诚通月月开 2 号集合资产管理计划

2026 年第 3 季度资产管理报告

管理人：诚通证券股份有限公司

托管人：兴业银行股份有限公司

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兴业银行股份有限公司于 2026 年 10 月 15 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 2026 年 07 月 01 日起至 2026 年 09 月 30 日止。

2 管理人履职报告

2.1 产品概况

资产管理计划名称：	诚通月月开 2 号集合资产管理计划
交易代码：	D22117
资产管理计划类型：	集合资产管理计划
成立日期：	2023 年 5 月 11 日
成立规模：	53,753,694.55 元
存续期：	5 年
管理人：	诚通证券股份有限公司
托管人：	兴业银行股份有限公司
证券账户信息：	D890389992、0899388446

2.2 投资经理简介

柏圣书先生，十年以上金融行业从业经历，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，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。所管理的产品多次获得“金牛奖”和“英华奖”，并多次跻身“Wind 万得”券商集合资管产品业绩榜前 10 名。

2.3 投资经理工作报告

三季度经济基本面呈现“生产和外需偏强，消费和投资偏弱”的弱修复格局，叠加资金面平稳宽松，债券收益率普遍下行，长端表现更优，曲线趋于平坦。具体来看，7 月初市场围绕资金面和政策预期区间震荡；下旬受存款降息预期及政治局会议释放宽松信号推动，收益率向下突破。8 月中上旬，长端进一步走强，10 年期国债收益率下探至季度低点 1.6645%附近，随后止盈情绪升温，触发回调。9 月开局 10 年期国债围绕 1.68%关口反复拉锯；下旬受宽松预期和跨季资金呵护带动，超长债率先突破，30 年期国债下行幅度显著大于 10 年期。季末，10 年期国债收益率收于 1.6775%附近。

展望后市，央行在中长期维度上持续强化货币与财政政策的协同效应，资金面保持平稳宽松，基本面短期仍处于弱复苏格局，债市整体面临的环境仍较为有利，操作上延续目标点位的交易策略，重点布局高流动性国债品种，兼顾灵活性与安全边际。

2.4 报告期内本资产管理计划运作遵规守信情况说明

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	2026 年 07 月 01 日—2026 年 09 月 30 日
本期利润（元）	6,177.25
本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额（元）	1,244.45
期末资产管理计划份额（份）	2,568,230.45
期末资产管理计划资产净值（元）	2,676,254.90
期末单位资产管理计划资产净值（元）	1.0421
期末累计单位资产管理计划资产净值（元）	1.0621

3.2 产品净值表现

阶段	净值增长率
2026 年 07 月 01 日—2026 年 09 月 30 日	0.2598%

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
5,224,251.60	0.00	2,656,021.15	2,568,230.45

4 资产管理计划投资组合报告

4.1 资产组合情况

项目	期末余额（元）	占资产比例
银行存款、备付金及存出保证金	51,205.70	1.91%
股票投资	0.00	0.00%
债券投资	2,327,929.92	86.89%
基金投资	0.00	0.00%
买入返售金融资产	299,933.26	11.20%
其他资产	76.27	0.00%
资产合计	2,679,145.15	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	019834	26 国债 08	10,000.00	1,011,445.21	37.79%
2	019832	26 国债 06	10,000.00	1,007,668.49	37.65%
3	019844	26 特国 04	3,000.00	308,816.22	11.54%

4.3 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	国债	2,327,929.92	86.98%

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五名基金投资明细

本资产管理计划本报告期末未持有基金。

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 资产管理计划杠杆运用情况

项目	本报告期末
资产管理计划杠杆比例	100.11%

6 资产管理计划费用的计提基准、计提方式和支付方式

6.1 管理费

本资产管理计划自成立后第二日起计提管理费。管理人按集合计划资产前一日净值的0.5%年费率收取集合计划管理费。管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。

6.2 托管费

本资产管理计划自成立后第二日起计提托管费。托管费,按集合计划资产前一日的资产净值的0.01%的年费率计提。托管费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。

6.3 业绩报酬

每笔参与份额以上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日（如该笔参与份额不存在上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日，则推广期参与的为注册登记机构份额注册登记日，存续期参与的为份额参与日，下同）到本次业绩报酬计提日的年化收益率，作为计提业绩报酬的基准。本资产管理计划业绩报酬计提基准于2025年7月18日进行调整，详见管理人于2025年7月11日出具的《关于诚通月月开2号集合资产管理计划业绩报酬计提基准调整的公告》。本资产管理计划现行的业绩报酬计提方式为年化收益率超出3.0%的部分提取40%作为管理人业绩报酬。业绩报酬以扣减现金的方式支付。

7 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。

8 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

8.1 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。

8.2 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。

9 备查文件目录

9.1 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月月开 2 号集合资产管理计划《资产管理计划备案证明》；

2、《诚通月月开 2 号集合资产管理计划资产管理合同》；

3、《诚通月月开 2 号集合资产管理计划说明书》；

4、《诚通月月开 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。

9.2 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。

诚通证券股份有限公司

2026 年 10 月 28 日