

财信证券 30 天持有期债券型集合资产管理计划

2023 年中期报告

2023 年 06 月 30 日

基金管理人:财信证券股份有限公司

基金托管人:中国建设银行股份有限公司

送出日期:2023 年 08 月 30 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事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的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2023年08月11日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金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基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2023年01月01日起至2023年06月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	19
§7 投资组合报告	41
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	42
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	43
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	43
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	43
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	44
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	44
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	44
7.12 投资组合报告附注	44
§8 基金份额持有人信息	45

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	45
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	46
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	46
§9 开放式基金份额变动	46
§10 重大事件揭示	46
10.1 基金份额持有人大会决议	46
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	46
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	46
10.4 基金投资策略的改变	47
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	47
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	47
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	48
10.8 其他重大事件	48
§11 影响投资者决策的其他重要信息	49
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	49
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	49
§12 备查文件目录	49
12.1 备查文件目录	49
12.2 存放地点	50
12.3 查阅方式	50

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	财信证券30天持有期债券型集合资产管理计划
基金简称	财信证券30天持有期债券型
基金主代码	970152
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022年05月20日
基金管理人	财信证券股份有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	631,968,401.24份
基金合同存续期	本集合计划自本资产管理合同变更生效日起存续期不得超过3年。本集合计划自资产管理合同变更生效日起3年后，按照中国证监会有关规定执行。

注：本报告所述的“基金”也包括按照《证券公司大集合资产管理业务适用<关于规范金融机构资产管理业务的指导意见>操作指引》的要求进行变更后的证券公司大集合资产管理产品。

2.2 基金产品说明

投资目标	本集合计划通过管理人积极主动的投资管理，力争为集合计划份额持有人实现长期稳定的投资收益。
投资策略	本集合计划在研究分析的基础上，综合运用利率预期、收益率曲线策略、流动性管理策略来构建固定收益品种投资组合。密切关注市场上债券发行、利率调整、宏观政策变化、市场走势变化等信息，紧密关注各种因素引起的收益率曲线变化、债券组合的到期收益率、久期、凸性等内在特性，对固定收益品种进行跟踪与维护，及时掌握任何可能影响债券价值和风险的因素，适时适度进行调整。
业绩比较基准	中债综合财富（1年以下）指数收益率*90%+一年期定期存款利率（税后）*10%
风险收益特征	本集合计划为债券型集合资产管理计划（大集合产品），其预期风险和预期收益水平低于股票型集合

	计划、股票型基金和混合型集合计划、混合型基金，高于货币市场型集合计划、货币市场基金。
--	--

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		财信证券股份有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张怡然	王小飞
	联系电话	0731-88954729	021-60637103
	电子邮箱	cxzg@cfzq.com	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		0731-84403481	021-60637228
传真		0731-84403357	010-67595853
注册地址		湖南省长沙市岳麓区茶子山东路112号滨江金融中心T2栋(B座)26层	北京市西城区金融大街25号
办公地址		长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心28楼	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码		410000	100033
法定代表人		刘宛晨	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	zg.stock.hnchasing.com
基金中期报告备置地点	长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心28楼

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	财信证券股份有限公司	长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26楼

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2023年01月01日-2023年06月30日)
本期已实现收益	5,954,989.84
本期利润	13,324,320.32
加权平均基金份额本期利润	0.0197
本期加权平均净值利润率	1.96%
本期基金份额净值增长率	1.98%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2023年06月30日)
期末可供分配利润	9,981,392.46
期末可供分配基金份额利润	0.0158
期末基金资产净值	641,949,793.70
期末基金份额净值	1.0158
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2023年06月30日)
基金份额累计净值增长率	1.58%

注：

- 1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益减暂估增值税的附加税。
- 2、期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。
- 3、上表所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标	业绩比较 基准收益	业绩比较 基准收益 率标准差	①-③	②-④

		准差②	率③	④		
过去一个月	0.14%	0.01%	0.19%	0.01%	-0.05%	0.00%
过去三个月	0.80%	0.01%	0.71%	0.01%	0.09%	0.00%
过去六个月	1.98%	0.02%	1.38%	0.01%	0.60%	0.01%
过去一年	0.99%	0.05%	2.31%	0.01%	-1.32%	0.04%
自基金合同生效起至今	1.58%	0.05%	2.55%	0.01%	-0.97%	0.04%

注：基金合同生效日为2022年5月20日，财信30天自2022年5月23日起开放申购和赎回业务。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

财信证券30天持有期债券型集合资产管理计划累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2022年05月20日-2023年06月30日)



注：基金合同生效日为2022年5月20日，财信30天自2022年5月23日起开放申购和赎回业务。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

财信证券股份有限公司是湖南财信金融控股集团有限公司旗下核心企业，系湖南省唯一的省属国有控股证券公司。公司成立于2002年8月，目前注册资本66.98亿元，全国设有7家分公司和88家营业部。截至2022年12月31日，公司总资产超570亿元，净资产超140亿元。

公司作为拥有全业务牌照的全国性综合类证券公司，业务范围涵盖证券经纪、投资银行、资产管理、投资咨询、融资融券、固定收益、证券投资、场外市场、期货经纪、另类投资、基金投资等；下设财信期货有限公司、深圳惠和投资有限公司、深圳市惠和投资基金管理有限公司3家子公司；初步构建了横跨场内场外市场、覆盖多元化金融服务的业务体系，致力于为客户提供全方位金融服务。

截至2023年6月末，公司共管理产品144只（不含延期清算），其中公募大集合1只；公司资管规模合计21,764,845,845.49 元。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张艳	本基金的基金经理、财信证券资管投资部投资主管	2022-05-20	-	12年	中国籍，经济学硕士，2011年入职广东南粤银行，曾任广东南粤银行债券交易员、投资经理等职务；2016年加入原财富证券，历任原财富1号、财富2号、财富3号、惠丰6号（已结束）、惠丰稳健22号（已结束）投资经理。
赵旻	本基金的基金经理、财信证券资管投资部投资经理	2022-05-20	-	6年	中国籍，经济学硕士，2017年入职洛肯国际投资管理（北京）有限公司，曾任固定收益研究员、投资经理等职务；2018年加入财信证券（原财富证券），

					现任资管投资部投资经理，曾任财富1号投资经理。
卜基鑫	本基金的基金经理、财信证券资管投资部投资经理	2022-09-27	-	6年	中国籍，经济学学士，多年固定收益从业经验，历任债券交易员，投资经理助理；2020年加入财信证券股份有限公司，现任资管投资部投资经理。
翟舒	本基金的基金经理助理、财信证券资管投资部投资经理助理	2022-05-20	-	16年	中国籍，理学硕士，2007年入职财信证券有限责任公司，曾任金融工程部投资经理助理，证券投资部投资经理助理、交易运营主管，现任资管投资部投资经理助理。

注：

- (1) 张艳、赵旻为本基金合同生效后的首任基金经理，“任职日期”即基金合同生效日。
- (2) “离任日期”指根据投资决策小组会议确定的离任日期。
- (3) 证券从业年限的计算标准为：自从事证券投研、交易等相关工作起至本报告期末的总年限，不满1年部分的不计入。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本基金的基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》等有关法律法规及基金合同、招募说明书等有关基金法律文件的规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，管理人主要通过建立有纪律、规范化的投资研究和决策流程、交易流程，以及强化事后监控分析来确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。本集合计划管理人制定了严格的投资权限管理制度、投资证券池管理制度和集中交易制度等，并重视交易执行环节的公平交易措施，以“时间优先、价格优先”作为执行指令的基本原则，通过投资交易系统内的公平交易模块，以尽可能确保公平对待各投资组合。本报告期内，公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金进行可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2023年上半年债市在经济现实不及预期的情况下，叠加资金面宽松推动下走牛，大体可以分为四个阶段：1) 元旦后至春节前：随着感染高峰逐渐过去，交通出行等高频经济数据明显改善，市场对于经济回暖预期明显升温，债券市场承压。2) 春节后至2月末：“经济修复期、政策推进期、资金紧平衡期”不利因素增多，信用债走出修复性行情，资金面较紧，利率债窄幅震荡。3) 3月初至6月中旬：经济环比下行压力增加、同比数据尚可、稳增长政策力度不足，在资金宽松推动下各品种、各期限债券收益率普遍下行，6月中旬的超预期OMO降息则带动利率进一步向下。4) 6月中旬至月底：降息后市场对于稳增长政策加码担忧明显增加，止盈压力明显加大，市场进入政策观望期，债券市场有所回调。

本基金在报告期内维持中高等级信用债策略，维持杠杆低位，主要关注中短期限高评级信用债、优质城投短债以及存单，同时控制账户久期，择时择机参与利率债波段交易。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末财信证券30天持有期债券型基金份额净值为1.0158元，本报告期内，基金份额净值增长率为1.98%，同期业绩比较基准收益率为1.38%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，宏观经济增速可能面临一定压力，政策方面的主要发力点在稳增长以及提振消费上，货币政策预计将维持宽松，财政政策将持续发力。目前总体来看宏观经济总体运行在合理区间，地产投资伴随着政策的逐渐稳定将减轻对经济的拖累，各部门也在密集的研究消费刺激政策，预计下半年消费将呈现缓慢修复的特征。

展望2023年下半年债券市场，市场对于宏观经济数据指标逐渐钝化，更多关注增量的刺激政策，预计仍将会处在围绕宽信用的预期和现实反复博弈，整体市场仍将呈现震荡行情。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照《企业会计准则》、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。估值委员会成员均具备专业胜任能力和相关从业资格，精通各自领域的理论知识，熟悉相关政策法规，并具有丰富的基金行业实践经验。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司、中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定提供固定收益品种和流通受限股票的估值相关数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

截至本报告期末，根据本基金合同和相关法律法规的规定，本基金无应分配但尚未实施的利润。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：财信证券30天持有期债券型集合资产管理计划

报告截止日：2023年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	2,820,382.21	613,331.88
结算备付金		1,081,520.15	22,808,048.01
存出保证金		20,602.14	27,912.84
交易性金融资产	6.4.7.2	739,224,447.87	706,906,704.33
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		700,595,741.01	676,745,131.84
资产支持证券投资		38,628,706.86	30,161,572.49
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	1,999,339.09	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	2,388,931.56

应收股利		-	-
应收申购款		613,765.00	634,000.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		745,760,056.46	733,378,928.62
负债和净资产	附注号	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		101,487,602.67	4,499,231.09
应付清算款		23,093.23	-
应付赎回款		1,300,649.61	2,829,707.93
应付管理人报酬		276,742.73	406,644.87
应付托管费		55,348.57	81,328.98
应付销售服务费		501,506.20	1,339,607.88
应付投资顾问费		-	-
应交税费		64,258.74	112,643.54
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	101,061.01	413,931.08
负债合计		103,810,262.76	9,683,095.37
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	631,968,401.24	726,494,324.24
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	9,981,392.46	-2,798,490.99
净资产合计		641,949,793.70	723,695,833.25
负债和净资产总计		745,760,056.46	733,378,928.62

注：报告截止日2023年6月30日，基金份额净值1.0158元，基金份额总额631,968,401.24份。

6.2 利润表

会计主体：财信证券30天持有期债券型集合资产管理计划

本报告期：2023年01月01日至2023年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023年01月01日至 2023年06月30日	上年度可比期间 2022年05月20日（基金 合同生效日）至2022 年06月30日
一、营业总收入		16,926,349.02	20,134,344.90
1.利息收入		82,664.01	113,020.00
其中：存款利息收入	6.4.7.9	49,810.24	35,693.20
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息 收入		-	-
买入返售金融资产 收入		32,853.77	77,326.80
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-” 填列）		9,474,354.53	13,725,012.97
其中：股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.10	9,027,994.12	13,589,465.93
资产支持证券投资 收益	6.4.7.11	446,360.41	135,547.04
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		-	-
以摊余成本计量的 金融资产终止确认 产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失	6.4.7.12	7,369,330.48	6,296,311.93

以“-”号填列)			
4.汇兑收益（损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列)		-	-
减：二、营业总支出		3,602,028.70	3,434,802.98
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,690,139.28	1,749,106.02
2. 托管费	6.4.10.2.2	338,027.86	349,821.16
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	1,014,083.54	1,049,463.59
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		425,935.73	195,228.74
其中：卖出回购金融资产支出		425,935.73	195,228.74
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		40,384.33	40,395.33
8. 其他费用	6.4.7.13	93,457.96	50,788.14
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列)		13,324,320.32	16,699,541.92
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列)		13,324,320.32	16,699,541.92
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		13,324,320.32	16,699,541.92

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：财信证券30天持有期债券型集合资产管理计划

本报告期：2023年01月01日至2023年06月30日

单位：人民币元

项目	本期			
	2023年01月01日至2023年06月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计

一、上期期末净资产（基金净值）	726,494,324.24	-	-2,798,490.99	723,695,833.25
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	726,494,324.24	-	-2,798,490.99	723,695,833.25
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-94,525,923.00	-	12,779,883.45	-81,746,039.55
（一）、综合收益总额	-	-	13,324,320.32	13,324,320.32
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-94,525,923.00	-	-544,436.87	-95,070,359.87
其中：1.基金申购款	164,710,556.85	-	1,288,292.64	165,998,849.49
2.基金赎回款	-259,236,479.85	-	-1,832,729.51	-261,069,209.36
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综	-	-	-	-

合收益结转留存收益				
四、本期期末净资产（基金净值）	631,968,401.24	-	9,981,392.46	641,949,793.70
项目	上年度可比期间			
	2022年05月20日（基金合同生效日）至2022年06月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	3,313,783,054.70	-	-	3,313,783,054.70
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-213,001,756.75	-	18,071,531.81	-194,930,224.94
（一）、综合收益总额	-	-	16,699,541.92	16,699,541.92
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-213,001,756.75	-	1,371,989.89	-211,629,766.86
其中：1.基金申购款	816,660,354.78	-	3,767,490.16	820,427,844.94
2.基金	-1,029,662,111.	-	-2,395,500.27	-1,032,057,611.

赎回款	53			80
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	3,100,781,297.95	-	18,071,531.81	3,118,852,829.76

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署:

刘宛晨

王培斌

林巍

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

财信证券30天持有期债券型集合资产管理计划变更自原大集合“财富1号资产管理计划”，原集合计划为非限定性集合资产管理计划，于2010年1月14日经中国证监会证监许可〔2010〕67号文核准设立，并于2010年6月9日正式成立。根据中国证监会于2018年11月28日发布的《证券公司大集合资产管理业务适用<关于规范金融机构资产管理业务的指导意见>操作指引》的规定，本集合计划参照《中华人民共和国证券投资基金法》等公开募集证券投资基金相关法律、行政法规及中国证监会的规定进行变更，并经中国证监会批准，“财富1号集合资产管理计划”正式更名为“财信证券30天持有期债券型集合资产管理计划”，截至2022年5月18日，财富1号集合资产管理计划已完成变更征询工作，合同变更满足生效条件，于2022年5月20日生效。根据2022年5月20日变更生效的《财信证券30天持有期债券型集合资产管理计划资产管理合同》，本集合计划自资产管理合同变更生效日起存续期不得超过3年。本集合计划自资产管理合同变更生效日起3年后，按照中国证监会有关规定执行。本集合计划的管理人为财信证券股份有限公司，托管人为中国建设银行股份有限公司，份额登记机构为财信证券股份有限公司。

根据2022年5月20日变更生效的《财信证券30天持有期债券型集合资产管理计划资产管理合同》的规定，本集合计划的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的国债、地方政府债、政府支持机构债、政府支持债券、金融债券、次级债券、政策性金融债券、中央银行票据、企业债、公司债、可转换债券、分离交易可转债、可交换债、证券公司发行的短期公司债券、短期融资券、超短期融资券、中期票据、债券回购、资产支持证券、现金及现金等价物、银行存款（包括协议存款、通知存款、定期存款等）、同业存单、货币市场工具、国债期货，以及法律法规或中国证监会允许公开募集证券投资基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本集合计划不直接投资股票，因投资可转换债券、可交换债券转股所获得的股票，本集合计划将在其可交易之日起的30个交易日内卖出。如法律法规或监管机构以后允许公开募集证券投资基金投资其他品种，集合计划管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部颁布的《企业会计准则-基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本集合计划财务报表以持续经营为编制基础。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本集合计划财务报表符合企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》（财会〔2022〕14号）的要求，真实、完整地反映了本集合计划的财务状况、经营成果和净资产变动等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本计划本报告期所采用的会计政策与上年度会计报表不一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

为确保证券投资基金对固定收益品种估值的合理性和公允性，中国证券投资基金业协会对《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年第一季度固定收益品种的估值处理标准》进行了修订，形成《关于固定收益品种的估值处理标准》并予以发布。同时，根据资产管理合同相关约定“如有新增事项或变更事项，按国家最新规定估值”。基于上述规定的要求及资产管理合同的约定，经与托管人协商一致，为进一步确保产品估值的合理性与公允性，我司于2023年3月31日调整资管计划投资于债权类资产的估值方法（采用摊余成本法估值的产品除外），具体估值方法调整如下：1、交易所及银行间市场交易的品种由对应的估值净价估值修改为全价估值。2、对于含投资者回售权的固定收益品种，行使回售权的，在回售登记日至实际收款日期间由按债券回售实施公告约定的回售价格估值修改为第三方估值基准服务机构提供的相应品种的唯一估值全价或推荐估值全价。回售登记期截止日（含当日）后未行使回售权的修改为按照长待偿期所对应的价格进行估值。3、对银行间市场未上市，且第三方估值机构未提供估值价格的债券，应采用估值技术确定公允价值。管理人持续评估该估值方式的适当性，并在情况发生改变时做出适当调整。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期未发生差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号文《财政部国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本集合计划适用的主要税项列示如下：

(1)证券投资基金管理人运用基金买卖债券的差价收入暂不征收企业所得税。

(2)2018年1月1日(含)以后，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对集合计划在2018年1月1日以前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，

不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。证券投资基金管理人对从国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

(3)对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(4)对基金在2018年1月1日(含)以后运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日
活期存款	2,820,382.21
等于：本金	2,818,479.74
加：应计利息	1,902.47
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	2,820,382.21

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

		2023年06月30日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		-	-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	206,272,866.43	5,805,699.69	212,906,838.09	828,271.97
	银行间市场	475,865,790.00	10,622,902.92	487,688,902.92	1,200,210.00
	合计	682,138,656.43	16,428,602.61	700,595,741.01	2,028,481.97
资产支持证券		37,952,470.00	679,906.86	38,628,706.86	-3,670.00
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		720,091,126.43	17,108,509.47	739,224,447.87	2,024,811.97

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	1,999,339.09	-
银行间市场	-	-
合计	1,999,339.09	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本集合计划本报告期末无其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付交易费用	27,296.05
其中：交易所市场	15,196.68
银行间市场	12,099.37
应付利息	-
预提费用	73,764.96
合计	101,061.01

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	726,494,324.24	726,494,324.24
本期申购	164,710,556.85	164,710,556.85
本期赎回（以“-”号填列）	-259,236,479.85	-259,236,479.85
本期末	631,968,401.24	631,968,401.24

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	9,627,367.28	-12,425,858.27	-2,798,490.99
本期利润	5,954,989.84	7,369,330.48	13,324,320.32
本期基金份额交易产生的变动数	-1,495,005.75	950,568.88	-544,436.87
其中：基金申购款	2,631,815.59	-1,343,522.95	1,288,292.64
基金赎回款	-4,126,821.34	2,294,091.83	-1,832,729.51
本期已分配利润	-	-	-

本期末	14,087,351.37	-4,105,958.91	9,981,392.46
-----	---------------	---------------	--------------

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
活期存款利息收入	14,516.97
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	35,015.37
其他	277.90
合计	49,810.24

6.4.7.10 债券投资收益

6.4.7.10.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
债券投资收益——利息收入	11,992,603.82
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-2,964,609.70
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	9,027,994.12

6.4.7.10.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	449,903,619.65

减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	444,871,590.32
减：应计利息总额	7,960,138.96
减：交易费用	36,500.07
买卖债券差价收入	-2,964,609.70

6.4.7.11 资产支持证券投资收益

6.4.7.11.1 资产支持证券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
资产支持证券投资收益——利息收入	448,350.90
资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入	-1,990.49
资产支持证券投资收益——赎回差价收入	-
资产支持证券投资收益——申购差价收入	-
合计	446,360.41

6.4.7.11.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
卖出资产支持证券成交总额	2,362,482.36
减：卖出资产支持证券成本总额	2,338,000.00
减：应计利息总额	24,482.36
减：交易费用	1,990.49
资产支持证券投资收益	-1,990.49

6.4.7.12 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
1.交易性金融资产	7,369,330.48
——股票投资	-
——债券投资	6,999,000.48
——资产支持证券投资	370,330.00
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	7,369,330.48

6.4.7.13 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
审计费用	14,876.39
信息披露费	49,588.57
汇划手续费	10,033.00
帐户维护费	18,960.00
合计	93,457.96

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明**6.4.8.1 或有事项**

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期末不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
财信证券股份有限公司	本基金的管理人
中国建设银行股份有限公司	本基金的托管人
财信期货有限公司	本基金管理人的子公司
深圳惠和投资有限公司	本基金管理人的子公司
湖南财信典当有限责任公司	与本基金管理人受同一控制人控制

注：上述为法人关联方，关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年01月01日至2023年06月30日		上年度可比期间 2022年05月20日（基金合同生效日） 至2022年06月30日	
	成交金额	占当期 债券买 卖成交 总额的	成交金额	占当期 债券买 卖成交 总额的

		比例		比例
财信证券 股份有限 公司	156,217,045.00	100.00%	319,137,700.00	100.00%

6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名 称	本期 2023年01月01日至2023年06月30日		上年度可比期间 2022年05月20日（基金合同生效日） 至2022年06月30日	
	成交金额	占当期 债券回 购成交 总额的 比例	成交金额	占当期 债券回 购成交 总额的 比例
财信证券 股份有限 公司	2,282,860,000.00	100.00%	1,161,300,000.00	100.00%

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名 称	本期 2023年01月01日至2023年06月30日			
	当期佣金	占 当期 佣金 总量 的 比例	期末应付佣金余额	占 期 末 应付 佣金 总额 的 比

				例
财信证券 股份有限 公司	53,705.97	10 0.0 0%	15,196.68	10 0.0 0%
关联方名 称	上年度可比期间 2022年05月20日（基金合同生效日）至2022年06月30日			
	当期佣金	占 当 期 佣 金 总 量 的 比 例	期 末 应 付 佣 金 余 额	占 期 末 应 付 佣 金 总 额 的 比 例
财信证券 股份有限 公司	75,059.78	10 0.0 0%	143,502.00	10 0.0 0%

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费后的金额列示。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日 至2023年06月30 日	上年度可比期间 2022年05月20日（基金合同 生效日）至2022年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,690,139.28	1,749,106.02
其中：支付销售机构的客户维护费	6,113.95	4,363.34

注：本集合计划的年管理费率为0.5%。计算方法如下：

$$H=E \times 0.5\% \div 365$$

H为每日应支付的管理费；

E为前一日的计划资产净值。

管理人的管理费每日计提，逐日累计，按月支付。由集合计划管理人向集合计划托管人发送集合计划管理费划款指令，集合计划托管人复核后于次月首日起5个工作日内从集合计划财产中一次性支付给集合计划管理人。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日 至2023年06月30 日	上年度可比期间 2022年05月20日（基金合同生 效日）至2022年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	338,027.86	349,821.16

注：本集合计划给付托管人托管费，按前一日的资产净值的年费率计提。本集合计划的年托管费率为0.1%，计算方法如下：

$$H=E \times 0.1\% \div 365$$

H为每日应支付的托管费；

E为前一日的计划资产净值。

托管人的托管费每日计提，逐日累计，按月支付。由托管人根据与管理人核对一致的财务数据，自动在次月首日起5个工作日内按照指定的账户路径进行资金支付，管理人无需再出具资金划拨指令。费用自动扣划后，管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方 名称	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
财信证券股份有限公司	525,963.81
中国建设银行股份有限公司	7,336.75

合计	533,300.56
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2022年05月20日（基金合同生效日）至2022年06月30日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
财信证券股份有限公司	673,105.81
中国建设银行股份有限公司	5,236.05
合计	678,341.86

注：本集合计划的销售服务费按前一日集合计划资产净值的0.3%的年费率计提，计算方法如下：

$$H=E \times 0.3\% \div 365$$

H为每日应支付的销售服务费；

E为前一日的集合计划资产净值。

集合计划销售服务费每日计提，逐日累计，按季支付。由管理人向托管人发送销售服务费划款指令，托管人复核后于每自然季第一个月首日起5个工作日内从集合计划财产中次性支付。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方通过银行间同业市场进行债券（含回购）交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2023年01月01日至2023年06月30日	2022年05月20日（基金合同生效日）至2022年06月30日
基金合同生效日（2022年05月20日）持有的基金份额	490,000,000.00	490,000,000.00
报告期初持有的基金份额	100,000,000.00	490,000,000.00
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	70,000,000.00
报告期末持有的基金份额	100,000,000.00	420,000,000.00

报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	15.82%	13.54%
---------------------	--------	--------

6.4.10.4 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2023年06月30日		上年度末 2022年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
湖南财信典当有限责任公司	2,987,452.70	0.47%	2,987,452.70	0.41%
深圳惠和投资有限公司	0.00	0.00%	2,109,022.25	0.29%

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年01月01日至2023年06月30日		上年度可比期间 2022年05月20日（基金合同生效日） 至2022年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	2,820,382.21	14,516.97	1,593,975.22	6,083.46

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未出现承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联方交易事项。

6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期末未进行利润分配。

6.4.12 期末（2023年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2023年6月30日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额56,004,450.74元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
200407	20农发07	2023-07-03	102.85	400,000	41,142,630.14
220216	22国开16	2023-07-03	101.05	192,000	19,402,862.46
合计				592,000	60,545,492.60

注：银行间债券正回购的质押券期末估值单价为2023年6月30日的中债估值（全价）。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2023年6月30日止，本基金开展证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额45,483,151.93元，于2023年7月3日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

管理人认为，有效的风险管理对于计划的成功运营至关重要。因此，管理人设计了一套风险管理与控制体系以衡量、监督和管理在集合计划运营过程中产生的风险，主要包括信用风险、市场风险与流动性风险等。

本集合计划管理人建立了董事会及其下设的风险控制委员会、监事会-经营层及其下设的风险管理委员会-风险管理部门-其他部门、分支机构及子公司为主体的层次明晰的风险管理组织体系。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指由于计划在交易过程中可能发生交收违约或者所投资的非公开发行股票的发行人违约，从而导致集合计划财产损失。

本集合计划管理人通过对发行人及股票投资进行内部评级，对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能的信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	151,660,607.91	30,182,490.41
合计	151,660,607.91	30,182,490.41

注:持有发行期限在一年以内（含）的债券按其债项评级作为短期信用评级进行列示，持有的其他债券以其债项评级作为长期信用评级进行列示。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	29,755,104.18	-
合计	29,755,104.18	-

注:持有发行期限在一年以内（含）的同业存单按其债项评级作为短期信用评级进行列示，持有的其他债券以其债项评级作为长期信用评级进行列示。

6.4.13.2.3 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
--------	--------------------	---------------------

AAA	312,299,179.76	363,569,375.21
AAA以下	145,242,731.35	232,120,784.03
未评级	61,638,117.81	50,872,482.19
合计	519,180,028.92	646,562,641.43

注:1、持有发行期限在一年以内（含）的债券按其债项评级作为短期信用评级进行列示，持有的其他债券以其债项评级作为长期信用评级进行列示。

2、未评级债券为政策性金融债和国债。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
AAA	-	2,338,690.30
AAA以下	38,628,706.86	27,822,882.19
未评级	-	-
合计	38,628,706.86	30,161,572.49

注:持有发行期限在一年以内（含）的资产支持证券按其债项评级作为短期信用评级进行列示，持有的其他债券以其债项评级作为长期信用评级进行列示。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指本集合计划在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本集合计划的流动性风险一方面来自于份额持有人可每月要求赎回其持有的份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本集合计划的管理人对本集合计划的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本集合计划的管理人在合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障持有人利益。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本集合计划管理人通过明确约定投资范围、投资对象和投资比例，保留一定的现金和现金等价物，以保持组合的较高流动性。本集合计划所持部分证券在证券交易所交易，其余亦可在银行间同业市场交易。此外，本集合计划可通过卖出回购金融资产方式借入

短期资金应对流动性需求。综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指投资品种的价格因受经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素影响而引起的波动，导致收益水平变化，产生风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指由于利率变动而导致的资产价格和资产利息的损益。利率波动会直接影响企业的融资成本和利润水平，导致证券市场的价格和收益的变动，使计划资产管理业务收益水平随之发生变化，从而产生风险。

本集合计划持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及各项投资等。

本集合计划管理人定期对组合中债券投资部分面临的利率风险进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 06 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	2,820,382.21	-	-	-	-	-	2,820,382.21
结算备付金	581,520.15	-	-	-	-	500,000.00	1,081,520.15
存出保证金	20,602.14	-	-	-	-	-	20,602.14
交易性金融资产	122,624,937.00	128,627,331.51	238,642,794.54	249,093,570.71	235,814.11	-	739,224,447.87
买入返售金融资产	1,999,339.09	-	-	-	-	-	1,999,339.09
应收申购款	-	-	-	-	-	613,765.00	613,765.00
资产总计	128,046,780.59	128,627,331.51	238,642,794.54	249,093,570.71	235,814.11	1,113,765.00	745,760,056.46
负债							
卖出回购金融资产款	101,487,602.67	-	-	-	-	-	101,487,602.67
应付清	-	-	-	-	-	23,093.23	23,093.23

财信证券 30 天持有期债券型集合资产管理计划 2023 年中期报告

算款							
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,300,649.61	1,300,649.61
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	276,742.73	276,742.73
应付托管费	-	-	-	-	-	55,348.57	55,348.57
应付销售服务费	-	-	-	-	-	501,506.20	501,506.20
应交税费	-	-	-	-	-	64,258.74	64,258.74
其他负债	-	-	-	-	-	101,061.01	101,061.01
负债总计	101,487,602.67	-	-	-	-	2,322,660.09	103,810,262.76
利率敏感度缺口	26,559,177.92	128,627,331.51	238,642,794.54	249,093,570.71	235,814.11	-1,208,895.09	641,949,793.70
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	613,331.88	-	-	-	-	-	613,331.88
结算备付金	22,308,048.01	-	-	-	-	500,000.00	22,808,048.01
存出保证金	27,912.84	-	-	-	-	-	27,912.84
交易性金融资产	12,532,467.95	20,658,017.54	214,362,933.77	459,353,285.07	-	-	706,906,704.33
应收清算款	-	-	-	-	-	2,388,931.56	2,388,931.56
应收申购款	-	-	-	-	-	634,000.00	634,000.00
资产总计	35,481,760.68	20,658,017.54	214,362,933.77	459,353,285.07	-	3,522,931.56	733,378,928.62
负债							
卖出回购金融资产款	4,499,231.09	-	-	-	-	-	4,499,231.09
应付赎回款	-	-	-	-	-	2,829,707.93	2,829,707.93
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	406,644.87	406,644.87
应付托管费	-	-	-	-	-	81,328.98	81,328.98
应付销	-	-	-	-	-	1,339,607.88	1,339,607.88

售服务费							
应交税费	-	-	-	-	-	112,643.54	112,643.54
其他负债	-	-	-	-	-	413,931.08	413,931.08
负债总计	4,499,231.09	-	-	-	-	5,183,864.28	9,683,095.37
利率敏感度缺口	30,982,529.59	20,658,017.54	214,362,933.77	459,353,285.07	-	-1,660,932.72	723,695,833.25

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1. 假定所有期限的利率均以相同幅度变动25个基点，其他市场变量均不发生变化。 2. 不考虑基金经理为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币元)	
		本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
	1. 市场利率下降25个基点	1,157,956.89	2,993,748.74
	2. 市场利率上升25个基点	-1,157,956.89	-2,993,748.74

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指除利率风险和外汇风险以外的市场因素的变动对基金所持有的金融工具的公允价值或未来现金流产生波动的风险。本集合计划的其他价格风险主要为市场价格的变化或波动所引起的投资资产损失的可能性。

本集合计划通过组合投资的分散化降低市场价格风险。此外，本集合计划管理人通过建立多层次的风险指标体系，对其他价格风险进行持续的度量和分析，以对该风险进行管理。

除市场利率和外汇利率以外的市场价格因素的变动对本集合计划资产净值无重大影响。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日		上年度末 2022年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	-	-	-	-
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	700,595,741.01	109.14	676,745,131.84	93.51
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	700,595,741.01	109.14	676,745,131.84	93.51

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

本期末本集合计划未持有权益类资产，除市场利率和外汇利率以外的市场价格因素的变动对本集合计划资产净值无重大影响。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

金额单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	1,774,078.38	-
第二层次	737,450,369.49	706,906,704.33
第三层次	-	-
合计	739,224,447.87	706,906,704.33

注：本集合计划持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产公允价值计量结果数据截至2023年6月30日。

6.4.14.2 公允价值所属层次间的重大变动

本集合计划以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本集合计划不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

无。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

无。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-

	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	739,224,447.87	99.12
	其中：债券	700,595,741.01	93.94
	资产支持证券	38,628,706.86	5.18
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	1,999,339.09	0.27
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	3,901,902.36	0.52
8	其他各项资产	634,367.14	0.09
9	合计	745,760,056.46	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金本报告期内未投资股票。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金本报告期内未投资股票。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内未投资股票。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
----	------	------	--------------

1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	91,955,090.41	14.32
	其中：政策性金融债	91,955,090.41	14.32
4	企业债券	295,966,261.09	46.10
5	企业短期融资券	121,343,635.31	18.90
6	中期票据	159,801,571.64	24.89
7	可转债(可交换债)	1,774,078.38	0.28
8	同业存单	29,755,104.18	4.64
9	其他	-	-
10	合计	700,595,741.01	109.14

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	200407	20农发07	400,000	41,142,630.14	6.41
2	2080342	20醴陵高新债	300,000	31,837,808.22	4.96
3	2080265	20衡阳高新01	300,000	31,697,145.21	4.94
4	188573	21海润03	300,000	31,109,342.47	4.85
5	152575	20郑发01	300,000	31,028,843.84	4.83

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	112116	尚水3优	180,000	18,301,043.84	2.85
2	180644	尚水1优	100,000	10,216,342.47	1.59
3	143056	崖州湾1A	100,000	10,111,320.55	1.58

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金将按照法律法规要求，以套期保值为目的参与国债期货投资。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末参与国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 本基金本报告期内未投资股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	20,602.14
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	613,765.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	634,367.14

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	113057	中银转债	299,709.53	0.05
2	123107	温氏转债	200,956.05	0.03
3	113050	XD南银转	135,108.82	0.02
4	110043	无锡转债	120,185.55	0.02
5	127064	杭氧转债	118,808.78	0.02
6	113062	常银转债	114,098.36	0.02
7	113049	长汽转债	113,834.52	0.02
8	110075	南航转债	112,622.18	0.02
9	110053	苏银转债	100,572.16	0.02
10	110048	福能转债	89,892.95	0.01
11	127058	科伦转债	75,586.03	0.01
12	113055	成银转债	58,365.75	0.01
13	110088	淮22转债	57,999.45	0.01
14	110067	华安转债	43,925.32	0.01
15	123108	乐普转2	36,550.44	0.01
16	113053	隆22转债	32,146.19	0.01

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户	户均持有的基金份额	持有人结构	
		机构投资者	个人投资者

数(户)		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
4,338	145,681.97	109,765,467.42	17.37%	522,202,933.82	82.63%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	1,916,524.60	0.30%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2022年05月20日)基金份额总额	3,313,783,054.70
本报告期期初基金份额总额	726,494,324.24
本报告期基金总申购份额	164,710,556.85
减：本报告期基金总赎回份额	259,236,479.85
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	631,968,401.24

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，自2022年06月28日起，杨光先生不再担任财务总监、董事会秘书；新任财务总监为王培斌先生，新任董事会秘书为李俭女士。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本基金管理人存在以下尚未了结的重大诉讼、仲裁事项:

2016年10月,公司作为管理人、湖南桂阳农村商业银行股份有限公司(以下简称“桂阳农商行”)作为委托人、广州农村商业银行股份有限公司(以下简称“广州农商行”)作为托管人签订了《珠江8号定向资产管理计划资产管理合同》。桂阳农商行认为管理人在管理珠江8号定向资管计划投资交易过程中存在越权交易,造成其本金及利息,交易费用损失。

桂阳农商行于2022年2月10日以管理人在合同履行过程中存在重大违约为由向湖南省桂阳县人民法院提起诉讼,请求管理人及广州农商行共向珠江8号定向资管计划专户补足其本金损失、利息及交易费损失共11,907.48万元。

湖南省桂阳县人民法院已于2022年3月10日立案。2022年9月6日,湖南省桂阳县人民法院开庭审理本案,桂阳农商行在开庭前撤回了对被告广州农商行的起诉。

2023年1月19日,公司收到湖南省桂阳县人民法院判决书:由财信证券于判决生效之日起十五日内向珠江8号的托管专户补足因越权交易“15沪华信MTN001”、“16华阳01”两只债券给原告带来的本金损失1亿元及利息损失和交易费用等。

公司因不服上述判决已于2023年2月依法向湖南省郴州市中级人民法院提起上诉并于2023年3月24日向法院提交二审新证据。

2023年5月24日,公司收到二审法院延长本案审限通知。

2023年5月29日,公司向法院邮寄了《庭外和解申请书》。

2023年6月15日,法院组织双方召开了第一次调解协调会,后续双方将对调解事宜进行下一步协商。

上述未决诉讼不会对公司生产经营、财务状况造成重大不利影响。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内未发生投资策略的重大改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金的审计机构为天健会计师事务所(特殊普通合伙),该审计机构自基金合同生效日起向本基金提供审计服务,无改聘情况。本产品应支付给审计机构的年度审计费用为30,000.00元人民币。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内本基金管理人(不含子公司)及高级管理人员未受到有权机关调查、未被司法纪检部门采取强制措施、未被移送司法机关或追究刑事责任、未被中国证监会稽查、

未被中国证监会采取行政处罚或行政监管措施、未被实施证券市场禁入、未被认定为不适当人选被其他行政管理部门处罚及证券交易所公开谴责。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内本基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
财信证券	2	-	-	53,705.97	100.00%	-

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
财信证券	156,217,045.00	100.00%	2,282,860,000.00	100.00%	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	财信证券30天持有期债券型集合资产管理计划关于基金经理赵旻女士因休假暂停履行职务和张艳女士恢复履行职务的公告	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报	2023-01-05
2	财信证券30天持有期债券型集合资产管理计划2022年第	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报	2023-01-20

	4季度报告	(提示性公告)	
3	财信证券30天持有期债券型集合资产管理计划2022年年度报告	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报 (提示性公告)	2023-03-30
4	财信证券30天持有期债券型集合资产管理计划2022年年度审计报告	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报 (提示性公告)	2023-03-30
5	关于财信证券股份有限公司资产管理计划估值调整的公告	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报	2023-03-31
6	财信证券30天持有期债券型集合资产管理计划2023年第一季度报告	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报 (提示性公告)	2023-04-21
7	财信证券股份有限公司关于财信证券30天持有期债券型集合资产管理计划更新代销机构状态的公告	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报	2023-06-15
8	财信证券股份有限公司基金行业高级管理人员变更公告	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报	2023-06-29

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会《关于准予财富1号集合资产管理计划合同变更的回函》；
- (2) 《财信证券30天持有期债券型集合资产管理计划资产管理合同》；
- (3) 《财信证券30天持有期债券型集合资产管理计划招募说明书》；

- (4) 《财信证券30天持有期债券型集合资产管理计划托管协议》；
- (5) 《财信证券30天持有期债券型集合资产管理计划产品资料概要》；
- (6) 《财信证券30天持有期债券型集合资产管理计划基金产品资料概要（更新）》；
- (7) 《财信证券30天持有期债券型集合资产管理计划招募说明书（更新）》；
- (8) 管理人经营证券期货业务许可证、营业执照；
- (9) 报告期内披露的各项公告

12.2 存放地点

本基金备查文件存放于基金管理人财信证券股份有限公司处。

地址：湖南省长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26-28层

12.3 查阅方式

投资者可以在管理人营业时间内到公司免费查阅。

登录本公司网站查阅基金产品相关信息：zg.stock.hnchasing.com

拨打本公司客户服务电话垂询：95317/400-8835-316

财信证券股份有限公司
二〇二三年八月三十日