

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

(2021 年二季度)

计划管理人：财通证券资产管理有限公司

计划托管人：招商银行股份有限公司

报告期间：2021 年 04 月 01 日-2021 年 06 月 30 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。

财通证券资管财丰1号集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”或“集合计划”或“本计划”）于2013年05月20日成立，并向中国证券业协会及中国证监会浙江监管局备案，但中国证券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《财通证券资管财丰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《财通证券资管财丰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：2021年04月01日-2021年06月30日

## 一、集合计划简介

### （一）基本资料

名称：财通证券资管财丰1号集合资产管理计划

类型：集合资产管理计划

成立日：2013年05月20日

成立份额：47,105,058.00

存续期：无固定委托期限

管理人：财通证券资产管理有限公司

托管人：招商银行股份有限公司

注册登记机构：中国证券登记结算有限责任公司

### （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](http://www.ctzg.com)

### （三）计划托管人

名称：招商银行股份有限公司

注册地址：深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦

法定代表人或负责人：李建红

## 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	2021年06月30日
1	期末单位集合计划资产净值	2.5359
2	期末单位集合计划累计资产净值	4.0552
3	期末集合计划资产净值	9,240,552.95
4	本期集合计划利润	926,029.25
5	期末集合计划未分配利润	5,596,606.15
6	单位期末集合计划未分配利润	1.5359
7	本期集合计划净值增长率%	23.9382%
8	集合计划累计净值增长率%	483.3889%

### （二）收益分配情况

本报告期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

二季度以来，A股打破箱体震荡向上，市场交易情绪也相对较高。

一方面，3月中旬以来，短期市场流动性处在相对宽松的环境，我们可以看到尽管4、5月份是缴税大月，但货币市场利率保持了相对稳定，DR007基本处于7天逆回购利率以下。另一方面，近期人民币汇率突破18年中以来新高，投资者对于人民币汇率升值新高形成较强预期，北上涌入显著增量资金助推市场向上，5月陆股通净流入超500亿元，其中5月25日单日净流入额约217亿元，规模也创新高。展望后市，我们对A股市场仍然持谨慎乐观的态度，仍然会表现出明显的结构性行情。

对于当前产品的运作，板块配置集中于TMT、消费、医药生物、高端装备、新能源、化工新材料等新兴行业，行业配置适度均衡，个股方面，以持有长逻辑较好、业绩增长确定且估值合理的相关标的为主，并结合产业上下游变化、公司基本面变化、市场及估值变化等适当灵活调整，通过不断思考和优化组合，力争为投资者带来稳定持续的超额回报。

关于下一阶段的运作，管理人将逐步减持阶段性达到目标价的前期强势股票，逐步增加以未来12个月的时间周期来看性价比较为合适的绝对收益的个股。整体上，我们还是希望稳中求进，避免净值有大的波动。

### （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

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在对财通证券资管财丰1号集合资产管理计划托管的过程中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管

义务并安全保管托管资产。

托管人对资产管理人报告中的财务净值数据做了复核。

## 五、财务会计报告

### (一) 资产负债表

日期：2021年06月30日

单位：元

资产	期末余额	负债与持有人权益	期末余额
<b>资产：</b>		<b>负债：</b>	
银行存款	3,714,575.92	短期借款	0.00
结算备付金	260,333.25	交易性金融负债	0.00
存出保证金	1,314.95	衍生金融负债	0.00
交易性金融资产	5,304,675.42	卖出回购金融资产款	0.00
其中：股票投资	5,163,825.62	应付证券清算款	0.00
债券投资	140,849.80	应付赎回款	0.00
基金投资	0.00	应付管理人报酬	2,680.58
权证投资	0.00	应付托管费	1,340.26
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	1,946.45
买入返售金融资产	0.00	应交税费	30,915.08
应收证券清算款	0.00	应付利息	0.00
应收利息	503.30	应付利润	0.00
应收股利	0.00	其他负债	3,967.52
应收申购款	0.00	<b>负债合计</b>	<b>40,849.89</b>
其他资产	0.00		
		<b>所有者权益：</b>	
		实收基金	3,643,946.80
		未分配利润	5,596,606.15
		所有者权益合计	9,240,552.95
<b>资产合计</b>	<b>9,281,402.84</b>	<b>负债和所有者权益总计</b>	<b>9,281,402.84</b>

### (二) 损益表

日期：2021年04月01日-2021年06月30日

单位：元

项目	本期数	本年累计数
一、收入	945,213.62	873,005.94
1、利息收入	4,563.02	9,095.42

其中：存款利息收入	1,409.28	2,425.94
债券利息收入	6.91	6.91
资产支持证券利息收入	0.00	0.00
买入返售证券收入	3,241.47	6,862.65
增值税利息收入抵减	-94.64	-200.08
2、投资收益	425,738.35	433,235.68
其中：股票投资收益	432,202.95	440,995.84
债券投资收益	0.00	0.00
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	5,084.38	5,084.38
增值税投资收益抵减	-11,548.98	-12,844.54
3、公允价值变动收益	514,912.25	430,674.84
4、其他收入	0.00	0.00
二、费用	19,184.37	28,205.50
1、管理人报酬	5,019.93	8,912.25
2、托管费	2,509.90	4,456.10
3、销售服务费	0.00	0.00
4、交易费用	6,193.65	7,579.49
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	5,460.89	7,257.66
三、利润总和	926,029.25	844,800.44

## 六、投资组合报告

### （一）资产组合情况

日期：2021年06月30日

单位：元

项目	期末市值	占期末总资产比例
----	------	----------



银行存款	3,714,575.92	40.02%
清算备付金	260,333.25	2.80%
存出保证金	1,314.95	0.01%
股票投资	5,163,825.62	55.64%
债券投资	140,849.80	1.52%
资产支持证券投资	0	0
基金投资	0	0
理财产品投资	0	0
买入返售金额资产	0	0
应收股利	0	0
应收利息	503.30	0.01%
其他应收款	0	0
证券清算款	0	0
资产合计	9,281,402.84	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
300751	迈为股份	2,360.00	1,073,092.00	11.61%
603906	龙蟠科技	16,838.00	589,330.00	6.38%
600570	恒生电子	4,000.00	373,000.00	4.04%
603501	韦尔股份	900.00	289,800.00	3.14%
002371	北方华创	800.00	221,904.00	2.40%
300433	蓝思科技	7,100.00	208,811.00	2.26%
002597	金禾实业	5,500.00	190,850.00	2.07%
002230	科大讯飞	2,800.00	189,224.00	2.05%
600703	三安光电	5,400.00	173,070.00	1.87%
002475	立讯精密	3,700.00	170,200.00	1.84%

## 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 0.5%	按前一日资产净值计提，按日计提，按月支付	5,019.93
托管费	年费率 0.25%	按前一日资产净值计提，按日计提，按月支付	2,509.90
业绩报酬	见下表	本计划有权对委托人持有的集合计划各类份额年化收益率超过对应份额当期业绩报酬计提基准的部分按约定的比例（见下表）计提业绩报酬	132.75

业绩报酬计提基准：

计提日期区间	计提基准	计提比例
2018/08/17-2099/12/31	15%	20.00%

## 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	196357.57	5.3886%
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](http://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

二〇二一年七月二十七日