

诚通新财富 50 号集合资产管理计划

2023 年第二季度资产管理报告

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 2023 年 7 月 12 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 2023 年 4 月 1 日起至 2023 年 6 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，十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：上半年国内经济基本面延续修复态势，一季度修复速度较快，随后斜率开始放缓。货币政策强调加强逆周期调节，6月央行降息10bp。债券收益率整体呈现先上后下格局。年初在经济修复预期下，收益率向上调整，进入二季度经济弱现实格局叠加央行降息，带动收益率持续下行。展望三季度国内基本面下行压力短期或难以缓解，需要货币总量在下一阶段保持相对宽松，债券市场面临的大环境较为有利。未来一个月仍是政策落地的窗口期，市场博弈政策预期变化的逻辑未变，长端依然面临政策不确定性影响，跨季结束后资金面延续宽松对中短端向下形成牵引。产品操作以短久期品种为主，关注信用债票息品种和高等级债券的杠杆套利空间。

权益市场：2023年上半年，A股主要股指涨跌不一，分化明显。科创50指数上涨幅度最大，达到4.71%，上证指数、万得全A涨幅均超3%。创业板指下跌幅度最大，达到5.61%，上证50累计跌幅为5.43%，沪深300跌幅为-0.75%。行业层面分化也较大，AI相关软件与服务业涨幅超30%、电信服务、技术硬件与设备、媒体行业涨幅居前，消费者服务、房地产行业表现垫底。整体来说，放开后市场经历了强预期弱现实的预期摆动，在没有政策强刺激条件下，居民消费、政府投资可能均面临相对较弱的环境，出口受海外的去库存周期影响高位回落。展望下半年经济有望在底部企稳，伴随ppi止跌，gdp名义增长有望重回上行周期，目前指数本身已经包含大部分弱现实的预期，整体风险不大，结构性机会主要在高红利个股、科技类题材和去库存周期接近尾声的出口股。

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	2023年4月1日—2023年6月30日
1	本期利润（元）	60,336.97
2	本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额（元）	47,668.04
3	期末资产管理计划份额（份）	4,473,701.45
4	期末资产管理计划资产净值（元）	5,209,993.32
5	期末单位资产管理计划资产净值（元）	1.1646
6	期末累计单位资产管理计划资产净值（元）	1.3246

3.2 产品净值表现

阶段	净值增长率
2023年第二季度	1.1728%

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
4,473,701.45	0.00	0.00	4,473,701.45

4 资产管理计划投资组合报告

4.1 资产组合情况

日期：2023年6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	778,151.64	14.76%
股票投资	627,346.00	11.90%
债券投资	3,864,606.01	73.32%

基金投资	0.00	0.00%
其他资产	1,090.88	0.02%
资产合计	5,271,194.53	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	162379.SH	19 淮建 02	10,000	1,036,600.00	19.90%
2	250265.SH	23 驻投 D3	10,000	1,008,000.00	19.35%
3	143727.SH	18 津投 04	7,000	700,490.00	13.45%
4	019694.SH	23 国债 01	5,000	500,700.00	9.61%
5	150797.SH	18 黄交 01	5,000	499,350.00	9.58%

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	601985.SH	中国核电	10,000	70,500.00	1.35%
2	600028.SH	中国石化	10,000	63,600.00	1.22%
3	601728.SH	中国电信	10,000	56,300.00	1.08%
4	600079.SH	人福医药	2,000	53,880.00	1.03%
5	601766.SH	中国中车	8,000	52,000.00	1.00%

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	3,244,440.00	62.27%
	国债	500,700.00	9.61%

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：北京市朝阳区东三环北路 27 号楼 12 层

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。

