

财通证券资产管理有限公司  
财通证券资管财嘉 101 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：中国农业银行股份有限公司-揭阳分行

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	财通证券资管财嘉 101 号集合资产管理计划
资产管理计划合同生效日	2023 年 06 月 13 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	中国农业银行股份有限公司-揭阳分行

## 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	2024 年 06 月 30 日
1	期末集合计划份额净值	0.8376
2	期末集合计划资产净值	31,494,170.33
3	本期集合计划利润	-3,438,231.56
4	本期集合计划净值增长率	-9.8385%
5	集合计划累计净值增长率	-16.2400%

### （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

黄晓霜女士，硕士研究生学历、硕士学位。2017 年 7 月加入财通证券资产管理有限公司，曾任固收私募投资部投资经理助理，现任固收私募投资部投资经理。

吴惠芬女士，硕士研究生学历、硕士学位。曾在杭州炬元管理有限公司工作。2018 年 9 月加入财通证券资产管理有限公司，曾任创新投资部投资经理助理兼投后管理岗、创新投资部投资经理、固收私募投资部投资经理，现任创新投资部投资经理。

## （二）、投资主办工作报告

回顾 2024 年二季度，中国 A 股市场宽幅震荡，中国 A 股市场整体上走出冲高回落的走势。一季度 GDP 同比增长 5.3%，为全年目标打下良好基础。但 5 月 PMI 回落至 49.5，社零同比增速在 2-4 月持续回落，5 月数据受到节假日、618 消费节提前的影响出现反弹。同时，5 月的政策侧重于财政和房地产领域，通过发行超长期特别国债和推出地产金融政策包，积极应对房地产市场下行压力，推动经济平稳运行。

2024 年二季度，股市大中小盘各类指数涨跌互现，分化巨大。4 月份，高股息的大盘蓝筹股表现依然较好，以强势横盘震荡为主。4 月 12 日新“国九条”重磅出台，市场继续反弹，许多资金开始结合一季报业绩转向对绩优成长中小股票的投资。5 月 20 日以后，随着各种利空因素不断出现，A 股市场震荡走低，6 月底指数收于年内相对低位。

指数方面，截至 2024 年 6 月 28 日，中证 1000 收于 4895.99 点，较上季度末收跌 10.02%；中证 500 指数收于 4942.78 点，较上季度末收跌 6.50%；沪深 300 指数收于 3461.66 点，较上季度末收跌 2.14%；上证 50 指数收于 2394.87 点，较上季度末收跌 0.83%。

财通证券资管财嘉 101 号集合资产管理计划产品投资策略为波动率策略+敲入期权看涨策略，本季度中证 1000 指数下跌 10.02%，根据投资策略，产品目前已停止高抛低吸，处于持有指数增强和持有看涨期权阶段，截至本季度末，产品单位净值为 0.8376，产品较中证 1000 指数获得超额收益约 8.9%。后续将继续基于市场行情、根据投资策略进行稳健投资。

### （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

在托管《财通证券资管财嘉 101 号集合资产管理计划》（以下简称“委托资产”）的过程中，托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》等相关法律法规的规定以及《财通证券资管财嘉 101 号集合资产管理计划合同》的约定，对委托资产的管理人财通证券资产管理有限公司 2024 年二季度的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害委托人利益的行为。在报告期内，本托管人未发现财通证券资产管理有限公司在委托资产的投资运作、委托资产净值的计算、费用开支等问题上，存在损害委托人利益的行为；未发现财通证券资产管理有限公司在产品运作中，存在违反有关法律法规和合同约定的行为。本托管人认为，管理人的

委托资产季度报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害委托人利益的行为。

## 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	7,713.01	短期借款	0.00
结算备付金	9,174,638.18	交易性金融负债	0.00
存出保证金	3,779,855.17	衍生金融负债	46,560.00
衍生金融资产	796,000.00	卖出回购金融资产款	0.00
交易性金融资产	17,937,354.36	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	129,473.79
债权投资	0.00	应付托管费	1,726.37
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	2,651.71
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	20,978.52
		负债合计	201,390.39
		所有者权益	
		实收资金	37,600,848.65
		其他综合收益	
		未分配利润	-6,106,678.32
		所有者权益合计	31,494,170.33
资产总计	31,695,560.72	负债和所有者权益总计	31,695,560.72

## （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	-3,294,842.83	-848,864.20
1.利息收入	53,214.24	39,844.68
2.投资收益（损失以“-”填列）	-2,110,121.02	-873,120.20
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）	-1,237,936.05	-15,588.68
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	143,388.73	139,041.98
1.管理人报酬	129,473.79	124,016.60
2.托管费	1,726.37	1,653.56
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	861.81	1,217.86
8.其他费用	11,326.76	12,153.96
三、利润总额	-3,438,231.56	-987,906.18
减：所得税费用	—	—
四、净利润	-3,438,231.56	-987,906.18
五、其他综合收益		
六、综合收益总额	-3,438,231.56	-987,906.18

## 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	7,713.01	0.02%
清算备付金	9,174,638.18	28.95%
存出保证金	3,779,855.17	11.93%
股票投资	0.00	0.00%
债券投资	14,911,603.29	47.05%
资产支持证券投资	0.00	0.00%
基金投资	3,025,751.07	9.55%
买入返售金融资产	0.00	0.00%
衍生工具	796,000.00	2.51%
资产合计	31,695,560.72	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
114529	19 泾河 01	60,000.00	6,020,880.00	19.12%
162537	19 四面山	40,000.00	4,070,000.00	12.92%
197194	21 济源 04	40,000.00	4,037,600.00	12.82%
008022	建信短债 F	2,682,403.43	3,025,751.07	9.61%

注：前十名证券明细，债券市值不含应计利息。

## （三）、报告期投资期货交易情况说明

### 1 报告期末本计划投资的股指期货交易情况说明

#### 1.1 本期股指期货投资政策

在配置优质固收类资产的基础上，利用资产配置等策略，获得相应的投资回报（收益或亏损）。

#### 1.2 报告期本计划投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量 (买/卖)	合约市值 (元)	公允价值变动 (元)
IM2407	IM2407	30	29,148,000.00	-945,120.00
公允价值变动总额合计 (元)				-945,120.00
股指期货投资本期收益 (元)				-2,361,440.00
股指期货投资本期公允价值变动 (元)				130,280.00

注：股指期货投资本期收益未扣除增值税和交易费用。

### 1.3 本期股指期货投资评价

在股指期货投资方面，本年度利用股指期货根据模型对指数的波动进行交易，在投资理念的指导下，为产品收益做出了贡献。

## 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	129,473.79
托管费	年费率 0.02%	按前一日资产净值计提，按日计提，按季支付	1,726.37
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
2023/06/12-2033/06/12	0%	15.00%

## 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	3,350,010.20	8.9094%
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](http://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