

**诚通新配置 2 号集合资产管理计划
2023 年第四季度资产管理报告**

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黑龙江省分行



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黑龙江省分行于2024年1月8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10月1日起至2023年12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2号集合资产管理计划
交易代码:	D20125
资产管理计划类型:	集合资产管理计划
成立日期:	2019年9月24日
成立规模:	23,770,044.91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黑龙江省分行
证券账户信息:	D890193650、0899207632

2.2 投资主办人简介

魏来先生，南加州大学金融工程硕士，五年证券投资从业经历。2018年参加工作入职新时代证券资产管理总部产品创新部，负责量化策略研究工作，现任诚通证券资产管理总部量化投资经理。对金融衍生品有长期深度的研究，擅长利用数理统计知识建立程序模型寻找市场规律，数学、编程基础扎实。

2.3 投资主办人工作报告

在2023年四季度，国内疫情的逐渐稳定为社会注入了新的活力。随着疫苗接种工作的深入推进，人们对疾病有了更科学、全面的认识，社会生活逐渐回归正常。海外方面，俄乌、巴以战争仍未缓解，全球经济面临着巨大的不确定性。欧洲受到能源危机的冲击，进口能源价格居高不下，美国通胀虽有所回落，但仍维持在较高水平，美联储保持渐进加息的立场，全球其他主要经济体也在逐步收紧货币政策。总体上2023年四季度国际经济环境复杂而多变。

从宏观经济数据来看，国内工业增速持续减缓，11月全国工业生产者出厂价格（PPI）同比跌幅扩大至3%，呈现出连续负增长的态势。物价方面，CPI同比转为下跌，11月同比录得-0.5%，显示国内通货膨胀压力相对较小。然而，由于生产和消费端双重压力，国内经济依然面临严峻的下行压力。

在证券市场方面，上证综指在四季度经历了一番波折，期间指数下跌135.55点，振幅高达7.33%，整体呈现出震荡走势。权益市场在国内经济逐步恢复的积极影响下，在季中一度重回3000点，但在季末受到外资出逃影响，甚至跌破2900点。固定收益市场方面，LPR在四季度维持相对稳定，由于股市疲软，股债跷跷板效应在四季度体现明显，市场利率债券整体利率大幅下行。

在运行操作方面，本季度产品依然保持相对稳健的投资策略，适度减持权益仓位的同时保持整体投资组合在谨慎的杠杆水平范围。产品仍然以追求净值平稳增长为目标，强调风险控制管理，力求在市场不确定性增加的背景下保障投资者的收益。我们将不断优化投资策略，为投资者创造更为稳健的投资回报；进一步加强风险控制管理，确保产品在复杂多变的 market 环境中能够稳健运行。期待与投资者共同携手，共度未来的投资征程，共创美好的投资成果。

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10月1日—2023年12月31日
1	本期利润（元）	44,653.06
2	本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额（元）	41,156.96
3	期末资产管理计划份额（份）	800,015.55
4	期末资产管理计划资产净值（元）	837,156.26
5	期末单位资产管理计划资产净值（元）	1.0464
6	期末累计单位资产管理计划资产净值（元）	1.0464

3.2 产品净值表现

阶段	净值增长率
2023年第四季度	5.63%

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
800,015.55	0.00	0.00	800,015.55

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12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	288,510.16	30.51%
股票投资	0.00	0.00%
债券投资	107,392.58	11.36%
基金投资	49,784.00	5.26%
其他资产	499,999.53	52.87%
资产合计	945,686.27	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	1,000	106,210.00	12.69%
---	------------	----------	-------	------------	--------

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未持有股票。

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	20,000.00	32,060.00	3.83%
2	512000. sh	华宝中证全指证券公司 ETF	11,000.00	9,504.00	1.14%
3	512010. sh	医药 ETF	20,000.00	8,220.00	0.98%

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	106,210.00	12.69%

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未持有期货。

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内未进行分红。

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

本资产管理计划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

本资产管理计划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 2 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 2 号集合资产管理计划集合资产管理合同》；
- 3、《诚通新配置 2 号集合资产管理计划说明书》；
- 4、《诚通新配置 2 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：北京市朝阳区东三环北路 27 号楼 12 层

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。

