

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
(2024 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：2024 年 04 月 01 日至 2024 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：2024 年 4 月 1 日-2024 年 6 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 | 2024年06月30日 |
|---|-------------|---------------|
| 1 | 期末集合计划份额净值 | 2.3325 |
| 2 | 期末集合计划资产净值 | 15,251,883.02 |
| 3 | 本期集合计划利润 | 185,349.47 |
| 4 | 本期集合计划净值增长率 | 1.1053% |
| 5 | 集合计划累计净值增长率 | 436.5963% |

（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，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 月以来，在一季报扰动，社融、生产等经济数据不及预期等影响下，市场波动开始加大。5 月内，一方面地产、绿电、半导体等领域政策利好催化不断，另一方面经济增长预期摇摆下多项因素交织，A 股震荡调整。但随着 6 月以来，受持续较弱的经济体感与人民币汇率走势、国内降息预期落空以及中报扰动等因素影响，北向持续流出，市场下行明显。

报告期内，组合保持中低仓位运行，配置中对业绩确定性要求更高。根据一季报业绩指引对消费和计算机做了减持，重点关注趋势改善的行业龙头及出清末期的底部行业，结合需求视角，看好人形机器人未来 2 年产业化突破、看好消费电子领域创新和半导体设备及材料的国产替代；此外，光伏领域除保留了电池新技术，增加了组件降本的光伏投资。

下一阶段，7 月的重要会议后是否会有新一轮政策释放以及前期各类稳增长政策落地的实际效果都有待验证，在市场对经济基本面的预期真正扭转之前，我们将始终保持谨慎态度。我们将在对宏观与中观层面的发展与变化做好预期管理的同时，紧跟政策趋势，加强数据跟踪，进一步完善选股框架，去伪存真，寻找景气度改善逻辑下公司

盈利能力有确定性提升的优质个股，以期优化组合，提升胜率。后续如果看到广义财政支出进度加快、地产数据改善、价格上涨持续等边际好转的变化，或可转向积极。

（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，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 2024 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：2024 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 | 7,791,449.79 | 短期借款 | 0.00 |
| 结算备付金 | 590,141.96 | 交易性金融负债 | 0.00 |

| | | | |
|----------|---------------|------------|---------------|
| 存出保证金 | 2,074.17 | 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 | 6,569,822.69 | 应付清算款 | 0.00 |
| 买入返售金融资产 | 0.00 | 应付赎回款 | 0.00 |
| 发放贷款和垫款 | | 应付管理人报酬 | 19,159.21 |
| 债权投资 | 0.00 | 应付托管费 | 3,193.20 |
| 其他债权投资 | | 应付销售服务费 | 0.00 |
| 应收清算款 | 334,633.50 | 应付投资顾问费 | 0.00 |
| 应收利息 | 0.00 | 应交税费 | 42.61 |
| 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 | 13,844.07 |
| | | 负债合计 | 36,239.09 |
| | | 所有者权益 | |
| | | 实收资金 | 6,538,733.97 |
| | | 其他综合收益 | |
| | | 未分配利润 | 8,713,149.05 |
| | | 所有者权益合计 | 15,251,883.02 |
| 资产总计 | 15,288,122.11 | 负债和所有者权益总计 | 15,288,122.11 |

（二）、损益表

日期：2024年04月01日-2024年06月30日

单位：元

| 项目 | 本期金额 | 上期金额 |
|--------------------------|------------|---------------|
| 一、收入 | 256,922.98 | -1,197,479.47 |
| 1.利息收入 | 28,297.31 | 51,685.54 |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | -1,463.35 | -1,324,484.65 |
| 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） | 230,089.02 | 75,319.64 |
| 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 | 71,573.51 | 79,881.70 |
| 1.管理人报酬 | 59,467.24 | 64,226.11 |

| | | |
|-----------------|------------|---------------|
| 2.托管费 | 9,911.21 | 10,704.35 |
| 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 | 75.80 | 167.05 |
| 8.其他费用 | 2,119.26 | 4,784.19 |
| 三、利润总额 | 185,349.47 | -1,277,361.17 |
| 减：所得税费用 | — | — |
| 四、净利润 | 185,349.47 | -1,277,361.17 |
| 五、其他综合收益 | | |
| 六、综合收益总额 | 185,349.47 | -1,277,361.17 |

六、投资组合报告

（一）、资产组合情况

日期：2024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 | 7,791,449.79 | 50.96% |
| 清算备付金 | 590,141.96 | 3.86% |
| 存出保证金 | 2,074.17 | 0.01% |
| 股票投资 | 6,569,822.69 | 42.97% |
| 债券投资 | 0.00 | 0.00% |
| 资产支持证券投资 | 0.00 | 0.00% |
| 基金投资 | 0.00 | 0.00% |
| 买入返售金融资产 | 0.00 | 0.00% |
| 证券清算款 | 334,633.50 | 2.19% |
| 资产合计 | 15,288,122.11 | 100.00% |

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 | 14,458.00 | 1,727,441.84 | 11.33% |
| 603009 | 北特科技 | 64,900.00 | 1,163,657.00 | 7.63% |
| 300606 | 金太阳 | 43,600.00 | 809,216.00 | 5.31% |
| 300320 | 海达股份 | 87,400.00 | 713,184.00 | 4.68% |
| 603606 | 东方电缆 | 8,000.00 | 390,480.00 | 2.56% |
| 300433 | 蓝思科技 | 14,200.00 | 259,150.00 | 1.70% |
| 002138 | 顺络电子 | 8,400.00 | 230,664.00 | 1.51% |
| 002938 | 鹏鼎控股 | 4,200.00 | 166,992.00 | 1.09% |
| 000528 | 柳 工 | 14,300.00 | 160,017.00 | 1.05% |
| 688256 | 寒武纪 | 767.00 | 152,379.89 | 1.00% |

注：前十名证券明细，债券市值不含应计利息。

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 | 本报告期计提费用 |
|------|----------------|---|-----------|
| 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 | 59,467.24 |
| 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 | 9,911.21 |
| 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 | 0.00 |

| | | | |
|--|--|------------------|--|
| | | 约定的比例（见下表）计提业绩报酬 | |
|--|--|------------------|--|

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）、重大关联交易情况

本报告期内，本计划不存在重大关联交易情况。

（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

1、报告期内，经本计划管理人第三届董事会 2023 年度会议审议通过并按规定备案，周志远先生自 2024 年 04 月 30 日起担任总经理助理。

2、报告期内，本计划管理人北京分公司住所于 2024 年 06 月 19 日变更至北京市西城区金融大街甲 9 号楼 8 层 801-01 单元。

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：400-116-7888

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

二〇二四年七月三十一日