

财达证券睿达景明灵动 1 号集合资产管理计划
2023 年年度资产管理报告

管理人：财达证券股份有限公司

托管人：江苏银行股份有限公司北京分行

报告期间：2023 年 5 月 16 日-2023 年 12 月 31 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.....	5
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	财务会计报告.....	6
5.1	资产负债表.....	6
5.2	所有者权益表.....	7
5.3	损益表.....	7
§ 6	投资组合报告.....	8
6.1	期末资产组合情况.....	8
6.2	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.....	9
6.3	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.....	9
6.4	本报告期投资基金情况.....	9
6.5	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.....	9
6.6	报告期末本集合计划投资金融衍生品的情况说明.....	9
6.7	本集合计划运用杠杆情况.....	9
6.8	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.....	10
6.9	投资组合报告附注或其他描述（如有）.....	10
§ 7	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.....	10
§ 8	本集合计划份额变动.....	11
8.1	本报告期份额变动情况.....	11
8.2	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.....	11
§ 9	重大事件揭示.....	11
9.1	投资经理变更.....	11
9.2	一般关联交易及重大关联交易.....	11
9.3	本报告期对本集合计划发生的重大影响事件.....	11
§ 10	备查文件目录.....	12
10.1	备查文件目录.....	12
10.2	存放地点.....	12
10.3	查阅方式.....	12

§ 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。

本报告中财务资料已经审计。

本报告中的内容由管理人负责解释。

本报告期自 2023 年 5 月 16 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 集合计划简介

集合计划名称	财达证券睿达景明灵动1号集合资产管理计划
产品类型	混合类集合资产管理计划
集合计划成立日期	2023/5/16
集合计划合同存续期	9 年
集合计划风险等级	中高风险（R4）的产品
推广对象	适合积极型（C4）（含）以上投资者
管理人	财达证券股份有限公司
托管人	江苏银行股份有限公司北京分行
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	1,320,108.90
期末本集合计划资产净值	1,366,641.77

期末本集合计划份额净值	1.0352
期末本集合计划份额累计净值	1.0352
报告期份额累计净值增长率	3.5200%

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)/期初单位净值

3.2 净值表现

截至本报告期末,本集合计划份额净值为【1.0352】元,份额累计净值为【1.0352】元。本报告期份额累计净值增长率为【3.5200】%。

3.3 收益分配情况

报告期内,本集合计划未进行收益分配。

§ 4 管理人报告

4.1 投资经理简介

常知常：财达证券股份有限公司北京资管部投资经理，无兼职情况。新加坡南洋理工大学应用经济学硕士，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。历任神州牧基金交易员、研究员，中航证券资产管理总部投资经理助理，2022年加入财达证券，目前任景明系列多支集合资产管理计划投资主办。

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遵规守信情况的说明

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

四季度权益市场主要受强政策刺激与弱经济影响。11 月经济总体平稳，中国规模以上工业增加值同比增长 6.6%，较上月增速大幅扩大 2.0 个百分点；CPI 同比下行 0.5%，较上月的-0.2%继续下滑；PPI 同比下降 3.0%，降幅较上月继续扩大 0.4 个百分点。四季度分母端利率下降。四季度，10 年期中国国债到期收益率先升后降，截至 2023 年 12 月 29 日报 2.5553%，较三季度末下降 11.98BP；10 年期美国国债到期收益率平稳波动，2023 年 12 月 29 日收报 3.88%，较三季度末降低 71BP。截至 2023 年末，全 A 指数的 PE 为 16.67 倍，处于 2010 年以来 33.47%分位数水平，较三季度末小幅下降；其 PB 为 1.47 倍，处于 2010 年以来 2.24%分位数水平，也较三季度末小幅下降。A 股当前整体估值水平处于历史中低位置。从交易情绪来看，四季度投资者情绪稍显低迷，日均成交额呈现先升后降态势。10 月、11 月、12 月日均成交额分别为 8268.51 亿元、8845.45 亿元、7827.84 亿元，日均换手率分别为 1.041%、1.044%、1.046%。四季度成交额与指数走势较为一致，即成交额上升时，指数上升；成交额下降时，指数下降。放量上涨、缩量下跌，表明多空博弈中，多头略微占优，市场底部特征明显。从行业来看，四季度总体上行业股指跌多涨少。冬储补库带来需求提升，叠加安全检查升级下供应面偏紧，煤炭行业迎来上涨行情，四季度涨幅达 4.18%；华为产业链带动下，电子行业表现较好，四季度收涨 3.92%；房地产市场处于下行周期，地产链整体回调，房地产和建筑材料行业跌幅近 15%，建筑装饰行业下跌 8.55%；大消费板块表现分化，农林牧渔行业小幅上涨 1.73%，美容护理、商贸零售等跌幅居前。

展望 24 年一季度，2024 年一季度 A 股市场包含较多利好因素。一是国内经济增速企稳回升，工业增加值增速持续扩大，2023 年年内出台众多稳经济及促产业发展等扩大

内需政策，在利好政策刺激下，稳增长实现可能性较大。由于政策施行存在一定时滞，2024年一季度有望逐步显现，利好A股市场波动上行。二是国内货币政策继续宽松的预期较强，美联储加息周期基本结束，2024年一季度外部环境有望继续巩固，A股估值上升可能性较大。结合春节背景，流动性相对宽松，在利好因素催化下，资金入场将更积极，北向资金净流出幅度有望收窄。2024年一季度叠加环境、政策驱动及春节躁动等因素，A股大盘收涨可能性较大，但整体或呈波动上行态势。需持续关注经济数据、重要政策会议以及相关产业发展机会，尤其是2024年春节前高股息配置策略。

§ 5 财务会计报告

5.1 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	23,634.21	0.00	短期借款	0.00	0.00
结算备付金	20,592.37	0.00	交易性金融负债	0.00	0.00
存出保证金	652.49	0.00	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	0.00	0.00
交易性金融资产	1,254,618.82	0.00	应付清算款	43,502.80	0.00
买入返售金融资产	69,985.09	0.00	应付赎回款	0.00	0.00
发放贷款和垫款			应付管理人报酬	2,012.84	0.00
债权投资	0.00	0.00	应付托管费	67.05	0.00
其他债权投资			应付销售服务费	0.00	0.00
应收清算款	54,063.71	0.00	应付投资顾问费	0.00	0.00
应收利息	0.00	0.00	应交税费	1,157.43	0.00
应收股利	0.00	0.00	应付利息	0.00	0.00
应收申购款	0.00	0.00	应付利润	0.00	0.00
其他资产	0.00	0.00	其他负债	10,164.80	0.00
			负债合计	56,904.92	0.00
			所有者权益		
			实收资金	1,320,108.90	0.00
			其他综合收益		
			未分配利润	46,532.87	0.00

			所有者权益合计	1,366,641.77	0.00
资产总计	1,423,546.69	0.00	负债和所有者权益总计	1,423,546.69	0.00

5.2 所有者权益表

项目	本期金额				上期金额			
	实收基金	综合收益	未分配利润	所有者权益合计	实收基金	综合收益	未分配利润	所有者权益合计
一、上期期末余额	11,320,558.90		0.00	11,320,558.90	0.00		0.00	0.00
加：会计政策变更								
前期差错更正								
其他								
二、本期期初余额	11,320,558.90		0.00	11,320,558.90	0.00		0.00	0.00
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-10,000,450.00		46,532.87	-9,953,917.13	0.00		0.00	0.00
(一) 综合收益总额			46,532.87	46,532.87			0.00	0.00
(二) 产品持有人申购和赎回	-10,000,450.00		0.00	-10,000,450.00	0.00		0.00	0.00
其中：1、产品申购	0.00		0.00	0.00	0.00		0.00	0.00
2、产品赎回	-10,000,450.00		0.00	-10,000,450.00	0.00		0.00	0.00
(三) 利润分配			0.00	0.00			0.00	0.00
(四) 其他综合收益 结转留存收益								
四、本期期末余额	1,320,108.90		46,532.87	1,366,641.77	0.00		0.00	0.00

5.3 损益表

项目	本期金额	上年金额
一、收入	63,511.29	0.00
1. 利息收入	12,558.41	0.00
2. 投资收益（损失以“-”填列）	33,272.74	0.00

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）	17,680.14	0.00
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	16,978.42	0.00
1. 管理人报酬	6,136.55	0.00
2. 托管费	204.48	0.00
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	20.89	0.00
其中：卖出回购金融资产利息支出	20.89	0.00
6. 信用减值损失	0.00	0.00
7. 税金及附加	216.50	0.00
8. 其他费用	10,400.00	0.00
三、利润总额	46,532.87	0.00
减：所得税费用	—	—
四、净利润	46,532.87	0.00
五、其他综合收益		
六、综合收益总额	46,532.87	0.00

§ 6 投资组合报告

6.1 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	23,634.21	1.66%
2	结算备付金	20,592.37	1.45%
3	存出保证金	652.49	0.05%
4	交易性金融资产	1,254,618.82	88.13%
	其中：股票投资	1,048,120.00	73.63%
	债券投资	206,498.82	14.51%
	基金投资	—	0.00%
	权证投资	—	0.00%
	资产支持证券	—	0.00%
5	衍生金融工具	—	0.00%
6	买入返售金融资产	69,985.09	4.92%

7	其他资产	54,063.71	3.80%
	合计	1,423,546.69	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。

6.2 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	251820.SH	23 商建 04	2,000	200,478.00	14.6694
2					
3					
4					
5					

6.3 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

序号	股票代码	股票名称	数量（张）	公允价值（元）	占资产净值比例（%）
1	603922.SH	金鸿顺	10,900	287,978.00	21.0719
2	000702.SZ	正虹科技	37,700	236,379.00	17.2963
3	300270.SZ	中威电子	27,300	210,756.00	15.4215
4	600262.SH	北方股份	7,200	138,600.00	10.1416
5	600455.SH	博通股份	5,000	124,250.00	9.0916

6.4 本报告期投资基金情况

本报告期末未持有基金。

6.5 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。

6.6 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。

6.7 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【104.16%】。

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。

6.8 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，本集合计划无投资于管理人、托管人关联方发行的或者承销期内承销的证券的情况。

6.9 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。

§7 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	$H = E \times \text{【 } 0.60 \text{】} \% \div 365$ 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	按季支付
托管费	$H = E \times \text{【 } 0.02 \text{】} \% \div 365$ 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	按季支付
业绩报酬 (如有)	管理人在本集合计划发行前或开放前确定业绩报酬计提基准，并在管理人网站公告；管理人在业绩报酬计提基准调整时，公告新的业绩报酬计提基准，在下次业绩报酬计提基准调整之前，都以该业绩报酬计提基准计提业绩报酬。 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，下同）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 20%，业绩报酬（Y）的计提公式为： $Y = N \times P_0^* \times (R - \text{业绩报酬计提基准}) \times 20\% \times D \div 365$ Y=业绩报酬；N=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^* =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。

§ 8 本集合计划份额变动

8.1 本报告期份额变动情况

单位：份

本报告期期初份额总额	11,320,558.90
本报告期总申购份额	0.00
减：本报告期总赎回份额	10,000,450.00
本报告期期末份额总额	1,320,108.90

注：总申购份额含红利再投

8.2 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	0.00	0.00%

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。

§ 9 重大事件揭示

9.1 投资经理变更

本报告期内，未发生投资经理变更情况。

9.2 一般关联交易及重大关联交易

本报告期内，未发生重大关联交易。

9.3 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。

§ 10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

1. 《财达证券睿达景明灵动1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。

10.2 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

10.3 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。

财达证券股份有限公司
二〇二四年四月二十二日

