

财达证券睿达双季悦享 5 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：招商银行股份有限公司北京分行

报告期间：2023 年 3 月 28 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遵规守信情况的说明 | 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 | 8 |
| § 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 3 月 28 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 集合计划简介

| | |
|-----------|----------------------|
| 集合计划名称 | 财达证券睿达双季悦享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 | 2023/3/28 |
| 集合计划合同存续期 | 9 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 | 招商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 | 70,674,927.58 |
| 期末本集合计划资产净值 | 75,328,666.14 |

| | |
|---------------|---------|
| 期末本集合计划份额净值 | 1.0658 |
| 期末本集合计划份额累计净值 | 1.0658 |
| 报告期间份额累计净值增长率 | 6.5800% |

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

报告期间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【1.0658】元,份额累计净值为【1.0658】元。本报告期间份额累计净值增长率为【6.5800】%。

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

陈南霖：财达证券股份有限公司北京资管部高级投资经理，无兼职情况。中央财经大学投资学硕士，投资学学士，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。6年固收投研从业经验，曾任中航证券资管业务部投资经理，2022年加入财达证券，目前任财达证券睿达系列等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

2023年国内中枢利率在经济弱预期中不断下行，国内经济在恢复常态化运行后，面临内生动力不强、内需不足等挑战，但长期向好的基本面没有改变。股市方面，2023年上证指数平均市盈率从13.51降至11.84，指数全年先涨后跌，上证全年下跌3.75%，较2022年全年跌幅收窄。从全年数据来看，2023年A股的热门概念题材，主要围绕科技相关领域展开。2023年债券市场的整体走势主要围绕着经济修复进程和政策预期进行，从2023年年初到2月末，在疫情防控机制优化以后，经济活动快速升温，市场对疫后经济复苏具有较强预期，叠加天量信贷对债券市场形成一定压力，长债利率有所上行并高位震荡。3月初到8月中下旬，经济基本面弱现实，叠加降息降准等宽货币举措，降准降息落地，利率持续回落。8月中下旬至11月末，在年内两次降息过后，市场将其视作利多出尽的信号，同时叠加财政发力、政府债券供给压力，资金面偏紧，利率回升。增发一万亿国债的消息，并没有明显转变市场的经济增长预期，市场开始博弈配合宽财政的宽货币政策。11月末至年底，稳增长政策力度被市场预期逐步消化，宽货币信号及预期较强，银行存款利率的下调带来较强的MLF降息预期，10年期国债收益率在年末下行至2.57%左右。信用债市场，2023年债市“资产荒”延续，叠加城投化债行情演绎，主要期限、评级城投债收益率和信用利差整体下行，8月后受政策影响快速压缩，至年末均位于历史较低水平。

展望2024年，市场普遍认为债市收益率或将在经济增速放缓、宽松宏观政策环境等因素的影响下震荡下行。2024年，我国经济尚处于增速换挡期和新旧动能转换期，经济增速回升基础尚未稳固，外部环境的复杂性、严峻性、不确定性上升。股市方面，市

场对股市普遍持谨慎乐观态度，导致 A 股在 2023 年表现疲弱的内外因均已出现好转，但仍难掩市场的不确定性。市场多认为中期反弹或温和复苏，或许正孕育着超越预期的力量，2024 年经济稳健复苏有望成为新起点。在此背景下，货币政策中性偏宽松的定调或将持续。因而在此政策预期下，2024 年我国债券市场或将继续维持震荡格局。信用债方面，2024 年城投债市场供不应求或将延续。由于城投监管依然严格，城投债供给收缩，提前兑付节奏加快，城投债将进入存量市场，加之包括地产在内等产业债供给仍将较弱，“资产荒”或持续演绎。考虑到资产荒和化债将会延续，叠加无风险利率中枢下移，2024 年城投债收益率和信用利差总体上或将具备一定维持低位的基础，后续需密切关注政策执行力度和实际效果，持续关注政策预期差导致的估值调整风险。

§ 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 | 1,566,105.55 | 0.00 | 短期借款 | 0.00 | 0.00 |
| 结算备付金 | 23,579.77 | 0.00 | 交易性金融负债 | 0.00 | 0.00 |
| 存出保证金 | 568.26 | 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 | 4,055,343.58 | 0.00 |
| 交易性金融资 产 | 69,475,960.90 | 0.00 | 应付清算款 | 0.00 | 0.00 |
| 买入返售金融 资产 | 0.00 | 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 | 76,751.11 | 0.00 |
| 债权投资 | 0.00 | 0.00 | 应付托管费 | 1,279.17 | 0.00 |
| 其他债权投资 | | | 应付销售服务费 | 0.00 | 0.00 |
| 应收清算款 | 0.00 | 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 | 40,275.84 | 0.00 |
| 应收股利 | 0.00 | 0.00 | 应付利息 | 0.00 | 0.00 |
| 应收申购款 | 8,450,000.00 | 0.00 | 应付利润 | 0.00 | 0.00 |
| 其他资产 | 0.00 | 0.00 | 其他负债 | 13,898.64 | 0.00 |
| | | | 负债合计 | 4,187,548.3 | 0.00 |

| | | | | | |
|------|---------------|------|------------|---------------|------|
| | | | | 4 | |
| | | | 所有者权益 | | |
| | | | 实收资金 | 70,674,927.58 | 0.00 |
| | | | 其他综合收益 | | |
| | | | 未分配利润 | 4,653,738.56 | 0.00 |
| | | | 所有者权益合计 | 75,328,666.14 | 0.00 |
| 资产总计 | 79,516,214.48 | 0.00 | 负债和所有者权益总计 | 79,516,214.48 | 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 | 10,300,463.50 | | 0.00 | 10,300,463.50 | 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 | 10,300,463.50 | | 0.00 | 10,300,463.50 | 0.00 | | 0.00 | 0.00 |
| 三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列) | 60,374,64.08 | | 4,653,738.56 | 65,028,202.64 | 0.00 | | 0.00 | 0.00 |
| (一) 综合收益总额 | | | 2,000,247.91 | 2,000,247.91 | | | 0.00 | 0.00 |
| (二) 产品持有人申购和赎回 | 60,374,64.08 | | 2,653,490.65 | 63,027,954.73 | 0.00 | | 0.00 | 0.00 |
| 其中：1、产品申购 | 80,348,981.50 | | 3,301,018.50 | 83,650,000.00 | 0.00 | | 0.00 | 0.00 |
| 2、产品赎回 | -19,974,517.42 | | -647,527.85 | -20,622,045.27 | 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 | 70,674,927.58 | | 4,653,738.56 | 75,328,666.14 | 0.00 | | 0.00 | 0.00 |

5.3 损益表

| 项目 | 本期金额 | 上年金额 |
|--------------------------|--------------|------|
| 一、收入 | 2,482,933.39 | 0.00 |
| 1. 利息收入 | 13,570.50 | 0.00 |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | 1,713,783.11 | 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） | 755,579.78 | 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 | 482,685.48 | 0.00 |
| 1. 管理人报酬 | 386,159.02 | 0.00 |
| 2. 托管费 | 2,516.17 | 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 | 63,855.37 | 0.00 |
| 其中：卖出回购金融资产利息支出 | 63,855.37 | 0.00 |
| 6. 信用减值损失 | 0.00 | 0.00 |
| 7. 税金及附加 | 9,152.31 | 0.00 |
| 8. 其他费用 | 21,002.61 | 0.00 |
| 三、利润总额 | 2,000,247.91 | 0.00 |
| 减：所得税费用 | — | — |
| 四、净利润 | 2,000,247.91 | 0.00 |
| 五、其他综合收益 | | |
| 六、综合收益总额 | 2,000,247.91 | 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 | 1,566,105.55 | 1.97% |
| 2 | 结算备付金 | 23,579.77 | 0.03% |
| 3 | 存出保证金 | 568.26 | 0.00% |

| | | | |
|---|----------|---------------|---------|
| 4 | 交易性金融资产 | 69,475,960.90 | 87.37% |
| | 其中：股票投资 | - | 0.00% |
| | 债券投资 | 69,475,960.90 | 87.37% |
| | 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 | - | 0.00% |
| 7 | 其他资产 | 8,450,000.00 | 10.63% |
| | 合计 | 79,516,214.48 | 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 | 102382254.IB | 23 山西建投 MTN004 | 60,000 | 6,108,930.00 | 8.1097 |
| 2 | 102383363.IB | 23 冀中能源 MTN012A(科创票据) | 60,000 | 6,026,508.00 | 8.0003 |
| 3 | 2180444.IB | 21 孝感长兴债 | 50,000 | 5,158,890.00 | 6.8485 |
| 4 | 252264.SH | 23 西咸 02 | 50,000 | 5,136,230.00 | 6.8184 |
| 5 | 252298.SH | 23 渭南 01 | 50,000 | 5,023,980.00 | 6.6694 |

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

本报告期末未持有股票。

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【 105.56% 】。

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 | $H = E \times 【0.6】\% \div 365$ 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 | $H = E \times 【0.01】\% \div 365$ 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，在下一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 60%，业绩报酬（Y）的计提公式为： $Y = N \times P_0^* \times (R - \text{业绩报酬计提基准}) \times 60\% \times D \div 365$ 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 | 10,300,463.50 |
| 本报告期总申购份额 | 80,348,981.50 |
| 减：本报告期总赎回份额 | 19,974,517.42 |
| 本报告期期末份额总额 | 70,674,927.58 |

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，增加一名投资经理，自 2023 年 5 月 12 日起本集合计划投资经理为陈南霖、曲雯慧。

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. 《财达证券睿达双季悦享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。

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

