

财达鑫享2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10月19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07月01日至2022年09月30日。

第二节 集合资产管理计划概况

名称：财达鑫享2号集合资产管理计划
类型：集合资产管理计划
成立日：2019年06月12日
报告期末份额总额：204,065,851.33
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	6,158,613.75
期末资产净值	217,051,578.92
期末每份额净值	1.0636
期末每份额累计净值	1.2308

二、业绩表现

截止2022年9月30日，本集合计划单位净值1.0636，累计单位净值1.2308，本期集合计划净值增长率2.9124%，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，金融硕士，2018年加入财达证券。13年证券从业经验，9年债券固收投资交易资历。曾任恒泰证券资管部投资经理，管理有债券类、货币类资管计划，管理规模约20亿。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

三季度债券市场先涨后跌，7月份地产风险事件和销售转弱导致对经济预期转弱，且受益于流动性持续宽松，债市走强。8月中旬央行超预期调降MLF和OMO利率10BP，10年期国债收益率月中触及2.58%的低位。但随后由于宽信用政策密集出台，资金价格有所回升，金融经济数据边际改善，美联储货币政策收紧等众多利空因素冲击，8月中下旬至9月末，债市持续回调。截至2022年9月末，10年期国债到期收益率2.76%，较6月末下降6.04BP。信用债方面受益于资金持续宽松，机构配置力量强大，收益率下行明显，信用利差收窄，截至2022年9月末，3年期AA级城投债收益率2.94%，较6月末下降28.34BP。三季度转债市场先涨后跌，但跌幅小于正股，成交量显著萎缩。转股溢价率被动上升，转债加权平均转股溢价率已接近4月底年内高点。截至2022年9月末，中证可转债指数收于402.64，季度跌幅3.82%。

三季度产品信用债维持前期稳健策略，杠杆和久期均处于中等偏低水平，整体上增加了AA+级以上债券和河北省内债券配置比例。转债方面整体降低了仓

位，但由于市场走弱，收益回撤出现一定浮亏。

（二）市场展望和投资策略

向后看，随着稳增长政策逐步落地，9月经济数据可能进一步向上修复，9月末下调公积金贷款利率、部分城市首套房贷款利率，房地产交易税收优惠等众多房地产放松政策出台，关注后续的实际效果。海外美联储加息周期可能对国内货币政策进一步放松产生制约，但货币政策转而迅速收紧的可能性也较小。预计利率债可能偏弱震荡，但如果资金不出现显著收紧，预计仍有配置盘逢高配置。信用债方面，城投债收益率和信用利差、等级利差均处于历史低位，仅期限利差稍高，信用债性价比不高。但是在资金宽松，供给偏弱的背景下，城投债仍然可以平稳配置。转债方面，市场短期可能在偏底部区域震荡，向上可能需要看到更多经济修复的证据和海外不确定性下降。

四季度产品信用债投资将仍以中部省份城投债为主，严控信用风险，分散持仓，关注估值波动可能对产品造成的影响，做好相应应对。可转债行业方面依然相对看好消费、养殖等板块，后续将对转债持仓进行调整，适度减少持仓品种。

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2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2号集合资产管理计划2022年3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10月19日



第六节 投资组合报告

一、 期末资产组合情况

2022年09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	1,105,350.25	0.51%
股票	0.00	0.00%
债券	248,258,129.78	114.38%
基金	0.00	0.00%
买入返售金融资产	23,292,228.43	10.73%
其他	2,197.87	0.00%
资产总值合计	272,657,906.33	125.62%

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

本集合计划报告期末未持有基金。

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	196317. SH	22 永城 01	100,000	10,463,100.00	4.8206
2	0321800 37. IB	21 随州城 投 PPN001	100,000	10,363,000.00	4.7744
3	184219. SH	22 金阳 01	100,000	10,300,200.00	4.7455
4	133132. SZ	21 通顺 02	100,000	10,298,790.00	4.7449
5	197433. SH	21 驻投 09	100,000	10,265,100.00	4.7293
6	162940. SH	20 商铁 01	100,000	10,199,600.00	4.6992
7	196577. SH	21 任丘 01	100,000	10,161,900.00	4.6818
8	197901. SH	21 廊控 01	100,000	10,160,500.00	4.6811
9	162937. SH	G20 洞庭 2	100,000	10,158,800.00	4.6804
10	196508. SH	21 牟中 02	100,000	10,150,900.00	4.6767

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	000290	债券质押协议 回购 3047	15,300,000.00	7.0490
2	000291	债券质押协议 回购 4168	7,975,000.00	3.6742

本集合计划报告期末持有2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	127049 .SZ	希望转2	3,314	391,111.65	0.1802
2	113043 .SH	财通转债	3,000	317,040.00	0.1461
3	127025 .SZ	冀东转债	2,660	288,974.42	0.1331
4	113024 .SH	核建转债	2,000	227,060.00	0.1046
5	113616 .SH	韦尔转债	2,000	226,940.00	0.1046
6	110081 .SH	闻泰转债	1,500	164,205.00	0.0757
7	110062 .SH	烽火转债	1,400	147,574.00	0.0680
8	113060 .SH	浙22转债	1,000	123,040.00	0.0567
9	110079 .SH	杭银转债	1,000	122,880.00	0.0566
10	118013 .SH	道通转债	1000	121,800.00	0.0561

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	204,065,851.33
报告期间净参与份额	0.00
红利再投资份额	0.00
报告期间净退出份额	0.00
报告期末份额总额	204,065,851.33

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71户，合计持有份额41,278,892.18份，占比20.23%。

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	954,480.68	1,123,771.63	短期借款	0.00	0.00
结算备付金	150,869.57	107,983.89	交易性金融负债	0.00	0.00
存出保证金	2,197.87	14,663.46	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	53,955,190.20	88,949,988.00
交易性金融资产	248,258,129.78	253,141,436.07	应付清算款	88,398.67	16,272.54
买入返售金融资产	23,292,228.43	56,835,000.00	应付赎回款	0.00	0.00
发放贷款和垫款			应付管理人报酬	268,402.57	280,252.24
债权投资	0.00	0.00	应付托管费	13,420.15	14,012.61
其他债权投资			应付销售服务费	0.00	0.00
应收清算款	0.00	0.00	应付投资顾问费	0.00	0.00
应收利息	0.00	6,411,466.89	应交税费	144,180.04	64,762.13
应收股利	0.00	0.00	应付利息	0.00	92,191.50
应收申购款	0.00	0.00	应付利润	1,131,728.31	0.00
其他资产	0.00	0.00	其他负债	5,007.47	2,231.87
			负债合计	55,606,327.41	89,419,710.89
			所有者权益		
			实收资金	204,065,851.33	220,219,288.89
			其他综合收益		
			未分配利润	12,985,727.59	7,995,322.16
			所有者权益合计	217,051,578.92	228,214,611.05
资产总计	272,657,906.33	317,634,321.94	负债和所有者权益总计	272,657,906.33	317,634,321.94

二、损益表

损益表

财达证券股份有限公司 财达鑫享2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01月 - 2022年09月

会资管02表
单位：元

项目	本期金额	上期金额
一、收入	6,975,979.63	4,827,532.53
1.利息收入	264,658.73	392,341.40
2.投资收益（损失以“-”填列）	4,365,972.73	4,063,398.40
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）	2,345,348.17	371,792.73
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	817,368.88	966,939.07
1.管理人报酬	268,402.57	267,870.84
2.托管费	13,420.15	13,393.57
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	499,318.41	646,830.32
其中：卖出回购金融资产利息支出	499,318.41	646,830.32
6.信用减值损失	0.00	0.00
7.税金及附加	25,148.62	17,334.96
8.其他费用	11,076.13	21,509.38
三、利润总额	6,158,613.75	3,860,593.46
减：所得税费用	—	—
四、净利润	6,158,613.75	3,860,593.46
五、其他综合收益		
六、综合收益总额	6,158,613.75	3,860,593.46

制表：梁杰媚
打印：梁杰媚

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2号集合资产管理计划 专用表

日期：2022年01月 - 2022年09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）	204,065,851.33	6,827,113.84	210,892,965.17	232,261,301.00	3,497,335.27	235,758,636.27
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	0.00	6,183,762.37	6,183,762.37	0.00	3,877,928.42	3,877,928.42
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	-28,195,449.67	-530,814.89	-28,726,264.56
其中：1.基金申购款	0.00	0.00	0.00	28,909,341.10	550,658.90	29,460,000.00
2.基金赎回款	0.00	0.00	0.00	-57,104,790.77	-1,081,473.79	-58,186,264.56
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	0.00	0.00
五、期末所有者权益（基金净值）	204,065,851.33	13,010,876.21	217,076,727.54	204,065,851.33	6,844,448.80	210,910,300.13

制表：梁杰媚
打印：梁杰媚

复核：

审核：
打印日期：2022-10-18

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.95363.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。

