

诚通月月开 1 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：中国农业股份有限公司天津市分行



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农业股份有限公司天津市分行于 2024 年 3 月 25 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:	诚通月月开 1 号集合资产管理计划
交易代码:	D22116
资产管理计划类型:	集合资产管理计划
成立日期:	2021 年 10 月 26 日
成立规模:	13,065,172.09 元
存续期:	5 年
管理人:	诚通证券股份有限公司
托管人:	中国农业股份有限公司天津市分行
证券账户信息:	D890311436、0899305868

2.2 投资主办人简介

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年加入新时代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。所管理的产品多次获得“Wind万得”券商集合资管产品业绩榜前10名。

吴武源先生，南开大学金融学硕士，十年以上金融行业从业经历，曾就职于中债资信评估有限责任公司，任职高级信用分析师。2016年加入新时代证券资产管理总部投资管理部，负责固收债券库管理及持仓债券信用风险控制等工作，现任诚通证券资产管理总部投资经理。对债券市场信用风险和流动性风险具有很强的识别和研究分析能力，擅长信用债投资及票息机会挖掘，所管理的各投资组合运作稳健，收益水平具有市场竞争力。

2.3 投资主办人工作报告

2023年国内经济基本面温和复苏，债券市场在“资产荒”和宽松货币环境下演绎出牛市行情，10Y国债收益率从年初的2.82%下行至2.55%附近，整体下行约27BP，期限利差持续压缩，收益率曲线进一步平坦化。2023年是信用债市场的大年，年初理财赎回潮后信用债估值逐渐修复，在机构配置热情下利差持续压缩，下半年的“一揽子化债”和特殊再融资债发行继续带动城投债持续走强。2023年产品在操作策略上成功抓住了信用债特别是城投债的行情机会，配置品种在获得良好票息收入的同时，也为账户提供了较高的资本利得收入。在配置优质债券获取收益的基础上，账户寻找多种策略中确定性较强的机会，积极参与了地方债和政策性金融债的交易机会，在承担较小波动的前提下，提高产品的整体收益。当前经济在淡季中需求不足仍是主要问题，宏观基本面整体对债市较为有利。年初资金面预计会维持季节性宽松，中短端的交易品种仍是较好的选择。债市“资产荒”持续，高票息个券日益稀缺，操作上将进一步挖掘票息品种的配置机会和短端的交易机会。

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）	15,662,334.30
2	本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额（元）	11,178,121.35
3	期末资产管理计划份额（份）	373,915,205.39
4	期末资产管理计划资产净值（元）	387,592,217.73
5	期末单位资产管理计划资产净值（元）	1.0366
6	期末累计单位资产管理计划资产净值（元）	1.1366

3.2 产品净值表现

阶段	净值增长率
2023年度	7.2481%

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
143,490,397.77	449,095,052.57	218,670,244.95	373,915,205.39

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、备付金及存出保证金	348,479.28	0.06%

股票投资	0.00	0.00%
债券投资	627,405,502.48	99.94%
基金投资	0.00	0.00%
其他资产	0.00	0.00%
资产合计	627,753,981.76	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	2371196.IB	23 内蒙古债 30	700,000	70,488,144.81	18.19%
2	2205749.IB	22 江西债 33	600,000	61,296,196.72	15.81%
3	801015.IB	22 天津 79	500,000	50,625,355.19	13.06%
4	112306282.IB	23 交通银行 CD282	500,000	48,955,340.98	12.63%
5	162379.SH	19 淮建 02	360,000	37,638,493.15	9.71%

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

本报告期末资产管理计划未持有股票。

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	232,908,310.41	60.09%
2	地方政府债	202,579,225.58	52.27%
3	中期票据	91,529,270.50	23.61%
4	同业存单	48,955,340.98	12.63%
5	短期融资券	20,668,131.15	5.33%
6	国债	20,121,382.51	5.19%
7	定向工具	10,643,841.35	2.75%

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 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	负债和所有者权益	期末余额	上年年末余额
资产：			负 债：		
银行存款	346,640.98	782,074.83	短期借款	0.00	0.00
结算备付金	0.87	183,748.66	交易性金融负债	0.00	0.00
存出保证金	1,837.43	1,165.29	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	239,759,708.15	88,875,088.25
交易性金融资产	627,405,502.48	240,620,911.25	应付清算款	0.00	0.00
买入返售金融资产	0.00	0.00	应付赎回款	0.00	0.00
发放贷款和垫款			应付管理人报酬	66,503.23	30,375.68
债权投资	0.00	0.00	应付托管费	6,650.30	3,037.58
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	306,571.93	150,805.03
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	22,330.42	54,079.16
			负债合计	240,161,764.03	89,113,385.70
			所有者权益		
			实收资金	373,915,205.39	143,490,397.77
			其他综合收益		
			未分配利润	13,677,012.34	8,984,116.56
			所有者权益合计	387,592,217.73	152,474,514.33
资产总计	627,753,981.76	241,587,900.03	负债和所有者权益总计	627,753,981.76	241,587,900.03

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

项目	本期金额	上期金额
一、收入	19,213,343.86	5,818,860.41
1. 利息收入	36,618.21	44,462.18
2. 投资收益（损失以“-”填列）	14,692,512.70	8,478,917.64
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
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	4,484,212.95	-2,704,519.41
4. 汇兑损益（损失以“-”号填列）	0.00	0.00
5. 其他业务收入	0.00	0.00
二、费用	3,551,009.56	1,632,479.28
1. 管理人报酬	1,700,701.16	297,748.39
2. 托管费	51,312.44	23,155.37
3. 销售服务费	0.00	0.00
4. 投资顾问费	0.00	0.00
5. 利息支出	1,716,897.68	1,199,780.34
其中：卖出回购金融资产利息支出	1,716,897.68	1,199,780.34
6. 信用减值损失	0.00	0.00
7. 税金及附加	57,982.96	30,066.78
8. 其他费用	24,115.32	81,728.40
三、利润总额	15,662,334.30	4,186,381.13
减：所得税费用	—	—
四、净利润	15,662,334.30	4,186,381.13
五、其他综合收益		
六、综合收益总额	15,662,334.30	4,186,381.13

6 资产管理计划收益分配情况

本资产管理计划本报告期内共进行二次分红，其中2023年4月10日分红金额为8,617,220.64，2023年10月26日分红总金额为16,485,793.14元。

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

本资产管理计划本报告期内未发生投资经理变更。

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月月开1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1号集合资产管理计划资产管理合同》；
- 3、《诚通月月开1号集合资产管理计划说明书》；
- 4、《诚通月月开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。

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。

