

财达证券睿达 5 号集合资产管理计划
2023 年第三季度资产管理报告



管理人：财达证券股份有限公司

托管人：兴业银行股份有限公司

报告期间：2023 年 7 月 1 日-2023 年 9 月 30 日

目 录

§ 1 重要提示.....	3
§ 2 集合计划简介.....	3
§ 3 主要财务指标、净值表现及收益分配情况.....	3
3.1 主要财务指标.....	3
3.2 净值表现.....	4
3.3 收益分配情况.....	4
§ 4 管理人报告.....	4
4.1 投资经理简介.....	4
4.2 管理人对报告期内本集合计划运作合规守信情况的说明.....	4
4.3 管理人对报告期内本集合计划的风险控制报告.....	4
4.4 报告期内本集合计划的投资策略和运作分析及市场简要展望.....	5
§ 5 投资组合报告.....	5
5.1 期末资产组合情况.....	5
5.2 期末按公允价值占资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	6
5.3 期末按公允价值占资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细.....	6
5.4 本报告期投资基金情况.....	6
5.5 报告期末本集合计划投资股指期货、商品期货、国债期货的情况说明.....	6
5.6 报告期末本集合计划投资金融衍生品的情况说明.....	6
5.7 本集合计划运用杠杆情况.....	6
5.8 本集合计划投资关联方发行的或者承销期内承销的证券的说明.....	7
5.9 投资组合报告附注或其他描述（如有）.....	7
§ 6 管理费、托管费、业绩报酬（如有）等费用的计提基准、计提方式和支付方式.....	7
§ 7 本集合计划份额变动.....	8
7.1 本报告期份额变动情况.....	8
7.2 本报告期管理人董事、监事、从业人员及其配偶、控股股东、实际控制人或者其他关联方参与本集合计划情况.....	8
§ 8 重大事件揭示.....	8
8.1 投资经理变更.....	8
8.2 一般关联交易及重大关联交易.....	8
8.3 本报告期对本集合计划发生的重大影响事件.....	8
§ 9 备查文件目录.....	9
9.1 备查文件目录.....	9
9.2 存放地点.....	9
9.3 查阅方式.....	9

§ 1 重要提示

本集合计划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，保证报告内容的真实性、准确性和完整性。

本集合计划托管人根据本集合计划合同规定复核了本报告中的主要财务指标、净值表现、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。

本集合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，但不保证本集合计划一定盈利，也不保证最低收益。

本集合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集合计划的合同、说明书、风险揭示书等文件。

本报告中财务资料未经审计。

本报告中的内容由管理人负责解释。

本报告期自 2023 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§ 2 集合计划简介

集合计划名称	财达证券睿达 5 号集合资产管理计划
产品类型	固定收益类集合资产管理计划
集合计划成立日期	2022/8/17
集合计划合同存续期	5 年
集合计划风险等级	中低风险（R2）的产品
推广对象	适合谨慎型（C2）（含）以上投资者
管理人	财达证券股份有限公司
托管人	兴业银行股份有限公司
注册登记机构	财达证券股份有限公司

§ 3 主要财务指标、净值表现及收益分配情况

3.1 主要财务指标

科目	金额（单位：元）
实收资本	372,953,761.56
期末本集合计划资产净值	382,105,245.71
期末本集合计划份额净值	1.0245
期末本集合计划份额累计净值	1.0645

报告期份额累计净值增长率	1.6520%
--------------	---------

注：期末份额净值=期末本集合计划资产净值÷期末本集合计划份额

期末份额累计净值=期末本集合计划份额净值+每份本集合计划份额累计分红

报告期份额累计净值增长率=（期末累计净值-期初累计净值）/期初累计净值

3.2 净值表现

截至本报告期末，本集合计划份额净值为 1.0245 元，份额累计净值为 1.0645 元。本报告期份额累计净值增长率为 1.6520%。

3.3 收益分配情况

报告期内，本集合计划 2023 年 9 月 5 日进行了收益分配，总分红金额 32,761,839.40 元（含业绩报酬）。

§ 4 管理人报告

4.1 投资经理简介

曲雯慧：财达证券股份有限公司北京资管部投资经理，无兼职情况。高丽大学经济学硕士，具备证券从业资格、基金从业资格，并已在证券投资基金业协会完成注册。曾任中航证券资产管理总部交易员、投资经理助理、交易主管，2022 年加入财达证券，目前任财达睿达系列等多支集合资产管理计划投资主办。

本集合计划投资经理，最近三年未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚。

4.2 管理人对报告期内本集合计划运作合规守信情况的说明

本报告期内，财达证券股份有限公司作为本集合计划管理人，严格依据法律法规、资产管理合同的约定，本着诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用本集合计划资产，为本集合计划持有人谋求最大利益，无损害持有人利益的行为。本集合计划投资组合符合有关法律法规及资产管理合同的约定。

4.3 管理人对报告期内本集合计划的风险控制报告

本报告期内，财达证券股份有限公司作为本集合计划管理人，始终按照有关法律法规、公司制度和本集合计划资产管理合同的要求，对本集合计划进行运作管理，通过风

险监测和预警机制及时发现运作过程中可能出现的风险状况。本集合计划的投资决策、投资交易程序、投资权限管理等各方面均符合有关规定要求，未出现异常交易、操纵市场的现象，未发现内幕交易情况。

4.4 报告期内本集合计划的投资策略和运作分析及市场简要展望

三季度债券市场整体低位窄幅震荡，基本面在7月看到阶段性底部，8月中下旬10年期国债快速向下突破2.6%，但又迅速反弹，9月债市小幅回调，整体窄幅震荡。基本面走弱叠加稳增长政策预期降温驱动该阶段利率下行。7月上旬央行公布的6月金融数据超市场预期，但是居民中长期贷款仍然偏弱，债市对此反应不大。进入7月中旬，统计局公布的6月和二季度经济数据低于市场预期，经济依然偏弱。8月15日降息落地后，资金价格反而边际回升，政府债券发行量增加，以及降息后银行冲贷这是8月降息后资金面收敛的重要原因。进入9月，虽然央行降准呵护流动性，但由于政府债券供给量依然处于高位，并且信贷在季末月份冲量。因而9月资金面进一步收敛，资金面收敛直接导致债市调整。

展望四季度，消费和投资仍承压，宏观经济或处于反复筑底过程，利率大幅上行概率不高，债市或维持区间震荡走势。银行信贷投放仍是宽信用主基调，专项债供给和一揽子化债方案落地后的特殊再融资债券发行等将扩大债市资金缺口，但货币政策工具仍有使用空间。另一方面，考虑到防止资金空转和汇率维稳等因素，流动性亦不会回到宽松局面，预计资金利率维持在政策利率上方震荡。

§ 5 投资组合报告

5.1 期末资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占总资产的比例（%）
1	银行存款	549,045.48	0.14%
2	结算备付金	1,474,487.63	0.39%
3	存出保证金	16,785.08	0.00%
4	交易性金融资产	362,212,652.45	94.65%
	其中：股票投资	0.00	0.00%
	债券投资	362,212,652.45	94.65%
	基金投资	0.00	0.00%

	权证投资	0.00	0.00%
	资产支持证券	0.00	0.00%
5	衍生金融资产	0.00	0.00%
6	买入返售金融资产	14,012,567.89	3.66%
7	其他资产	4,405,569.31	1.15%
	合计	382,671,107.84	100.00%

注：其他资产包括应收证券清算款、应收利息、应收股利、应收申购款等。

5.2 期末按公允价值占资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占资产净值比例（%）
1	102282138.IB	22 河钢集 MTN012	700,000	70,206,080.00	18.3735
2	019659.SH	21 国债 11	500,000	50,458,050.00	13.2053
3	220208.IB	22 国开 08	500,000	50,242,750.00	13.1489
4	012300217.IB	23 武清国资 SCP001	500,000	50,051,500.00	13.0989
5	101901551.IB	19 天津港 MTN001	300,000	30,458,580.00	7.9713

5.3 期末按公允价值占资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

本报告期末未持有股票。

5.4 本报告期投资基金情况

本报告期末未持有基金。

5.5 报告期末本集合计划投资股指期货、商品期货、国债期货的情况说明

本报告期末未持有期货。

5.6 报告期末本集合计划投资金融衍生品的情况说明

本报告期末未参与金融衍生品投资。

5.7 本集合计划运用杠杆情况

截至报告期末，本集合计划杠杆倍数（总资产/净资产）为【100.15%】。

报告期，本集合计划严格按照合同要求开展投资，控制杠杆比例，未出现违反合同约定的情况。

5.8 本集合计划投资关联方发行的或者承销期内承销的证券的说明

本报告期内，本集合计划 2023 年 9 月 7 日二级买入 23 河北国控 MTN002 票面金额 1500 万元；2023 年 9 月 20 日二级卖出 22 河钢集 MTN012 票面金额 3000 万元；关联交易均已进行公告披露。

5.9 投资组合报告附注或其他描述（如有）

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 6 管理费、托管费、业绩报酬（如有）等费用的计提基准、计提方式和支付方式

费用明细	计提基准	计提方式	支付方式
管理费	$H = E \times 【0.3】\% \div 365$ H 为每日应计提的管理费 E 为前一日的集合计划资产净值	每日计提	按月支付
托管费	$H = E \times 【0.01】\% \div 365$ H 为每日应计提的托管费 E 为前一日的集合计划资产净值	每日计提	按月支付
业绩报酬 （如有）	具体业绩报酬计提基准以产品实际发行时为准，业绩报酬计提基准在发行前及开放前由管理人确定并在管理网站发布公告。 每笔参与份额以上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日（当业绩报酬计提基准调整时，为公告的业绩报酬计提基准调整日；如该笔参与份额不存在上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日，则推广期参与的为计划成立日，存续期参与的为份额参与申请日）到本次业绩报酬计提日的年化收益率，作为计提业绩报酬的基准。	若年化收益率 $R \geq$ 业绩报酬计提基准，则计提比例为 40%，业绩报酬（Y）的计提公式为： $Y = N \times P_0^* \times (R - \text{业绩报酬计提基准}) \times 40\% \times D \div 365$ $Y = \text{业绩报酬}$ ； $N = \text{业绩报酬计提日委托人每笔符合业绩报酬计提条件的份额}$ ； $P_0^* = \text{上一个发生业绩报酬计提日的计划单位净值}$ 。	业绩报酬提取频率不超过每 6 个月一次。因投资者退出资产管理计划，按照资产管理合同的约定提取业绩报酬的，不受前述提取频率的限制。

§ 7 本集合计划份额变动

7.1 本报告期份额变动情况

单位：份

本报告期期初份额总额	817,148,629.79
本报告期总申购份额	5,805,131.77
减：本报告期总赎回份额	450,000,000.00
本报告期期末份额总额	372,953,761.56

注：总申购份额含红利转投。

7.2 本报告期管理人董事、监事、从业人员及其配偶、控股股东、实际控制人或者其他关联方参与本集合计划情况

项目	持有份额总数（份）	占总份额比例
持有本集合计划	19,914,883.03	5.64%

经对本集合计划账户进行监控，未发现存在因管理人关联方参与本集合计划导致的不公平对待投资者行为。

§ 8 重大事件揭示

8.1 投资经理变更

本报告期内，未发生投资经理变更情况。

8.2 一般关联交易及重大关联交易

本报告期内，本集合计划 2023 年 9 月 7 日二级买入 23 河北国控 MTN002 票面金额 1500 万元；2023 年 9 月 20 日二级卖出 22 河钢集 MTN012 票面金额 3000 万元；关联交易均已进行公告披露。

8.3 本报告期对本集合计划发生的重大影响事件

本报告期内，未发生其他涉及投资者权益的重大事项。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1. 《财达证券睿达5号集合资产管理计划资产管理合同》、说明书、风险揭示书；
2. 管理人业务资格批复、营业执照；
3. 本集合计划各项公告。

9.2 存放地点

备查文件存放于管理人办公场所：河北省石家庄市自强路35号

9.3 查阅方式

投资者可登录管理人网站www.95363.com查询。

客户服务电话：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疑问，可咨询管理人财达证券股份有限公司。

