

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

(2023年二季度)

计划管理人：财通证券资产管理有限公司

计划托管人：招商银行股份有限公司

报告期间：2023年04月01日-2023年06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04月01日-2023年06月30日

一、资产管理计划概况

资产管理计划全称：财通证券资管财丰1号集合资产管理计划

资产管理计划合同生效日：2013年05月20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：招商银行股份有限公司

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06月30日
1	期末单位集合计划资产净值	2.6282
2	期末集合计划资产净值	24,974,500.42
3	本期集合计划利润	-999,843.35
4	本期集合计划净值增长率%	-3.1971%
5	集合计划累计净值增长率%	504.6227%

（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

二季度市场再度探底回落，一季度末各项经济数据和高频数据都显示出国内经济增速开始放缓，同时，伴随着人民币汇率震荡走低，本季度市场偏弱运行，领跌A股的有内需偏弱影响的消费、以及地产产业链，而TMT板块开始走向分化，计算机和电子表现偏弱，数字经济和AI为代表通信传媒涨幅居前。至季末，A股主要指数悉数下跌，创业板指下跌7.69%、深证成指下跌5.97%、沪深300下跌5.15%、上证指数下跌2.16%。

二季度组合仍保持了相对保守的仓位，在未积累到足够的安全垫以前不会有太大的仓位提升。报告期内组合配置思路没有太大变化，随着市场的调整对个股做了一定优化。今年组合最大的风险是复苏风险，恢复不及预期，当前组合中的消费和白酒仍承担了较大的压力。长期看国内经济稳中向好方向确立，三季度复苏阵痛期或许还没完全结束，但随着时间的推移市场对经济形势的认识会逐渐清晰。从二季度末的降息、新能源汽车、家电等政策密集落地也可以看出，稳增长托底护航，叠加中美恢复平等关系，下半年市场环境将好于上半年。板块方面，当前市场对于基本面定价过渡悲观，从中观行业景气度，结合自下而上的研究方式，当下可以找到很多成长提速的公司做布局。板块配置方面，除了有一定滞涨的电子复苏周期跟着全球周期走慢于预期，消费信心不足，

在半导体中模拟、存储、设备下半年可以看到补库周期和全球需求的拐点，机床和机床零部件是符合时代背景的产物。未来，管理人会继续将精力聚焦具备长逻辑的、持续成长的公司才能在中长期取得较好的复合收益率水平。

（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

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在对财丰1号托管的过程中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务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2023年二季度报告中的截至报告期末财务数据进行了复核。

五、财务会计报告

（一）资产负债表

日期：2023年06月30日单位：元

资产	期末余额	负债与持有人权益	期末余额
资产：		负债：	
银行存款	1,208,982.40	短期借款	0.00
结算备付金	1,337,066.97	交易性金融负债	0.00
存出保证金	6,667.23	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	7,660,717.76	应付清算款	59,715.97
买入返售金融资产	14,873,724.84	应付赎回款	0.00
发放贷款和垫款		应付管理人报酬	31,810.34
债权投资	0.00	应付托管费	5,301.71
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	601.41
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	15,229.35
		负债合计	112,658.78
		所有者权益	
		实收资金	9,502,592.01
		其他综合收益	
		未分配利润	15,471,908.41
		所有者权益合计	24,974,500.42
资产总计	25,087,159.20	负债和所有者权益总计	25,087,159.20

(二) 损益表

日期：2023年04月01日-2023年06月30日单位：元

项目	本期金额	上期金额
一、收入	-868,578.91	-1,860,762.10
1. 利息收入	80,163.98	77,574.68
2. 投资收益（损失以“-”填列）	-689,816.37	202,546.58
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）	-258,926.52	-2,140,883.36
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	131,264.44	189,076.00
1. 管理人报酬	109,565.50	155,993.03
2. 托管费	18,260.95	25,723.62
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	251.26	3,097.36
8. 其他费用	3,186.73	4,261.99
三、利润总额	-999,843.35	-2,049,838.10
减：所得税费用	—	—
四、净利润	-999,843.35	-2,049,838.10
五、其他综合收益		
六、综合收益总额	-999,843.35	-2,049,838.10

六、投资组合报告

（一）资产组合情况

日期：2023年06月30日单位：元

项目	期末市值	占期末总资产比例
银行存款	1,208,982.40	4.82%
清算备付金	1,337,066.97	5.33%
存出保证金	6,667.23	0.03%
股票投资	7,660,717.76	30.54%
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	14,873,724.84	59.29%
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	25,087,159.20	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	15,258.00	2,584,400.04	10.35%
603517	绝味食品	24,300.00	902,745.00	3.61%
600702	舍得酒业	6,000.00	743,700.00	2.98%
688355	明志科技	23,867.00	726,034.14	2.91%
688981	中芯国际	12,269.00	619,829.88	2.48%
300820	英杰电气	5,250.00	432,495.00	1.73%
002436	兴森科技	25,000.00	387,500.00	1.55%
002463	沪电股份	15,500.00	324,570.00	1.30%
601607	上海医药	13,100.00	293,571.00	1.18%
002737	葵花药业	11,100.00	270,174.00	1.08%

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	109,565.50
托管费	年费率 0.25%	按前一日资产净值计提，按日计提，按季支付	18,260.95
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
--------	------	------

2022/03/30-2032/03/30	6%	20.00%
-----------------------	----	--------

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	0.00	0.0000%
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	0.00	0.0000%

（四）其他涉及投资者权益的重大事项。

报告期内，2023年6月21日，周志远离任本产品管理人副总经理，担任FICC投资总监。

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

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

二〇二三年七月三十一日