

财达创新 1 号集合资产管理计划
2026 年第一季度资产管理报告



管理人：财达证券股份有限公司

托管人：中国工商银行股份有限公司重庆市分行

报告期间：2026 年 1 月 01 日-2026 年 3 月 31 日

目 录

§ 1	重要提示	3
§ 2	集合计划简介	3
§ 3	主要财务指标、净值表现及收益分配情况	4
3.1	主要财务指标	4
3.2	净值表现	4
3.3	收益分配情况	4
§ 4	管理人报告	4
4.1	投资经理简介	4
4.2	管理人对报告期内本集合计划运作遵规守信情况的说明	5
4.3	管理人对报告期内本集合计划的风险控制报告	5
4.4	报告期内本集合计划的投资策略和运作分析及市场简要展望	5
§ 5	投资组合报告	6
5.1	期末资产组合情况	6
5.2	期末按公允价值占资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	6
5.3	期末按公允价值占资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资投资明细	6
5.4	期末按公允价值占资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细	6
5.5	本报告期投资基金情况	6
5.6	报告期末本集合计划投资股指期货、商品期货、国债期货的情况说明	7
5.7	报告期末本集合计划投资金融衍生品的情况说明	7
5.8	本集合计划运用杠杆情况	7
5.9	本集合计划投资关联方发行的或者承销期内承销的证券的说明	7
5.10	投资组合报告附注或其他描述（如有）	7
§ 6	管理费、托管费、业绩报酬（如有）等费用的计提基准、计提方式和支付方式	7
§ 7	本集合计划份额变动	9
7.1	本报告期份额变动情况	9
7.2	本报告期管理人董事、监事、从业人员及其配偶、控股股东、实际控制人或者其他关联方参与本集合计划情况	9
§ 8	重大事件揭示	9
8.1	投资经理变更	9
8.2	一般关联交易及重大关联交易	9
8.3	本报告期对本集合计划发生的重大影响事件	9
§ 9	备查文件目录	10
9.1	备查文件目录	10
9.2	存放地点	10
9.3	查阅方式	10

§ 1 重要提示

本集合计划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，保证报告内容的真实性、准确性和完整性。

本集合计划托管人根据本集合计划合同规定复核了本报告中的主要财务指标、净值表现、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。

本集合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，但不保证本集合计划一定盈利，也不保证最低收益。

本集合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集合计划的合同、说明书、风险揭示书等文件。

本报告中财务资料未经审计。

本报告中的内容由管理人负责解释。

本报告期自 2026 年 1 月 01 日起至 2026 年 3 月 31 日止。

§ 2 集合计划简介

集合计划名称	财达创新 1 号集合资产管理计划
产品类型	混合类集合资产管理计划
集合计划成立日期	2020-03-23
集合计划合同存续期	10 年
集合计划风险等级	中高风险(R4)
推广对象	积极型(C4)及高于积极型的合格投资者
管理人	财达证券股份有限公司
托管人	中国工商银行股份有限公司重庆市分行
注册登记机构	财达证券股份有限公司

§ 3 主要财务指标、净值表现及收益分配情况

3.1 主要财务指标

科目	金额（单位：元）
实收资本	7,688,826.14
期末本集合计划资产净值	6,747,548.12
期末本集合计划份额净值	0.8776
期末本集合计划份额累计净值	1.0810
报告期份额累计净值增长率	1.2646%

注：期末份额净值=期末本集合计划资产净值÷期末本集合计划份额

期末份额累计净值=期末本集合计划份额净值+每份本集合计划份额累计分红

报告期份额累计净值增长率=（期末累计净值-期初累计净值）/期初累计净值

3.2 净值表现

截至本报告期末，本集合计划份额净值为【0.8776】元，份额累计净值为【1.0810】元。本报告期份额累计净值增长率为【1.2646】%。

3.3 收益分配情况

报告期内，本集合计划未进行收益分配。

§ 4 管理人报告

4.1 投资经理简介

沈小琳：财达证券股份有限公司深圳资管部投资经理，无兼职情况。伦敦大学学院统计学硕士，具备证券从业资格、基金从业资格，并已在证券投资基金业协会完成注册。2019年3月加入财达证券股份有限公司资产管理部，具有3年以上投资交易、投资研究、投资咨询等相关业务经验，具备良好的诚信记录和职业操守，最近三年未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚。

陈谢鹏：财达证券股份有限公司深圳资管部投资经理，无兼职情况。法国克莱蒙费朗一大金融硕士，具备证券从业资格、基金从业资格，并已在证券投资基金业协会完成注册。2016年12月加入财达证券股份有限公司资产管理部，具有3年以上投资交易、投资研究、投资咨询等相关业务经验，具备良好的诚信记录和职业操守，最近三年未被监

管机构采取重大行政监管措施、行政处罚。

本集合计划投资经理，最近三年未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚。

4.2 管理人对报告期内本集合计划运作合规守信情况的说明

本报告期内，财达证券股份有限公司作为本集合计划管理人，严格依据法律法规、资产管理合同的约定，本着诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用本集合计划资产，为本集合计划持有人谋求最大利益，无损害持有人利益的行为。本集合计划投资组合符合有关法律法规及资产管理合同的约定。

4.3 管理人对报告期内本集合计划的风险控制报告

本报告期内，财达证券股份有限公司作为本集合计划管理人，始终按照有关法律法规、公司制度和本集合计划资产管理合同的要求，对本集合计划进行运作管理，通过风险监测和预警机制及时发现运作过程中可能出现的风险状况。本集合计划的投资决策、投资交易程序、投资权限管理等各方面均符合有关规定要求，未出现异常交易、操纵市场的现象，未发现内幕交易情况。

4.4 报告期内本集合计划的投资策略和运作分析及市场简要展望

一季度市场表现：2026 年一季度，A 股市场整体呈现调整态势，深市表现相对强于沪市，上证指数季度下跌 1.94%，深证成指季度下跌 0.35%，沪深 300 下跌 3.87%。市场成交保持活跃，日均成交规模稳定在 2 万亿上下。一季度主要由于外部地缘冲突推高能源价格，以受益于油价中枢抬升的能源、煤炭、化工等板块表现突出。

一季度的业绩表现来看，本产品净值跑赢业绩基准与市场主要指数。本季度在适当增配了新能源汽车与猪肉养殖两大方向。考虑到，猪肉价格持续下行，行业深度亏损，能繁母猪进入去化加速期，猪周期已处于下行尾声，为下一阶段反转奠定基础。增配新能源汽车赛道，在于行业景气度回升，国内新能源汽车出海渗透率稳步提升，尤其是在欧洲、澳洲等市场政策加码支持需求，海外出口成为国内厂商重要的增长点。与此同时，我们也将持续关注新质生产力方向投资机会。

展望 2026 年二季度，我们预计市场将以震荡调整为主，随着海外局势的稳定和业绩披露季节的结束，市场有望企稳回升。

§ 5 投资组合报告

5.1 期末资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占总资产的比例（%）
1	银行存款	1,868,653.28	24.65
2	结算备付金	30,343.73	0.40
3	存出保证金	2,549.23	0.03
4	交易性金融资产	4,792,121.74	63.21
	其中：股票投资	2,314,483.00	30.53
	债券投资	-	0.00
	基金投资	2,477,638.74	32.68
	权证投资	-	-
	资产支持证券	-	0.00
5	衍生金融工具	-	0.00
6	买入返售金融资产	800,000.80	10.55
7	其他资产	87,750.47	1.16
	合计	7,581,419.25	100.00

注：其他资产包括应收证券清算款、应收利息、应收股利、应收申购款等。

5.2 期末按公允价值占资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本报告期末未持有债券

5.3 期末按公允价值占资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资投资明细

本报告期末未持有资产支持证券

5.4 期末按公允价值占资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	公允价值（元）	占资产净值比例（%）
1	002594	比亚迪	473,625.00	7.0192
2	603477	巨星农牧	440,160.00	6.5233
3	300035	中科电气	437,200.00	6.4794
4	300170	汉得信息	286,500.00	4.2460
5	603228	景旺电子	231,158.00	3.4258

5.5 本报告期投资基金情况

序号	基金代码	基金名称	公允价值（元）	占资产净值比例（%）
----	------	------	---------	------------

1	015467	太平中证 1000 指数增强 C	949,798.74	14.0762
2	510210	综指 ETF	305,040.00	4.5208
3	512000	券商 ETF	216,480.00	3.2083
4	513130	恒生科技	206,850.00	3.0656
5	159141	科创创业人工 智能 ETF 永赢	193,800.00	2.8722

5.6 报告期末本集合计划投资股指期货、商品期货、国债期货的情况说明

本报告期末未持有期货

5.7 报告期末本集合计划投资金融衍生品的情况说明

本报告期末未参与其他金融衍生品投资

5.8 本集合计划运用杠杆情况

截至报告期末，本集合计划杠杆倍数（总资产/净资产）为【112.36】%。

报告期，本集合计划严格按照合同要求开展投资，控制杠杆比例，未出现违反合同约定的情况。

5.9 本集合计划投资关联方发行的或者承销期内承销的证券的说明

本报告期内，本集合计划无投资于管理人、托管人关联方发行的或者承销期内承销的证券的情况。

5.10 投资组合报告附注或其他描述（如有）

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 管理费、托管费、业绩报酬（如有）等费用的计提基准、计提方式和支付方式

费用明细	计提基准	计提方式	支付方式
管理费	$H = E \times 【1.50】\% \div 365$ H 为每日应计提的管理 费	每日计提	按季支付

	E 为前一日的集合计划资产净值		
托管费	$H = E \times \text{【0.03】} \% \div 365$ H 为每日应计提的托管费 E 为前一日的集合计划资产净值	每日计提	按季支付
业绩报酬 (如有)	<p>本集合计划业绩报酬计提基准为 8%/年。管理人在业绩报酬计提基准调整时,公告新的业绩报酬计提基准,在下次业绩报酬计提基准调整之前,都以该业绩报酬计提基准计提业绩报酬。业绩报酬计提基准仅作为管理人计提业绩报酬的标准,并不是对本集合计划投资业绩的承诺,不构成管理人保证计划资产本金不受损失或取得最低收益的承诺。</p>	<p>业绩报酬计算方法:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. 若 $S \leq K$, 则计提比例=0 2. 若 $S > K$, 则计提比例=X <p>业绩报酬计提办法:(S 为年化收益率)</p> $S = \frac{(C'' - C')}{C} \times \frac{365}{D}$ $H = Q \times C \times (S - K) \times \frac{D}{365} \times X$ <p>其中:</p> <p>C'': 在业绩报酬计提日的累计单位净值;</p> <p>C': 为上一个业绩报酬计提日本集合计划的累计单位净值 (首次业绩报酬分配时,该净值为产品成立日单位净值);</p> <p>C: 为上一个业绩报酬计提日本集合计划的单位净值(首次业绩报酬分配时,该净值为产品成立日单位净值);</p> <p>D: 为本次计提业绩报酬区间天数,即该委托人上一个业绩报酬计提日至本次业绩报酬计提日的间隔天数;</p> <p>H: 业绩报酬计提日管理人应计提的业绩报酬;</p> <p>Q: 业绩报酬计提日委托人退出份额数或计划分红、终止时持有份额总数;</p> <p>X: 业绩报酬计提比例。</p>	<p>由于涉及份额注册登记,业绩报酬由管理人负责计算,托管人不承担计算或复核管理人业绩报酬的责任。管理人向托管人发送业绩报酬划付指令,托管人将业绩报酬划拨给管理人。从分红资金中提取业绩报酬的频率不超过每 6 个月一次。因投资者退出资产管理计划或资产管理计划终止,管理人按照资产管理合同的约定提取业绩报酬的,不受前述提取频率的限制。若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。</p>

§ 7 本集合计划份额变动

7.1 本报告期份额变动情况

单位：份

本报告期期初份额总额	7,688,826.14
本报告期总申购份额	-
减：本报告期总赎回份额	-
本报告期期末份额总额	7,688,826.14

注：总申购份额含红利转投

7.2 本报告期管理人董事、监事、从业人员及其配偶、控股股东、实际控制人或者其他关联方参与本集合计划情况

项目	持有份额总数（份）	占总份额比例
持有本集合计划	4,080,708.00	53.07%

经对本集合计划账户进行监控，未发现存在因管理人关联方参与本集合计划导致的不公平对待投资者行为。

§ 8 重大事件揭示

8.1 投资经理变更

本报告期内，未发生投资经理变更情况。

8.2 一般关联交易及重大关联交易

本报告期内，未发生一般关联交易及重大关联交易。

8.3 本报告期对本集合计划发生的重大影响事件

本报告期内，未发生其他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. 《财达创新1号集合资产管理计划资产管理合同》、说明书、风险揭示书。
2. 管理人业务资格批复、营业执照。
3. 本集合计划各项公告。

9.2 存放地点

备查文件存放于管理人办公场所：河北省石家庄市胜利南大街87号。

9.3 查阅方式

投资者可登录管理人网站www.95363.com查询。

客户服务电话：95363（河北区域投资者请致电95363，河北省外区域投资者请致电0311-95363）

投资者对本报告书如有疑问，可咨询管理人财达证券股份有限公司。

