资部负责人兼投资经理；益民基金管理有限公司公募债券基金经理、货币基金经理；重庆国际信托股份有限公司固定收益投资部总经理；国都证券股份有限公司固定收益部总经理；中国民族证券有限责任公司债券部业务总监。从事银行间及交易所市场债券投资、交易和承销工作将近15年，债券投资和交易经验丰富。现任重庆国际信托股份有限公司资产管理总部副总裁。 |
| 陈铭哲 | 投资经理 | 2023-03-22 | - | 4年 | 对外经贸大学经济学硕士，历任首钢集团境外投资管理经理；联合资信评估股份有限公司信用评级分析师、高级分析师。从事企业资本运作、信用评级工作超过7年。现任重庆国际信托股份有限公司资产管理总部信托经理。 |

10.2 报告期内本计划投资策略和业绩表现的说明与解释

2023年三季度，经济数据呈边际好转态势。具体来看，8月工业增加值同比回到4.5%；工业企业盈利当月同比增长17.2%，增速较上月大幅提升；社零同比回到4.6%；环比0.31%，高于前值的-0.02%；固定资产投资隐含的单月同比为2.0%，高于前值的1.2%。9月份制造业PMI50.2%，前值49.7%，重回荣枯线上。三季度GDP同比增速为4.9%，高于市场预期的4.5%。

利率市场方面，三季度在化债、地产和资本市场政策驱动下及经济数据验证下，利率呈现震荡行情，全季短端利率上行幅度较为明显。四季度上述政策预计持续发力，机构短期扰动行为增多。当前十年国债收益率已经进入2.65%-2.75%目标区域，特殊再融资债发行市场已有充分预期，继续调整的空间有限。四季度仍有降准、降息可能，三季度GDP超预期下，超预期刺激政策出台概率有所下降，根据货币政策执行情况和经济数据再进行久期选择。

信用市场方面，三季度以来，在配置需求推动下信用债延续下行趋势，尤其是城投债化债背景下收益率快速下行。但地方财政吃紧、城投企业资金紧绷的状态能否得到缓解仍需观察，城投债结构分化仍将延续。

展望四季度，预计经济将延续弱复苏，大幅反弹的可能性较低，货币政策预计短期仍保持宽松；债券收益率大幅上行的风险较低。化债大背景下城投行情较优，规避短期内债券收益率下降过快的主体区域和部分弱资质主体，同时关注债券估值风险。

§ 11 重大事项报告

注：无。

§ 12 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。



免责声明

本报告并非宣传推介材料，所载内容仅供受益人参考。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。受托人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用信托财产，但不保证信托财产一定盈利，也不保证最低收益。本信托计划的过往业绩及净值高低并不预示其未来业绩表现，受托人管理的其他信托计划的业绩也不构成本信托计划业绩表现的保证。本信托计划的具体情况以信托文件为准，请仔细阅读。

005 出 2

