

财通证券资产管理有限公司 财通资管财臻1号集合资产管理计划 季度资产管理报告

(2020年一季度)

计划管理人：财通证券资产管理有限公司

计划托管人：中国工商银行股份有限公司-浙江省分行

报告期间：2020年01月01日-2020年03月31日

重要提示

本报告由集合资产管理计划管理人财通证券资产管理有限公司依据《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》（以下简称《管理办法》）、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》（以下简称《运作管理规定》）及其他有关规定制作。

财通资管财臻1号集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”或“集合计划”）于2015年02月10日成立，并向中国证券投资基金业协会及中国证监会浙江监管局备案，但中国证券投资基金业协会及中国证监会浙江监管局对本集合计划做出的任何决定，均不表明其对本集合计划的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明客户参与本集合计划没有风险。

托管人已对本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报表、投资组合报告等数据进行了复核。本报告未经审计。

管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用本集合计划资产，但不保证本集合计划一定盈利，也不保证最低收益。

管理人保证本报告书中所载资料的真实性、准确性和完整性，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担责任。

本报告涉及《财通资管财臻1号集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称《管理合同》）及《财通资管财臻1号集合资产管理计划说明书》（以下简称《说明书》）的相关内容若与《管理合同》及《说明书》中的相关内容不一致，以最新的《管理合同》及《说明书》为准。

本报告书中的内容由管理人负责解释。

本报告期起止时间：2020年01月01日-2020年03月31日

一、集合计划简介

（一）基本资料

名称：财通资管财臻1号集合资产管理计划

类型：集合资产管理计划

成立日：2015年02月10日

成立份额：49,200,376.24

存续期：10年

管理人：财通证券资产管理有限公司

托管人：中国工商银行股份有限公司-浙江省分行

注册登记机构：财通证券资产管理有限公司

（二）计划管理人

名称：财通证券资产管理有限公司

注册地址：浙江省杭州市上城区白云路26号143室

办公地址：浙江省杭州市上城区四宜路22号四宜大院B座

法定代表人：马晓立

公司网址：www.ctzg.com

（三）计划托管人

名称：中国工商银行股份有限公司-浙江省分行

注册地址：浙江省杭州市中河中路150号

法定代表人或负责人：戴春林

二、主要财务指标、投资表现和收益分配情况

(一) 主要财务指标及投资表现

单位：元

	主要财务指标及投资表现	2020 年 03 月 31 日
1	期末单位集合计划资产净值	1.1042
2	期末单位集合计划累计资产净值	2.3984
3	期末集合计划资产净值	37,097,658.17
4	本期集合计划利润	511,287.30
5	期末集合计划未分配利润	3,501,255.11
6	单位期末集合计划未分配利润	0.1042
7	本期集合计划净值增长率%	3.74%
8	集合计划累计净值增长率%	166.58%

(二) 收益分配情况

本报告期间不存在收益分配情况。

三、管理人履职报告

(一) 投资主办简介

陈李先生，同济大学工学硕士。曾就职于上汽集团市场部，3年后从实业转为研究员，主攻汽车、电力设备、新能源、高端装置，2015年6月起担任财通证券资管投资经理。

(二) 投资主办工作报告

一季度回顾及展望

今年开始至一季度末，市场经历了大幅波动，尤其是科技类板块调

整幅度较深，春节以后，受疫情的发展及全世界蔓延的影响，各行业板块差异化更加显现，全球产业链的行业尤为明显。3 月的海外风暴虽然起始于新冠疫情，但是已经演化成对未来长期经济衰退和去杠杆的担忧，例如高盛预测二季度美国经济环比下滑 24%。但是，我们也开始看到一些积极因素开始出现。疫情方面，西班牙、意大利的新增出现一定缓和迹象，从中国、韩国等国的经验来看，采取严控措施后到疫情出现拐点一般要 2-3 周的时间间隔，因此各国出现拐点的时间不同，但随着时间的推移，积极消息会越来越多。经济方面，各国央行均极力宽松，G20 上全球达成 5 万亿美元刺激的共识，疫情缓和后会对经济起到一定支撑作用。

本产品 in 行业配置方面只要采取自上而下及个股深入研究及跟踪的策略，根据当下宏观环境、行业景气度未来产业政策刺激等因素考虑，主要配置在“老基建”、“新基建”、医疗器械服务、消费、高端制造等领域，未来将跟踪各行业的复苏预期，政策刺激、总体估值等情况做相应的比例调整。

展望后三季度，与全球相比，国内情况明显更好，一方面国内疫情现在基本是输入性病例；另一方面海外货币政策空间已经十分有限，例如美国长端利率已经处于极低水平，不具备实行大规模 QE 的条件，但国内长端利率水平仍然相对较高，还有较大的宽松空间。短期来看，“M2-名义 GDP 增速”所表征的剩余流动性仍然为正，尤其是二季度 GDP 增速可能要低于当前市场的一致预期，未来经济下行叠加政策宽松的组合会长期存在，即剩余流动性有望持续回升，历史上只要剩余流动性为正，一般权益市场在当前估值水平都具有不错的机会。中期来看，

从全球配置的视角，考虑到国内疫情情况、经济增长情况、以及中外利差的扩大，人民币资产成为全球新晋避险资产的可能性越来越大，外资流入会成为A股长期的增量资金。本报告适用于本人名下管理的所有集合及定向产品

（三）内部性声明

1. 运作合规性声明

本报告期内，集合计划管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《管理办法》、《运作管理规定》及其他法律法规的规定，本着诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用本集合计划资产，在严格控制风险的基础上，为集合计划持有人谋求最大利益。本报告期内，本集合计划运作合法合规，无损害集合计划持有人利益的行为，本集合计划的投资管理符合有关法规的规定。

2. 风险控制报告

本报告期内，集合计划管理人通过设立独立的风险控制部门，对集合理财业务进行事前审核、事中监控，日常对集合资产管理业务的重大事项进行风险评估，并提出风险控制措施。风险管理部还对业务授权、投资交易的执行情况进行监控，控制业务运作过程中存在的风险。本次风险控制报告综合了集合计划管理人全面自查和风险管理部日常监控、重点检查的结果。

我们认为，在本报告期内，本集合计划管理人对集合计划的管理始终都能按照有关法律法规、公司相关制度和《管理合同》及《说明书》的要求进行。本集合计划的投资决策、投资交易程序、投资权限等各方面均符合规定的要求；交易行为合法合规，未出现异常交易、操纵市场

的现象；未发现内幕交易的情况；本集合计划持有的证券符合规定的比例要求；相关的信息披露和财务数据皆真实、完整、准确、及时。

3. 涉及本计划的重大诉讼事项

本报告期内，无涉及本计划的重大诉讼事项。

四、托管人履职报告

本报告期内，本托管人在对财通资管财臻1号集合资产管理计划的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和资产管理合同的有关规定，不存在任何损害资产管理计划份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了托管人应尽的义务。

本报告期内，托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、资产管理合同和托管协议的规定，对本资产管理计划管理人的投资运作进行了必要的监督，对资产净值的计算、份额参与与退出价格计算、以及费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本计划管理人存在损害份额持有人利益的行为。

本报告期内，本托管人依法对财通证券资产管理有限公司编制的财通资管财臻1号集合资产管理计划2020年一季度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

五、财务会计报告

(一) 资产负债表

日期：2020年03月31日

单位：元

资产	期末余额	负债与持有人权益	期末余额
资产：		负债：	
银行存款	153,080.82	短期借款	0.00
结算备付金	872,189.90	交易性金融负债	0.00
存出保证金	25,559.19	衍生金融负债	0.00
交易性金融资产	32,696,103.98	卖出回购金融资产款	0.00
其中：股票投资	29,209,213.10	应付证券清算款	738,532.79
债券投资	3,486,890.88	应付赎回款	0.00
基金投资	0.00	应付管理人报酬	45,254.97
权证投资	0.00	应付托管费	18,102.00
资产支持证券投资	0.00	应付销售服务费	0.00
衍生金融工具	0.00	应付交易费用	21,511.98
买入返售金融资产	3,400,034.00	应交税费	160.01
应收证券清算款	765,054.13	应付利息	0.00
应收利息	9,187.16	应付利润	0.00
应收股利	0.00	其他负债	9,989.26
应收申购款	10,000.00	负债合计	833,551.01
其他资产	0.00		
		所有者权益：	
		实收基金	33,596,403.06
		未分配利润	3,501,255.11
		所有者权益合计	37,097,658.17
资产合计	37,931,209.18	负债和所有者权益总计	37,931,209.18

(二) 损益表

日期：2020年01月01日-2020年03月31日

单位：元

项目	本期数	本年累计数
一、收入	697,243.48	697,243.48
1、利息收入	31,659.11	31,659.11
其中：存款利息收入	7,887.41	7,887.41
债券利息收入	3,259.31	3,259.31
资产支持证券利息收入	0.00	0.00

买入返售证券收入	21,226.10	21,226.10
增值税利息收入抵减	-713.71	-713.71
2、投资收益	2,802,952.84	2,802,952.84
其中：股票投资收益	3,513,811.38	3,513,811.38
债券投资收益	-569,851.72	-569,851.72
基金投资收益	0.00	0.00
权证投资收益	0.00	0.00
资产支持证券投资收益	0.00	0.00
衍生工具收益	0.00	0.00
股利收益	0.00	0.00
增值税投资收益抵减	-141,006.82	-141,006.82
3、公允价值变动收益	-2,137,368.47	-2,137,368.47
4、其他收入	0.00	0.00
二、费用	185,956.18	185,956.18
1、管理人报酬	45,254.97	45,254.97
2、托管费	18,102.00	18,102.00
3、销售服务费	0.00	0.00
4、交易费用	105,592.22	105,592.22
5、利息支出	0.00	0.00
其中：卖出回购金融资产支出	0.00	0.00
6、其他费用	17,006.99	17,006.99
三、利润总和	511,287.30	511,287.30

六、投资组合报告

（一）资产组合情况

日期：2020 年 03 月 31 日

单位：元

项目	期末市值	占期末总资产比例
银行存款	153,080.82	0.40%
清算备付金	872,189.90	2.30%
存出保证金	25,559.19	0.07%

股票投资	29,209,213.10	77.01%
债券投资	3,486,890.88	9.19%
资产支持证券投资	0	0
基金投资	0	0
理财产品投资	0	0
买入返售金融资产	3,400,034.00	8.96%
应收股利	0	0
应收利息	9,187.16	0.02%
应收申购款	10,000.00	0.03%
其他应收款	0	0
证券清算款	765,054.13	2.02%
资产合计	37,931,209.18	100%

注：由于四舍五入的原因，期末市值占期末总资产比例的分项之和与合计可能有尾差。

（二）报告期末按市值占本计划资产净值比例大小排序的前十名证券明

细

证券代码	证券名称	数量	市值	市值占净值比
600031	三一重工	214,400.00	3,709,120.00	10.00%
002511	中顺洁柔	118,858.00	2,014,643.10	5.43%
300383	光环新网	81,800.00	1,957,474.00	5.28%
002439	启明星辰	51,400.00	1,901,800.00	5.13%
600183	生益科技	69,000.00	1,826,430.00	4.92%
603019	中科曙光	39,600.00	1,729,332.00	4.66%
000063	中兴通讯	39,100.00	1,673,480.00	4.51%
603208	江山欧派	19,400.00	1,531,048.00	4.13%
300751	迈为股份	10,500.00	1,523,025.00	4.11%
300014	亿纬锂能	25,900.00	1,505,049.00	4.06%

七、管理费、托管费及业绩报酬

单位：元

费用类型	计提费率 (计提基准)	计提方式及支付方式	本报告期应付费用
------	----------------	-----------	----------

管理费	年费率 0.50%	按前一日资产净值计提，按日计提，按季支付	45,254.97
托管费	年费率 0.20%	按前一日资产净值计提，按日计提，按季支付	18,102.00

注：本计划不计提业绩报酬。

八、重要事项揭示

（一）投资经理变更情况

本报告期内，本计划未发生投资经理变更。

（二）重大关联交易情况

本报告期内，本计划不存在重大关联交易情况。

（三）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情况

项目	持有份额 总数(份)	占总份额 比例
报告期末董事、监事、从业人员及配偶持有本计划份额情况	0.00	0.0000%
报告期末控股股东、实际控制人或者其他关联方参与情况持有本计划份额情况	0.00	0.0000%

（四）其他涉及投资者权益的重大事项。

本报告期内，不存在其他涉及投资者权益的重大事项。

九、备查文件目录

（一）查阅方式

财通证券资管网址：www.ctzg.com

客服电话：95336

投资者对本报告如有任何疑问，可咨询管理人财通证券资产管理有限公司。

财通证券资产管理有限公司

二〇二〇年四月二十四日