

# 财达证券稳达三个月滚动持有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:财达证券股份有限公司

基金托管人:招商银行股份有限公司

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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2023年8月15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1月1日起至6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.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§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.....	8
§4 管理人报告.....	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	12
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合规守信情况声明.....	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	13
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.....	13
§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.....	43
7.1 期末基金资产组合情况.....	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	44
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.....	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	44
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.....	45
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.....	45
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.....	45
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.....	45
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	45
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	45
7.12 投资组合报告附注.....	45
§8 基金份额持有人信息.....	46
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	46
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	47
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.....	47
§9 开放式基金份额变动.....	47
§10 重大事件揭示.....	48
10.1 基金份额持有人大会决议.....	48

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.....	48
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	48
10.4	基金投资策略的改变.....	48
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	48
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.....	48
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.....	49
§11	影响投资者决策的其他重要信息.....	50
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.....	50
11.2	影响投资者决策的其他重要信息.....	50
§12	备查文件目录.....	51
12.1	备查文件目录.....	51
12.2	存放地点.....	51
12.3	查阅方式.....	51

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	财达证券稳达三个月滚动持有债券型集合资产管理计划	
基金简称	稳达三个月滚动持有	
基金主代码	970146	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022年03月28日	
基金管理人	财达证券股份有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	266,171,866.07份	
基金合同存续期	3年	
下属分级基金的基金简称	稳达三个月滚动持有债券A	稳达三个月滚动持有债券C
下属分级基金的交易代码	970146	970147
报告期末下属分级基金的份额总额	169,953,939.13份	96,217,926.94份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险、保持资产良好流动性的基础上，通过主动管理，获取证券的利息收益和资本利得收益，以追求资产持续稳健的增值。
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>本资产管理计划将充分发挥管理人的资产配置能力，在货币市场工具、利率债、信用债等资产之间进行灵活配置。以债券类资产为主要配置，同时依托丰富的投资经验和优秀的风险控制能力在控制组合回撤风险的基础上增厚组合收益，力争获取持续稳定的收益。</p> <p>2、债券资产投资策略</p> <p>管理人在宏观经济形势、货币及财政政策研究的基础上，以预测未来市场利率的走势和债券市场供求关系为核心，结合收益率期限结构和利差分析，来构建债券组合。在运作过程中将实施积极的、动态的债券投资组合管理，争取获取较高的债券组合收益。</p> <p>3、货币市场工具投资策略</p>

	<p>本资产管理计划将在确定总体流动性要求的基础上，结合不同类型货币市场工具的流动性和货币市场预期收益水平、银行存款的期限、债券逆回购的预期收益率来确定货币市场工具的配置，并定期对货币市场工具组合平均剩余期限以及投资品种比例进行适当调整。</p> <p>4、资产支持证券投资策略</p> <p>本集合计划将在基本面分析和债券市场宏观分析的基础上，对资产支持证券的交易结构风险、信用风险、提前偿还风险和利率风险等进行分析，采取包括收益率曲线策略、信用利差曲线策略、预期利率波动率策略等积极主动的投资策略，投资于资产支持证券。</p> <p>5、可转债投资策略</p> <p>本资产管理计划将采用定性与定量相结合的方法来构建可转债投资组合，重点投资价值被市场低估、发债公司具有较好发展潜力、基础股票具有较高上升预期的个券品种。</p>
<p>业绩比较基准</p>	<p>本集合计划的业绩比较基准为：中债总财富(1-3年)指数收益率*90%+一年期定期存款利率(税后)*10%。</p>
<p>风险收益特征</p>	<p>本集合计划为债券型集合资产管理计划，其预期风险和预期收益高于货币市场基金和货币型集合资产管理计划，低于股票型基金、股票型集合资产管理计划、混合型基金和混合型集合资产管理计划。</p>

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。

### 2.3 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		财达证券股份有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	康云龙	张姗
	联系电话	0311-66006326	0755-83077987
	电子邮箱	kangyunlong@cdzq.com	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		95363	95555

传真	0311-66006200	0755-83195201
注册地址	石家庄市桥西区自强路35号	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
办公地址	河北省石家庄市桥西区自强路35号	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
邮政编码	050000	518040
法定代表人	翟建强	缪建民

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券日报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.95363.com">http://www.95363.com</a>
基金中期报告备置地点	石家庄市自强路35号庄家金融大厦

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	财达证券股份有限公司	河北省石家庄市桥西区自强路35号

## §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)	
	稳达三个月滚动持有债券A	稳达三个月滚动持有债券C
本期已实现收益	2,793,717.07	1,475,144.27
本期利润	5,328,947.26	2,894,529.08
加权平均基金份额本期利润	0.0310	0.0286
本期加权平均净值利润率	2.97%	2.79%
本期基金份额净值增长率	2.99%	2.84%
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	9,044,088.69	3,268,935.77
期末可供分配基金份额利润	0.0532	0.0340
期末基金资产净值	180,026,163.28	99,783,066.78
期末基金份额净值	1.0593	1.0371
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	报告期末 (2023年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	4.37%	3.71%

注：（1）所述集合计划业绩指标不包括持有人认购或交易的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

（2）本期已实现收益指集合计划本期利息收入、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损益。

（3）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（为期末余额，不是当期发生数）。

## 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

稳达三个月滚动持有债券A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.35%	0.02%	0.30%	0.03%	0.05%	-0.01%
过去三个月	1.26%	0.02%	1.06%	0.02%	0.20%	0.00%
过去六个月	2.99%	0.02%	1.56%	0.02%	1.43%	0.00%
过去一年	2.73%	0.04%	2.76%	0.04%	-0.03%	0.00%
自基金合同生效起至今	4.37%	0.04%	3.61%	0.03%	0.76%	0.01%

稳达三个月滚动持有债券C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.32%	0.02%	0.30%	0.03%	0.02%	-0.01%



过去三个月	1.19%	0.02%	1.06%	0.02%	0.13%	0.00%
过去六个月	2.84%	0.02%	1.56%	0.02%	1.28%	0.00%
过去一年	2.43%	0.04%	2.76%	0.04%	-0.33%	0.00%
自基金合同生效起至今	3.71%	0.04%	3.61%	0.03%	0.10%	0.01%

### 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

稳达三个月滚动持有债券A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3月28日，财达证券稳达三号集合资产管理计划正式变更为财达证券稳达三个月滚动持有债券型集合资产管理计划，即本集合计划。

注：本基金建仓期6个月，即从2022年3月28日至2022年9月27日止，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

稳达三个月滚动持有债券C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3月28日，财达证券稳达三号集合资产管理计划正式变更为财达证券稳达三个月滚动持有债券型集合资产管理计划，即本集合计划。

注：本基金建仓期6个月，即从2022年3月28日至2022年9月27日止，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

## §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

财达证券根据《财达证券稳达三号集合资产管理计划资产管理合同》及《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，截至2022年3月28日，旗下已有2只大集合产品完成公募化改造，分别为“财达证券稳达中短债债券型集合资产管理计划”、“财达证券稳达三个月滚动持有债券型集合资产管理计划”。

#### 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		
孔雀	投资经理	2022-03-28	-	13年	孔雀，硕士研究生学历，2017年12月加入财达证券，担任财达证券稳达一号、

					稳达三号集合资产管理计划投资经理
--	--	--	--	--	------------------

注：(1)基金的首任基金经理，其"任职日期"为基金合同生效日，其"离职日期"为根据公司决议确定的解聘日期；

(2)非首任基金经理，其"任职日期"和"离任日期"分别指根据公司决议确定的聘任日期和解聘日期；

(3)证券从业年限计算标准遵从中国证监会《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》中关于证券投资基金从业人员范围的相关规定。

#### 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，财达证券股份有限公司作为本集合计划管理人，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券法》、《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》、计划合同以及其它有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用计划资产，为集合计划份额持有人谋求最大利益，无损害集合计划持有人利益的行为，本集合计划投资组合符合有关法规及计划合同的约定。

#### 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

本集合计划管理人一贯公平对待旗下管理的所有集合计划和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《财达证券股份有限公司资产管理业务公平交易管理细则》等规定。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本集合计划存在异常交易行为。

报告期内，未出现涉及本集合计划的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况。

#### 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年上半年国内经济整体延续修复态势，通胀维持相对低位，固定资产投资中基建投资为重要支撑，地产投资仍为较大拖累，出口受外需影响偏弱，消费有所修复，其中餐饮消费恢复较快。

2023年初信贷数据良好叠加疫情冲击逐步减退，市场对经济复苏有较强的预期，收益率呈现震荡行情，进入3月之后，市场对基本面预期进一步转弱，经济内生动能不足，叠加资金面相对宽松，6月中旬超预期降息，债券市场收益率持续下行。

报告期内，组合采取了灵活稳健的投资策略，持仓品种AA+以上国企信用债为主，在结合对宏观经济、政策面和交易情绪等分析判断下灵活调整了久期和杠杆，精选个券，报告期内整体运行平稳。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末稳达三个月滚动持有债券A基金份额净值为1.0593元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为2.99%，同期业绩比较基准收益率为1.56%；截至报告期末稳达三个月滚动持有债券C基金份额净值为1.0371元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为2.84%，同期业绩比较基准收益率为1.56%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，政治局会议对稳增长政策发力表述积极，预计后续稳增长、宽地产，促消费等政策将密集落地。下半年广义财政政策或继续发力稳增长，尤其是在基建领域的投资力度或加大。在当前地产市场供求关系发生重大变化的新形势下，地产政策将适时调整优化，需要密切关注因城施策政策出台带来的边际变化。随着居民收入持续恢复，叠加鼓励消费政策的推出落地，下半年消费或将继续回暖。预计下半年仍将维持稳健的货币政策，在逆周期调节背景下，总量和结构性货币政策工具也将发挥作用，预计未来市场资金利率或将维持相对宽松。综上所述，管理人将继续本着谨慎、稳健、安全的原则，积极关注经济和政策面的变化，在严格控制信用风险的前提下，根据市场变化灵活调整投资策略，为投资者谋取稳定回报。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本投资管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和投资合同关于估值的约定，对投资所持有的投资品种进行估值。本计划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。本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

报告期内本集合计划未进行收益分配。

#### 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，本集合计划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

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

## 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

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，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：财达证券稳达三个月滚动持有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
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	766,989.86	2,896,011.94
结算备付金		-	1,128,740.29
存出保证金		466.99	1,421.04
交易性金融资产	6.4.7.2	281,865,297.09	289,430,162.62
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		281,865,297.09	289,430,162.62
资产支持证券投资		-	-
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	-	29,991,992.47
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		999,133.70	16,915.07
应收股利		-	-
应收申购款		400.00	101,000.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		283,632,287.64	323,566,243.43
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年06月30日</b>	<b>上年度末 2022年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
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		2,999,379.13	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		567,645.94	638,514.72
应付管理人报酬		65,465.70	84,019.61
应付托管费		21,821.91	28,006.54
应付销售服务费		24,794.61	65,753.38
应付投资顾问费		-	-
应交税费		32,723.61	29,366.46
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	111,226.68	166,553.33
负债合计		3,823,057.58	1,012,214.04
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	266,171,866.07	315,924,562.86

其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	13,637,363.99	6,629,466.53
净资产合计		279,809,230.06	322,554,029.39
负债和净资产总计		283,632,287.64	323,566,243.43

注：报告截止日2023年6月30日，基金份额净值1.0512元，基金份额总额266,171,866.07份，其中，A类基金份额净值1.0593元，基金份额总额169,953,939.13份；C类基金份额净值1.0371元，基金份额总额96,217,926.94份。

## 6.2 利润表

会计主体：财达证券稳达三个月滚动持有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03月28日（基金 合同生效日）至2022 年06月30日
<b>一、营业总收入</b>		9,300,914.20	3,002,557.62
1.利息收入		204,368.12	39,624.54
其中：存款利息收入	6.4.7.9	12,011.54	13,976.82
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		192,356.58	26,417.13
其他利息收入		-	-769.41
2.投资收益（损失以“-”填列）		5,141,931.08	1,805,437.93
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-	-
基金投资收益	6.4.7.11	-	-
债券投资收益	6.4.7.12	5,141,931.08	1,755,780.13
资产支持证券投资 收益	6.4.7.13	-	49,657.80
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-

股利收益	6.4.7.15	-	-
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（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	3,954,615.00	1,157,495.15
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-	-
<b>减：二、营业总支出</b>		1,077,437.86	310,905.53
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	422,289.78	147,175.92
2. 托管费	6.4.10.2.2	140,763.27	49,058.66
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	154,777.69	12,721.85
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		235,192.13	44,941.73
其中：卖出回购金融资产支出		235,192.13	44,941.73
6. 信用减值损失	6.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		18,931.19	10,243.50
8. 其他费用	6.4.7.19	105,483.80	46,763.87
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		8,223,476.34	2,691,652.09
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		8,223,476.34	2,691,652.09
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		8,223,476.34	2,691,652.09

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：财达证券稳达三个月滚动持有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）	315,924,562.86	-	6,629,466.53	322,554,029.39
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）	315,924,562.86	-	6,629,466.53	322,554,029.39
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-49,752,696.79	-	7,007,897.46	-42,744,799.33
（一）、综合收益总额	-	-	8,223,476.34	8,223,476.34
（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）	-49,752,696.79	-	-1,215,578.88	-50,968,275.67
其中：1.基金申购款	38,366,725.11	-	2,059,170.99	40,425,896.10
2.基金赎回款	-88,119,421.90	-	-3,274,749.87	-91,394,171.77
（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）	266,171,866.07	-	13,637,363.99	279,809,230.06
项目	上年度可比期间 2022年03月28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）	175,530,445.94	-	2,648,893.58	178,179,339.52
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	41,428,805.84	-	3,154,944.66	44,583,750.50
（一）、综合收益总额	-	-	2,694,532.65	2,694,532.65
（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）	41,428,805.84	-	460,412.01	41,889,217.85
其中：1.基金申购款	98,767,925.46	-	1,673,683.93	100,441,609.39
2.基金赎回款	-57,339,119.62	-	-1,213,271.92	-58,552,391.54

（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）	216,959,251.78	-	5,803,838.24	222,763,090.02

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：

康云龙

李冬梅

李冬梅

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

财达证券稳达三个月滚动持有债券型集合资产管理计划(以下简称“本集合计划”)是由财达证券稳达三号集合资产管理计划转型而来。财达证券稳达三号集合资产管理计划的管理人财达证券股份有限公司于2022年3月28日发布《财达证券稳达三个月滚动持有债券型集合资产管理计划合同生效公告》。根据公告，财达证券稳达三号集合资产管理计划名称变更为“财达证券稳达三个月滚动持有债券型集合资产管理计划”，财达证券稳达三号集合资产管理计划份额转换为财达证券稳达三个月滚动持有债券型集合资产管理计划份额。合同变更后，本集合计划的托管人不变，登记机构变更为财达证券股份有限公司。自2022年3月28日起《财达证券稳达三个月滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同》、《财达证券稳达三个月滚动持有债券型集合资产管理计划托管协议》生效。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。本集合计划的管理人为财达证券股份有限公司(以下简称“财达证券”)，托管人为招商银行股份有限公司(以下简称“招商银行”)。

本集合计划主要投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行的债券(包括国债、地方政府债、金融债、政策性金融债券、企业债、公司债、次级债、可转换债券(含可分离交易可转债的纯债部分)、证券公司发行的短期公司债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许集合计划投资的其他金融工具(但

须符合中国证监会相关规定)。本集合计划不直接从二级市场买入股票、权证等权益类资产,也不参与一级市场的新股申购或增发新股,仅可持有因可转债转股所形成的股票、因所持股票所派发的权证以及因投资可分离债券而产生的权证等,以及法律法规或中国证监会允许投资的其他非固定收益类品种(但须符合中国证监会的相关规定)。因上述原因持有的股票和权证等资产,本集合计划应在其可交易之日起的10个交易日内卖出。本集合计划不投资于股票等资产,也不投资于可交换债券。如法律法规或监管机构以后允许集合计划投资其他品种,管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本集合计划的投资组合比例为:本集合计划债券资产的比例不低于集合计划资产的80%;本集合计划所持有现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于计划资产净值的5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。如果法律法规或监管机构变更投资品种的投资比例限制,管理人在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。本集合计划的业绩比较基准为:中债总财富(1-3年)指数收益率\*90%+一年期定期存款利率(税后)\*10%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本集合计划的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》和在财务报表附注“重要会计政策和会计估计”所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本集合计划本报告期财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本集合计划本期末的财务状况以及本报告期的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 6.4.4.1 会计年度

本集合计划的会计年度为公历年度,即每年1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为2023年1月1日至2023年6月30日止期间。

##### 6.4.4.2 记账本位币

本集合计划核算以人民币为记账本位币,以人民币元为记账单位。

##### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### (1) 金融资产的分类

根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征，将金融资产划分为：以摊余成本计量的金融资产；以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产；以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

金融资产在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产，相关交易费用计入初始确认金额。

本计划目前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包括债券投资。

## （2）金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。

本集合计划的金融负债主要系其他金融负债。

### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

#### （1）金融工具的确认

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产采用公允价值进行后续计量，公允价值变动形成的利得或损失以及与该等金融资产相关的股利和利息收入计入当期损益。贷款和应收款项采用实际利率法，按摊余成本进行后续计量，在终止确认、发生减值或摊销时产生的利得或损失，计入当期损益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债采用公允价值进行后续计量，公允价值的变动形成的利得或损失以及与该等金融负债相关的股利和利息支出计入当期损益。其他金融负债采用实际利率法，按摊余成本进行后续计量，终止确认或摊销产生的利得或损失计入当期损益。

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益。

#### （2）金融资产的转移和计量方法

满足下列条件之一的金融资产，予以终止确认：①收取该金融资产现金流量的合同权利终止；②该金融资产已转移，且将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；③该金融资产已转移，虽然企业既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

若企业既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，且未放弃对该金融资产的控制的，则按照继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。继续涉入所转移金融资产的程度，是指该金融资产价值变动使企业面临的风险水平。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，将所转移金融资产的账面价值及因转移而收到的对价与原计入其他综合收益的公允价值变动累计额之和的差额计入当期损益。

金融资产部分转移满足终止确认条件的，将所转移金融资产的账面价值在终止确认及未终止确认部分之间按其相对的公允价值进行分摊，并将因转移而收到的对价与应分

摊至终止确认部分的原计入其他综合收益的公允价值变动累计额之和与分摊的前述账面金额之差额计入当期损益。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

(1) 估值原则：

①对存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的投资品种，在估值日有报价的，除会计准则规定的例外情况外，应将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量。估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

②对不存在活跃市场的投资品种，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

③如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在0.25%以上的，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 6.4.4.7 实收基金

本基金的份额面值为人民币1.00元。实收基金为对外发行基金份额总额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入实收基金增加和转出实收基金减少。

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。

损益平准金于申购确认日或赎回确认日确认，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由集合计划管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率或票面利率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由集合计划管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除在适用情况下公允价值变动产生的预估增值税后的净额确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由集合计划管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按资产管理合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

由于本基金A类和C类基金份额的销售费用收取方式存在不同，各基金份额类别对应的可供分配收益将有所不同。同一类别每一基金份额享有同等分配权。本基金收益分配方式分为现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值。

#### 6.4.4.12 外币交易

无。

#### 6.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组

成部分：(1)该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2)本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3)本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

对于已上市或已挂牌转让的不含权固定收益品种，选取第三方估值基准服务机构提供的相应品种当日的估值全价并根据相关法律、法规的规定进行涉税处理。

对于已上市或已挂牌转让的含权固定收益品种，选取第三方估值基准服务机构提供的相应品种当日的唯一估值全价或推荐估值全价。

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选取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，同时应充分考虑发行人的信用风险变化对公允价值的影响。回售登记期截止日（含当日）后未行使回售权的按照第三方估值基准服务机构提供的长待偿期所对应的价格进行估值。

对于在交易所市场上市交易的公开发行的可转换债券等有活跃市场的含转股权的债券，实行全价交易的债券选取估值日收盘价作为估值全价；实行净价交易的债券选取估值日收盘价并加计每百元税前应计利息作为估值全价。

对于未上市或未挂牌转让且不存在活跃市场的固定收益品种，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定其公允价值。

### 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

本集合计划本报告期末发生会计政策变更。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

报告期内按照中基协2022年12月30日发布的《关于固定收益品种的估值处理标准》进行了估值方法修改。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本集合计划在本报告期间无须说明的会计差错更正。

### 6.4.6 税项

本集合计划目前比照证券投资基金的相关税务法规及其他相关国内税务法规计提和缴纳税款，主要税项列示如下：

#### 1、增值税



根据财政部和国家税务总局2017年6月30日发布的《关于资管产品增值税有关问题的通知》，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，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税，通知自2018年1月1日起施行。对资管产品在2018年1月1日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，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

## 2、印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年4月24日起，调整证券(股票)交易印花税税率，由原先的3%调整为1%；经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年9月19日起，调整由出让方按证券(股票)交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变。

## 3、城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

## 4、个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自2008年10月9日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

### 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	766,989.86
等于：本金	766,742.22
加：应计利息	247.64
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	766,989.86

#### 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	70,391,100.00	1,015,150.69	71,525,635.69	119,385.00
	银行间市场	206,512,645.00	4,074,146.40	210,339,661.40	-247,130.00
	合计	276,903,745.00	5,089,297.09	281,865,297.09	-127,745.00
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	276,903,745.00	5,089,297.09	281,865,297.09	-127,745.00	

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本集合计划本报告期末未持有衍生金融资产/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

本集合计划本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本集合计划本报告期末未持有从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未持有其他资产。

### 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	22,883.52
其中：交易所市场	6,148.33
银行间市场	16,735.19
应付利息	-
预提费用	79,343.16
预提费用-账户维护费	9,000.00
合计	111,226.68

### 6.4.7.7 实收基金

#### 6.4.7.7.1 稳达三个月滚动持有债券A

金额单位：人民币元

项目 (稳达三个月滚动持有债券A)	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	196,935,279.62	196,935,279.62
本期申购	33,531,648.04	33,531,648.04
本期赎回（以“-”号填列）	-60,512,988.53	-60,512,988.53
本期末	169,953,939.13	169,953,939.13

#### 6.4.7.7.2 稳达三个月滚动持有债券C

金额单位：人民币元

项目 (稳达三个月滚动持有债券C)	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	118,989,283.24	118,989,283.24
本期申购	4,835,077.07	4,835,077.07
本期赎回（以“-”号填列）	-27,606,433.37	-27,606,433.37
本期末	96,217,926.94	96,217,926.94

### 6.4.7.8 未分配利润

#### 6.4.7.8.1 稳达三个月滚动持有债券A

单位：人民币元

项目 (稳达三个月滚动持有 债券A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	7,242,715.20	-1,621,748.97	5,620,966.23
本期利润	2,793,717.07	2,535,230.19	5,328,947.26
本期基金份额交易产 生的变动数	-992,343.58	114,654.24	-877,689.34
其中：基金申购款	1,730,177.02	182,687.43	1,912,864.45
基金赎回款	-2,722,520.60	-68,033.19	-2,790,553.79
本期已分配利润	-	-	-
本期末	9,044,088.69	1,028,135.46	10,072,224.15

#### 6.4.7.8.2 稳达三个月滚动持有债券C

单位：人民币元

项目 (稳达三个月滚动持有 债券C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	2,307,833.65	-1,299,333.35	1,008,500.30
本期利润	1,475,144.27	1,419,384.81	2,894,529.08
本期基金份额交易产 生的变动数	-514,042.15	176,152.61	-337,889.54
其中：基金申购款	135,829.18	10,477.36	146,306.54
基金赎回款	-649,871.33	165,675.25	-484,196.08
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,268,935.77	296,204.07	3,565,139.84

### 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	6,193.31

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	5,813.40
其他	4.83
合计	12,011.54

#### 6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

本集合计划本报告期内无股票投资收益-买卖股票差价收入。

#### 6.4.7.11 基金投资收益

本集合计划本报告期内无基金投资。

#### 6.4.7.12 债券投资收益

##### 6.4.7.12.1 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	5,627,923.47
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-485,992.39
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	5,141,931.08

##### 6.4.7.12.2 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	189,062,166.87
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	185,606,650.00
减：应计利息总额	3,928,542.22
减：交易费用	12,967.04
买卖债券差价收入	-485,992.39

#### 6.4.7.12.3 债券投资收益——赎回差价收入

本集合计划本报告期内无债券赎回差价收入。

#### 6.4.7.12.4 债券投资收益——申购差价收入

本集合计划本报告期内无债券申购差价收入。

#### 6.4.7.13 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益项目构成

本集合计划本报告期内无资产支持证券投资收益。

##### 6.4.7.13.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本集合计划本报告期内无买卖资产支持证券差价收入

##### 6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

本集合计划本报告期内无资产支持证券投资赎回差价收入。

##### 6.4.7.13.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

本集合计划本报告期内无资产支持证券申购差价收入。

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

##### 6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本集合计划本报告期内无衍生工具收益-买卖权证差价收入。

##### 6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

本集合计划本报告期内无衍生工具收益-其他投资收益。

#### 6.4.7.15 股利收益

本集合计划本报告期内无股利收益。

#### 6.4.7.16 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	3,954,615.00
——股票投资	-
——债券投资	3,954,615.00

——资产支持证券投资	-
——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	3,954,615.00

注：本表扣减预估附加税。

#### 6.4.7.17 其他收入

无。

#### 6.4.7.18 信用减值损失

本产品无预期信用减值。

#### 6.4.7.19 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	19,835.79
信息披露费	59,507.37
汇划手续费	7,660.64
帐户维护费	18,480.00
合计	105,483.80

#### 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，本集合计划并无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本集合计划并无须作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

本集合计划本报告期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
财达证券	基金管理人、基金销售机构
招商银行股份有限公司	基金托管人

#### 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

本集合计划本报告期未发生通过关联方交易单元进行的股票交易。

##### 6.4.10.1.2 权证交易

本集合计划本报告期未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

##### 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03月28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比例	成交金额	占当期债券买卖成交总额的比例
财达证券	39,829,700.00	100.00%	10,000,000.00	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03月28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
财达证券	413,100,000.00	100.00%	615,800,000.00	100.00%



### 6.4.10.1.5 基金交易

本集合计划本报告期未发生通过关联方交易单元进行的基金交易。

### 6.4.10.1.6 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
财达证券	14,215.54	100.00%	6,148.33	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2022年03月28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
财达证券	10,787.99	100.00%	5,784.99	100.00%

注：上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与佣金收取方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

### 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03月28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	422,289.78	147,175.92
其中：支付销售机构的客户维护费	436.64	-

注：支付基金管理人财达证券的管理费按前一日集合计划资产净值的0.3%年费率计提，按月支付。其计算公式为：

每日应计提的集合计划管理费 = 前一日集合计划资产净值 × 0.30% / 当年天数。

#### 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	上年度可比期间 2022年03月28日（基金合同生
----	-------------------	------------------------------

	至2023年06月30日	效日)至2022年06月30日
	日	
当期发生的基金应支付的托管费	140,763.27	49,058.66

注：支付托管人招商银行的托管费按前一日集合计划资产净值的0.1%年费率计提，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日集合计划资产净值×0.10%/当年天数。

#### 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		
	稳达三个月滚动持有债券A	稳达三个月滚动持有债券C	合计
财达证券	0.00	154,777.69	154,777.69
合计	0.00	154,777.69	154,777.69
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2022年03月28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		
	稳达三个月滚动持有债券A	稳达三个月滚动持有债券C	合计
财达证券	0.00	12,721.85	12,721.85
合计	0.00	12,721.85	12,721.85

注：支付销售机构的销售服务费按前一日A类基金份额和C类基金份额基金资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。由托管人根据管理人的指令从基金资产中支付。A类计划份额不收取销售服务费，C类计划份额的销售服务费年费率为0.3%。其计算公式为：

每日应计提的C类计划份额销售服务费=为前一日的C类计划份额的资产净值×销售服务年费率/当年天数。

#### 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

本报告期内，本集合计划未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本集合计划本报告期内未有与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况。

#### 6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本集合计划本报告期内未有与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

稳达三个月滚动持有债券A

份额单位：份

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03月28日（基金 合同生效日）至2022年0 6月30日
基金合同生效日（2022年03月28日）持有的基金份额	0.00	0.00
报告期初持有的基金份额	0.00	0.00
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	0.00
报告期末持有的基金份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	0.00%

稳达三个月滚动持有债券C

份额单位：份

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03月28日（基金 合同生效日）至2022年0 6月30日
基金合同生效日（2022年03月28日）持有的基金份额	0.00	0.00
报告期初持有的基金份额	39,745,627.98	0.00
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	0.00
报告期末持有的基金份额	39,745,627.98	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	41.31%	0.00%

#### 6.4.10.5.2 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

截至本报告期末，无除基金管理人之外的其他关联方投资本集合计划。

#### 6.4.10.6 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03月28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
招商银行股份有限公司	766,989.86	6,193.31	7,672,766.15	7,374.32

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期内，本集合计划不存在在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本报告期内，本集合计划未发生其他关联交易事项。

#### 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

本报告期内，本集合计划未进行利润分配。

#### 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

截至本报告期末，本集合计划未持有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

截至本报告期末，本集合计划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，本集合计划未持有银行间市场债券正回购。

#### 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，本集合计划从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额2,999,379.13元。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本集合计划本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

本集合计划为债券型集合计划，其预期风险和预期收益高于货币市场基金和货币型集合计划，低于混合型基金、混合型集合计划、股票型基金和股票型集合计划。主要投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行的债券(包括国债、地方政府债、金融债、政策性金融债券、企业债、公司债、次级债、可转换债券(含可分离交易可转债的纯债部分)、证券公司发行的短期公司债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许集合计划投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。日常经营活动中本集合计划面临的风险主要包括：信用风险、流动性风险、市场风险、利率风险。

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

为加强公司内部控制和风险管理，防范和化解风险，促进公司诚信、合法、有效经营，保障产品投资者的合法权益，公司已经建立健全内部控制体系和内部控制制度。

公司内部控制制度有公司基本管理制度、部门业务规章组成，其中公司基本管理制度包括公司的风险管理制度、公司合规管理制度、稽核审计制度，从公司层面全面建立、健全风险管理制度体系和风险管理要求；部门业务规章包括部门专门针对资产管理业务的风险管理制度、流动性风险管理、合规管理制度、集合计划会计制度、信息披露制度、关联交易制度等，针对资产管理业务进行具体规范。

公司风险管理组织架构包括五个主要部分：董事会及风险管理委员会，监事会，总经理办公会及风险控制委员会，风险管理部及各类专业风险管理部门，其他各部门、分支机构及子公司。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指集合计划在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者集合计划所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致集合计划资产损失和收益变化的风险。

本集合计划的管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本集合计划的活期银行存款存放在本集合计划的托管行招商银行股份有限公司。对于定期银行存

款，本集合计划通过选择具备适当信用水平的银行作为交易对手、平衡信用风险与投资收益率、综合参考内外部信用评级信息评价及调整投资限额，管理相关信用风险并定期评估减值损失。本集合计划在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本集合计划的管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

#### 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	15,143,220.38	-
A-1以下	-	-
未评级	35,467,068.20	-
合计	50,610,288.58	-

注：1、2022年12月31日及以前债券取债项评级，没有债项评级的取主体评级。2023年6月30日债券只取债项评级，没有债项评级的部分，归入未评级部分。

2、2023年6月30日按照期限来进行短期信用评级和长期信用评级的划分，债券发行期限小于等于1年的，归入短期信用评级部分，发行期限大于1年的，归入长期信用评级部分。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

截至本报告期末，本集合计划未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

截至本报告期末，本集合计划未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

#### 6.4.13.2.4 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	123,569,858.13	116,647,902.34
AAA以下	41,281,724.98	71,536,786.30
未评级	66,403,425.40	101,245,473.98
合计	231,255,008.51	289,430,162.62

注：1、2022年12月31日及以前债券取债项评级，没有债项评级的取主体评级。2023年6月30日债券只取债项评级，没有债项评级的部分，归入未评级部分。

2、2023年6月30日按照期限来进行短期信用评级和长期信用评级的划分，债券发行期限小于等于1年的，归入短期信用评级部分，发行期限大于1年的，归入长期信用评级部分。

#### **6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

截至本报告期末，本集合计划未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### **6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

截至本报告期末，本集合计划未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

### **6.4.13.3 流动性风险**

流动性风险主要是指公司无法以合理成本及时获得充足资金，以偿付到期债务、履行其他支付义务和满足正常业务开展的资金需求的风险。

公司建立以净资本和流动性为核心的风险控制指标体系，健全动态监控系统，完善压力测试工作机制，加强对流动性的监测、分析与报告，及时识别和管理公司在经营过程中的流动性风险。

公司关注并加强资金流动性风险管理，充分考量公司的风险偏好和风险承受，对自营、信用交易、资管等风险业务设定相应的风控指标，如债券评级、单一客户和单一证券集中度、自有资金参与单个资管项目规模等，同时加强该类指标的监控。

同时，本集合计划的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本集合计划从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本集合计划管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

#### **6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析**

在日常运作中，本集合计划的流动性安排能够与基金合同约定的申购赎回安排以及投资者的申购赎回规律相匹配。在资产端，本集合计划主要投资于合同约定的具有良好流动性的金融工具。本集合计划管理人持续监测集合计划持有资产的市场交易量、交易集中度等涉及资产流动性水平的风险指标，并定期开展压力测试，详细评估在不同的压力情景下资产变现情况的变化。在负债端，本集合计划管理人持续监测集合计划开放期内投资者历史申购、投资者类型和结构变化等数据，审慎评估不同市场环境可能带来的投资者潜在赎回需求，当市场环境或投资者结构发生变化时，及时调整组合资产结构及比例，预留充足现金头寸，保持基金资产可变现规模和期限与负债赎回规模和期限的匹

配。如遭遇极端市场情形或投资者非预期巨额赎回情形，本集合计划管理人将采用基金合同约定的赎回申请处理方式及其他各类流动性风险管理工具，控制极端情况下的潜在流动性风险。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指集合计划所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本集合计划管理人定期对本集合计划面临的利率敏感性缺口进行监控，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。

本集合计划投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种比重较大，此外还持有银行存款、结算备付金、存出保证金和买入返售金融资产等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。

##### 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 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
<b>资产</b>					
银行存款	766,989.86	-	-	-	766,989.86
存出保证金	466.99	-	-	-	466.99
交易性金融资产	162,713,929.06	119,151,368.03	-	-	281,865,297.09
应收清算款	-	-	-	999,133.70	999,133.70
应收申购款	-	-	-	400.00	400.00
资产总计	163,481,385.91	119,151,368.03	-	999,533.70	283,632,287.64
<b>负债</b>					
卖出回购金融资产款	2,999,379.13	-	-	-	2,999,379.13
应付赎回款	-	-	-	567,645.94	567,645.94
应付管理人报酬	-	-	-	65,465.70	65,465.70
应付托管费	-	-	-	21,821.91	21,821.91
应付销售服务费	-	-	-	24,794.61	24,794.61
应交税费	-	-	-	32,723.61	32,723.61
其他负债	-	-	-	111,226.68	111,226.68
负债总计	2,999,379.13	-	-	823,678.45	3,823,057.58
利率敏感度缺口	160,482,006.78	119,151,368.03	-	175,855.25	279,809,230.06



上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	2,896,011.94	-	-	-	2,896,011.94
结算备付金	1,128,740.29	-	-	-	1,128,740.29
存出保证金	1,421.04	-	-	-	1,421.04
交易性金融资产	51,158,283.56	238,271,879.06	-	-	289,430,162.62
买入返售金融资产	29,991,692.47	-	-	-	29,991,692.47
应收清算款	-	-	-	16,915.07	16,915.07
应收申购款	-	-	-	101,000.00	101,000.00
资产总计	85,176,149.30	238,271,879.06	-	117,915.07	323,565,943.43
负债					
应付赎回款	-	-	-	638,514.72	638,514.72
应付管理人报酬	-	-	-	84,019.61	84,019.61
应付托管费	-	-	-	28,006.54	28,006.54
应付销售服务费	-	-	-	65,753.38	65,753.38
应交税费	-	-	-	29,366.46	29,366.46
其他负债	-	-	-	166,553.33	166,553.33
负债总计	-	-	-	1,012,214.04	1,012,214.04
利率敏感度缺口	85,176,149.30	238,271,879.06	-	-894,298.97	322,553,729.39

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
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
	市场利率上升25个基点	-648,383.21	-1,026,085.19
	市场利率下降25个基点	651,308.61	1,032,470.92

#### 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。本集合计划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

其他价格风险为除市场利率和外汇汇率以外的市场因素发生变动时产生的价格波动风险。本集合计划的其他价格风险主要为市场价格变化或波动所引起的债券等资产损失的可能性。

本集合计划通过投资组合的分散化降低市场价格风险。此外，本集合计划管理人对本集合计划所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法进行风险度量和分析，以对风险进行跟踪和控制。

#### 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	281,865,297.09	100.73	289,430,162.62	89.73
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	281,865,297.09	100.73	289,430,162.62	89.73

### 6.4.14 公允价值

#### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

根据企业会计准则的相关规定，以公允价值计量的金融工具，其公允价值的计量可分为三个层次：

第一层次：对存在活跃市场报价的金融工具，可以相同资产/负债在活跃市场上的报价确定公允价值。

第二层次：对估值日活跃市场无报价的金融工具，可以类似资产/负债在活跃市场上的报价为依据做必要调整确定公允价值；对估值日不存在活跃市场的金融工具，可以相同或类似资产/负债在非活跃市场上的报价为依据做必要调整确定公允价值。

第三层次：对无法获得相同或类似资产可比市场交易价格的金融工具，可以其他反映市场参与者对资产/负债定价时所使用的参数为依据确定公允价值。

#### 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	-	-
第二层次	281,865,297.09	289,430,162.62
第三层次	-	-
合计	281,865,297.09	289,430,162.62

#### 6.4.14.2 公允价值所属层次间的重大变动

本集合计划持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2023年6月30日，本集合计划未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本集合计划无需要说明的其他重要事项。

## §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	281,865,297.09	99.38
	其中：债券	281,865,297.09	99.38
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-

	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	766,989.86	0.27
8	其他各项资产	1,000,000.69	0.35
9	合计	283,632,287.64	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本集合计划本报告期末未持有股票。

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本集合计划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

本集合计划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

本集合计划本报告期内未持有股票。

### 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

本集合计划本报告期内未持有股票。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本集合计划本报告期内未持有股票。

## 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	15,366,515.21	5.49
	其中：政策性金融债	15,366,515.21	5.49
4	企业债券	81,980,827.20	29.30
5	企业短期融资券	50,610,288.58	18.09
6	中期票据	133,907,666.10	47.86

7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	281,865,297.09	100.73

### 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	102103251	21信阳华信MTN001	200,000	20,501,372.05	7.33
2	101901680	19蓉经开MTN001	100,000	10,527,018.90	3.76
3	2180386	21周口小微债02	100,000	10,455,191.51	3.74
4	102101443	21国药租赁MTN001	100,000	10,450,230.96	3.73
5	102281673	22淮安开发MTN003	100,000	10,438,997.95	3.73

### 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

本集合计划本报告期末未持有资产支持证券。

### 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

本集合计划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

本集合计划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

本集合计划本报告期末无股指期货投资。

### 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

本集合计划本报告期末无国债期货投资。

#### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本集合计划本报告期末无国债期货投资。

### 7.12 投资组合报告附注

**7.12.1 基金投资前十名证券的发行主体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 本集合计划本报告期末未持有股票。**

**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	466.99
2	应收清算款	999,133.70
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	400.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,000,000.69

**7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

本集合计划本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

**7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本集合计划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

份额级别	持有人户数(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	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
稳达三	1,783	95,319.09	39,840,302.61	23.44%	130,113,636.52	76.56%

个月滚动持有债券A						
稳达三个月滚动持有债券C	840	114,545.15	49,632,912.93	51.58%	46,585,014.01	48.42%
合计	2,579	103,207.39	89,473,215.54	33.61%	176,698,650.53	66.39%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	稳达三个月滚动持有债券A	3,568,471.38	2.10%
	稳达三个月滚动持有债券C	429,382.96	0.45%
	合计	3,997,854.34	1.50%

### 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	份额级别	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	稳达三个月滚动持有债券A	0
	稳达三个月滚动持有债券C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	稳达三个月滚动持有债券A	0~10
	稳达三个月滚动持有债券C	0
	合计	0~10

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

	稳达三个月滚动持有债券A	稳达三个月滚动持有债券C
基金合同生效日(2022年03月28日)基金份额总额	140,701,671.74	-

本报告期期初基金份额总额	196,935,279.62	118,989,283.24
本报告期基金总申购份额	33,531,648.04	4,835,077.07
减：本报告期基金总赎回份额	60,512,988.53	27,606,433.37
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	169,953,939.13	96,217,926.94

## §10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本集合计划未召开份额持有人大会。

### 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，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本集合计划未改聘会计师事务所。

### 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

本报告期内，管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 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	
财达证券股	2	-	-	14,215.54	100.00%	-



份有限公司						
-------	--	--	--	--	--	--

### 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
财达证券股份有限公司	39,829,700.00	100.00%	413,100,000.00	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	关于财达证券股份有限公司旗下部分基金在蚂蚁（杭州）基金销售有限公司销售并参加其申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-02-27
2	关于财达证券股份有限公司旗下部分基金在中证金牛（北京）基金销售有限公司销售并参加其申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-03-10
3	关于财达证券股份有限公司旗下部分基金在上海联泰基金销售有限公司销售并参加其申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-03-15
4	财达证券稳达三个月滚动持有债券型集合资产管理计划（A类份额）基金产品资料概要更新	中国证监会指定报刊及网站	2023-03-28
5	财达证券稳达三个月滚动持有债券型集合资产管理计划（C类份额）基金产品资料概要更新	中国证监会指定报刊及网站	2023-03-28
6	财达证券稳达三个月滚动持有债券型集合资产管理计划	中国证监会指定报刊及网站	2023-03-28

	招募说明书（更新）（2023 年第1号）		
7	财达证券稳达三个月滚动持有债券型集合资产管理计划 2022年年度报告	中国证监会指定网站	2023-03-31
8	关于财达证券股份有限公司旗下部分基金在上海攀赢基金销售有限公司销售并参加其申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-03-31
9	关于财达证券股份有限公司旗下部分基金在珠海盈米基金销售有限公司销售并参加其申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-04-06
10	财达证券稳达三个月滚动持有债券型集合资产管理计划 2023年第1季度报告	中国证监会指定网站	2023-04-21
11	关于财达证券股份有限公司旗下部分基金在通华财富（上海）基金销售有限公司销售并参加其申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-04-26
12	关于财达证券股份有限公司旗下部分基金在宁波银行股份有限公司销售并参加其申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-06-06
13	关于财达证券股份有限公司旗下部分基金在招商银行股份有限公司销售并参加其申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-06-06

## §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

本集合计划报告期内未出现单一投资者持有集合计划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、《关于准予财达证券稳达三号集合资产管理计划合同变更的回函》；
- 2、《财达证券稳达三个月滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同》；
- 3、《财达证券稳达三个月滚动持有债券型集合资产管理计划托管协议》；
- 4、《财达证券稳达三个月滚动持有债券型集合资产管理计划招募说明书》；
- 5、报告期内在规定报刊上披露的各项公告；
- 6、集合计划管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、中国证监会要求的其他文件。

### 12.2 存放地点

备查文件存放于集合计划管理人的办公场所：  
石家庄市自强路35号庄家金融大厦。

### 12.3 查阅方式

投资者可到集合计划管理人的办公场所免费查阅备查文件，亦可通过公司网站查阅，公司网址为：[www.95363.com](http://www.95363.com)。

财达证券股份有限公司  
二〇二三年八月三十日