

诚通新财富 50 号集合资产管理计划
2023 年第三季度资产管理报告

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10月17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7月1日起至2023年9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，13年投研经验，北京大学药学经济学双学士，北京大学药剂学硕士，2012年加入新时代证券资产管理总部，负责权益类相关产品的投资管理工作。现任诚通证券资产管理总部权益投资负责人。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年加入新时代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。所管理的产品多次获得“Wind万得”券商集合资管产品业绩榜前10名。

2.3 投资主办人工作报告

债券市场：三季度国内经济修复不及预期，生产端边际好转，但需求仍显不足。8月底以来，稳增长政策陆续出台并落实，经济开始呈现触底回升的特征，后续经济复苏的持续性仍有待观察。资金方面，受到信贷放量和政府债券发行提速等因素的影响，进入8月份银行间资金面逐步由宽松向中性偏松转化，资金利率中枢有所抬升。现券方面，长端无风险利率整体呈现先下后上格局，在基本面弱化和超预期降息带动下，长端利率在8月份下行至年内最低，随后认房不认贷等稳增长政策陆续出台，市场止盈情绪浓厚，同时基本面呈现弱复苏状态，利率开始回调。截至2023年9月28日，10Y国债收益率收于2.68%，较6月底上行4bp左右。展望后市在经济弱复苏预期和货币政策中性宽松的指导下预计债市中短期内维持区间窄幅震荡。节后内蒙古、天津启动特殊再融资债发行，用于偿还存量债务，一揽子化债下城投债依然是比较好的品种选择。

权益市场：23年3季度沪深300下跌3.98%，上证50上涨0.6%，创业板指下跌9.53%，wind全A下跌4.33%。北向资金大幅流出A股且公募基金三季度销售低迷导致市场整体比较惨淡。但政策层面已经明显转向，包括政治局会议明确提出活跃资本市场，提振投资者信心，LPR和MLF分别调降10bp与15bp，住房政策调整，规范再融资和减持新规的出台等，呵护市场的举动频频出台。与此同时，外围的金融条件还在继续收紧，长端美债利率过去3个月上行100bp至4.8%。同时，美联储可能在较高的利率水平维持较长时间，给金融市场施压。整体上，估值层



面对于股市的压力依然存在，但基本面层面随着经济逐步企稳，各行业补库陆续到来，PPI 逐步由负转正，企业盈利有望企稳回升。50 号三季度依然坚守盈利稳定的高股息个股，同时增持了部分顺周期行业个股，取得了相对稳健的收益。展望四季度，我们认为如果金融条件依然趋紧的环境下，权益比较难有趋势性机会，但经济转型依然是市场重点关注的领域，AI、医药、智能驾驶领域是我们重点关注的结构性投资机会领域。

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 7 月 1 日—2023 年 9 月 30 日
1	本期利润（元）	53,450.90
2	本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额（元）	54,231.65
3	期末资产管理计划份额（份）	5,340,803.11
4	期末资产管理计划资产净值（元）	6,273,444.22
5	期末单位资产管理计划资产净值（元）	1.1746
6	期末累计单位资产管理计划资产净值（元）	1.3346

3.2 产品净值表现

阶段	净值增长率
2023 年第三季度	0.8587%

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	867,101.66	0.00	5,340,803.11

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9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	71,349.04	1.13%
股票投资	681,964.00	10.78%
债券投资	4,723,582.19	74.64%
基金投资	0	0.00%
其他资产	851,479.44	13.45%
资产合计	6,328,374.67	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	1,040,700.00	16.59%
2	250265.SH	23 驻投 D3	10,000	1,008,800.00	16.08%
3	196019.SH	22 港投 01	10,000	1,005,600.00	16.03%
4	251983.SH	23 景旅 D5	10,000	1,003,600.00	16.00%
5	150797.SH	18 黄交 01	5,000	499,900.00	7.97%

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（元）	市值占净值比例
1	601985.SH	中国核电	10,000	73,000.00	1.16%
2	002158.SZ	汉钟精机	2,500	62,100.00	0.99%
3	600028.SH	中国石化	10,000	60,700.00	0.97%
4	002430.SZ	杭氧股份	1,800	58,446.00	0.93%
5	600079.SH	人福医药	2,400	58,056.00	0.93%

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	4,558,600.00	72.67%

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内未进行分红。

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

本资产管理计划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

本资产管理计划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。

