

诚通新财富 50 号集合资产管理计划
2023 年第一季度资产管理报告

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 2023 年 4 月 11 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 2023 年 1 月 1 日起至 2023 年 3 月 31 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:	5 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，北京大学药学经济学双学士，北京大学药剂学硕士，现任诚通证券资产管理总部权益投资负责人，11年投研经验，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年加入诚通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。

2.3 投资主办人工作报告

债券市场：一季度宏观基本面延续修复态势，居民消费显著回暖，地产在政策刺激下好转，但受到出口等因素拖累，经济复苏节奏和强度未超市场预期，投资者对基本面的反应逐步弱化，因此长端利率债处于窄幅震荡格局，由于资金价格收敛无风险利率一季度呈现熊平行行情，10年期国债在2.81%-2.93%区间震荡，1年期国债上行8bp至2.23%。信用债方面，在理财规模企稳回升和年初旺盛配置需求带动下，信用市场走出修复行情，信用利差整体收窄，市场再次出现“结构性资产荒”。一季度产品操作上抓住票息配置行情，关注一二级信用品种的票息机会，获得良好收益。展望后市受经济复苏预期影响，长端利率或维持在2.85%附近震荡。跨季后预计4月份资金面保持偏松格局，票息策略仍然占优，但随着信用债收益率的持续下行，需注意配置的安全边际和利差保护水平。

权益市场：2023年一季度A股主流指数上涨为主，上证指数涨幅5.94%，上证50涨幅1.01%，沪深300涨幅4.63%，wind全A涨幅6.47%，创业板指涨幅2.25%。行业层面，结构性分化明显，计算机、传媒、通信、电子涨幅分别为36.79%、34.24%、29.51%、15.5%，远远领先其他行业。房地产、商贸零售、银行跌幅居前，跌幅分别为6.11%、5.11%、2.7%。一季度国内经济复苏斜率趋缓，美国通胀粘性显著叠加经济衰退不确定性加大，上证指数在3300点附近震荡加大，顺周期行业走势趋弱。基本面，1、2月制造业PMI数据表现较好，3月环比下降，经济复苏基础仍有待加强。房地产行业3月后新房、二手房销售数据同、环比均出现反复。资金面，一季度北向资金持续净流入，中强美弱格局下，A股吸引力逐步提升。国内超预期降准，流动性保持宽松。情绪面，资本市场和房地产市场财富效应逐步显现，偏股型权益类基金份额温和增加。

新财富 50 号 1 季度，在经济弱复苏环境下，权益操作积极布局政策提振的领域，数字经济、中特估值、中药等行业均有个股持仓。展望二季度，上市公司年报和一季报陆续披露，行业基本面更加明朗，经济温和复苏态势预计持续。新财富 50 号将继续布局行业复苏较好的个股，实现收益稳步提升。

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	2023 年 1 月 1 日—2023 年 3 月 31 日
1	本期利润（元）	98,772.49
2	本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额（元）	93,118.03
3	期末资产管理计划份额（份）	4,473,701.45
4	期末资产管理计划资产净值（元）	5,149,656.35
5	期末单位资产管理计划资产净值（元）	1.1511
6	期末累计单位资产管理计划资产净值（元）	1.3111

3.2 产品净值表现

阶段	净值增长率
2023 年第一季度	1.9575%

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
4,473,701.45	0.00	0.00	4,473,701.45

4 资产管理计划投资组合报告

4.1 资产组合情况

日期：2023年3月31日

单位：人民币元

项目	期末余额	占资产比例
银行存款、备付金及存出保证金	31,037.43	0.60%
股票投资	573,725.00	11.02%
债券投资	3,818,893.50	73.34%
基金投资	92,400.00	1.77%
其他资产	691,194.76	13.27%
资产合计	5,207,250.69	100.00%

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	162379.SH	19 淮建 02	10,000	1,026,500.00	19.93%
2	250265.SH	23 驻投 D3	10,000	1,003,000.00	19.48%
3	143727.SH	18 津投 04	7,000	700,560.00	13.60%
4	178749.SH	21 饶创 02	5,000	500,150.00	9.71%
5	150797.SH	18 黄交 01	5,000	497,100.00	9.65%

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	市值占净值比例
1	601816.SH	京沪高铁	20,000	104,400.00	2.03%
2	601985.SH	中国核电	10,000	63,900.00	1.24%
3	002078.SZ	太阳纸业	5,000	60,950.00	1.18%
4	600298.SH	安琪酵母	1,400	58,450.00	1.14%
5	600587.SH	新华医疗	2,000	55,680.00	1.08%

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	3,727,310.00	72.38%

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集合资产管理合同》;

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:北京市海淀区北三环西路 99 号院 1 号楼 15 层 1501

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。



