

财达鑫享 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：中国工商银行股份有限公司重庆市分行

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.....	5
4.1 投资经理简介.....	5
4.2 管理人对报告期内本集合计划运作合规守信情况的说明.....	5
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.....	6
5.1 期末资产组合情况.....	6
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.....	7
5.3 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.....	7
5.4 本报告期投资基金情况.....	7
5.5 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.....	7
5.6 报告期末本集合计划投资金融衍生品的情况说明.....	7
5.7 本集合计划运用杠杆情况.....	7
5.8 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.....	8
5.9 投资组合报告附注或其他描述（如有）.....	8
§ 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.....	8
§ 7 本集合计划份额变动.....	9
7.1 本报告期份额变动情况.....	9
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.....	9
§ 8 重大事件揭示.....	10
8.1 投资经理变更.....	10
8.2 一般关联交易及重大关联交易.....	10
8.3 本报告期对本集合计划发生的重大影响事件.....	10
§ 9 备查文件目录.....	10
9.1 备查文件目录.....	10
9.2 存放地点.....	10
9.3 查阅方式.....	10

## § 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	财达鑫享 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	2019-01-16
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) (含) 以上投资者
管理人	财达证券股份有限公司
托管人	中国工商银行股份有限公司重庆市分行
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司

### § 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	373,348,197.91
期末本集合计划资产净值	382,764,318.57
期末本集合计划份额净值	1.0252
期末本集合计划份额累计净值	1.3686
报告期份额累计净值增长率	0.0512%

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

报告期份额累计净值增长率=（期末累计净值-期初累计净值）/期初累计净值

#### 3.2 净值表现

截至本报告期末,本集合计划份额净值为【1.0252】元,份额累计净值为【1.3686】元。本报告期份额累计净值增长率为【0.0512】%。

#### 3.3 收益分配情况

##### （一）收益分配方案

根据《财达鑫享1号集合资产管理计划资产管理合同》等有关约定,以截止至2024年7月12日的可分配收益为基准,向全部份额持有人进行收益分配,总分红金额12,521,284.61元(含业绩报酬),向集合计划份额持有人所有持有的份额每10份派发红利0.3400元(含业绩报酬)。

##### （二）收益分配时间

权益登记日、除息日:2024年7月12日

分红公告日:2024年7月15日

红利款划出时间:2024年7月16日

##### （三）收益分配对象

权益登记日登记在册的本集合计划份额持有人。

## § 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。

刘玥祺：武汉大学金融学硕士，无兼职情况，具有七余年投资管理、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。10年金融从业经验，7年债券产品管理经验。曾任华商银行资金部业务助理、同业机构经理，财达证券资产管理部投资经理助理，具有较为丰富的债券产品管理经验。

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合规守信情况的说明

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规、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

三季度利率债收益率先下后上，7月下旬降息落地利率债收益率快速下行，8月初央行引导大行卖出长债利率有所回调，此后收益率继续下行，并在9月下行创下新低，9月24日国新办发布会介绍金融支持经济高质量发展有关情况，政策密集出台并超出市场预期，权益市场风险偏好明显抬升，利率债收益率大幅调整。截至2024年9月30日，

1 年期国债到期收益率 1.37%，较上季末下降 17.11BP，10 年期国债到期收益率 2.15%，较上季末下降 5.4BP。30 年期国债到期收益率 2.36%，较上季末下降 7.32BP，30-10 年利差小幅收窄至 20.32BP。

信用债方面，三季度收益率先下后上，流动性偏弱的信用债调整幅度显著高于利率债，信用利差和等级利差全面走阔，且 5 年期较弱资质债券基本没有买盘，赎回踩踏下 9 月 30 日单日出现较大幅度下跌。截至 2024 年 9 月 30 日，3 年期 AA 城投债到期收益率 2.51%，较上季末上升 22.36BP，信用利差 63.55BP，较上季末回升 28.65BP。

三季度，产品维持既定的投资策略，择优配置 3-5 年期城投债，对账上部分 5 年浮盈券和剩余期限较短债券进行了止盈再投，小幅降低了产品杠杆和久期，转债方面继续小幅增加了半导体、光伏等行业转债持仓。

8 月中下旬信用债已有走弱趋势，9 月末市场出现了较大幅度调整，产品将首先保证产品流动性，选择收益率较低债券卖出，降低产品久期、杠杆以应对市场波动，待市场稳定后再进行择优配置。

## § 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	1,676,303.87	0.34%
2	结算备付金	751,741.22	0.15%
3	存出保证金	18,212.93	0.00%
4	交易性金融资产	491,435,168.69	99.50%
	其中：股票投资	-	0.00%
	债券投资	491,435,168.69	99.50%
	基金投资	-	0.00%
	权证投资	-	-
	资产支持证券	-	0.00%
5	衍生金融工具	-	0.00%
6	买入返售金融资产	-	0.00%
7	其他资产	0.00	0.00%
	合计	493,881,426.71	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	253304	23 中城 01	100,000.00	10,926,250.00	2.8546
2	242380006	23 唐山银行 永续债 02	100,000.00	10,886,459.86	2.8442
3	252879	23 临东 02	100,000.00	10,665,245.75	2.7863
4	102383396	23 陕建集团 MTN002	100,000.00	10,626,368.03	2.7762
5	102103139	21 吉首华泰 MTN001	100,000.00	10,608,338.58	2.7715

## 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

本报告期末未持有资产支持证券

## 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

本报告期末未持有基金

## 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【129.03】%。

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	按日计提	按季支付
托管费	$H = E \times 【0.05】\% \div 365$ 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	按日计提	按季支付
业绩报酬（如有）	具体业绩报酬计提基准以实际发行时为准，在集合计划当前运作周期到期日之前，由管理人公告下个运作周期的业绩报酬计提基准。	业绩报酬计算方法： 1. 若 $S \leq K$ ，则计提比例=0 2. 若 $S > K$ ，则计提比例=X 业绩报酬计提办法：（S 为年化收益率） $S = \frac{(C'' - C')}{C} \times \frac{365}{D}$ $H = Q \times C \times (S - K) \times \frac{D}{365} \times X$ 其中： C''：在业绩报酬计提日的累计单位净值； C'：为上一个业绩报酬计提日本集合计划的累计单位净值（首次业绩报酬分配时，该净值为产品成立日单位净值）； C：为上一个业绩报酬计提日本集合计划的单位净值（首次	业绩报酬在业绩报酬计提日计提并支付，由管理人在计提当日向托管人发送业绩报酬计提金额，托管人据此计提应付管理人业绩报酬。若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。业绩报酬以管理人提供的数据为准，托管人对业绩报酬的计算不承担复核义务和责任。 委托人退出时，

		业绩报酬分配时,该净值为产品成立日单位净值); D: 为本次计提业绩报酬区间天数,即该委托人上一个业绩报酬计提日至本次业绩报酬计提日的间隔天数; H: 业绩报酬计提日管理人应计提的业绩报酬; Q: 业绩报酬计提日委托人退出份额数或计划分红、终止时持有份额总数; X: 业绩报酬计提比例。	托管人根据管理人的指令将退出金额(扣除业绩报酬)划拨给注册登记机构,由注册登记机构将扣除业绩报酬的退出款项转入委托人的交易账户。管理人的业绩报酬的计算和复核工作由管理人完成,相关信息在注册登记机构记录。
--	--	---	---

## § 7 本集合计划份额变动

### 7.1 本报告期份额变动情况

单位: 份

本报告期期初份额总额	368,273,076.91
本报告期总申购份额	29,185,816.49
减: 本报告期总赎回份额	24,110,695.49
本报告期期末份额总额	373,348,197.91

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	103,406,571.86	27.70%

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. 《财达鑫享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。

