

财达证券鑫享月月鑫 1 号集合资产管理计划 2023 年年度资产管理报告

计划管理人：财达证券股份有限公司

计划托管人：招商银行股份有限公司天津分行

报告期间：2023年4月19日至2023年12月31日

重要提示

本报告由财达证券鑫享月月鑫1号集合资产管理计划（“本集合计划”）管理人财达证券股份有限公司（“财达证券”）编制。本集合计划托管人招商银行股份有限公司天津分行于2024年4月17日对本报告中的财务指标、净值表现、投资组合报告等内容进行了复核。

管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用本集合计划资产，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，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本集合资产管理计划说明书。

本报告相关财务资料已经审计。

本报告期间：2023年4月19日至2023年12月31日。

目录

一、 集合计划概况.....	1
1. 基本资料.....	1
2. 管理人.....	1
3. 托管人.....	2
4. 会计师事务所.....	2
二、 主要财务指标和集合资产管理计划净值表现.....	2
1. 本集合计划业绩表现.....	2
2. 主要财务指标（2023年4月19日—2023年12月31日）.....	2
三、 集合计划管理人报告.....	3
1. 集合计划投资主办人员简介.....	3
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.....	3
3. 管理人对报告期内本集合计划的风险控制报告.....	3
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.....	3
四、 托管人报告.....	5
五、 审计报告.....	6
1. 审计报告基本信息.....	6
2. 审计报告的基本内容.....	6
六、 年度财务报表.....	6
1. 资产负债表.....	6
2. 经营业绩表.....	8
3. 所有者权益变动表.....	9
七、 投资组合报告（2023年12月31日）.....	10
1. 期末资产组合情况.....	10
2. 期末按公允价值占集合计划资产净值前五名股票明细.....	10
3. 期末按公允价值占集合计划资产净值前五名基金明细(不包含货币市场基金).....	10
4. 期末按公允价值占集合计划资产净值前五名债券明细.....	10
5. 期末按公允价值占集合计划资产净值前五名债券逆回购明细.....	10
6. 期末按公允价值占集合计划资产净值前五名权证明细.....	10
7. 期末按公允价值占集合计划资产净值前五名衍生工具明细.....	11
8. 投资组合报告附注.....	11
八、 集合计划份额变动情况.....	11
九、 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
十、 重要事项提示.....	11
1. 投资经理变更.....	11
2. 一般关联交易及重大关联交易.....	11
3. 本报告期对本集合计划发生的重大影响事件.....	11
十一、 信息披露的查阅方式.....	12

一、 集合计划概况

1. 基本资料

产品名称：	财达证券鑫享月月鑫1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
成立日期：	2023年4月19日
成立规模：	人民币49,634,285.35元
存续期：	10年
投资目标：	通过对宏观经济运行、宏观经济政策及债券市场走势的前瞻性研究，追求相对稳健的收益。
投资策略：	<p>本资产管理计划首先采用战略资产配置策略，通过对宏观经济运行状况、国家财政和货币政策、资本市场资金环境的分析，预测宏观经济的发展趋势和利率政策的变化，并据此评价未来一段时间债券市场相对收益率和主要风险。在确定资产管理计划整体流动性要求、投资品种流动性强弱程度和收益创造能力大小的基础上，确定各类资产的配置比例。</p> <p>1、对宏观经济运行趋势的判断、经济政策调整的前瞻性分析，以及各类别资产的政策效应研究等，主要考虑以下几个因素：经济周期和经济环境、货币因素、政策影响因素、CPI预测分析因素、量化模型分析因素、市场气氛等。</p> <p>2、债券投资方面，综合运用久期和凸性策略、收益率曲线策略、类别选择策略和个券选择策略构建债券组合。</p>
业绩比较基准：	无
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天津分行
注册登记机构：	财达证券股份有限公司

2. 管理人

名称：财达证券股份有限公司

法人代表：翟建强

公司地址：石家庄市桥西区自强路25号庄家金融大厦24楼

邮政编码：050000

联系电话：0311-67508978

3. 托管人

名称：招商银行股份有限公司天津分行
 法人代表：潘祖荣
 通信地址：天津市河西区广东路255号、前进道9号
 邮政编码：300201
 联系电话：022-58191695

4. 会计师事务所

名称：中审众环会计师事务所（特殊普通合伙）
 执行事务合伙人：石文先、管云鸿、杨荣华
 通讯地址：武汉市武昌区水果湖街道中北路166号长江产业大厦17-18楼
 邮政编码：430077
 联系电话：027-86791215

二、 主要财务指标和集合资产管理计划净值表现

1. 本集合计划业绩表现

截止2023年12月31日，本集合计划单位净值1.0211，累计单位净值1.0501，报告期内集合计划净值增长率为5.0547%。

报告期内，本集合计划于【2023】年【10】月【18】日进行收益分配，分红金额【2,449,429.25】元（含业绩报酬），具体详见管理人网站相关公告。

2. 主要财务指标（2023年4月19日—2023年12月31日）

单位：元

本期已实现收益	2,330,979.59
本期利润	2,896,209.45
期末资产净值	81,375,911.22
期末单位份额净值	1.0211

期末单位份额累计净值	1.0501
------------	--------

注：本期已实现收益指本集合计划本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。期末单位份额累计净值含单位分红金额。本期集合计划净值增长率=（本期第一次分红或扩募前单位净值÷期初单位净值）×（本期第二次分红或扩募前单位净值÷本期第一次分红或扩募后单位净值）×……×（期末单位净值÷本期最后一次分红或扩募后单位净值）-1

三、集合计划管理人报告

1. 集合计划投资主办人员简介

刘莉：硕士，无兼职情况，具有八余年投资管理、投资研究、投资咨询等相关业务经验，已经取得基金从业资格。2011-2014：恒泰证券资产管理部交易员；2015-2017：恒泰证券资产管理部投资经理；2018至今：财达证券资产管理部投资经理。

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。

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。

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. 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

2022年底至2023年一季度，市场收益率呈明显的倒“V”型走势，尤其是

短端利率表现尤为明显。二季度，数据表现较弱，市场由强预期向弱预期演绎，银行存款利率调降，叠加资金面持续宽松，共同支持债市走强。三季度，债券市场整体表现较弱，以城投债为代表的网红区域较高收益信用债券则出现结构性行情。四季度，资金面年底如市场预期略有收紧，短端收益下行乏力，中长端则随着地方债发行结束，收益率在10-11月小幅震荡后，12月随着“双降”预期的发酵，机构开始抢跑长端。2023年，整体收益下行明显，且曲线结构走平，期限利差处于历史低位。

2023年，产品坚持稳健投资策略，结合产品开放频率控制组合久期和杠杆水平。展望未来市场，当前较高的实际利率水平对经济形成较大的收缩压力，若未来总需求仍不足，CPI持续低迷，名义利率仍有进一步下行的动力，利好债券市场。尽管当前市场收益处于较低水平，但市场曲线变化下短债仍有获取超额收益的机会。未来在维持稳健策略的同时，将更加精细化操作，关注短端各期限利差情况，随曲线变动积极调整组合资产期限结构。

四、 托管人报告

关于《财达证券鑫享月月鑫1号集合资产管理计划2023年年度报告》托管人
复核意见的回函

财达证券股份有限公司：

托管人声明,在本报告期内,资产托管人严格遵守有关法律法规、托管协议、资产管理合同/基金合同关于托管人职责的约定,尽职尽责地履行了托管职责并安全保管托管资产。

在管理人提供的各项数据和信息真实、准确、有效的前提下,在我行能够知悉和掌握的情况范围内,我行对《财达证券鑫享月月鑫1号集合资产管理计划2023年年度报告》报告中的截至报告期末财务数据进行了复核。

特此报告。



招商银行股份有限公司天津分行
资产托管业务专用章

2024年4月17日

五、 审计报告

1. 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	众环审字(2024)2700168号

2. 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	财达证券财达月月鑫1号集合资产管理计划全体份额持有人
审计意见	我们审计了财达证券鑫享月月鑫1号集合资产管理计划(以下简称“集合计划”)的财务报表,包括2023年12月31日的资产负债表,2023年度的利润表和净资产(基金净值)变动表以及财务报表附注。 我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定编制,公允反映了集合计划2023年12月31日的财务状况以及2023年度的经营成果和基金净值变动情况。
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	-
会计师事务所的名称	中审众环会计师事务所(特殊普通合伙)

六、 年度财务报表

1. 资产负债表

报告截止日:2023年12月31日

单位:人民币元

项目	年末数	年初数
资产:		
银行存款	880,479.59	
结算备付金	103,586.68	
存出保证金	1,464.33	
衍生金融资产		
交易性金融资产	125,052,205.12	
买入返售金融资产		

发放贷款和垫款		
债权投资		
其他债权投资		
应收清算款		
应收利息		
应收股利	2,091.31	
应收申购款		
其他资产		
资产合计	126,039,827.03	-
负债：		
短期借款		
交易性金融负债		
衍生金融负债		
卖出回购金融资产款	44,510,242.69	
应付清算款		
应付赎回款		
应付管理人报酬	104,880.14	
应付托管费	2,097.59	
应付销售服务费		
应付投资顾问费		
应交税费	34,879.32	
应付利息		
应付利润		
其他负债	11,816.07	
负债合计	44,663,915.81	-
持有人权益：		
实收资金	79,695,163.52	
其他综合收益		
未分配利润	1,680,747.70	
持有人权益合计	81,375,911.22	-
负债及持有人权益合计	126,039,827.03	-

2. 经营业绩表

本报告期： 2023年4月19日至2023年12月31日

单位：人民币元

项目	本年数	上年数
一、收入	3,871,928.50	-
1. 利息收入	48,996.28	
2. 投资收益(损失以“-”填列)	3,257,702.36	
其中：以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		
3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	565,229.86	
4. 汇兑损益(损失以“-”号填列)		
5. 其他业务收入		
二、费用	975,719.05	-
1. 管理人报酬	604,907.76	
2. 托管费	4,680.96	
3. 销售服务费		
4. 投资顾问费		
5. 利息支出	328,400.06	
其中：卖出回购金融资产利息支出	328,400.06	
6. 信用减值损失		
7. 税金及附加	13,529.07	
8. 其他费用	24,201.20	
三、利润总和	2,896,209.45	-
减：所得税费用		
四、净利润	2,896,209.45	-
五、其他综合收益		
六、综合收益总额	2,896,209.45	-

3. 所有者权益变动表

本报告期：2023年4月19日至2023年12月31日

单位：人民币元

项目	本年数				上年数			
	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	-	-	-	-				-
加：会计政策变更								
前期差错更正								
其他								
二、本期期初余额	-	-	-	-	-	-	-	-
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	79,695,163.52	-	1,680,747.70	81,375,911.22	-	-	-	-
（一）综合收益总额			2,896,209.45	2,896,209.45			-	-
（二）产品持有人申购和赎回	79,695,163.52		949,215.25	80,644,378.77	-	-	-	-
其中：1、产品申购	112,251,514.59		1,564,220.97	113,815,735.56				-
2、产品赎回	-32,556,351.07		-615,005.72	-33,171,356.79				-
（三）利润分配			-2,164,677.00	-2,164,677.00				-
（四）其他综合收益结转留存收益								
四、本期期末余额	79,695,163.52	-	1,680,747.70	81,375,911.22	-	-	-	-

七、投资组合报告（2023年12月31日）

1. 期末资产组合情况

项目名称	项目市值（元）	占资产净值比例
银行存款及清算备付金合计	984,066.27	1.2093%
股票	0.00	0.0000%
债券	122,052,205.12	149.9857%
基金	3,000,000.00	3.6866%
买入返售金融资产	0.00	0.0000%
其他	3,555.64	0.0043%
资产总值合计	126,039,827.03	154.8859%

2. 期末按公允价值占集合计划资产净值前五名股票明细

本集合计划报告期末未参与股票。

3. 期末按公允价值占集合计划资产净值前五名基金明细（不包含货币市场基金）

序号	基金代码	基金名称	持有份额（份）	公允价值（元）	占资产净值比例（%）
1	001526	鑫元安鑫宝货币A	3,000,000.00	3,000,000.00	3.6866

本集合计划报告期末持有1支基金。

4. 期末按公允价值占集合计划资产净值前五名债券明细

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	163506.SH	20楚昌01	150,000	11,734,176.58	14.4198
2	032300408.IB	23唐山控股PPN002	100,000	10,385,677.60	12.7626
3	112304066.IB	23中国银行CD066	100,000	9,769,450.98	12.0054
4	251544.SH	23周口03	80,000	8,266,982.79	10.1590
5	177043.SH	PR万投01	100,000	6,272,372.95	7.7079

5. 期末按公允价值占集合计划资产净值前五名债券逆回购明细

本集合计划报告期末未参与质押式回购。

6. 期末按公允价值占集合计划资产净值前五名权证明细

本集合计划报告期末未持有权证。

7. 期末按公允价值占集合计划资产净值前五名衍生工具明细

本集合计划报告期末未参与衍生工具。

8. 投资组合报告附注

本集合资产管理计划投资的前五名证券的发行主体在本报告期内未被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内也未到受到公开谴责、处罚。

八、集合计划份额变动情况

单位：份

本报告期期初份额总额	49,634,285.35
本报告期总申购份额	62,617,229.24
减：本报告期总赎回份额	32,556,351.07
本报告期期末份额总额	79,695,163.52

九、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	7,274,752.38	9.25%

十、重要事项提示

1. 投资经理变更

本报告期内，未发生投资经理变更情况。

2. 一般关联交易及重大关联交易

本报告期内，本集合计划投资于管理人关联方发行的证券如下：

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	102382187.IB	23 河北国控 MTN002	50,000	5,128,784.84	6.3036

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。

十一、信息披露的查阅方式

信息披露网址：www.95363.com

信息披露电话：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任何疑问，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

二〇二四年四月三十日

