

# 财通证券资产管理有限公司 财通资管财臻1号集合资产管理计划 季度资产管理报告

(2023年三季度)

计划管理人：财通证券资产管理有限公司

计划托管人：中国工商银行股份有限公司-浙江省分行

报告期间：2023年07月01日-2023年09月30日

## 重要提示

本报告由集合资产管理计划管理人财通证券资产管理有限公司依据《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》（以下简称《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》（以下简称《运作管理规定》）及其他有关规定制作。

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。

管理人保证本报告书中所载资料的真实性、准确性和完整性，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担责任。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期起止时间：2023年07月01日-2023年09月30日

## 一、资产管理计划概况

资产管理计划全称：财通资管财臻1号集合资产管理计划

资产管理计划合同生效日：2015年02月10日

资产管理计划管理人：财通证券资产管理有限公司

资产管理计划托管人：中国工商银行股份有限公司-浙江省分行

## 二、主要财务指标、投资表现和收益分配情况

### （一）主要财务指标及投资表现

单位：元

	主要财务指标及投资表现	2023年09月30日
1	期末单位集合计划资产净值	2.3939
2	期末集合计划资产净值	134,580,470.99
3	本期集合计划利润	-5,051,370.70
4	本期集合计划净值增长率	-3.3510%
5	集合计划累计净值增长率	481.2543%

### （二）收益分配情况

本报告期不存在收益分配情况。

## 三、管理人履职报告

### （一）投资主办简介

陈李先生，硕士研究生学历、硕士学位。曾在上汽集团乘用车分公司、湘财证券股份有限公司、财通证券有限责任公司工作。2015年8月加入财通证券资产管理有限公司，曾任权益私募投资部投资经理，权益私募投资部高级投资经理，现任权益私募投资部副总经理（主持工作）。

## （二）投资主办工作报告

### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2023年三季度，市场整体维持震荡下探。A股本季度主要指数悉数下跌，创业板指、深证成指分别下跌9.53%、8.32%，万得全A、沪深300分别下跌4.33%、3.98%。权益资产方面，TMT延续弱势调整，传统经济在三季度受到了明显的支持，金融和地产板块表现亮眼，尤其是非银金融三季度涨幅领先，其次红利策略环境和供给侧因素下煤炭、石油石化、钢铁板块涨幅仅次于非银金融。

报告期内，组合保持在较低仓位，8月开始外资持续流出加速了股价波动，导致很多白马和龙头公司估值继续下挫，原来判断公司价值的锚今年不断被打破，我们主要采取仓位和强ALPHA的方法来对抗市场波动。配置上，在持仓结构总体稳定的情况下对个股做了小幅优化，对基本面表现平稳但市场预期大幅偏弱的消费做了小幅减持。组合重点配置方向还是中游高端制造，涉及行业新技术和国产替代，细分领域在工业母机和半导体制造、机器人、智能驾驶、以及光伏电池片新技术。

展望四季度，当前中国经济正处于转型换挡期，不能再依靠原来的三驾马车拉动，我们必须要做到换挡，从低附加值简单商品切入到高附加值的商品，经济才能进入更健康和可持续的发展。地产政策的出台属于短期触动交易的友善政策，真正的改变需要看到供需关系的变化。所

以，对于顺周期板块投资机会以择时为主。其次，只要市场不在继续单边下跌，不会转变组合当前的持仓结构，还是以均衡配置为主。

### （三）内部性声明

#### 1. 运作合规性声明

本报告期内，集合计划管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《管理办法》、《运作管理规定》及其他法律法规的规定，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，在严格控制风险的基础上，为集合计划持有人谋求最大利益。本报告期内，本集合计划运作合法合规，无损害集合计划持有人利益的行为，本集合计划的投资管理符合有关法规的规定。

#### 2. 风险控制报告

本报告期内，集合计划管理人通过设立独立的风险控制部门，对集合理财业务进行事前审核、事中监控，日常对集合资产管理业务的重大事项进行风险评估，并提出风险控制措施。风险管理部还对业务授权、投资交易的执行情况进行监控，控制业务运作过程中存在的风险。本次风险控制报告综合了集合计划管理人全面自查和风险管理部日常监控、重点检查的结果。

我们认为，在本报告期内，本集合计划管理人对集合计划的管理始终都能按照有关法律法规、公司相关制度和《管理合同》及《说明书》的要求进行。本集合计划的投资决策、投资交易程序、投资权限等各方面均符合规定的要求；交易行为合法合规，未出现异常交易、操纵市场的现象；未发现内幕交易的情况；本集合计划持有的证券符合规定的比

例要求；相关的信息披露和财务数据皆真实、完整、准确、及时。

### 3. 涉及本计划的重大诉讼事项

本报告期内，无涉及本计划的重大诉讼事项。

## 四、托管人履职报告

本报告期内，本托管人在对财通资管财臻1号集合资产管理计划的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和资产管理合同的有关规定，不存在任何损害资产管理计划份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了托管人应尽的义务。

本报告期内，托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、资产管理合同和托管协议的规定，对本资产管理计划管理人的投资运作进行了必要的监督，对资产净值的计算、份额参与与退出价格计算、以及费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本计划管理人存在损害份额持有人利益的行为。

本报告期内，本托管人依法对财通证券资产管理有限公司编制的财通资管财臻1号集合资产管理计划2023年三季度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## 五、财务会计报告

## (一) 资产负债表

日期：2023年09月30日

单位：元

资产	期末余额	负债与持有人权益	期末余额
<b>资产：</b>		<b>负债：</b>	
银行存款	1,989,424.00	短期借款	0.00
结算备付金	6,044,823.23	交易性金融负债	0.00
存出保证金	26,537.86	衍生金融负债	0.00
衍生金融资产	0.00	卖出回购金融资产款	0.00
交易性金融资产	40,121,965.28	应付清算款	247,501.89
买入返售金融资产	87,331,417.67	应付赎回款	0.00
发放贷款和垫款		应付管理人报酬	557,389.56
债权投资	0.00	应付托管费	74,318.65
其他债权投资		应付销售服务费	0.00
应收清算款	0.00	应付投资顾问费	0.00
应收利息	0.00	应交税费	2,847.08
应收股利	0.00	应付利息	0.00
应收申购款	0.00	应付利润	0.00
其他资产	0.00	其他负债	51,639.87
		<b>负债合计</b>	933,697.05
		<b>所有者权益</b>	
		实收资金	56,217,473.24
		其他综合收益	
		未分配利润	78,362,997.75
		所有者权益合计	134,580,470.99
<b>资产总计</b>	135,514,168.04	<b>负债和所有者权益总计</b>	135,514,168.04

## (二) 损益表

日期：2023年07月01日-2023年09月30日

单位：元

项目	本期金额	上期金额
一、收入	-4,415,841.38	-5,437,455.54
1. 利息收入	353,617.91	442,682.35
2. 投资收益（损失以“-”填列）	-1,862,242.34	-3,281,963.37
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）	-2,907,216.95	-2,598,174.52

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	635,529.32	696,074.46
1. 管理人报酬	557,389.56	610,537.05
2. 托管费	74,318.65	81,404.94
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	0.00	0.00
其中：卖出回购金融资产利息支出	0.00	0.00
6. 信用减值损失	0.00	0.00
7. 税金及附加	1,048.23	1,389.73
8. 其他费用	2,772.88	2,742.74
三、利润总额	-5,051,370.70	-6,133,530.00
减：所得税费用	—	—
四、净利润	-5,051,370.70	-6,133,530.00
五、其他综合收益		
六、综合收益总额	-5,051,370.70	-6,133,530.00

## 六、投资组合报告

### (一) 资产组合情况

日期：2023 年 09 月 30 日

单位：元

项目	期末市值	占期末总资产比例
银行存款	1,989,424.00	1.47%
清算备付金	6,044,823.23	4.46%
存出保证金	26,537.86	0.02%
股票投资	40,121,965.28	29.61%
债券投资	0	0
资产支持证券投资	0	0
基金投资	0	0

理财产品投资	0	0
买入返售金额资产	87,331,417.67	64.44%
应收股利	0	0
应收利息	0	0
其他应收款	0	0
证券清算款	0	0
资产合计	135,514,168.04	100%

注：由于四舍五入的原因，期末市值占期末总资产比例的分项之和与合计可能有尾差。

## （二）报告期末按市值占本计划资产净值比例大小排序的前十名证券明

细

证券代码	证券名称	数量	市值	市值占净值比
300751	迈为股份	84,238.00	10,666,215.56	7.93%
603517	绝味食品	155,900.00	5,858,722.00	4.35%
002050	三花智控	134,000.00	3,979,800.00	2.96%
002463	沪电股份	140,800.00	3,169,408.00	2.36%
002436	兴森科技	239,400.00	2,923,074.00	2.17%
688355	明志科技	108,398.00	2,334,892.92	1.73%
688702	盛科通信	37,778.00	2,213,790.80	1.65%
000568	泸州老窖	7,400.00	1,603,210.00	1.19%
002044	美年健康	217,400.00	1,478,320.00	1.10%
002739	万达电影	103,800.00	1,399,224.00	1.04%

## 七、费用计提情况

### （一）管理费、托管费及业绩报酬

单位：元

费用类型	计提费率 (计提基准)	计提方式及支付方式	本报告期应付费用
------	----------------	-----------	----------

管理费	年费率 1.5%	按前一日资产净值计提，按日计提，按季支付	557,389.56
托管费	年费率 0.2%	按前一日资产净值计提，按日计提，按季支付	74,318.65
业绩报酬	见下表	本计划有权对委托人持有的集合计划各类份额年化收益率超过对应份额当期业绩报酬计提基准的部分按约定的比例（见下表）计提业绩报酬	0.00

业绩报酬计提基准：

计提日期区间	计提基准	计提比例
2015/02/10-2025/02/10	0%	10.00%

## 八、重要事项揭示

### （一）投资经理变更情况

本报告期内，本计划未发生投资经理变更。

### （二）关联交易情况

本报告期内，本计划未发生重大关联交易。

本报告期内，本计划未发生一般关联交易。

（三）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情况

项目	持有份额 总数(份)	占总份额 比例
报告期末董事、监事、从业人员及配偶持有本计划份额情况	2,284,366. 23	4.06%
报告期末控股股东、实际控制人或者其他关联方参与情况持有本计划份额情况	831,641.12	1.48%

### （四）其他涉及投资者权益的重大事项。

报告期内，2023年8月4日，胡珍珍同志离任本计划管理人财务负责人，由钱慧同志代任财务负责人。

## 九、运用杠杆情况

本报告期内，本计划运用杠杆情况符合资管合同约定，杠杆比例未主动超过法规要求的上限。

## 十、备查文件目录

### （一）查阅方式

财通证券资管网址：[www.ctzg.com](http://www.ctzg.com)

客服电话：95336

投资者对本报告如有任何疑问，可咨询管理人财通证券资产管理有限公司。

财通证券资产管理有限公司

二〇二三年十月三十日