

诚通新财富 50 号集合资产管理计划  
2024 年第一季度资产管理报告

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 2024 年 4 月 12 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 2024 年 1 月 1 日起至 2024 年 3 月 31 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:	15 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，十年以上金融行业从业经历，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：一季度央行超预期降准降息，调降5年期LPR利率25bp，公开市场操作则以“削峰填谷”为主，资金面整体平稳充裕。宏观方面，经济基本面延续弱复苏趋势，投资和出口均出现不同程度改善，社零增速维持平稳，但地产链仍有较大的修复空间。一季度以来，机构对经济弱复苏预期较为一致，同时资金面较去年末边际转松，加之机构配置力量增强，而一级债券供给量偏少，共同推动债券收益率震荡下行。产品运作方面：本季度账户的债券资产提供了稳定的票息收入，在配置优质债券获取收益的基础上，账户寻找多种策略中确定性较强的机会，积极参与了地方债和高等级信用债的交易机会，在承担较小波动的前提下，提高产品的整体收益。展望后市，重要会议基调偏稳健，更注重高质量发展，预计短期内经济可能不会出现强劲的复苏，而是保持温和的增长态势。在通胀率较低背景下，货币政策有望继续保持宽松，二季度银行间流动性可能会受到财政存款或一级供给的小幅扰动，但央行大概率通过相应货币政策工具维持流动性的合理充裕。同时实体经济融资需求仍然一般，而机构配置压力较大，整体环境对债市仍然有利。

2024年一季度，A股市场先抑后扬，主要指数涨跌互现。其中，上证50指数表现最强，一

季度累计上涨 3.82%，上证指数一季度收涨 2.23%，沪深 300 上涨 3.1%，创业板和科创 50 分别下跌 3.87%、10.48%。总体来看，一季度大盘蓝筹股明显强于中小盘股。市场运行的整体逻辑依然遵循去年以来的走势，红利策略一枝独秀，市场整体估值继续压缩，投资者风险偏好极低，倾向于持有高现金类资产。展望二季度，我们认为红利类投资思路可能依然延续，但需要关注高分红类资产由于经营下滑而带来的潜在风险，选取业绩稳定性好的持仓进行配置。

## 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	2024 年 1 月 1 日—2024 年 3 月 31 日
1	本期利润（元）	110,667.65
2	本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额（元）	33,811.67
3	期末资产管理计划份额（份）	8,405,365.91
4	期末资产管理计划资产净值（元）	10,146,089.82
5	期末单位资产管理计划资产净值（元）	1.2071
6	期末累计单位资产管理计划资产净值（元）	1.3671

## 3.2 产品净值表现

阶段	净值增长率
2024 年第一季度	1.0718%

## 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
8,154,151.71	1,173,141.17	921,926.97	8,405,365.91

## 4 资产管理计划投资组合报告

### 4.1 资产组合情况

日期：2024年3月31日

单位：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	153,111.65	1.19%
股票投资	467,236.00	3.62%
债券投资	11,953,415.95	92.52%
基金投资	344,600.00	2.67%
其他资产	1,090.88	0.01%
资产合计	12,919,454.48	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	109955.SH	22 河南 72	50,000	5,110,858.90	50.37%
2	253420.SH	23 寿光 04	20,000	2,050,756.16	20.21%
3	162379.SH	19 淮建 02	10,000	1,057,167.12	10.42%
4	251983.SH	23 景旅 D5	10,000	1,055,875.34	10.41%
5	252698.SH	23 寿光 D1	10,000	1,052,986.30	10.38%

### 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	601658.SH	邮储银行	20,000	95,000.00	0.94%
2	600970.SH	中材国际	8,000	89,920.00	0.89%
3	000786.SZ	北新建材	3,000	85,110.00	0.84%
4	000333.SZ	美的集团	1,000	64,220.00	0.63%
5	603529.SH	爱玛科技	2,000	62,380.00	0.61%

### 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	地方债	5,110,858.90	50.37%
2	公司债	6,265,197.80	61.75%
3	可转债	577,359.25	5.69%

#### 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。

