
财信证券30天持有期债券型集合资产管理计划

2023年第四季度报告

2023年12月31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

报告送出日期:2024年01月19日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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2024年01月10日复核了本报告中的财务指标、净值表现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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2023年10月01日起至2023年12月31日止。

§2 基金产品概况

| | |
|------------|---|
| 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 |
| 报告期末基金份额总额 | 368,547,197.73份 |
| 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。 |
| 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 |

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。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期（2023年10月01日 - 2023年12月31日） |
|----------------|--------------------------------|
| 1.本期已实现收益 | 3,184,249.62 |
| 2.本期利润 | 2,275,571.10 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0054 |
| 4.期末基金资产净值 | 378,287,351.85 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.0264 |

注：

- 1、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。
- 2、本集合计划一般情况下不收取申购费用与赎回费用。但是，对持续持有期少于7日的投资者收取不低于1.5%的赎回费，并全额计入集合计划财产。
- 3、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。

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 | 净值增长率① | 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 |
|----|--------|-----------|------------|---------------|-----|-----|
| | | | | | | |

| | | | | | | |
|------------|-------|-------|-------|-------|--------|-------|
| 过去三个月 | 0.54% | 0.02% | 0.71% | 0.02% | -0.17% | 0.00% |
| 过去六个月 | 1.04% | 0.02% | 1.13% | 0.01% | -0.09% | 0.01% |
| 过去一年 | 3.04% | 0.02% | 2.54% | 0.01% | 0.50% | 0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | 2.64% | 0.04% | 3.70% | 0.01% | -1.06% | 0.03% |

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



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 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 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、 | 2022- | - | 12年 | 中国籍，经济学硕士，2011 |

| | | | | | |
|----|------------------------|------------|---|----|--|
| | 财信证券资管投资部投资主管 | 05-20 | | | 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。 |
| 赵旸 | 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。 |

注：

- （1）张艳、赵旸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。

4.1.1 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遵规守信情况的说明

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，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

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 报告期内基金的投资策略和运作分析

四季度债券收益率震荡明显，利率中枢整体下行。10月中上旬，受特殊再融资债券供给扰动影响，资金面持续紧张，收益率上行，短债压力尤其明显；10月下旬，增发国债落地，市场配置力量支撑债市，PMI数据偏弱，长端收益率下行，受同业存单利率持续高企影响短端表现不佳；11月，稳增长预期再起，央行关注资金空转，债市再次调整，11月底央行三季度货币政策执行报告基调偏暖，多头情绪得到提振，12月中央经济工作会议落地，政策未超预期，年末银行存款利率下调彻底引爆债券市场，各期限收益率快速下行。

本报告期内本基金资产以短期限、高等级信用债为主，优选安全等级高、流动性好的标的贡献票息及资本利得收益，积极参与利率债、二级资本债、可转债波段交易，辅以国债期货套保策略。本报告期内，本基金杠杆率和组合久期均维持在较低水平。

4.5 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1.0264元，本报告期内，基金份额净值增长率为0.54%，同期业绩比较基准收益率为0.71%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 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 | 387,512,755.55 | 94.66 |

| | | | |
|---|-------------------|----------------|--------|
| | 其中：债券 | 348,209,506.24 | 85.06 |
| | 资产支持证券 | 39,303,249.31 | 9.60 |
| 4 | 贵金属投资 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | 19,347,153.71 | 4.73 |
| | 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 | 2,331,725.70 | 0.57 |
| 8 | 其他资产 | 193,463.80 | 0.05 |
| 9 | 合计 | 409,385,098.76 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|-----------|----------------|---------------|
| 1 | 国家债券 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 92,021,412.56 | 24.33 |
| | 其中：政策性金融债 | 50,561,994.53 | 13.37 |
| 4 | 企业债券 | 90,115,026.71 | 23.82 |
| 5 | 企业短期融资券 | 60,831,795.08 | 16.08 |
| 6 | 中期票据 | 103,508,999.67 | 27.36 |
| 7 | 可转债（可交换债） | 1,732,272.22 | 0.46 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 348,209,506.24 | 92.05 |

5.5 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债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|--------------|---------|---------------|--------------|
| 1 | 1928010 | 19平安银行二级 | 300,000 | 31,095,188.52 | 8.22 |
| 2 | 012381780 | 23赣国资SCP004 | 300,000 | 30,500,040.98 | 8.06 |
| 3 | 127767 | PR钱投债 | 500,000 | 21,300,038.36 | 5.63 |
| 4 | 102100059 | 21徐州交通MTN001 | 200,000 | 20,740,860.27 | 5.48 |
| 5 | 102101120 | 21平天湖MTN001 | 200,000 | 20,681,338.80 | 5.47 |

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

| 序号 | 证券代码 | 证券名称 | 数量(份) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|-------|---------|---------------|--------------|
| 1 | 112116 | 尚水3优 | 180,000 | 18,589,389.04 | 4.91 |
| 2 | 180644 | 尚水1优 | 100,000 | 10,371,493.15 | 2.74 |
| 3 | 143056 | 崖州湾1A | 100,000 | 10,342,367.12 | 2.73 |

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金执行国债期货套期保值策略，借助国债期货防范债券投资业务中的市场风险，提高债券投资业务模式的稳定性和可靠性。在风险可控的前提下，综合考虑流动性、

基差水平等情况，谨慎原则参与国债期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

| 代码 | 名称 | 持仓量 (买/卖) | 合约市值 (元) | 公允价值 变动(元) | 风险指标说明 |
|-------------------|---|--------------|---------------|---------------|-----------|
| TS2403 | 票面利率 3%的2年 期名义中 短期国债 期货2403 合约 | -1 | -2,026,440.00 | -7,720.00 | - |
| 公允价值变动总额合计(元) | | | | | -7,720.00 |
| 国债期货投资本期收益(元) | | | | | 2,950.70 |
| 国债期货投资本期公允价值变动(元) | | | | | -7,720.00 |

注：本基金本报告期内通过在财信期货有限公司开立的期货账户进行的国债期货投资。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本报告期内，本基金的国债期货投资相对谨慎，通过国债期货套期保值操作调整组合整体久期和DV01水平，降低产品净值波动，符合既定的投资政策和投资目的。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 本基金本报告期内未投资股票。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|----|---------|------------|
| 1 | 存出保证金 | 17,163.80 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 176,300.00 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |

| | | |
|---|----|------------|
| 8 | 合计 | 193,463.80 |
|---|----|------------|

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|-------|------------|--------------|
| 1 | 127005 | 长证转债 | 367,172.53 | 0.10 |
| 2 | 110048 | 福能转债 | 302,593.97 | 0.08 |
| 3 | 110062 | 烽火转债 | 279,369.86 | 0.07 |
| 4 | 127064 | 杭氧转债 | 182,306.27 | 0.05 |
| 5 | 127084 | 柳工转2 | 168,004.79 | 0.04 |
| 6 | 110075 | 南航转债 | 156,014.25 | 0.04 |
| 7 | 113024 | 核建转债 | 106,931.64 | 0.03 |
| 8 | 113050 | 南银转债 | 106,013.56 | 0.03 |
| 9 | 123108 | 乐普转2 | 33,002.67 | 0.01 |
| 10 | 113053 | 隆22转债 | 30,862.68 | 0.01 |

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末持有股票。

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|---------------------------|----------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 468,631,764.93 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 40,382,902.76 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 140,467,469.96 |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 368,547,197.73 |

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

| | |
|--------------------------|---------------|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额 | 45,000,000.00 |
| 报告期期间买入/申购总份额 | - |
| 报告期期间卖出/赎回总份额 | 45,000,000.00 |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额 | - |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%） | - |

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

| 序号 | 交易方式 | 交易日期 | 交易份额（份） | 交易金额（元） | 适用费率 |
|----|------|------------|---------------|---------------|------|
| 1 | 赎回 | 2023-11-13 | 30,000,000.00 | 30,705,000.00 | - |
| 2 | 赎回 | 2023-11-14 | 15,000,000.00 | 15,355,500.00 | - |
| 合计 | | | 45,000,000.00 | 46,060,500.00 | |

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

2023/10/24 财信证券30天持有期债券型集合资产管理计划2023年第三季度报告

2023/12/12 财信证券股份有限公司基金行业高级管理人员变更公告

§9 备查文件目录

9.1 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) 2022年《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) 2022年《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) 2023年《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》；
- (9) 2023年《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》；
- (10) 管理人经营证券期货业务许可证、营业执照；

(11) 报告期内披露的各项公告

9.2 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

9.3 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

2024年01月19日