

诚通新配置 2 号集合资产管理计划
2023 年年度资产管理报告

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 2023 年 3 月 20 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 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年中，随着新冠病毒变异稳定，国家将新冠防控从“乙类甲管”调整至“乙类乙管”，标志着疫情防控进入新阶段。国内疫情影响基本结束，民生秩序恢复正常，社会生活逐步回到正轨。国际上，俄乌战争全年持续，对国际政治经济情势产生深远影响。能源危机尤其是欧盟地区，面临能源供应压力，影响全球经济复苏。中美关系其中二季度中美贸易顺差下降，显现出脱钩迹象。美联储加息应对高通胀，美联储持续加息，影响全球货币政策走向。国内维持稳健的货币政策适时调整，包括“两会”期间全面降准25bp以及LPR调整，以稳定经济。

关于宏观，从工业生产者出厂价格（PPI）的角度来看，国内经历了一段时间的负增长，这在一定程度上反映了工业领域面临的下行压力。具体来说，2月全国PPI同比跌幅达到1.4%，持续到五月时进一步下滑至4.6%，并在9月达到2.5%的跌幅，11月更是扩大至3%。这一连串的负增长数字凸显了全年工业品价格受到的压力，同时也反映出生产成本和市场需求之间的紧张关系。在消费者价格指数（CPI）方面，国内物价水平显示出较为稳定的增长态势。一年的时间里，CPI的增长幅度相对温和，其中2月CPI同比上涨1.0%，到了5月仅上涨0.2%，表明国内物价增长速度有所放缓。到了年末，11月CPI同比录得-0.5%，显示出消费者物价水平的实际下降，这可能反映了消费需求的变化以及市场供需关系的调整。这一系列的PPI和CPI数据不仅反映了国内外经济环境和政策调整对市场的影响，也突显了中国在稳定宏观经济、控制通胀压力方面所做的努力。在面对国内外多重挑战的背景下，通过有效的政策工具和经济调控措施，中国经济展现出应对复杂环境的韧性，为稳定经济增长和维护市场秩序提供了重要支持。

在证券市场方面，股市方面，全年经历先升后降的过程，A股市场在一季度表现强劲，但随后在国内外多重因素的影响下，市场震荡调整。一季度大盘一路向上，重回3200点附近。二季度市场先涨后跌，一度突破3400点，后回落至3200点附近。三季度市场先涨后跌，从3300

点回落至 3000 点附近。四季度市场震荡走势，季末甚至跌破 2900 点。固定收益市场则受益于货币政策的相对宽松，市场利率债券收益率大幅下行，展现出投资价值。一季度市场利率债券收益率大幅下行，股债齐涨。二季度 LPR 环比下降 10BP，固收市场大涨。三季度市场利率债券收益率先下行后上涨。四季度市场利率债券整体利率大幅下行。尽管面对复杂多变的经济环境和市场情绪，通过适时调整权益仓位和加强风险管理，投资策略在追求净值平稳增长的同时，也积极应对市场波动，保护了投资者的收益。

投资策略和运营方面，面对疫情恢复态势和市场变化，我们适时调整了权益的仓位，控制整体投资组合在合理的杠杆水平范围。同时，加强了风险控制管理，优化投资策略，力求在不确定的市场环境中，实现产品净值的稳步增长。通过对宏观经济走势、政策变化及市场动态的深入分析，我们能够灵活应对市场波动，为投资者寻找稳健的投资机会。

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 12 月 31 日
1	本期利润（元）	60,983.09
2	本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额（元）	51,943.09
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）	837,156.27
5	期末单位资产管理计划资产净值（元）	1.0465
6	期末累计单位资产管理计划资产净值（元）	1.0465

3.2 产品净值表现

阶段	净值增长率
2023 年年度	7.8500%

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：元

项目	期末余额	占资产比例
银行存款及备付金	288,510.16	34.46%
股票投资	0.00	0.00%
债券投资(利息)	107,392.58	12.83%
基金投资	49,784.00	5.95%
其他资产	391,469.52	46.76%
资产合计	837,156.26	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	32,060.00	3.83%
2	512000.sh	华宝中证全指证 券公司 ETF	11,000	9,504.00	1.14%
3	512010.sh	医药 ETF	20,000	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 集合资产管理计划会计报告

5.1 集合计划资产负债表

日期：2023年12月31日

单位：元

资产	期末余额	上年年末 余额	负债与持有人权益	期末余额	上年年末余额
资产：			负债：		
银行存款	246,638.05	384,849.61	短期借款	0.00	0.00
结算备付金	41,872.11	24,850.27	交易性金融负债	0.00	0.00
存出保证金	48.51	118.24	衍生金融负债	0.00	0.00
衍生金融资产	0.00	0.00	卖出回购金融资产款	0.00	0.00
交易性金融资产	157,176.58	124,725.38	应付清算款	99,804.05	7,851.84
买入返售金融	499,951.02	299,918.9	应付赎回款	0.00	0.00

资产		6			
发放贷款和垫款			应付管理人报酬	425.89	396.98
债权投资	0.00	0.00	应付托管费	28.41	26.45
其他债权投资			应付销售服务费	0.00	0.00
应收清算款	0.00	0.00	应付投资顾问费	0.00	0.00
应收利息	0.00	0.00	应交税费	271.07	0.00
应收股利	0.00	0.00	应付利息	0.00	0.00
应收申购款	0.00	0.00	应付利润	0.00	0.00
其他资产	0.00	0.00	其他负债	8,000.59	50,014.02
			负债合计	108,530.01	58,289.29
			所有者权益		
			实收资金	800,015.55	800,015.55
			其他综合收益		
			未分配利润	37,140.71	-23,842.38
			所有者权益合计	837,156.26	776,173.17
资产总计	945,686.27	834,462.46	负债和所有者权益总计	945,686.27	834,462.46

5.2 集合资产管理计划损益表

日期：2023年1月1日-2023年12月31日

单位：元

序号	项目	本期数	上年同期数
1	一、收入	33,274.29	19,440.92
2	1. 利息收入	10,423.77	4,457.57
3	2. 投资收益（损失以“-”填列）	13,810.52	23,915.19
4	其中：以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益	0.00	0.00
5	3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	9,040.00	-8,931.84
6	4. 汇兑损益（损失以“-”号填列）	0.00	0.00
7	5. 其他业务收入	0.00	0.00
8	二、费用	-27,708.80	57,186.34
9	1. 管理人报酬	4,786.34	4,790.39
10	2. 托管费	319.07	319.27
11	3. 销售服务费	0.00	0.00

12	4. 投资顾问费	0.00	0.00
13	5. 利息支出	0.00	0.00
14	其中：卖出回购金融资产利息支出	0.00	0.00
15	6. 信用减值损失	0.00	0.00
16	7. 税金及附加	72.79	0.00
17	8. 其他费用	-32,887.00	52,076.68
18	三、利润总额	60,983.09	-37,745.42
19	减：所得税费用	—	—
20	四、净利润	60,983.09	-37,745.42
21	五、其他综合收益		
22	六、综合收益总额	60,983.09	-37,745.42

6 资产管理计划收益分配情况

本资产管理计划本报告期末未分红。

7 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

7.1 资产管理计划投资经理变更情况

本报告期内未发生资产管理计划投资经理变更情况。

7.2 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。

8 备查文件目录

8.1 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。

8.2 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。

