

财达证券鑫享月月鑫 1 号集合资产管理计划
2024 年第三季度资产管理报告



管理人：财达证券股份有限公司

托管人：招商银行股份有限公司天津分行

报告期间：2024 年 7 月 01 日-2024 年 9 月 30 日

目 录

§ 1	重要提示.....	3
§ 2	集合计划简介.....	3
§ 3	主要财务指标、净值表现及收益分配情况.....	4
3.1	主要财务指标.....	4
3.2	净值表现.....	4
3.3	收益分配情况.....	4
§ 4	管理人报告.....	4
4.1	投资经理简介.....	4
4.2	管理人对报告期内本集合计划运作遵规守信情况的说明.....	4
4.3	管理人对报告期内本集合计划的风险控制报告.....	5
4.4	报告期内本集合计划的投资策略和运作分析及市场简要展望.....	5
§ 5	投资组合报告.....	5
5.1	期末资产组合情况.....	5
5.2	期末按公允价值占资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	6
5.3	期末按公允价值占资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资投资明细.....	6
5.4	期末按公允价值占资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细.....	6
5.5	本报告期投资基金情况.....	6
5.6	报告期末本集合计划投资股指期货、商品期货、国债期货的情况说明.....	6
5.7	报告期末本集合计划投资金融衍生品的情况说明.....	7
5.8	本集合计划运用杠杆情况.....	7
5.9	本集合计划投资关联方发行的或者承销期内承销的证券的说明.....	7
5.10	投资组合报告附注或其他描述（如有）.....	7
§ 6	管理费、托管费、业绩报酬（如有）等费用的计提基准、计提方式和支付方式.....	7
§ 7	本集合计划份额变动.....	8
7.1	本报告期份额变动情况.....	8
7.2	本报告期管理人董事、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本集合计划情况.....	8
§ 8	重大事件揭示.....	8
8.1	投资经理变更.....	8
8.2	一般关联交易及重大关联交易.....	8
8.3	本报告期对本集合计划发生的重大影响事件.....	9
§ 9	备查文件目录.....	9
9.1	备查文件目录.....	9
9.2	存放地点.....	9
9.3	查阅方式.....	9

§ 1 重要提示

本集合计划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，保证报告内容的真实性、准确性和完整性。

本集合计划托管人根据本集合计划合同规定复核了本报告中的主要财务指标、净值表现、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。

本集合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，但不保证本集合计划一定盈利，也不保证最低收益。

本集合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集合计划的合同、说明书、风险揭示书等文件。

本报告中财务资料未经审计。

本报告中的内容由管理人负责解释。

本报告期自 2024 年 7 月 01 日起至 2024 年 9 月 30 日止。

§ 2 集合计划简介

集合计划名称	财达证券鑫享月月鑫 1 号集合资产管理计划
产品类型	固定收益类集合资产管理计划
集合计划成立日期	2023-04-19
集合计划合同存续期	10 年
集合计划风险等级	中风险(R3)
推广对象	稳健型(C3)及高于稳健型的合格投资者
管理人	财达证券股份有限公司
托管人	招商银行股份有限公司天津分行
注册登记机构	财达证券股份有限公司

§ 3 主要财务指标、净值表现及收益分配情况

3.1 主要财务指标

科目	金额（单位：元）
实收资本	71,106,471.13
期末本集合计划资产净值	75,595,618.65
期末本集合计划份额净值	1.0631
期末本集合计划份额累计净值	1.0921
报告期份额净值增长率	0.3019%

注：期末份额净值=期末本集合计划资产净值÷期末本集合计划份额

期末份额累计净值=期末本集合计划份额净值+每份本集合计划份额累计分红

3.2 净值表现

截至本报告期末，本集合计划份额净值为【1.0631】元，份额累计净值为【1.0921】元。本报告期份额净值增长率为【0.3019】%。

3.3 收益分配情况

报告期内，本集合计划未进行收益分配。

§ 4 管理人报告

4.1 投资经理简介

刘莉：硕士，无兼职情况，具有十余年投资管理、投资研究、投资咨询等相关业务经验，已经取得基金从业资格。2011-2014：恒泰证券资产管理部交易员；2015-2017：恒泰证券资产管理部投资经理；2018至今：财达证券资产管理部投资经理

本集合计划投资经理，最近三年未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚。

4.2 管理人对报告期内本集合计划运作遵规守信情况的说明

本报告期内，财达证券股份有限公司作为本集合计划管理人，严格依据法律法规、资产管理合同的约定，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，为本集合计划持有人谋求最大利益，无损害持有人利益的行为。本集合计划投资组合符合有关法律法规及资产管理合同的约定。

4.3 管理人对报告期内本集合计划的风险控制报告

本报告期内，财达证券股份有限公司作为本集合计划管理人，始终按照有关法律法規、公司制度和本集合计划资产管理合同的要求，对本集合计划进行运作管理，通过风险监测和预警机制及时发现运作过程中可能出现的风险状况。本集合计划的投资决策、投资交易程序、投资权限管理等各方面均符合有关规定要求，未出现异常交易、操纵市场的现象，未发现内幕交易情况。

4.4 报告期内本集合计划的投资策略和运作分析及市场简要展望

三季度，市场收益率波动下行。三季度，尽管受央行借券控制市场收益下行节奏以及交易商协会对国债违规交易查处影响，市场收益出现短暂波动，但由于基本面数据逐月下行，以及OMO利率下调等利好支撑，十年国债收益率在9月创出阶段新低，回落至2.0附近，信用债利差极致压缩。9月末，超预期会议影响下，股票市场短期迅速上涨，股债跷跷板效应下居民资产配置出现较大幅度的切换，理财资金迎来一波赎回潮，信用债出现大幅调整。

三季度，产品继续维持短久期配置，由于份额净增加导致杠杆回落至110%。

经历国庆节前后市场的大幅调整，债市收益尤其是信用债收益上行幅度较大，而资金利率在央行降准、降息等宽松货币政策下总体维持平稳，当前信用债绝对收益水平及杠杆利差水平均处于今年以来的较高水平，市场收益空间打开。未来，财政政策落地的节奏以及基本面能否走出通缩将主导市场走向。四季度，产品将继续维持短久期的防守策略，择机配置高流动性短债资产，小幅提高杠杆水平增强组合弹性。

§ 5 投资组合报告

5.1 期末资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占总资产的比例（%）
1	银行存款	774,812.37	0.93%
2	结算备付金	5,029.89	0.01%
3	存出保证金	1,054.44	0.00%
4	交易性金融资产	82,462,477.21	99.06%
	其中：股票投资	-	0.00%
	债券投资	68,463,409.84	82.24%
	基金投资	863,005.00	1.04%

	权证投资	-	-
	资产支持证券	13,136,062.37	15.78%
5	买入返售金融资产	-	0.00%
6	其他资产	0.00	0.00%
	合计	83,243,373.91	100.00%

注：其他资产包括应收证券清算款、应收利息、应收股利、应收申购款等。

5.2 期末按公允价值占资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占资产净值比例(%)
1	032300408	23 唐山控股 PPN002	100,000	10,338,450.96	13.6760
2	254379	24 津保 04	100,000	10,267,874.52	13.5826
3	102482198	24 开滦 MTN003 (科创票据)	100,000	10,039,962.05	13.2811
4	163506	20 楚昌 01	150,000	7,685,029.32	10.1659
5	177043	PR 万投 01	100,000	6,512,385.06	8.6148

5.3 期末按公允价值占资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资投资明细

序号	代码	名称	数量(份)	公允价值(元)	占资产净值比例(%)
1	262642	24 财资 1A	100,000	10,044,619.18	13.2873
2	261863	熠安 4A2	100,000	3,091,443.19	4.0895

5.4 期末按公允价值占资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

本报告期末未持有股票	
------------	--

5.5 本报告期投资基金情况

序号	基金代码	基金名称	公允价值(元)	占资产净值比例(%)
1	508001	浙江杭徽	289,960.00	0.3836
2	180401	鹏华深能	243,600.00	0.3222
3	511380	转债 ETF	168,345.00	0.2227
4	508018	中交 REIT	100,000.00	0.1323
5	520990	国新红利	61,100.00	0.0808

5.6 报告期末本集合计划投资股指期货、商品期货、国债期货的情况说明

本报告期末未持有期货	
------------	--

5.7 报告期末本集合计划投资金融衍生品的情况说明

本报告期末未参与其他金融衍生品投资

5.8 本集合计划运用杠杆情况

截至报告期末，本集合计划杠杆倍数（总资产/净资产）为【110.12】%。

报告期，本集合计划严格按照合同要求开展投资，控制杠杆比例，未出现违反合同约定的情况。

5.9 本集合计划投资关联方发行的或者承销期内承销的证券的说明

本报告期内，本集合计划无投资于管理人、托管人关联方发行的或者承销期内承销的证券的情况。

5.10 投资组合报告附注或其他描述（如有）

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 管理费、托管费、业绩报酬（如有）等费用的计提基准、计提方式和支付方式

费用明细	计提基准	计提方式	支付方式
管理费	$H = E \times 【0.50】\% \div 365$ H为每日应计提的管理费 E为前一日的集合计划资产净值	每日计提	按季支付
托管费	$H = E \times 【0.01】\% \div 365$ H为每日应计提的托管费 E为前一日的集合计划资产净值	每日计提	按季支付
业绩报酬（如有）	管理人在本集合计划发行前或开放前确定业绩报酬计提基准，管理人在发生业绩报酬计提基准调整时，公告新的业绩报酬计提基准，在下一期业	在收益分配基准日、委托人退出申请日和计划终止日，管理人对符合业绩报酬提取条件的份额计提业绩报酬。 业绩报酬计提期间年化收益率低于业绩报酬计提基准时，	计提后支付

	绩报酬计提基准调整之前,都以该业绩报酬计提基准计提业绩报酬。 截至 2024 年 9 月末,本集合计划业绩报酬计提基准为 3.0%/年。	管理人不收取业绩报酬;年化收益率等于或高于业绩报酬计提基准时,基准以上的部分,管理人收取 50%的业绩报酬。	
--	---	--	--

§ 7 本集合计划份额变动

7.1 本报告期份额变动情况

本报告期期初份额总额	67,000,302.89
本报告期总申购份额	12,313,275.74
减: 本报告期总赎回份额	8,207,107.50
本报告期期末份额总额	71,106,471.13

注: 总申购份额含红利转投

7.2 本报告期管理人董事、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本集合计划情况

项目	持有份额总数 (份)	占总份额比例
持有本集合计划	1,841,691.03	2.59%

经对本集合计划账户进行监控,未发现存在因管理人关联方参与本集合计划导致的不公平对待投资者行为。

§ 8 重大事件揭示

8.1 投资经理变更

本报告期内,未发生投资经理变更情况。

8.2 一般关联交易及重大关联交易

本报告期内,未发生一般关联交易及重大关联交易。

8.3 本报告期对本集合计划发生的重大影响事件

本报告期内，未发生其他涉及投资者权益的重大事项。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1. 《财达证券鑫享月月鑫1号集合资产管理计划资产管理合同》、说明书、风险揭示书；
2. 管理人业务资格批复、营业执照；
3. 本集合计划各项公告。

9.2 存放地点

备查文件存放于管理人办公场所：河北省石家庄市自强路35号

9.3 查阅方式

投资者可登录管理人网站www.95363.com查询。

客户服务电话：95363（河北区域投资者请致电95363，河北省外区域投资者请致电0311-95363）

投资者对本报告书如有疑问，可咨询管理人财达证券股份有限公司。

财达证券股份有限公司

二〇二四年十月十六日