

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年三季度)

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07月01日-2021年09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07月01日-2021年09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：10年

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

（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：缪建民

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09月30日
1	期末单位集合计划资产净值	2.8975
2	期末单位集合计划累计资产净值	4.4168
3	期末集合计划资产净值	29,109,379.60
4	本期集合计划利润	1,763,458.54
5	期末集合计划未分配利润	19,062,885.42
6	单位期末集合计划未分配利润	1.8975
7	本期集合计划净值增长率%	14.2592%
8	集合计划累计净值增长率%	566.5757%

（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

三季度以来，在财政后置的影响下，叠加地产压制、限产政策以及国内疫情等因素，需求加速放缓，经济动能减弱。短期来看，当前影响最大的是能耗双控背景下各省相继加码防控措施，以及疫情反复对消费

的冲击，暂时未看到转变的迹象。7/30 政治局会议明确提出“合理把握预算内投资和地方政府债券发行进度，推动今年底明年初形成实物工作量”，8月开始政府债券发行开始放量，但真正形成实物投资可能至少要到四季度。因此，三季度处于经济加速下行和政府债券放量流动性边际趋紧的过度阶段，市场呈现震荡走势；但同时政策维度央行下调金融机构存款准备金率等操作来看，说明政策大概率不会再度收紧，央行后续仍有投放流动性的必要性和紧迫性，未来货币政策可能易松难紧，但政策节奏和力度不易判断。权益资产方面，三季度整体维持震荡向下，前期涨幅过大、交易拥挤的趋势赛道接连出现调整，28个申万一级行业多数收跌，分化进一步加大。

展望四季度，市场操作难度较大，操作上应更加重视具体的个股的安全性，降低波动及收益预期。

（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

托管人声明,在本报告期内，资产托管人严格遵守有关法律法规、资产管理合同关于托管人职责的约定，尽职尽责地履行了托管职责。

在管理人提供的各项数据和信息真实、准确、有效的前提下，在我行能够知悉和掌握的情况范围内，我行对资产管理人报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等财务数据进行了复核，未发现存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏的情形。

特此报告。

五、财务会计报告

(一) 资产负债表

日期：2021年09月30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	87,480.43	短期借款	0.00
结算备付金	537,371.92	交易性金融负债	0.00
存出保证金	3,882.57	衍生金融负债	0.00
交易性金融资产	14,546,319.88	卖出回购金融资产款	0.00
其中：股票投资	14,546,319.88	应付证券清算款	0.00
债券投资	0.00	应付赎回款	0.00
基金投资	0.00	应付管理人报酬	11,195.85
权证投资	0.00	应付托管费	5,597.90
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	8,227.20
买入返售金融资产	14,000,140.00	应交税费	36,829.90
应收证券清算款	11,200.00	应付利息	0.00
应收利息	-9,180.19	应付利润	0.00
应收股利	0.00	其他负债	5,984.16
应收申购款	0.00	负债合计	67,835.01
其他资产	0.00		
		所有者权益：	
		实收基金	10,046,494.18
		未分配利润	19,062,885.42
		所有者权益合计	29,109,379.60
资产合计	29,177,214.61	负债和所有者权益总计	29,177,214.61

(二) 损益表

日期：2021年07月01日-2021年09月30日

单位：元

项目	本期数	本年累计数
一、收入	1,841,739.32	2,714,745.26
1、利息收入	27,102.93	36,198.35
其中：存款利息收入	4,837.01	7,262.95
债券利息收入	207.56	214.47
资产支持证券利息收入	0.00	0.00
买入返售证券收入	22,726.32	29,588.97
增值税利息收入抵减	-667.96	-868.04

2、投资收益	1,713,997.24	2,147,232.92
其中：股票投资收益	1,355,179.32	1,796,175.16
债券投资收益	407,684.99	407,684.99
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	2,478.49	7,562.87
增值税投资收益抵减	-51,345.56	-64,190.10
3、公允价值变动收益	100,639.15	531,313.99
4、其他收入	0.00	0.00
二、费用	78,280.78	106,486.28
1、管理人报酬	24,768.33	33,680.58
2、托管费	12,384.12	16,840.22
3、销售服务费	0.00	0.00
4、交易费用	32,387.93	39,967.42
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	8,740.40	15,998.06
三、利润总和	1,763,458.54	2,608,258.98

六、投资组合报告

（一）资产组合情况

日期：2021年09月30日

单位：元

项目	期末市值	占期末总资产比例
银行存款	87,480.43	0.30%
清算备付金	537,371.92	1.84%
存出保证金	3,882.57	0.01%
股票投资	14,546,319.88	49.86%
债券投资	0	0

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	14,000,140.00	47.98%
应收股利	0	0
应收利息	-9,180.19	-0.03%
其他应收款	0	0
证券清算款	11,200.00	0.04%
资产合计	29,177,214.61	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	3,260.00	1,987,067.80	6.83%
003043	华亚智能	24,700.00	1,296,997.00	4.46%
603906	龙蟠科技	21,438.00	1,077,688.26	3.70%
002409	雅克科技	11,900.00	908,684.00	3.12%
300558	贝达药业	9,200.00	861,212.00	2.96%
002079	苏州固锝	53,500.00	778,425.00	2.67%
603259	药明康德	4,800.00	733,440.00	2.52%
300480	光力科技	21,900.00	711,093.00	2.44%
300122	智飞生物	4,000.00	635,960.00	2.18%
300482	万孚生物	14,700.00	632,100.00	2.17%

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	24,768.33

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	12,384.12
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	55,424.44

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	1.9545%
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

二〇二一年十月二十九日