
国信睿丰债券型集合资产管理计划

2024年第2季度报告

2024年06月30日

基金管理人:国信证券股份有限公司

基金托管人:中国工商银行股份有限公司

报告送出日期:2024年07月19日

§1 重要提示

集合计划管理人的董事会及董事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。

集合计划托管人中国银行股份有限公司根据本集合计划合同规定，于2024年07月19日复核了本报告中的主要财务指标、净值表现和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。

集合计划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。集合计划的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本集合计划的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2024年04月01日起至2024年06月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	国信睿丰债券
基金主代码	938666
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022年12月23日
报告期末基金份额总额	262,853,985.85份
投资目标	在保持集合计划资产流动性和严格控制集合计划资产风险的前提下，通过积极主动的投资管理，力争获取超越业绩比较基准的投资回报，追求集合计划资产的长期稳健增值。
投资策略	本集合计划主要投资策略包括资产配置策略、久期控制策略、期限结构配置策略、基于信用利差曲线策略、基于信用债信用分析策略、国债期货投资策略、股票投资策略、存托凭证投资策略。未来，随着证券市场投资工具的发展和丰富，集合计划可在履行适当程序后，相应调整和更新相关投资策略。
业绩比较基准	中债新综合财富指数收益率*90%+沪深300指数收益率*10%
风险收益特征	本集合计划为债券型集合资产管理计划，其预期收益和预期风险通常高于货币市场基金，低于混合型基金、混合型集合资产管理计划、股票型基金、股票型集合资产管理计划。

基金管理人	国信证券股份有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	国信睿丰债券A	国信睿丰债券C
下属分级基金的交易代码	938666	970207
报告期末下属分级基金的份额总额	219,929,256.01份	42,924,729.84份

注：本报告中所述的“基金”包括按照《证券公司大集合资产管理业务适用<关于规范金融机构资产管理业务的指导意见>操作指引》的要求进行变更后的证券公司大集合资产管理产品。

§3 主要财务指标和基金净值表现

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04月01日 - 2024年06月30日)	
	国信睿丰债券A	国信睿丰债券C
1.本期已实现收益	2,847,760.17	448,444.39
2.本期利润	2,376,936.86	289,728.34
3.加权平均基金份额本期利润	0.0110	0.0077
4.期末基金资产净值	236,048,174.22	45,827,412.01
5.期末基金份额净值	1.0733	1.0676

注：（1）本集合计划合同于2022年12月23日生效，截至本报告期末本集合计划运作已满一年。（2）本期已实现收益指集合计划本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。（3）所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

国信睿丰债券A净值表现

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.06%	0.07%	1.36%	0.08%	-0.30%	-0.01%

过去六个月	1.71%	0.07%	3.51%	0.09%	-1.80%	-0.02%
过去一年	4.26%	0.08%	4.31%	0.09%	-0.05%	-0.01%
自基金合同生效起至今	7.33%	0.07%	7.00%	0.09%	0.33%	-0.02%

国信睿丰债券C净值表现

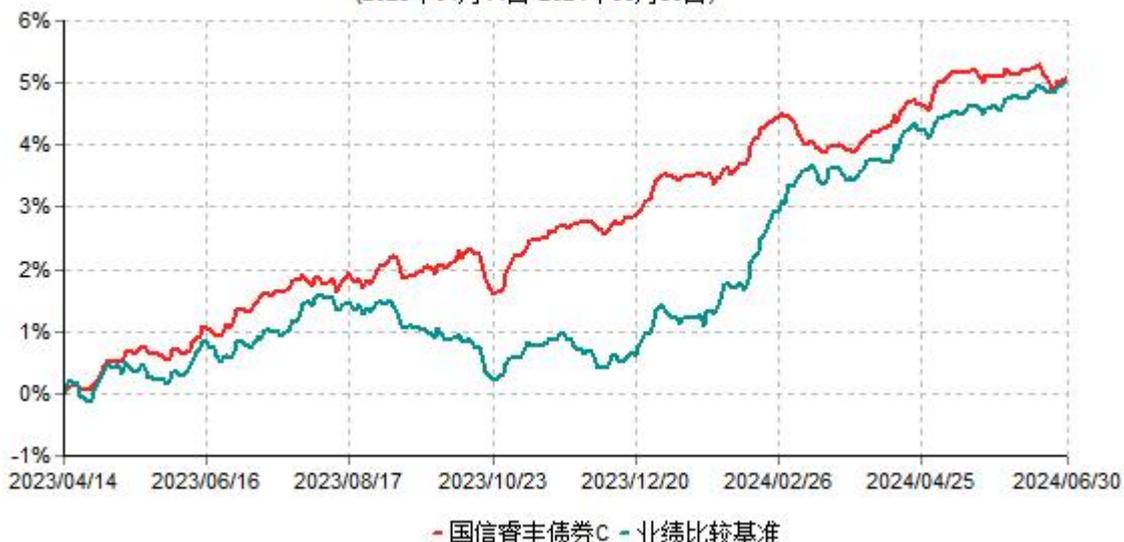
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.96%	0.07%	1.36%	0.08%	-0.40%	-0.01%
过去六个月	1.48%	0.07%	3.51%	0.09%	-2.03%	-0.02%
过去一年	3.82%	0.08%	4.31%	0.09%	-0.49%	-0.01%
自基金合同生效起至今	5.07%	0.07%	5.01%	0.09%	0.06%	-0.02%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

国信睿丰债券A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2022年12月23日-2024年06月30日)



国信睿丰债券C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2023年04月14日-2024年06月30日)



- 注：1. 本集合计划变更后合同生效日为2022年12月23日，截至本报告期末本集合计划运作已满一年；
2. 按集合计划合同和招募说明书的约定，本集合计划建仓期为合同生效后6个月，报告期末已完成建仓，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同有关规定；
3. 本计划C类份额的净值增长率和业绩比较基准收益率从2023年4月14日C类有份额之日开始计算。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
梁策	投资经理	2022-12-23	-	12	梁策，中国国籍，管理学硕士，经济师，具有基金从业资格、证券从业资格，4年证券研究经验、8年证券投资经验。2011年加入国信证券资产管理总部，历任资产管理总部投资助理、投资经理，现任国信证券资产管理总部投资经理。无其他兼职情况。最近三年未曾被监管机构采取重大行政监管措

					施、行政处罚。
凌铃	投资经理	2023-12-20	-	8	凌铃，中国国籍，武汉大学应用数学学士，中央财经大学金融学硕士，具有基金从业资格、证券从业资格，8年以上证券从业经验。曾任安信证券固定收益部策略研究员、投资经理，重庆农商行总行资金运营部债券及衍生品交易岗。现任国信证券资产管理总部投资经理。无其他兼职情况。最近三年未曾被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚。
张浩冉	投资经理	2024-04-02	-	6	张浩冉，中国国籍，法国马赛大学化学工程与工艺学士，法国洛林大学化学工程与工艺硕士。2年实业咨询工作经验，5年以上证券从业经验。曾供职于华为技术有限公司、德勤管理咨询（深圳）有限公司，曾任国信证券资产管理总部大周期行业研究员、投资经理助理。现任国信证券资产管理总部投资经理，无其他兼职情况。已取得证券从业资格、基金从业资格。最近三年未曾被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚。

注：(1)集合计划的首任投资经理，其“任职日期”为基金合同生效日，其“离职日期”为根据公司决议确定的解聘日期；(2)非首任投资经理，其“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决议确定的聘任日期和解聘日期；(3)证券从业的含义遵从行业协会的相关规定。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期末，本集合计划不存在基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

在本报告期内，管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关法律法规及其各项实施准则的规定以及本集合计划的合同等法律文件的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用集合计划资产，在严格控制风险的前提下，为集合计划持有人谋求最大利益。本报告期内，集合计划运作整体合法合规，没有发现损害持有人利益的行为。集合计划的投资范围以及投资运作符合有关法律法规及本集合计划合同的规定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《国信证券股份有限公司资产管理业务公平交易管理制度（修订）》，内容主要包括公平交易的适用范围、公平交易的原则和内容、公平交易的实现措施和交易执行程序、反向交易控制、公平交易效果评估及报告等。公平交易制度所规范的范围涵盖旗下各类资产组合，围绕境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易（含银行间市场）等投资管理活动，贯穿投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等各个环节。公平交易的原则包括：集中交易原则、机制公平原则、公平协调原则、及时评估反馈原则。

公平交易的实现措施和执行程序主要包括：通过建立规范的投资决策机制、共享研究资源和投资品种备选库为投资人员提供公平的投资机会；投资人员应公平对待其管理的不同投资组合，原则上应当做到“同时同价”，合理控制其所管理不同组合对同一证券的同向交易价差；建立集中交易制度，交易系统具备公平交易功能，对于满足公平交易执行条件的同向指令，系统将自动启用公平交易功能，按照交易公平的原则合理分配各投资指令的执行；严格控制不同投资组合之间的同日反向交易；根据交易所场内竞价交易和非公开竞价交易的不同特点分别设定合理的交易执行程序和分配机制，通过系统与人工控制相结合的方式，力求确保所有投资组合在交易机会上得到公平、合理对待；建立事中和事后的同反向交易、异常交易监控分析机制，对于发现的异常问题进行提示，并要求投资组合经理解释说明。

公司严格按照法律法规的要求禁止旗下管理的不同投资组合之间各种可能导致不公平交易和利益输送的反向交易行为。对于旗下投资组合之间（纯被动指数组合和量化投资组合除外）确因投资策略或流动性管理等需要而进行的反向交易，投资人员须提供充分的投资决策依据，并经审核确认方可执行。公司通过定期或不定期的公平交易效果评估报告机制，并借助相关技术系统，使投资和交易人员能及时了解各组合的公平交易执行状况，持续督促公平交易制度的落实执行，并不断在实践中检验和完善公平交易制度。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

管理人通过建立完善的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，保证公平交易原则的实现。在投资决策的内部控制方面，管理人建立了投资证券库，投资组合的投资标的来源于证券库。管理人建立了明确的投资决策流程与授权管理制度，投资经理在授权范围内独立、客观地履行职责，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。管理人建立投资研究沟通机制，通过日常的投资研究各种例会和讨论会，保证各投资组合在获得投资信息、投资建议和实施投资决策等方面享有公平的机会。在交易过程中，管理人以公平交易为原则，保证各投资组合的交易得到公平、及时、准确地执行。

管理人通过统计检验的方法对管理的不同投资组合，在不同时间窗下（1日内、3日内、5日内）的本报告期内同向交易价差进行了专项分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

本报告期内，公司所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，未发生同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易。

本报告期内，上述公平交易制度和控制方法总体执行情况良好，未发现旗下投资组合之间存在不公平交易现象。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

二季度债券市场缺乏明显的交易逻辑，利率整体处在箱体震荡，但收益率曲线上中短端和长端及超长端利率走势出现一定分化，曲线形态出现明显修复。具体来看，进入2024年4月份后，市场一方面继续受政府债供给压力担忧的影响，导致长端和超长端交易情绪偏弱，另一方面又受资金面转松刺激开始交易中短端资产，曲线开始往陡峭化修复。随着基本面数据公布以及政府债发行计划公布，市场开始交易利空落地，长端和超长端利率开始跟随下行。但在4月下旬央行开始提示长端利率风险以及出台新一轮地产政策后，长端及超长端利率出现一轮较大幅度调整。进入2024年5月后，债市进入窄幅震荡状态，基本面、政策面、资金面甚至消息面都缺乏足以影响债市逻辑的因素。但监管禁止“手工补息”后，非银机构资金面显著宽松，中短端资产受到追捧。5月底央行再次提示长端利率风险，市场出现小幅调整。进入2024年6月后，市场开始交易降息预期，各期限利率稳步下行，央行行长关于货币政策框架演进的讲话让市场长期以来对长端利率的定价模式和参考基准发生变化，进一步推动长端利率下行。

权益市场方面，二季度股市走出了“八”型走势，在地产政策带动下，地产及其相关行业标的出现快速上涨行情，同时也带动市场情绪明显好转，进一步带动宽基指数的修复。但随后在退市风险及其他负面消息影响下，市场情绪逐渐冷清，出现持续下跌。转债方面，与权益市场类似，转债市场在二季度也是先涨后跌，在地产政策刺激及固收+产品配置发力带动下，转债市场在4月和5月延续了一季度的上涨行情，但随后在正股退市风险和转债信用风险的影响下，转债市场也出现一轮快速下跌行情。

操作方面，权益资产方面，本产品在二季度适度提升了权益仓位，但整体仍控制在较低水平。转债方面，根据对市场的研判，本产品在二季度对转债仓位进行了较为灵活的调整。债券资产方面，本产品在二季度特别是5月份以后操作更加积极，一方面通过加仓长久期利率债显著提升了组合久期，另一方面通过增配配置性底仓信用债适度提升了杠杆水平，组合期限结构呈现哑铃型。

展望三季度，债券市场仍将处在有利环境中。基本面延续稳中向好态势，二季度各项基本面数据未超市场预期，预计三季度整体修复程度仍在市场预期范围内，对债券市场利空有限。货币政策方面，货币政策框架在发生变化，市场还需要进一步研究和适应央行新的货币政策体系和逻辑，但流动性稳健宽松的局面不会改变，对债券市场的支撑作用仍将延续下去，另外市场对降准和降息在三季度落地仍持有较为一致的预期。当然，债市在三季度也存在一些不确定性因素，一是财政政策发力和政府债供给压力始终是悬在债市头上的一把剑，而在三季度兑现的概率在不断上升，届时对债市情绪或会有较大影响。二是当前各期限各品种债券的收益率都处在较低水平，各类投资策略也都被充分运用，虽然短期内从逻辑和情绪上都难出现大幅波动，但也需随时保持谨慎，担心物极必反。权益方面，随着各项宏观政策的稳步推进，经济高质量发展效果逐渐呈现，部分行业和企业可能迎来周期性好转，同时，近期出台的多项资本市场监管政策也有利于行业出清。

操作展望上，股票方面，本产品仍将坚持以价值投资为导向，坚持稳健的策略定位，在大类资产配置策略下灵活调整权益仓位。债市方面，预计债市仍处在震荡偏强走势，但操作空间愈发狭窄、操作难度增加，债券组合中要做好交易类资产的仓位和久期管理，提高操作灵活度，积极应对市场变化。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末国信睿丰债券A基金份额净值为1.0733元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为1.06%，同期业绩比较基准收益率为1.36%；截至报告期末国信睿丰债券C基金份额净值为1.0676元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.96%，同期业绩比较基准收益率为1.36%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内，本集合计划未出现连续二十个工作日集合计划份额持有人数量不满二百人或集合计划资产净值低于五千万元的情形。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
----	----	-------	------------------

1	权益投资	23,482,824.39	7.20
	其中：股票	23,482,824.39	7.20
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	299,841,302.99	91.88
	其中：债券	299,841,302.99	91.88
	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	-	-
	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	1,628,508.36	0.50
8	其他资产	1,371,208.99	0.42
9	合计	326,323,844.73	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	1,838,758.00	0.65
C	制造业	17,610,443.39	6.25
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,031,888.00	0.37
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	1,440,335.00	0.51
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	1,561,400.00	0.55
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-

N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	23,482,824.39	8.33

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601939	建设银行	211,000	1,561,400.00	0.55
2	601233	桐昆股份	67,800	1,082,088.00	0.38
3	601985	中国核电	96,800	1,031,888.00	0.37
4	000725	京东方A	245,300	1,003,277.00	0.36
5	601088	中国神华	22,400	993,888.00	0.35
6	300037	新宙邦	32,500	928,200.00	0.33
7	000963	华东医药	31,700	881,577.00	0.31
8	600256	广汇能源	126,100	844,870.00	0.30
9	000400	许继电气	23,700	815,517.00	0.29
10	002648	卫星化学	41,000	737,180.00	0.26

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	10,182,991.76	3.61
2	央行票据	-	-
3	金融债券	125,662,061.16	44.58
	其中：政策性金融债	30,946,336.06	10.98
4	企业债券	94,538,050.43	33.54
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	41,677,778.69	14.79

7	可转债（可交换债）	13,038,301.94	4.63
8	同业存单	14,742,119.01	5.23
9	其他	-	-
10	合计	299,841,302.99	106.37

5.5 报告期末按公允价值占基金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)	占基金资产净值比例（%）
1	230211	23国开11	200,000	20,319,770.49	7.21
2	2120089	21北京银行永续债01	150,000	16,186,893.44	5.74
3	2121038	21重庆农商永续债	150,000	16,069,196.72	5.70
4	112408171	24中信银行CD171	150,000	14,742,119.01	5.23
5	115607	23安租Y3	100,000	10,695,849.32	3.79

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细
本集合计划本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细
本集合计划本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本集合计划本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
本集合计划本报告期末未持有股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
本集合计划本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本集合计划投资的前十名证券的发行主体中，北京银行股份有限公司、重庆农村商业银行股份有限公司、中信银行股份有限公司、浙商银行股份有限公司、中国农业银行股份有限公司、招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到监管部门的处罚，处罚力度和性质对该公司长期经营未产生重大负面影响。本集合计划对上述主体发

行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及合同的要求。除上述主体外，本集合计划投资的其他前十名证券的发行主体本期没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

5.11.2 集合计划投资的前十名股票未超出集合计划合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	12,355.23
2	应收证券清算款	531,036.29
3	应收股利	-
4	应收利息	375,000.00
5	应收申购款	452,817.47
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	1,371,208.99

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
1	110079	杭银转债	3,019,226.03	1.07
2	113055	成银转债	1,889,102.05	0.67
3	127056	中特转债	1,312,076.22	0.47
4	113050	南银转债	1,254,126.03	0.44
5	110073	国投转债	1,082,395.89	0.38
6	128136	立讯转债	913,586.41	0.32
7	113049	长汽转债	894,448.22	0.32
8	113043	财通转债	889,249.32	0.32
9	113052	兴业转债	865,756.71	0.31
10	113616	韦尔转债	673,621.64	0.24
11	113062	常银转债	244,713.42	0.09

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本集合计划本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和和合计可能有尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

	国信睿丰债券A	国信睿丰债券C
报告期期初基金份额总额	232,519,143.27	29,417,723.74
报告期期间基金总申购份额	45,412,458.05	19,168,744.44
减：报告期期间基金总赎回份额	58,002,345.31	5,661,738.34
报告期期间基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列)	-	-
报告期期末基金份额总额	219,929,256.01	42,924,729.84

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

单位：份

	国信睿丰债券A	国信睿丰债券C
报告期期初管理人持有的本基金份额	12,357,825.63	-
报告期期间买入/申购总份额	-	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	12,357,825.63	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	5.62	-

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20240401-20240630	71,313,777.66	-	-	71,313,777.66	27.13%
产品特有风险							
本集合计划于本报告期内出现单一投资者持有集合计划份额比例达到或者超过20%的情形，本集合计划管理人已经采取措施，审慎确认大额申购与大额赎回，防控产品流动性风险并公平对待投资者。本集合计划管理人提请投资者注意因单一投资者							

持有集合计划份额集中导致的产品流动性风险、大额赎回风险以及净值波动风险等特有风险。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

- 1、国信睿丰债券型集合资产管理计划基金经理变更公告
- 2、关于国信证券股份有限公司管理的资产管理计划拟变更管理人的提示性公告
- 3、国信证券股份有限公司关于旗下部分集合资产管理计划继续开展申购费率优惠活动的公告

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会关于准予国信“金理财”债券1号集合资产管理计划合同变更的回函；
- 2、《国信睿丰债券型集合资产管理计划资产管理合同》及其更新文件（如有）；
- 3、《国信睿丰债券型集合资产管理计划托管协议》及其更新文件（如有）；
- 4、《国信睿丰债券型集合资产管理计划招募说明书》及其更新文件；
- 5、国信睿丰债券型集合资产管理计划（A类份额）产品资料概要及其更新文件；
- 6、国信睿丰债券型集合资产管理计划（C类份额）产品资料概要及其更新文件；
- 7、关于申请《国信“金理财”债券1号集合资产管理合同》变更的法律意见；
- 8、集合计划管理人业务资格批件、营业执照；
- 9、集合计划托管人业务资格批件、营业执照；
- 10、国信睿丰债券型集合资产管理计划报告期内披露的各项公告；
- 11、中国证监会要求的其他文件。

9.2 存放地点

备查文件存放于集合计划管理人和托管人的办公场所，并登载于集合计划管理人网站www.guosen.com.cn。

9.3 查阅方式

投资者可于本集合计划管理人、托管人办公时间预约查阅，或登录集合计划管理人网站www.guosen.com.cn查阅，还可拨打本公司客服电话（95536）查询相关信息。

国信证券股份有限公司
2024年07月19日