

诚通新财富 50 号集合资产管理计划
2024 年第二季度资产管理报告

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7月8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4月1日起至2024年6月30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：二季度债券市场收益率呈现震荡下行趋势，具体来看，季初宏观基本面数据偏弱，利率债供给放量偏温和，债券收益率持续下行，10Y国债活跃券收益率单边下行至2.22%。随后央行提示长端利率风险，收益率由下转上，10Y国债活跃券收益率快速上行至2.35%。五月银行被禁止进行“手工补息”操作，银行存款逐步转移至非银体系内，推动短端收益下行，长端则在监管部门多次发声，关注长期债券利率风险中维持震荡走势。6月份在宽松货币政策推动下市场继续交易“资产荒”和总需求偏弱的主线，各期限收益率下行，10年国债活跃券收益率报收2.23%。目前，国内经济持续恢复基础仍需夯实，从宏观数据来看基本面短期依然面临有效需求不足的制约，结构性分化趋势延续。下半年货币政策基调大概率保持宽松，债市大方向仍处于利多环境中。在“存款搬家”的逻辑推动下，机构欠配压力依然不小。对于银行而言，在信贷需求偏弱和金融数据“挤水分”影响下配债仍然有支撑。禁止“手工补息”也提升了保险增配债券的需求和理财规模的增长，“资产荒”交易主线有望延续。对信用债而言，边际上更加利好中短久期信用债，操作上可继续积极参与高等级品种的利差轮动交易。长端利率进入前期央行喊话的区间下沿，继续下行或需要新的催化因素，可等待更好的交易入场时机。

权益市场：上证指数在2024年上半年微跌0.25%，深证成指下跌7.10%，创业板指下跌

10.99%。上证50指数累计涨幅2.95%，沪深300指数小幅上涨0.89%，红利指数涨幅居首为11.25%。年初国内金融、经济数据延续弱势，投资者信心持续走低，叠加雪球敲入、融资盘强平等下行压力下，指数从3000点急跌至2635低点。后续中央汇金等托市资金通过增持宽基ETF入场。3、4月份国内经济阶段回暖，房地产放松政策加码，专项债发行额度预期升温，出口数据持续超预期，指数企稳回升。5月随着国内外经济数据再次回落，投资者风险偏好再次走低，指数再次回调至3000点以下。展望后市，我们认为随着外资流出压力降低，个股盈利逐步触底，指数有望逐步企稳，但信贷下行周期经济依然在偏弱的区间运行，市场以结构性机会为主。高质量发展的大前提下，市场定价的锚从看重增长和盈利能力逐步转向看重分红意愿和盈利稳定性，以股息率为衡量指标的结构性机会仍将持续。我们会积极调整持仓，适应目前市场，以绝对收益为目标，灵活操作仓位，力争实现净值的稳步增长。

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4月1日—2024年6月30日
1	本期利润（元）	221,531.38
2	本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额（元）	279,452.46
3	期末资产管理计划份额（份）	16,916,540.76
4	期末资产管理计划资产净值（元）	20,769,475.88
5	期末单位资产管理计划资产净值（元）	1.2278
6	期末累计单位资产管理计划资产净值（元）	1.3878

3.2 产品净值表现

阶段	净值增长率
----	-------

2024 年第二季度	1.7149%
------------	---------

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
8,405,365.91	10,612,953.39	2,101,778.54	16,916,540.76

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 6 月 30 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	296,672.49	1.100%
股票投资	967,058.00	3.580%
债券投资	18,611,818.62	68.860%
基金投资	594,400.00	2.200%
买入返售金融资产	6,557,002.26	24.260%
其他资产	1090.88	0.004%
资产合计	27,028,042.25	100.000%

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	5,179,898.63	24.94%
2	136762.SH	16 长电 01	20,000	2,103,175.34	10.13%
3	253420.SH	23 寿光 04	20,000	2,079,701.37	10.01%
4	136165.SH	16 中油 02	20,000	2,076,460.27	10.00%
5	115277.SH	23 苏信 K1	20,000	2,045,489.86	9.85%

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	600941.SH	中国移动	1,500	161,250.00	0.78%
2	600323.SH	瀚蓝环境	7,000	146,300.00	0.70%
3	600585.SH	海螺水泥	6,000	141,540.00	0.68%

4	688009.SH	中国通号	20,000	120,000.00	0.58%
5	688036.SH	传音控股	1,400	107,156.00	0.52%

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	公司债	13,431,919.99	64.67%
2	地方政府债	5,179,898.63	24.94%

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。

