

# 财达尊享5号集合资产管理计划

## 2022年第2季度资产管理报告

### 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招商银行股份有限公司武汉分行于2022年7月20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：财达尊享5号集合资产管理计划  
类型：集合资产管理计划  
成立日：2019年10月23日  
报告期末份额总额：226,878,344.15  
管理人：财达证券股份有限公司  
托管人：招商银行股份有限公司武汉分行

### 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	3,809,909.52
期末资产净值	230,661,173.58
期末每份额净值	1.0167
期末每份额累计净值	1.1784



## 二、业绩表现

截止2022年06月30日，本集合计划单位净值1.0167，累计单位净值1.1784，本期集合计划净值增长率1.6966%。

本集合计划2022年第二季度分红6,534,133.96元。

## 第四节 管理人报告

### 一、投资主办人简介

褚蕊，2011年加入财达证券，南京大学硕士研究生，取得基金从业资格。现任财达证券资产管理业务总部投资经理，历任财达证券固定收益部研究员、资产管理部投资经理助理，资产管理部投资经理。具有10年以上投资管理、投资研究、投资咨询等相关业务经验，具备良好的诚信记录和职业操守，最近三年没用被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚。

刘家华，2016年加入财达证券，华东师范大学金融硕士，取得基金从业资格。现任财达证券资产管理业务总部投资经理，历任财达证券固定收益部交易员、资产管理部投资助理。具有5年以上投资交易、投资研究、投资咨询等相关业务经验，具备良好的诚信记录和职业操守，最近三年未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚。

### 二、投资主办人工作报告

#### （一）二季度市场回顾和投资策略

二季度经济面临地产投资低迷、疫情冲击等多重下行压力。3月底到4月中，上海疫情爆发，经济活动放缓，供应链出现局部断裂，股市大跌，经济担忧开始升温，金融委会议之后货币政策博弈再起，利率下行。4月中到5月中，降准幅度不及预期，宽货币预期消退，同时上海疫情出现拐点，利率再度上行。与此同时资金利率大幅下行，带动短端利率开始走低，曲线陡峭化。5月中到5月底，4月社融数据坍塌，全国稳大盘会议之后基本面担忧加剧，同时资金面继续宽松，利率再度下探。进入6月后经济小复苏，利率缓慢上行。信用债方面，二季度经历了资产荒，3年内信用债收益率下行明显。

二季度组合整体采取了稳健的投资策略，保持了适中杠杆和久期，精选个券，整体运行平稳。

#### （二）三季度市场展望和投资策略

三季度随着疫情的逐渐缓解、稳增长政策的落地，经济即将步入小复苏阶段，实体经济活力逐步恢复。货币政策方面，在整体增长压力较大的宏观背景下，预计流动性继续保持宽

松，但需警惕边际变化。另外需要关注财政政策的变化。信用债方面我们依然保持票息策略，谨慎下沉。

在投资策略上，我们将关注资金面和政策面变化，保持一定杠杆水平，控制组合久期，灵活调整投资策略，以获取稳定回报。

## 第五节 托管人报告

### 财达尊享5号集合资产管理计划 2022年第二季度托管人报告

财达证券股份有限公司：

托管人声明,在本报告期内,资产托管人——招商银行股份有限公司武汉分行严格遵守有关法律法规、托管人签署的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。

招商银行股份有限公司武汉分行

2022年7月20日



分  
105

## 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	206,092.79	0.0893%
股票	-	-
债券	299,880,568.22	130.0091%
基金	-	-
买入返售金融资产	-	-
其他	3.45	0.0001%
资产总值合计	300,086,664.46	130.0985%

（注：合计和汇总可能存在尾差。）

### 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（张）	市值（元）	占净值比例（%）
1	150877.SH	18 民泰债	290,000	30,302,876.71	13.1374
2	177029.SH	20 贵溪 01	200,000	20,869,041.1	9.0475
3	162333.SH	19 南开 01	200,000	20,705,693.15	8.9767
4	177952.SH	21 靖投 01	200,000	20,505,753.42	8.8900
5	177963.SH	21 润城 01	200,000	20,379,972.6	8.8354
6	178630.SH	21 恒润 01	200,000	20,150,794.52	8.7361
7	196577.SH	21 任丘 01	100,000	10,614,268.49	4.6017
8	178314.SH	21 景旅 02	100,000	10,572,438.36	4.5836
9	196947.SH	21 景旅 03	100,000	10,525,698.63	4.5633
10	032100693.IB	21 牟中发展 PPN001	100,000	10,251,873.97	4.4445

### 五、期末市值占集合计划资产净值前十名债券逆回购明细

本集合计划报告期末未持有债券逆回购。

### 六、期末市值占集合计划资产净值前十名权证明细

本集合计划报告期末未持有权证。

### 七、投资组合报告附注

1  
2  
3  
4  
5  
6  
7  
8  
9  
10

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 集合计划份额变动

### 一、集合计划份额变化情况

2022年6月30日

单位：份

期初份额总额	213,024,063.50
报告期内净参与份额	24,497,922.67
红利再投资份额	-
报告期内净退出份额	10,643,642.02
报告期末份额总额	226,878,344.15

## 第八节 重要事项提示

截止2022年06月30日，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。

## 第九节 信息披露的查阅方式

信息披露网址：[www.s10000.com](http://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。

