

达诚基金致远一期集合资产管理计划

2024 年第 2 季度报告

2024 年 6 月 30 日

资产管理人:达诚基金管理有限公司

资产托管人:中信证券股份有限公司

报告送出日期:2024 年 7 月 31 日

§ 1 重要提示

资产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。

资产托管人中信证券股份有限公司根据本资产管理计划资产管理合同约定，于2024年7月29日复核了本报告中的财务指标、净值表现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。

资产管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运作资产管理计划，但不保证资产一定盈利。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2024年4月1日起至2024年6月30日止。

§ 2 资产管理计划产品概况

| | |
|-------------|-------------|
| 资产管理计划简称 | 达诚致远一期 |
| 资产管理计划编码 | SLE765 |
| 资产管理计划类型 | 混合类集合资产管理计划 |
| 资产管理计划合同生效日 | 2020年6月18日 |
| 资产管理计划合同存续期 | 5年 |
| 资产管理人 | 达诚基金管理有限公司 |
| 资产托管人 | 中信证券股份有限公司 |

§ 3 主要财务指标、资产管理计划净值表现及收益分配情况

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期（2024年4月1日-2024年6月30日） |
|--------------|---------------------------|
| 本期已实现收益 | -1,824,662.67 |
| 本期利润 | -1,082,452.13 |
| 期末资产管理计划资产净值 | 18,708,826.64 |
| 期末资产管理计划份额净值 | 1.192 |

3.2 资产管理计划净值表现

| 阶段 | 净值增长率 |
|----|-------|
|----|-------|

| | |
|-------|--------|
| 过去三个月 | -4.94% |
|-------|--------|

3.3 收益分配情况

本报告期内，本资产管理计划无收益分配。

§ 4 资产管理计划份额变动

单位：份

| | |
|-------------------------------|---------------|
| 报告期期初资产管理计划份额总额 | 21,590,443.07 |
| 报告期期间资产管理计划总申购份额 | 0.00 |
| 减：报告期期间资产管理计划总赎回份额 | 5,891,576.46 |
| 报告期期间资产管理计划拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | 0.00 |
| 报告期期末资产管理计划份额总额 | 15,698,866.61 |

注：其中集合资产管理计划“申购”指参与，“赎回”指退出；单一资产管理计划“申购”指追加，“赎回”指提取。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末资产管理计划资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额（元） | 占资产管理计划总资产的比例（%） |
|----|-------------------|---------------|------------------|
| 1 | 权益投资 | 12,486,323.28 | 66.31% |
| | 其中：股票 | 12,486,323.28 | 66.31% |
| 2 | 基金投资 | 3,006,279.28 | 15.97% |
| 3 | 固定收益投资 | 0.00 | 0.00% |
| | 其中：债券 | 0.00 | 0.00% |
| | 资产支持证券 | 0.00 | 0.00% |
| 4 | 贵金属投资 | 0.00 | 0.00% |
| 5 | 金融衍生品投资 | 0.00 | 0.00% |
| 6 | 买入返售金融资产 | 0.00 | 0.00% |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | 0.00 | 0.00% |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 3,336,233.74 | 17.72% |

| | | | |
|---|------|---------------|---------|
| 8 | 其他资产 | 0.00 | 0.00% |
| 9 | 合计 | 18,828,836.30 | 100.00% |

注：本报告中因四舍五入原因，投资组合报告中市值占总资产比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§ 6 管理人报告

6.1 投资经理简介

| 姓名 | 职务 | 任本资产管理计划的投资经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|----|------------|-----------------|------|--------|--|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 赵楠 | 投资经理、首席投资官 | 2020-06-18 | | 26 | 赵楠先生，现任达诚基金管理有限公司首席投资官。北京大学理学学士学位、经济学学士学位，武汉大学工商管理硕士。拥有24年证券基金研究投资经验，曾任中信基金管理有限公司研究总监、投委会委员；中信建投证券公司自营部执行总经理；方正富邦基金管理有限公司投资总监；永赢基金管理有限公司董事、副总经理（分管权益投资）。 |

注：1. 首任投资经理，任职日期为资产管理计划合同生效日，离任日期为根据公司决定确定的解聘日期；

2. 非首任投资经理，任职日期和离任日期分别指根据公司决定的聘任日期和解聘日期。

3. “职务”填列该人员除了担任本资产管理计划的投资经理外，是否还担任公司的其他职务，具体填列内容如“投资经理、公司投资总监”等。

6.2 报告期内资产管理计划的投资策略和运作分析

2024年上半年A股市场在“微盘股”抱团瓦解中开始，在各方努力下市场情绪稳定但预期仍不确定的情况下选择了“红利”和“出海”作为新的抱团对象，与此相反成长板块则受到了较大的下行压力。诸多不确定的新形势下确实对以往的成长型投资思路造成了较大压力，以往惯常发生的大小盘估值切换和股价对盈利周期提前反应等均未出现，这也侧面反应了市场对未来不确定性抱有一定程度的悲观预期。

预计下半年的确定性来自7月重要会议即将宣布的各方面改革政策，市场将会关注和评估政策的方向和力度，不确定性则可能更多来自贸易壁垒增加等外部因素。对国内大多数竞争性行业，这两年无疑是面临着行业自然出清的状况，这个过程体现在市场上体现为业绩和估值的双杀。深度内卷的各行各业，要不寻求出海机会，要不持续投入提升，总会有优秀的公司能最终胜出。在估值和盈利均处于相对底部区域时候，静候优秀公司从行业洗牌中脱颖而出的胜率可能要大于相对高位的红利板块。

§ 7 管理人风控报告

7.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人严格执行中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，建立了健全、有效的公平交易制度体系，贯穿分工授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估、监督检查等各业务环节。基金管理人通过完善各类交易的公平交易执行细则、严格的流程控制、持续的技术改进，确保公平交易原则的实现；通过 IT 系统和人工监控等方式进行日常监控，公平对待旗下管理的所有投资组合。

报告期内，公司对旗下所有投资组合之间的收益率差异以及分投资类别的收益率差异进行了分析，并采集连续四个季度期间内，不同时间窗口下同向交易的样本，根据 95% 置信区间下差价率的 T 检验显著程度、差价率均值、同向交易占优比等方面进行综合分析，未发现旗下投资组合之间存在利益输送情况。

7.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，公司旗下所有投资组合参与交易所公开竞价交易中，未发生同日反向交易中成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况。未发现不公平交易和利益输送的情况。

7.3 报告期内本资产管理计划运作合规守信情况说明

本报告期内，本资产管理计划管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《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》等有关法律法规及其各项实施准则、本资产管理计划合同。本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理组合资产，在严格控制风险的基础上，为投资者谋求最大利益。本报告期内，本资产管理计划运作整体合法合规，无损害投资者利益的行为。

7.4 重大关联交易

无

7.5 报告期内本公司关联方参与本资产管理计划情况说明

本报告期内，公司董事、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（后文简称“公司关联方”）未参与已退出本资产管理计划。截至本报告期末，公司关联方合计持有份额占本资产管理计划总份额比例为 0.00%。

7.6 其他涉及投资者权益的重大事项

无

7.7 一般关联交易

| 专户名称 | 日期 | 交易类型 | 证券代码 | 证券名称 | 交易金额 |
|------------------|------------|------|--------|--------------------|--------------|
| 达诚基金致远一期集合资产管理计划 | 2024-04-22 | 申购 | 019572 | 达诚中证同业存单AAA指数7天持有期 | 3,000,000.00 |

7.8 报告期内本公司自有资金参与、退出本资产管理计划情况

本报告期内，本公司及子公司自有资金未参与未退出本资产管理计划。截至本报告期末，本公司及子公司合计持有份额占本资产管理计划总份额比例为0.00%。

达诚基金管理有限公司

2024年7月31日