

诚通新配置 1 号集合资产管理计划 2023 年 1 季度托管报告

诚通证券股份有限公司：

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对诚通新配置 1 号集合资产管理计划（以下称“本计划”）的托管过程中，严格遵守《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》和其他有关法规、资产管理合同的规定，认真履行了应尽的义务，不存在损害计划份额持有人利益的行为。

本报告期内，本托管人根据《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》和其他有关法规、资产管理合同的规定，对本计划管理人的投资运作进行了必要的监督。资产管理报告中的财务指标、净值表现及投资组合报告中的数据核对一致。

中国银行股份有限公司

北京市分行

2023 年 4 月 18 日



李川川

核对一致

吴

诚通新配置 1 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北京市分行

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北京市分行于2023年10月18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:	诚通新配置1号集合资产管理计划
交易代码:	D20124
资产管理计划类型:	集合资产管理计划
成立日期:	2018年12月20日
成立规模:	27,039,054.44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北京市分行
证券账户信息:	D890160699、0899184959

2.2 投资主办人简介

魏来先生，南加州大学金融工程硕士。4 年证券投资从业经历，曾任产品创新量化策略研究员，对金融衍生品有长期深度的研究，擅长从统计学角度建立程序模型找寻二级市场规律，数理基础扎实。目前担任诚通证券资产管理总部量化投资经理。

2.3 投资主办人工作报告

2023 年一季度，随着新冠病毒毒株变异逐渐稳定，致病力进一步降低；人们对疾病更加科学全面的认识，预防和治疗手段更加成熟；普通群众对新冠个人防护能力不断提高，国家将新冠防控降级，从“乙类甲管”调整至“乙类乙管”后，我国新冠疫情防控进入了新阶段。海外方面，俄乌战争仍在持续，欧盟挺过冬季能源危机，进口能源价格的急剧上涨，导致 2022 年欧盟货物贸易出现了高达 4320 亿欧元的逆差，世界经济复苏仍旧面临巨大压力。美国通胀居高不下，美联储持续加息美元，国际其他锚定币种汇率陆续加息。随着世界经济持续不振，国际能源需求不断减少，国际油价保持在近年相对低位，国际其他大宗商品价格同步下跌，贵金属走出牛市，避险抗通胀资产受到资本青睐。美联储加息幅度逐步收紧，一季度，美元指数震荡下降，人民币汇率在 6.8 附近波动。一季度，商品物价增幅继续下降，工业原材料价格受疫情影响同比出现负增长；股市方面，一季度大盘一路向上，重回 3200 点附近，A 股日均交易金额明显放量，市场成交意愿强烈。

从宏观层面上看，一季度国内工业增速继续减缓，2 月全国工业生产者出厂价格（PPI）同比跌幅 1.4，连续五个月出现负增长；物价方面，CPI 同比上涨 1.0%，已连续二十个月转正，增幅逐渐减小，国内物价短期没有通胀压力，但受制于生产、消费端双重疲软，国内经济恢复仍然面临不小的下行压力。

关于一季度证券市场的表现，其中上证综指上涨了 183.60 点，指数涨幅加大，区间振幅达到 8.73%，年前权益市场活跃，大盘指数快速突破 3200 点。固收方面，两会指引央行向实体经济减费让利，一季度执行全面降准 25bp，市场利率债券收益率大幅下行，金融市场股债齐涨。

运行操作方面，一季度权益市场上涨，随着国内防疫政策的全面放开，国内经济逐渐恢复，产品适当增加了权益的仓位，控制整体投资组合在保守的杠杆水平范围；产品旨在控制风险，追求产品净值平稳增长，组合依旧采用稳健的风格，维持组合在合理的风险水平。未来产品将总结经验，优化投资策略，加强风控管理，控制产品回撤幅度，保障投资者收益。

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）	22,361.95
2	本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额（元）	15,282.14
3	期末资产管理计划份额（份）	1,639,141.06
4	期末资产管理计划资产净值（元）	1,737,345.59
5	期末单位资产管理计划资产净值（元）	1.0599
6	期末累计单位资产管理计划资产净值（元）	1.0599

3.2 产品净值表现

阶段	净值增长率
2023年第一季度	1.13%

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
2,039,164.39	0.00	400,023.33	1,639,141.06

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
银行存款及备付金	534,156.59	29.12%
股票投资	0.00	0.00%
债券投资(利息)	303,241.32	16.53%
基金投资	296,981.50	16.19%

其他资产	699,953.83	38.16%
资产合计	1,834,333.24	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	019547.sh	16 国债 19	3,000	302,220.00	17.40%

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十名股票投资明细

本资产管理计划本报告期末持有股票。

4.4 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十名基金投资明细

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	513500.sh	标普 500	121,600.00	159,052.80	9.15%
2	512000.sh	华宝中证全指证券公司 ETF	154,100.00	133,604.70	7.69%
3	512010.sh	医药 ETF	9,200.00	4,324.00	0.25%

4.5 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	利率债	302,220.00	17.40%

4.6 报告期末本资产管理计划投资的期货持仓和损益明细

本资产管理计划本报告期末持有期货。

4.7 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末分红。

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配置 1 号集合资产管理计划《资产管理计划备案证明》；

2、《诚通新配置 1 号集合资产管理计划集合资产管理合同》；

3、《诚通新配置 1 号集合资产管理计划说明书》；

4、《诚通新配置 1 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。

诚通证券股份有限公司

2023年4月6日