

诚通新财富 50 号集合资产管理计划
2022 年第三季度资产管理报告

管理人:诚通证券股份有限公司

托管人:中国银行股份有限公司广东省分行



1 重要提示

本报告依据《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》及其他有关规定制作。

本报告由资产管理计划管理人编制。管理人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。

资产管理计划托管人中国银行股份有限公司广东省分行于2022年10月26日复核了本报告中的财务指标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。

资产管理计划管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用资产管理计划资产，但不保证资产管理计划一定盈利。

资产管理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资产管理计划的资产管理计划说明书。

本报告中相关财务资料未经审计。

本报告期自2022年7月1日起至2022年9月30日止。

2 管理人履职报告

2.1 产品概况

资产管理计划名称:	诚通新财富 50 号集合资产管理计划
交易代码:	D22114
资产管理计划类型:	集合资产管理计划
成立日期:	2019 年 4 月 23 日
成立规模:	17,117,090.88 元
存续期:	5 年
管理人:	诚通证券股份有限公司
托管人:	中国银行股份有限公司广东省分行
证券账户信息:	D890175602、0899194822

2.2 投资主办人简介

周鹤翔女士，北京大学药学经济学双学士，北京大学药剂学硕士，现任诚通证券资产管理总部权益投资负责人，11年投研经验，管理产品两度获得金牛理财产品称号，擅长从产业经济学角度分析不同企业的产业链地位和差异，注重企业安全边际的研究，投资奉行在有效控制回撤的基础上取得超越市场平均收益率。

柏圣书先生，九年金融行业从业经历，曾就职于天津信唐货币经纪有限责任公司，历任债券市场部利率债经纪人及信用债经纪人。2015年加入诚通证券资产管理总部投资管理部，负责债券交易工作，现任诚通证券资产管理总部投资经理。具备良好的固定收益类产品知识基础，较强的债券交易能力，能及时准确洞察债券市场变化，寻求投资、交易机会。

2.3 投资主办人工作报告

债券市场：三季度债券市场收益率整体呈现先下后上格局，整体较二季度有所下行。具体来看，进入7月份在地产停贷事件冲击及资金面超宽松背景下收益率进入下行通道，随后公布的7月社融和经济数据不及预期，8月15日央行超预期下调了7天逆回购利率和1年期MLF利率，点燃市场做多热情，10Y国债收益率来到季度最低点下行至2.58%，随后收益率维持低位震荡。进入9月份在稳地产政策不断加码、人民币汇率贬值、季末资金面波动等多重利空冲击下收益率开始回调，截止9月30日10年国债下行6bp至2.76%。

债券操作和策略：本组合在三季度坚持以票息杠杆策略为主，配置品种选择兼顾收益和安全的短久期城投债为主，严格控制产品久期风险，获得良好业绩的同时保证了产品的安全和流动性。进入10月份在季节性扰动结束后资金利率中枢有望回到较低水平，机构将继续加杠杆来进行套利。目前基建、地产等稳增长政策发力预期上升，但整体效果尤其是地产的回暖仍待观察，基本面面临消费恢复乏力、出口下滑的考验，整体来看市场不具备趋势性调整的条件。产品操作上信用债配置策略特别是城投债配置策略，将继续有效，同时关注预期差带来的利率债交易机会。

权益方面：22年3季度，沪深300指数下跌15.16%，创业板指下跌18.56%，万德全A下跌12.61%，市场日均成交一度跌破6000亿。市场情绪已经降至冰点，疲弱的基本面叠加美元紧缩周期加速是市场调整的主要原因。展望四季度，尽管出口、消费依然会对经济造成一定拖累，但投资端特别是财政主导的基建和部分民生领域有望率先走出低谷，出现结构性投资机会。

2.4 报告期内本资产管理计划运作合规守信情况说明

报告期内本资产管理计划的运作符合相关法律、法规以及资产管理合同的约定，不存在损害持有人利益的行为。

3 主要财务指标和资产管理计划投资表现

3.1 主要财务指标

	项目	2022年7月1日—2022年9月30日
1	本期利润（元）	-6,750.74
2	本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额（元）	40,154.26
3	期末资产管理计划份额（份）	6,931,473.1
4	期末资产管理计划资产净值（元）	7,797,675.61
5	期末单位资产管理计划资产净值（元）	1.1250
6	期末累计单位资产管理计划资产净值（元）	1.2850

3.2 产品净值表现

阶段	净值增长率
2022年第三季度	-0.0799%

3.3 资产管理计划份额变动情况

期初总份额	期间参与份额	期间退出份额	期末总份额
6,931,473.10	0.00	0.00	6,931,473.10

4 资产管理计划投资组合报告

4.1 资产组合情况

日期：2022年9月30日

单位：人民币元

项目	期末余额	占资产比例
银行存款、备付金及存出保证金	952,328.93	12.14%
股票投资	406,520.00	5.18%

债券投资	6,482,540.02	82.66%
基金投资	0.00	0.00%
其他资产	1,090.88	0.01%
资产合计	7,842,479.83	100.00%

4.2 报告期末按市值占资产管理计划资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	证券代码	证券名称	库存数量	证券市值(元)	市值占净值比例
1	177046.SH	20润城01	15,000	1,540,800.00	19.76%
2	196270.SH	22潼南D1	15,000	1,501,650.00	19.26%
3	178749.SH	21饶创02	15,000	1,485,900.00	19.06%
4	162379.SH	19淮建02	10,000	1,002,200.00	12.85%
5	143727.SH	18津投04	7,000	706,160.00	9.06%

4.3 报告期末按市值占资产管理计划资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

序号	证券代码	证券名称	库存数量	证券市值	市值占净值比例
1	300529.SZ	健帆生物	2,000	96,960.00	1.24%
2	600426.SH	华鲁恒升	3,000	87,510.00	1.12%
3	300699.SZ	光威复材	1,000	82,910.00	1.06%
4	603982.SH	泉峰汽车	3,000	72,540.00	0.93%
5	600989.SH	宝丰能源	5,000	66,600.00	0.85%

4.4 报告期末按债券品种分类债券投资组合

序号	债券品种	市值(元)	市值占净值比例
1	公司债	6,236,710.00	79.98%

4.5 投资组合报告附注

1、报告期内资产管理计划投资的前五名股票及债券的发行主体没有被监管部门立案调查，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

2、资产管理计划投资的前十名股票及债券中，没有超出资产管理计划合同规定的投资范围。

5 资产管理计划收益分配情况

本资产管理计划本报告期末进行分红。

6 投资经理变更、重大关联交易等涉及投资者权益的重大事项

6.1 资产管理计划投资经理变更情况

本报告期内未发生投资经理变更情况。

6.2 重大关联交易等涉及投资者权益的重大事项

本报告期内未发生重大关联交易等涉及投资者权益的重大事项。

7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1、中国证券投资基金业协会出具的关于诚通新财富 50 号集合资产管理计划《资产管理计划备案证明》；

2、《诚通新财富 50 号集合资产管理计划集合资产管理合同》；

3、《诚通新财富 50 号集合资产管理计划说明书》；

4、《诚通新财富 50 号集合资产管理计划风险揭示书》；

5、资产管理计划管理人业务资格批件、营业执照。

7.2 存放地点

文件存放地点：北京市海淀区北三环西路 99 号院 1 号楼 15 层 1501

网址：<http://www.cctgsc.com.cn>

信息披露电话：95399

投资者对本报告书如有任何疑问，可咨询管理人诚通证券股份有限公司。

