

财通证券资产管理有限公司  
财通证券资管财申道系列-国企改革主题  
集合资产管理计划  
季度资产管理报告  
(2022 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：中国工商银行股份有限公司-浙江省分行

报告期间：2022 年 04 月 01 日-2022 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。

财通证券资管财申道系列-国企改革主题集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”或“集合计划”）于 2015 年 04 月 13 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《财通证券资管财申道系列-国企改革主题集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称《管理合同》）及《财通证券资管财申道系列-国企改革主题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：2022 年 04 月 01 日-2022 年 06 月 30 日

## 一、集合计划简介

### （一）基本资料

名称：财通证券资管财申道系列-国企改革主题集合资产管理计划

类型：集合资产管理计划

成立日：2015 年 04 月 13 日

成立份额：74,053,432.27

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](http://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：浙江省杭州市江干区剧院路 66 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	2022 年 06 月 30 日
1	期末单位集合计划资产净值	1.2586
2	期末单位集合计划累计资产净值	2.5686
3	期末集合计划资产净值	13,090,260.03
4	本期集合计划利润	1,000,554.62
5	期末集合计划未分配利润	2,689,900.68
6	单位期末集合计划未分配利润	0.2586
7	本期集合计划净值增长率%	8.6874%
8	集合计划累计净值增长率%	182.3568%

### （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

于洋先生金融学硕士，历任申银万国证券研究所有限公司研究员；瑞银证券有限责任公司研究员、研究部副董事；富国基金管理有限公司投资经理。2018 年 4 月加入财通证券资产管理有限公司。

### （二）投资主办工作报告

2022 年二季度，A 股市场探底回升，整体波动幅度较大。海外方

面，俄乌冲突仍在发酵，美国通胀持续高企，联储坚定加息打击通胀，美债收益率震荡上行。国内方面，二季度本土疫情多地散发，多地防控措施升级，企业供应链承压，国内经济面临需求收缩、供给冲击、预期转弱三重压力，资本市场情绪也相对悲观，在疫情最严重的 4 月，A 股市场经历了一轮快速下跌，上证指数一度跌破 3000 点，随后政治局会议积极表态提振市场信心，国常会出台一揽子政策托底经济，全国稳住经济大盘电视电话会议促进政策加快落地，与此同时国内疫情也有所好转，复工复产有序展开，市场情绪明显回暖，5 月、6 月 A 股迎来了明显反弹。从主要股指表现来看，二季度沪深 300 指数上涨 6.21%，上证综指上涨 4.50%，深证成指上涨 6.42%，创业板指数上涨 5.68%。行业方面，31 个申万一级行业涨跌参半，汽车板块以 23.09% 的涨幅领涨其他行业，食品饮料、电力设备、美容护理、商贸零售、家用电器板块也录得 10% 以上涨幅，相比之下，房地产、计算机行业板块下跌较多。

报告期内，本计划仍保持中低仓位，管理人结合市场行情和基本面变化小幅优化了组合配置。经过 4 月的急速下跌，恐慌情绪加速释放，市场估值位于历史低位，部分高成长赛道和个股估值性价比凸显，进入 5 月随着国内疫情度过最困难的时候，市场开始交易疫后复苏，在消费场景修复、鼓励政策刺激、企业促销活动等多重拉动下消费板块有望迎来环比改善，从经济数据来看，上半年超预期的疫情使得经济下行压力进一步加大，基建、地产相关政策依然是市场关注的重点，因此本季度管理人主要对新能源、TMT、医药、消费等板块配置比例和个股进行了一定调整，整体风格依然略偏成长。展望下一阶段，美国短期内经济政策的首要任务依然是打击高通胀，但伴随着美国经济走弱加息节奏会逐步放

缓，届时美债收益率的企稳回落或将消除市场最大的负面因素，下半年国内经济也有望在消费、基建、地产等板块的带动下实现弱复苏，企业盈利将环比改善，市场流动性预计整体合理充裕，因此我们对后续市场走势整体相对乐观，相信大小盘成长、大消费、稳增长板块都可能迎来结构性机会。

### （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了监控，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，本托管人在对财通证券资管财申道系列-国企改革主题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证券资管财申道系列-国企改革主题集合资产管理计划 2022 年二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：2022 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	7,522,166.16	短期借款	0.00
结算备付金	9,101.96	交易性金融负债	0.00
存出保证金	20,995.69	衍生金融负债	0.00
交易性金融资产	5,578,485.80	卖出回购金融资产款	0.00
其中：股票投资	5,578,485.80	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	23,826.24
权证投资	0.00	应付托管费	5,956.60
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	658.85
买入返售金融资产	0.00	应交税费	6,080.37
应收证券清算款	0.00	应付利息	0.00
应收利息	0.00	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>	40,489.58
其他资产	0.00		
		<b>所有者权益：</b>	
		实收基金	10,400,359.35
		未分配利润	2,689,900.68
		所有者权益合计	13,090,260.03
<b>资产合计</b>	13,130,749.61	<b>负债和所有者权益总计</b>	13,130,749.61

### (二) 损益表

日期：2022 年 04 月 01 日-2022 年 06 月 30 日

单位：元

项目	本期金额	上期金额
一、收入	1,032,983.65	-5,153,970.21
1. 利息收入	7,938.03	88,366.33



2. 投资收益（损失以“-”填列）	289,404.72	-705,599.25
其中：以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益	0.00	0.00
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	714,240.29	-4,554,888.58
4. 汇兑损益（损失以“-”号填列）	0.00	0.00
5. 其他业务收入	21,400.61	18,151.29
二、费用	32,429.03	106,599.54
1. 管理人报酬	23,826.24	95,494.93
2. 托管费	5,956.60	23,805.67
3. 销售服务费	0.00	0.00
4. 投资顾问费	0.00	0.00
5. 利息支出	0.00	0.00
其中：卖出回购金融资产利息支出	0.00	0.00
6. 信用减值损失	0.00	0.00
7. 税金及附加	651.47	-15,563.86
8. 其他费用	1,994.72	2,862.80
三、利润总额	1,000,554.62	-5,260,569.75
减：所得税费用	—	—
四、净利润	1,000,554.62	-5,260,569.75
五、其他综合收益		
六、综合收益总额	1,000,554.62	-5,260,569.75

## 六、投资组合报告

### （一）资产组合情况

日期：2022 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	7,522,166.16	57.29%
清算备付金	9,101.96	0.07%
存出保证金	20,995.69	0.16%
股票投资	5,578,485.80	42.48%

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	0	0
应收股利	0	0
应收利息	0	0
其他应收款	0	0
证券清算款	0	0
资产合计	13,130,749.61	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	2,040.00	1,001,436.00	7.65%
688516	奥特维	2,148.00	573,408.60	4.38%
603816	顾家家居	6,760.00	382,818.80	2.92%
601567	三星医疗	28,000.00	371,840.00	2.84%
300122	智飞生物	3,300.00	366,333.00	2.80%
000661	长春高新	1,400.00	326,788.00	2.50%
002572	索菲亚	11,600.00	319,000.00	2.44%
002240	盛新锂能	5,200.00	313,872.00	2.40%
002271	东方雨虹	5,300.00	272,791.00	2.08%
300595	欧普康视	4,700.00	268,793.00	2.05%

## 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 0.8%	按前一日资产净值计提，按日计提，按季支付	23,826.24
托管费	年费率 0.2%	按前一日资产净值计提，按日计提，按季支付	5,956.60
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	0.00

业绩报酬计提基准：

计提日期区间	计提基准	计提比例
2015/04/13-2025/04/14	6%	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	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](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

二〇二二年七月二十七日