

财达鑫享1号集合资产管理计划资产管理报告

第一节 重要提示

本报告由集合资产管理计划管理人编制。集合资产管理计划托管人中国工商银行股份有限公司于2022年7月21日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容。

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

集合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，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本集合资产管理计划说明书。

本报告相关财务资料未经审计。

本报告期间：2022年04月01日至2022年06月30日。

第二节 集合资产管理计划概况

名称：财达鑫享1号集合资产管理计划
类型：集合资产管理计划
成立日：2019年01月16日
报告期末份额总额：365,401,922.33
管理人：财达证券股份有限公司
托管人：中国工商银行股份有限公司重庆市分行

第三节 主要财务指标和集合资产管理计划净值表现

一、主要财务指标（单位：人民币元）

本期利润	6,251,935.97
期末资产净值	376,676,757.04
期末每份额净值	1.0309
期末每份额累计净值	1.2240

二、业绩表现

截止2022年6月30日，本集合计划单位净值1.0309，累计单位净值1.2240，本期集合计划净值增长率1.6968%，本集合计划报告期内未分红。

第四节 管理人报告

一、投资主办人简介

刘莉：具备投资主办人资格(S04008180400)。金融硕士，13年证券从业经验，9年债券交易投资经验，管理有债券类、货币类资管计划。从业期间积累了丰富的银行间交易经验，熟悉市场各类机构交易风格，有较强的流动性风险和信用风险控制意识，擅长通过个券信用分析挖掘投资价值。

刘玥祺：金融学硕士，2016年加入财达证券。9年金融从业经验，6年债券产品管理经验。曾任华商银行资金部业务助理、同业机构经理，财达证券资产管理部投资经理助理，具有较为丰富的债券产品管理经验。

二、投资主办人工作报告

(一) 行情回顾及运作分析

二季度由于疫情扩散，企业信贷需求收缩等影响，资金市场出现流动性淤积，银行间7天回购加权利率均值1.85%，跨季末稍有上升。

二季度利率债先下后上，4-5月受疫情影响，资金宽松，利率债收益率下行，随着疫情得到控制，稳增长政策持续推进，6月利率债收益率转为上行。但整体呈窄幅震荡，长端对基本面的反应相对钝化，短端由于资金宽松，收益率降幅相对较明显。2022年2季度末，10年国开债收益率3.05%，较上季末上升1.21BP。1年国开债收益率2.02%，较上季末下降26.66BP。

信用债方面，城投债表现优于长久期利率债，2022年2季度末，AA三年城投债收益率3.22%，较上季度末下降26BP，3年-1年AA城投债期限利差63.4BP，较上季末上升8.64BP。由于资金持续宽松而城投债供给偏弱，4月以来城投债一级投标持续火爆，数只债券出现60倍超高倍数申购，6月随着供给恢复，投标热情有所降温，但收益率仍处于低位。

可转债方面，4月底以来，随着稳增长政策持续出台，疫情逐渐受到控制，市场极度悲观预期扭转，A股市场出现了估值修复。2022年2季度，中证转债及可交换债券指数收于418.62，较上季末上涨4.68%。转债估值方面，目前全市场转股溢价率均值53.37%，较年初大幅上行19.13个百分点，处于2017年以来

98.2%分位数水平。

二季度我们维持了前期的投资策略，产品配置方面仍以城投债为主，主要在中部省份平台做挖掘，持续关注中部省份平台+省级担保公司担保债券的配置价值。鑫享系列产品整体久期控制在1.5年以内，杠杆140%以内，AA+以上债券占比40%以上。可转债方面，大部分仓位仍然在养殖、金融、基建板块，受益于股市回暖，对产品净值产生了正贡献。

（二）市场展望和投资策略

向后看，经济仍将持续修复，但经济增长的高度预计有限，资金面仍将保持宽松，债市可能面临一定压力，但大幅调整的可能性较小。信用债方面预计市场仍将追逐于相对安全的城投债品种，但目前收益率已处于低位，且弱资质平台的融资并未出现明显改善，后续产品配置方面仍以城投债为主，但资质下沉偏谨慎，规避高负债区域及瑕疵主体，适度增加AA+评级以上债券持仓比例。杠杆、久期维持现状，如果市场发生调整，择机进行利率债、高评级信用债波段操作。

可转债方面，后续将加大对转债的深入研究分析，积极参与打新和一级新上市质优转债交易，择机增加可转债仓位，提升可转债仓位对产品收益的贡献度。

第五节 托管人报告

中国工商银行（资产托管部重庆分部）

托管人履职报告

本报告期内，本托管人在财达鑫享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，本托管人依法对财达证券股份有限公司编制和披露的财达鑫享1号集合资产管理计划2022年2季度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、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。

托管人：中国工商银行股份有限公司资产托管部重庆分部

2022年7月21日



第六节 投资组合报告

一、 期末资产组合情况

2022年6月30日

单位：人民币元

项目名称	项目市值（元）	占资产净值比例
银行存款及清算备付金合计	2,003,470.48	0.5319%
股票	-	0.0000%
债券	413,371,548.71	109.7417%
基金	10,000,000.00	2.6548%
买入返售金融资产	33,112,203.88	8.7906%
其他	10,168.45	0.0027%
资产总值合计	458,497,391.52	121.7217%

二、 期末市值占集合计划资产净值前十名股票明细

本集合计划报告期末未持有股票。

三、 期末市值占集合计划资产净值前十名基金明细

序号	代码	名称	数量	市值（元）	占净值比例（%）
1	004787	渤海汇金汇添金货币B	10,000,000.00	10,000,000.00	2.6548

四、 期末市值占集合计划资产净值前十名债券明细

序号	代码	名称	数量	市值（元）	占净值比例（%）
1	102101390.IB	21 景德镇陶 MTN001	200,000	20,336,000.00	5.3988
2	178772.SH	21 高邮 01	200,000	20,040,000.00	5.3202
3	166653.SH	20 丰住 03	200,000	20,000,300.00	5.3097
4	162940.SH	20 商铁 01	200,000	20,000,000.00	5.3096
5	196577.SH	21 任丘 01	200,000	20,000,000.00	5.3096
6	101901758.IB	19 磁湖高新 MTN002	200,000	19,888,000.00	5.2799
7	032280180.IB	22 十堰聚鑫 PPN001	100,000	10,188,000.00	2.7047
8	194361.SH	22 驻产 02	100,000	10,151,700.00	2.6951
9	1980228.IB	19 玉山控股债 02	100,000	10,146,000.00	2.6936
10	167529.	20 枝金 03	100,000	10,130,200.00	2.6894

	SH				
--	----	--	--	--	--

五、 期末市值占集合计划资产净值前十名质押式回购明细

序号	代码	名称	市值(元)	占净值比例(%)
1	000400	债券质押协议 回购 5148	13,000,000.00	3.4512
2	000014	R014	10,080,135.12	2.6761
3	000399	债券质押协议 回购 1067	10,000,000.00	2.6548

本集合计划报告期末持有3支质押式回购。

六、 期末市值占集合计划资产净值前十名可转债/可交债明细

序号	代码	名称	数量(张)	市值(元)	占净值比例(%)
1	132026 .SH	G 三峡 EB2	3,630	406,716.09	0.1080
2	127058 .SZ	科伦转债	3,000	391,605.00	0.1040
3	110064 .SH	建工转债	3,000	369,990.00	0.0982
4	127049 .SZ	希望转 2	2,500	306,720.00	0.0814
5	113616 .SH	韦尔转债	1,500	191,280.00	0.0508
6	127015 .SZ	希望转债	1,250	146,135.00	0.0388
7	128035 .SZ	大族转债	1,300	145,836.60	0.0387
8	128135 .SZ	洽洽转债	1,000	127,582.00	0.0339
9	113024 .SH	核建转债	1,000	119,420.00	0.0317
10	113049 .SH	长汽转债	900	118,287.00	0.0314

七、 投资组合报告附注

本集合资产管理计划投资的前十名证券的发行主体在本报告期内未被监管

部门立案调查，在本报告编制日前一年内也未到受到公开谴责、处罚。

第七节 集合计划份额情况

一、 集合计划份额变化情况

单位：份

期初份额总额	365,401,922.33
报告期内净参与份额	0.00
红利再投资份额	0.00
报告期内净退出份额	0.00
报告期末份额总额	365,401,922.33

二、 集合计划关联方份额情况

本集合计划报告期末，参与本集合计划的管理人关联方共计102户，合计持有份额111,428,606.40份，占比30.49%。

第八节 财务会计报告

一、 资产负债表

资产	期末余额	上年年末余额	负债和所有者权益	期末余额	上年年末余额
资产：			负 债：		
银行存款	1,360,253.65	991,619.00	短期借款	0.00	0.00
结算备付金	643,216.83	1,035,561.98	交易性金融负债	0.00	0.00
存出保证金	9,668.65	12,765.10	衍生金融负债	0.00	0.00
衍生金融资产	0.00	0.00	卖出回购金融资产款	80,858,967.65	95,869,684.08
交易性金融资产	423,371,548.71	332,885,995.53	应付清算款	0.00	0.00
买入返售金融资产	33,112,203.88	78,760,132.87	应付赎回款	0.00	0.00
发放贷款和垫款			应付管理人报酬	817,563.82	408,110.85
债权投资	0.00	0.00	应付托管费	46,562.13	40,811.11
其他债权投资			应付销售服务费	0.00	0.00
应收清算款	0.00	28,249.45	应付投资顾问费	0.00	0.00
应收利息	0.00	9,223,082.01	应交税费	85,367.68	84,703.98
应收股利	499.80	0.00	应付利息	0.00	113,564.19
应收申购款	0.00	0.00	应付利润	0.00	0.00
其他资产	0.00	0.00	其他负债	12,173.20	3,531.42
			负债合计	81,820,634.48	96,520,405.63
			所有者权益		
			实收资金	365,401,922.33	315,298,701.92
			其他综合收益		
			未分配利润	11,274,834.71	11,118,298.39
			所有者权益合计	376,676,757.04	326,417,000.31
资产总计	458,497,391.52	422,937,405.94	负债和所有者权益总计	458,497,391.52	422,937,405.94

二、 损益表

损益表

财达证券股份有限公司——财达鑫享1号集合资产管理计划——专用表
编制单位：财达证券股份有限公司 2022年04月 - 2022年06月

会计报表
单位：元

项目	本期金额	上期金额
一、收入	7,487,290.45	5,104,088.11
1. 利息收入	772,152.07	1,115,111.73
2. 投资收益（损失以“-”填列）	6,149,354.14	5,441,992.88
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）	555,774.24	-454,016.50
4. 汇兑损益（损失以“-”号填列）	0.00	0.00
5. 其他业务收入	0.00	0.00
二、费用	1,235,354.43	1,324,508.17
1. 管理人报酬	455,521.45	440,581.59
2. 托管费	45,552.13	44,088.24
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	673,345.32	782,788.53
其中：卖出回购金融资产利息支出	673,345.32	782,788.53
6. 信用减值损失	0.00	0.00
7. 税金及附加	25,672.82	22,324.37
8. 其他费用	24,152.75	34,525.34
三、利润总额	6,251,935.97	4,779,479.94
减：所得税费用	—	—
四、净利润	6,251,935.97	4,779,479.94
五、其他综合收益		
六、综合收益总额	6,251,935.97	4,779,479.94

制表：梁杰楠
打印：梁杰楠

复核：

三、所有者权益变动表

所有者权益变动表

财达证券股份有限公司——财达鑫享1号集合资产管理计划——专用表

日期：2022年04月 - 2022年06月

单位：元

项目	本期金额			上期金额		
	实收基金	未分配利润	所有者权益	实收基金	未分配利润	所有者权益
一、期初所有者权益（基金净值）	365,401,922.33	5,022,898.74	370,424,821.07	315,298,701.92	11,118,298.39	326,417,000.31
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	0.00	6,251,935.97	6,251,935.97	0.00	4,779,479.94	4,779,479.94
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（减少以“-”号填列）	0.00	0.00	0.00	50,103,220.41	186,182.75	50,289,403.16
其中：1. 基金申购款	0.00	0.00	0.00	81,761,320.54	277,993.25	82,039,313.79
2. 基金赎回款	0.00	0.00	0.00	-31,658,100.13	-91,810.50	-31,749,910.63
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动数	0.00	0.00	0.00	0.00	-11,061,062.34	-11,061,062.34
五、期末所有者权益（基金净值）	365,401,922.33	11,274,834.71	376,676,757.04	365,401,922.33	5,022,898.74	370,424,821.07

制表：梁杰楠
打印：梁杰楠

复核：

审核：
打印日期：2022-07-19

第九节 重要事项提示

本集合资产管理计划投资的前十名证券的发行主体在本报告期内未发生需

披露的重要事项。

第十节 信息披露的查阅方式

信息披露网址：www.s10000.com

信息披露电话：95363（河北区域投资者请致电95363，河北省外区域投资者请致电0311-95363）

投资者对本报告书如有任何疑问，可咨询管理人财达证券股份有限公司。

