

# 财信证券 30 天持有期债券型集合资产管理计划

## 2024 年中期报告

2024 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:2024 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2024年08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2024年01月01日起至2024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 .....	14
6.3 净资产变动表 .....	16
6.4 报表附注 .....	18
§7 投资组合报告 .....	45
7.1 期末基金资产组合情况 .....	45
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	46
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 .....	46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	47
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 .....	47
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 .....	47
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 .....	48
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 .....	48
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	48
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	48
7.12 投资组合报告附注 .....	48
§8 基金份额持有人信息 .....	49

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	50
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	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 .....	50
§9 开放式基金份额变动 .....	50
§10 重大事件揭示 .....	51
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	51
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 .....	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	51
10.4 基金投资策略的改变 .....	52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	52
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 .....	52
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	52
10.8 其他重大事件 .....	53
§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....	54
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 .....	54
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	54
§12 备查文件目录 .....	54
12.1 备查文件目录 .....	54
12.2 存放地点 .....	55
12.3 查阅方式 .....	55

## §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	356,460,407.54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	021-60635778
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	张金良

### 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 (2024年01月01日- 2024年06月30日)
本期已实现收益	2,704,482.28
本期利润	4,440,108.51
加权平均基金份额本期利润	0.0120
本期加权平均净值利润率	1.16%
本期基金份额净值增长率	1.18%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2024年06月30日)
期末可供分配利润	13,717,664.64
期末可供分配基金份额利润	0.0385
期末基金资产净值	370,178,072.18
期末基金份额净值	1.0385
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2024年06月30日)
基金份额累计净值增长率	3.85%

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

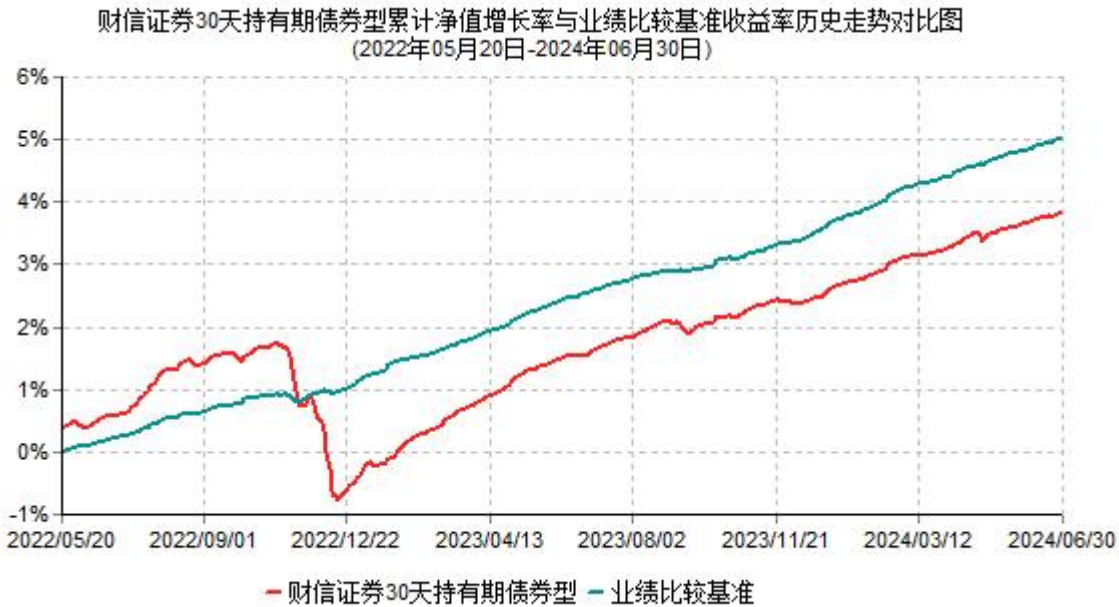
##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	①-③	②-④

		准差②	率③	率标准差④		
过去一个月	0.19%	0.01%	0.18%	0.01%	0.01%	0.00%
过去三个月	0.57%	0.02%	0.59%	0.01%	-0.02%	0.01%
过去六个月	1.18%	0.02%	1.26%	0.01%	-0.08%	0.01%
过去一年	2.23%	0.02%	2.40%	0.01%	-0.17%	0.01%
自基金合同生效起至今	3.85%	0.04%	5.01%	0.01%	-1.16%	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



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（简称“财信证券”）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。截至2023年12月31日，公司总资产超540亿元，净资产超150亿元。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。公司在全国设有6家分公司和86家营业部，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。

经过多年探索积累，公司在债券承销、固定收益投资、互联网金融等业务领域逐渐形成了相对优势和经营特色。连续四年获评企业债券主承销商信用评级A类、公司债券业务执业能力评价A类券商；2023年证券公司投行业务质量评价A类。

截至2024年6月末，公司共管理产品154只（不含延期清算和专项计划），其中公募大集合1只；公司资管规模合计17,536,289,433.51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	2024- 02-21	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。
翟舒	本基金的基金经理、财信证券资管投资部投资经理	2024-03-27	-	16年	中国籍，理学硕士，2007年入职财信证券股份有限公司（原财富证券），历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，资管投资部投资经理助理，现任资管投资部投资经理。

注：

(1) 对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据投资决策小组会议确定的解聘日期；对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据投资决策小组会议确定的聘任日期和解聘日期。

(2) 证券从业年限的含义遵从行业协会相关规定。

#### 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，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

2024年上半年，在国内有效需求不足、经济复苏承压、货币政策保持合理充裕、“资产荒”的大背景下，债券收益率整体下行，各类利差大幅压缩，大体分成三个阶段：

第一阶段年初至3月初，此阶段受存款利率、存款准备金率下调，尤其是LPR超预期调降的影响，债券市场对货币政策预期乐观，资产配置需求明显，市场利率快速下行，尤其长端利率下行明显。

第二阶段3月初至4月末，此阶段受进出口数据超预期、两会稳增长政策出台预期、央行多次提示长端利率风险、财政部发文将在公开市场增加国债买卖等因素的影响，市场震荡加剧，债市收益率出现小幅上行，债券各品种走势出现分化，信用债表现相对偏强。

第三阶段为5月至6月底，市场在央行风险提示与资产供需矛盾中震荡，随着超长期特别国债发行安排落地，新一轮地产政策出台，市场对供给放量的担忧降低，债市逐步企稳。陆家嘴金融论坛提出持续推进利率市场化改革，叠加税期及季末资金流动性平稳，在资产荒的大背景下债券收益率再次下行。

本报告期内本基金以短期限、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和资本利得收益，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。

### 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1.0385元，本报告期内，基金份额净值增长率为1.18%，同期业绩比较基准收益率为1.26%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年国内GDP增速为5.0%，持平全年经济增长目标，但二季度增速4.7%，复苏节奏较一季度回落，固定资产投资表现仍受地产销售数据拖累，社零数据偏弱显示内需尚待提振，下半年稳增长重要性突出，财政政策或将发力，专项债发行使用进度将加快，通胀有望从低位温和回升。7-9月或将迎来政府债的供给高峰，对债券供需形成扰动。但下半年国外主要经济体陆续进入降息周期是大概率事件，人民币汇率压力趋于减小，货币政策操作空间或有增加，在支持性的货币政策立场下，存在降息降准的可能性。整体来看对债券市场偏友好，但预计市场在经济修复现实、债券供需情况、货币政策工具的

使用、监管利率引导等各因素影响下震荡加大，有阶段性调整上行的可能性。后续将持续关注经济数据、政策效果及力度、信贷需求的变化，跟踪债券供给和资金面情况。

#### 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：2024年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	578,376.16	1,115,086.66
结算备付金		315,108.17	1,216,639.04
存出保证金		2,836.23	17,163.80
交易性金融资产	6.4.7.2	404,138,991.12	387,512,755.55
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		374,715,004.81	348,209,506.24
资产支持证券投资		29,423,986.31	39,303,249.31
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	879,023.95	19,347,153.71
应收清算款		270,594.31	-
应收股利		-	-
应收申购款		168,667.00	176,300.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		406,353,596.94	409,385,098.76

负债和净资产	附注号	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
<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		35,201,802.79	29,999,606.44
应付清算款		-	7,024.67
应付赎回款		353,035.23	375,209.28
应付管理人报酬		153,449.82	165,668.82
应付托管费		30,689.95	33,133.78
应付销售服务费		284,623.69	327,868.74
应付投资顾问费		-	-
应交税费		51,057.49	32,075.00
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	100,865.79	157,160.18
负债合计		36,175,524.76	31,097,746.91
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	356,460,407.54	368,547,197.73
未分配利润	6.4.7.8	13,717,664.64	9,740,154.12
净资产合计		370,178,072.18	378,287,351.85
负债和净资产总计		406,353,596.94	409,385,098.76

注：报告截止日2024年6月30日，基金份额净值1.0385元，基金份额总额356,460,407.54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：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
----	-----	----	---------

		2024年01月01日至 2024年06月30日	2023年01月01日至202 3年06月30日
<b>一、营业总收入</b>		6,477,428.92	16,926,349.02
1.利息收入		30,265.29	82,664.01
其中：存款利息收入	6.4.7.9	8,888.26	49,810.24
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		21,377.03	32,853.77
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-” 填列）		4,708,909.12	9,474,354.53
其中：股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.10	4,127,392.35	9,027,994.12
资产支持证券投资 收益	6.4.7.11	589,959.87	446,360.41
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.12	-8,443.10	-
股利收益		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失 以“-”号填列）	6.4.7.13	1,738,254.51	7,369,330.48
4.汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-” 号填列）		-	-
<b>减：二、营业总支出</b>		2,037,320.41	3,602,028.70
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	951,360.41	1,690,139.28
2.托管费	6.4.10.2.2	190,272.05	338,027.86

3.销售服务费	6.4.10.2.3	570,816.26	1,014,083.54
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		200,633.52	425,935.73
其中：卖出回购金融资产支出		200,633.52	425,935.73
6.信用减值损失		-	-
7.税金及附加		21,592.39	40,384.33
8.其他费用	6.4.7.14	102,645.78	93,457.96
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		4,440,108.51	13,324,320.32
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		4,440,108.51	13,324,320.32
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		4,440,108.51	13,324,320.32

### 6.3 净资产变动表

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：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	368,547,197.73	9,740,154.12	378,287,351.85
二、本期期初净资产	368,547,197.73	9,740,154.12	378,287,351.85
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-12,086,790.19	3,977,510.52	-8,109,279.67
（一）、综合收益	-	4,440,108.51	4,440,108.51



总额			
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-12,086,790.19	-462,597.99	-12,549,388.18
其中: 1.基金申购款	120,125,403.15	3,851,496.78	123,976,899.93
2.基金赎回款	-132,212,193.34	-4,314,094.77	-136,526,288.11
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-
四、本期期末净资产	356,460,407.54	13,717,664.64	370,178,072.18
项目	上年度可比期间		
	2023年01月01日至2023年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	726,494,324.24	-2,798,490.99	723,695,833.25
二、本期期初净资产	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净资产变动数(净资产减少以“-”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净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	631,968,401.24	9,981,392.46	641,949,793.70

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

刘之彦

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。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”，于2022年5月20日完成变更。根据《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》，本计划类型为集合资产管理计划，本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。本计划的管理人为财信证券股份有限公司，计划托管人为中国建设银行股份有限公司，计划的份额登记机构为财信证券股份有限公司。

根据《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一致。

##### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年自1月1日起至12月31日止。

##### 6.4.4.2 记账本位币

采用人民币为记账本位币。

##### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融资产在初始确认时划分为以下三类：(1) 以摊余成本计量的金融资产；(2) 以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产；(3) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

金融负债在初始确认时划分为以下三类：(1) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债；(2) 金融资产转移不符合终止确认条件或继续涉入被转移金融资产所形成的金融负债；(3) 以摊余成本计量的金融负债。

##### 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) 金融资产和金融负债的确认依据和初始计量方法

本计划成为金融工具合同的一方时，确认一项金融资产或金融负债。初始确认金融资产或金融负债时，按照公允价值计量；对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，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或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

## (2) 金融资产的后续计量方法

### 1) 以摊余成本计量的金融资产

采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。以摊余成本计量且不属于任何套期关系的一部分的金融资产所产生的利得或损失，在终止确认、重分类、按照实际利率法摊销或确认减值时，计入当期损益。

### 2) 以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的债务工具投资

采用公允价值进行后续计量。采用实际利率法计算的利息、减值损失或利得及汇兑损益计入当期损益，其他利得或损失计入其他综合收益。终止确认时，将之前计入其他综合收益的累计利得或损失从其他综合收益中转出，计入当期损益。

### 3) 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，产生的利得或损失（包括利息和股利收入）计入当期损益，除非该金融资产属于套期关系的一部分。

## (3) 金融负债的后续计量方法

### 1) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

此类金融负债包括交易性金融负债（含属于金融负债的衍生工具）和指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。对于此类金融负债以公允价值进行后续计量。因本计划自身信用风险变动引起的指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债的公允价值变动金额计入其他综合收益，除非该处理会造成或扩大损益中的会计错配。此类金融负债产生的其他利得或损失（包括利息费用、除因本计划自身信用风险变动引起的公允价值变动）计入当期损益，除非该金融负债属于套期关系的一部分。终止确认时，将之前计入其他综合收益的累计利得或损失从其他综合收益中转出，计入留存收益。

2) 金融资产转移不符合终止确认条件或继续涉入被转移金融资产所形成的金融负债按照《企业会计准则第23号——金融资产转移》相关规定进行计量。

### 3) 以摊余成本计量的金融负债

采用实际利率法以摊余成本计量。以摊余成本计量且不属于任何套期关系的一部分的金融负债所产生的利得或损失，在终止确认、按照实际利率法摊销时计入当期损益。

## (4) 金融资产和金融负债的终止确认

### 1) 当满足下列条件之一时，终止确认金融资产：

#### ① 收取金融资产现金流量的合同权利已终止；

② 金融资产已转移，且该转移满足《企业会计准则第23号——金融资产转移》关于金融资产终止确认的规定。

2) 当金融负债（或其一部分）的现时义务已经解除时，相应终止确认该金融负债（或该部分金融负债）。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本计划持有的股票投资、债券投资和衍生金融工具，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相关金融资产和金融负债的公允价值。公司将估值技术使用的输入值分以下层级，并依次使用：

(1) 第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

(2) 第二层次输入值是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，包括：活跃市场中类似资产或负债的报价；非活跃市场中相同或类似资产或负债的报价；除报价以外的其他可观察输入值，如在正常报价间隔期间可观察的利率和收益率曲线等；市场验证的输入值等；

(3) 第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值，包括不能直接观察或无法由可观察市场数据验证的利率、股票波动率、企业合并中承担的弃置义务的未来现金流量、使用自身数据做出的财务预测等。

具体估值方法如下：

##### (1) 投资债权类资产的估值方法

##### ① 证券交易所上市的有价证券的估值

A、交易所市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（本合同另有规定的除外），选取估值日第三方估值机构（中证指数有限公司）提供的相应品种对应的估值全价估值；

B、交易所上市的可转换债券、可交换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；

C、交易所市场挂牌转让的资产支持证券、非公开发行可转换债、非公开发行可交换债和私募债券等，选取估值日第三方估值机构（中证指数有限公司）提供的相应品种对应的估值全价估值；

D、对于已申报成功回售登记的含投资人回售权的债券（法律法规另有规定的除外），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。在选择债券回售时或回售期内，由于债券发行人信用风险显著增加或发生其他可能导致债券回售失败的突发、异常情形，按管理人、托管人协商一致的方法处理估值相关事宜。回售登记期截止日（含当日）后未行使回售权的按照长待偿期所对应的价格进行估值。

②首次公开发行未上市或未挂牌转让的债券，对存在活跃市场的情况下，应以活跃市场上未经调整的报价作为计量日的公允价值；对于活跃市场报价未能代表计量日公允价值的情况下，应对市场报价进行调整以确认计量日的公允价值；对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下，则应采用估值技术确定其公允价值。

③全国银行间市场的有价证券的估值

A、对全国银行间市场上不含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的估值全价估值。对银行间市场上含权的固定收益品种，按照第三方估值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估值。

B、对于已申报成功回售登记的含投资人回售权的债券（法律法规另有规定的除外），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。在选择债券回售时或回售期内，由于债券发行人信用风险显著增加或发生其他可能导致债券回售失败的突发、异常情形，按管理人、托管人协商一致的方法处理估值相关事宜。回售登记期截止日（含当日）后未行使回售权的按照长待偿期所对应的价格进行估值。

C、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。

D、原则上，第三方估值机构选取中债金融估值中心有限公司。

④同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

⑤持有的银行存款或通知存款以本金列示，按协议或合同利率逐日确认利息收入。如提前支取或利率发生变化，管理人应及时通知托管人，双方及时进行账务调整。

⑥持有的债券逆回购（正回购）以本金列示，按约定利率逐日确认利息收入（利息支出）。

（2）投资股权类资产的估值方法

①上市流通股票的估值

A、交易所上市的流通股票，按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，或者证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价、重大变化因素及监管有关规定，调整最近交易市价，确定公允价格。

B、交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。

②处于未上市期间的股票应区分如下情况处理：

A、送股、转增股、配股和公开增发的新股等发行未上市的股票，按估值日在证券交易所上市的同一股票的市价（收盘价）估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值。

B、首次发行未上市的股票和权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本价估值。

C、流通受限股票（发行时明确一定期限限售期股票），包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等按以下方法估值：

$$FV = S \times (1 - LoMD)$$

其中：FV：估值日该流通受限股票的价值

S：估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值

LoMD：该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣（流动性折扣由第三方估值机构提供）。

（3）国债期货等标准化期货和衍生品类资产以估值日交易所的当日结算价估值，该日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，以最近一日的当日结算价计算。

#### （4）投资资产管理产品的估值方法

①持有的交易所上市基金（包括封闭式基金、上市开放式基金（LOF）），按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考监管机构或行业协会有关规定，或者类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值；

②持有的场外基金（包括托管在场外的上市开放式基金（LOF）），按估值日前一交易日的基金份额净值估值；估值日前一交易日基金份额净值无公布的，按此前最近交易日的基金份额净值估值；尚未公布过基金份额净值的，采用估值技术确定公允价值。

③持有的货币市场基金，按基金管理公司公布的估值日前一交易日的每万份收益计算。

④持有的基金处于封闭期的，按照最新公布的份额净值估值；没有公布份额净值的，按成本价估值。

（5）其他资产的估值方法：按照管理人和托管人协商后的方法进行，同时应符合国家有关规定。

（6）如有新增事项或变更事项，按国家最新规定估值。本集合计划应按照法律法规、监管部门或自律组织出具的相关规定进行减值计提。本计划应按新金融工具准则规定进行资产分类以及会计核算。

当有充足证据表明按上述规定不能真实公允反映集合计划相关资产价值的，管理人可根据具体情况，在与托管人商议后，按最能反映集合计划资产公允价值的方法估值。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不相互抵销。但同时满足下列条件的，本计划以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：(1) 本计划具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；(2) 本计划计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

不满足终止确认条件的金融资产转移，本计划不对已转移的金融资产和相关负债进行抵销。

#### **6.4.4.7 实收基金**

实收资金为对外发行集合计划份额所募集的份额总额。

#### **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计划份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占计划净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回计划份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占计划净值比例计算的金额。损益平准金于计划申购确认日或计划赎回确认日认列，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**

本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为债权投资的，在持有期间将按票面或合同利率计算的利息计入投资收益，并将扣除该部分利息后的公允价值变动额计入公允价值变动损益。

本计划当期实现的利息等收入，无论款项是否收取，均计入当期损益。

#### **6.4.4.10 费用的确认和计量**

本计划向管理人支付管理人报酬，本计划按照权责发生制原则，在管理人提供相关服务的期间，将当期发生的管理人报酬计入当期损益。

本计划当期发生的托管费、销售服务费、投资顾问费等费用，无论款项是否支付，均计入当期损益。

#### **6.4.4.11 基金的收益分配政策**

投资人认购、申购或转换转入产品份额的，本计划按照实收资金、其他综合收益、未分配利润占净资产的比例，将认购款、申购款或转换转入款分别计入实收资金、其他综合收益和未分配利润。



投资人赎回或转换转出产品份额的，本计划按照实收资金、其他综合收益、未分配利润占净资产的比例，将赎回款或转换转出款分别冲减实收资金、其他综合收益和未分配利润。

在符合有关集合计划分红条件的前提下，本计划可进行收益分配。每次收益分配比例等具体分红方案见集合计划管理人届时发布的相关分红公告。本计划收益分配方式为现金分红。集合计划收益分配后集合计划份额净值不能低于面值；即集合计划收益分配基准日的集合计划份额净值减去每单位集合计划份额收益分配金额后不能低于面值。本计划每一集合计划份额享有同等分配权。

#### **6.4.4.12 外币交易**

本计划本报告期内无外币交易。

#### **6.4.4.13 分部报告**

本计划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**

本计划本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

### **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**

本计划本报告期未发生会计政策变更。

#### **6.4.5.2 会计估计变更的说明**

本计划本报告期未发生会计估计变更。

#### **6.4.5.3 差错更正的说明**

本计划本报告期未发生差错更正。

### **6.4.6 税项**

(一) 本计划的各项税费参照证券投资基金公司缴纳。

(二) 根据《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〔2008〕1号），本计划从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，不征收企业所得税。

(三) 根据《关于资管产品增值税有关问题的通知》（财税〔2017〕56号），自2018年1月1日起，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。

(四) 根据《财政部 国家税务总局关于调整证券（股票）交易印花税征收方式的通知》（财税明电〔2008〕2号），自2008年9月19日起，基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日
活期存款	578,376.16
等于：本金	578,163.05
加：应计利息	213.11
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	578,376.16

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

		2024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	85,277,301.98	1,641,486.12	86,995,527.12	76,739.02
	银行间市场	282,921,102.31	3,839,477.69	287,719,477.69	958,897.69
	合计	368,198,404.29	5,480,963.81	374,715,004.81	1,035,636.71
资产支持证券		28,000,000.00	1,394,586.31	29,423,986.31	29,400.00
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		396,198,404.29	6,875,550.12	404,138,991.12	1,065,036.71

#### 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 2024年06月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	879,023.95	-
银行间市场	-	-
合计	879,023.95	-

##### 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 2024年06月30日	
	应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-	
应付证券出借违约金	-	
应付交易费用	16,974.91	
其中：交易所市场	2,567.88	
银行间市场	14,407.03	
应付利息	-	
预提费用	83,890.88	
合计	100,865.79	

#### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
	上年度末	368,547,197.73
本期申购	120,125,403.15	120,125,403.15
本期赎回（以“-”号填列）	-132,212,193.34	-132,212,193.34
本期末	356,460,407.54	356,460,407.54

#### 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
上年度末	14,134,225.04	-4,394,070.92	9,740,154.12
本期期初	14,134,225.04	-4,394,070.92	9,740,154.12
本期利润	2,704,482.28	1,735,626.23	4,440,108.51
本期基金份额交易产生的变动数	-554,387.49	91,789.50	-462,597.99

其中：基金申购款	5,044,874.94	-1,193,378.16	3,851,496.78
基金赎回款	-5,599,262.43	1,285,167.66	-4,314,094.77
本期已分配利润	-	-	-
本期末	16,284,319.83	-2,566,655.19	13,717,664.64

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年01月01日至2024年06月30日	
活期存款利息收入		5,991.84
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		2,859.92
其他		36.50
合计		8,888.26

#### 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	
	2024年01月01日至2024年06月30日	
债券投资收益——利息收入		6,213,336.07
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入		-2,085,943.72
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		4,127,392.35

##### 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	
	2024年01月01日至2024年06月30日	

卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	328,962,439.79
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	320,207,556.97
减：应计利息总额	10,823,875.47
减：交易费用	16,951.07
买卖债券差价收入	-2,085,943.72

#### 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 2024年01月01日至2024年06月30日
资产支持证券投资收益——利息收入	542,429.87
资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入	47,530.00
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	589,959.87

##### 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 2024年01月01日至2024年06月30日
卖出资产支持证券成交总额	10,499,364.38
减：卖出资产支持证券成本总额	9,952,470.00

减：应计利息总额	499,364.38
减：交易费用	-
资产支持证券投资收益	47,530.00

#### 6.4.7.12 衍生工具收益

##### 6.4.7.12.1 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
期货投资	-8,443.10

#### 6.4.7.13 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
1.交易性金融资产	1,752,436.83
——股票投资	-
——债券投资	1,738,566.83
——资产支持证券投资	13,870.00
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	7,720.00
——权证投资	-
——期货投资	7,720.00
3.其他	2,628.28
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	24,530.60
合计	1,738,254.51

#### 6.4.7.14 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
审计费用	14,918.54
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
汇划手续费	9,094.90
帐户维护费	18,960.00
合计	102,645.78

#### 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

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

本基金本报告期末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 2024年01月01日至2024年06月30日		上年度可比期间 2023年01月01日至2023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
财信证券 股份有限 公司	54,838,062.17	100.00%	156,217,045.00	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 2024年01月01日至2024年06月30日		上年度可比期间 2023年01月01日至2023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	317,577,000.00	100.00%	2,282,860,000.00	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 2024年01月01日至2024年06月30日			
	当期佣金	占当期	期末应付佣金余额	占期末应

		佣金总量的比例		付佣金总额的比例
财信证券股份有限公司	14,312.59	100.00%	2,567.88	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 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	100.00%	15,196.68	100.00%

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 2024年01月01日至2024年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	951,360.41	1,690,139.28
其中：应支付销售机构的客户维护费	3,487.18	6,113.95
应支付基金管理人的净管理费	947,873.23	1,684,025.33

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 2024年01月01日至2024 年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	190,272.05	338,027.86

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 2024年01月01日至2024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	401,396.00
中国建设银行股份有限公司	4,184.66
合计	405,580.66
获得销售服务费的各关联方 名称	上年度可比期间 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

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一次性支付。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 2024年01月01日至 2024年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至 2023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	0.00	100,000,000.00
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	0.00
报告期末持有的基金份额	0.00	100,000,000.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	15.82%

注：基金合同生效日为2022年05月20日，财信证券30天持有期债券型自2022年5月23日起开放申购和赎回业务。

**6.4.10.4.2 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**

本报告期末无其他关联方投资本基金的情况。

**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 2024年01月01日至2024年06月30日		上年度可比期间 2023年01月01日至2023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	578,376.16	5,991.84	2,820,382.21	14,516.97

**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**

本基金财信期货账户已于2024年3月27日完成注销。

**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（2024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2024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10,002,054.79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	数量（张）	期末估值总额
------	------	-------	-----	-------	--------

			值单价		
210203	21国开03	2024-07-01	103.51	6,000	621,089.59
230208	23国开08	2024-07-01	102.20	100,000	10,219,545.21
合计				106,000	10,840,634.80

注：银行间债券正回购的质押券期末估值单价为2024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2024年6月30日，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25,199,748.00元,于2023年7月1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 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
A-1	10,164,584.70	-
A-1以下	-	-
AA+	-	10,115,754.10

AAA	-	50,716,040.98
未评级	70,761,351.57	-
合计	80,925,936.27	60,831,795.08

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 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	49,169,677.04	-
合计	49,169,677.04	-

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 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
AAA	136,923,889.44	215,559,685.87
AAA以下	10,821,183.72	21,256,030.76
未评级	96,874,318.34	50,561,994.53
合计	244,619,391.50	287,377,711.16

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 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
--------	--------------------	---------------------

AAA	-	-
AAA以下	29,423,986.31	39,303,249.31
未评级	-	-
合计	29,423,986.31	39,303,249.31

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 2024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							
货币资金	578,163.05	-	-	-	-	213.11	578,376.16
结算备付金	113,498.94	-	-	-	-	201,609.23	315,108.17
存出保证金	2,834.93	-	-	-	-	1.30	2,836.23
交易性金融资产	27,023,500.00	32,054,000.00	177,716,300.00	150,359,641.00	10,110,000.00	6,875,550.12	404,138,991.12
买入返售金融资产	879,023.95	-	-	-	-	-	879,023.95
应收清算款	-	-	-	-	-	270,594.31	270,594.31
应收申购款	-	-	-	-	-	168,667.00	168,667.00
资产总计	28,597,020.87	32,054,000.00	177,716,300.00	150,359,641.00	10,110,000.00	7,516,635.07	406,353,596.94
负债							
卖出回购金融资产款	35,199,543.00	-	-	-	-	2,259.79	35,201,802.79
应付赎回款	-	-	-	-	-	353,035.23	353,035.23
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	153,449.82	153,449.82
应付托管费	-	-	-	-	-	30,689.95	30,689.95
应付销售服务费	-	-	-	-	-	284,623.69	284,623.69
应交税	-	-	-	-	-	51,057.49	51,057.49

费							
其他负债	-	-	-	-	-	100,865.79	100,865.79
负债总计	35,199,543.00	-	-	-	-	975,981.76	36,175,524.76
利率敏感度缺口	-6,602,522.13	32,054,000.00	177,716,300.00	150,359,641.00	10,110,000.00	6,540,653.31	370,178,072.18
上年度末 2023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							
货币资金	1,114,851.77	-	-	-	-	234.89	1,115,086.66
结算备付金	1,216,277.14	-	-	-	-	361.90	1,216,639.04
存出保证金	17,160.28	-	-	-	-	3.52	17,163.80
交易性金融资产	70,023,000.00	33,447,515.00	167,821,320.00	66,248,509.00	40,377,790.00	9,594,621.55	387,512,755.55
买入返售金融资产	19,300,375.50	-	-	-	-	46,778.21	19,347,153.71
应收清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	176,300.00	176,300.00
资产总计	91,671,664.69	33,447,515.00	167,821,320.00	66,248,509.00	40,377,790.00	9,818,300.07	409,385,098.76
负债							
卖出回购金融资产款	30,001,412.60	-	-	-	-	-1,806.16	29,999,606.44
应付清算款	-	-	-	-	-	7,024.67	7,024.67
应付赎回款	-	-	-	-	-	375,209.28	375,209.28
应付管理人报	-	-	-	-	-	165,668.82	165,668.82

酬							
应付托管费	-	-	-	-	-	33,133.78	33,133.78
应付销售服务费	-	-	-	-	-	327,868.74	327,868.74
应交税费	-	-	-	-	-	32,075.00	32,075.00
其他负债	-	-	-	-	-	157,160.18	157,160.18
负债总计	30,001,412.60	-	-	-	-	1,096,334.31	31,097,746.91
利率敏感度缺口	61,670,252.09	33,447,515.00	167,821,320.00	66,248,509.00	40,377,790.00	8,721,965.76	378,287,351.85

#### 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 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
	1. 市场利率下降25个基点	1,016,527.63	489,598.77
	2. 市场利率上升25个基点	-1,016,527.63	-489,598.77

#### 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。

本计划通过组合投资的分散化降低市场价格风险。此外，本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 2024年06月30日		上年度末 2023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	374,715,004.81	101.23	348,209,506.24	92.05
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	374,715,004.81	101.23	348,209,506.24	92.05

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

本期末本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**

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
第一层次	1,302,955.87	1,732,272.22
第二层次	402,836,035.25	385,780,483.33
第三层次	-	-
合计	404,138,991.12	387,512,755.55

注：本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2024年6月30日。

**6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动**

本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	404,138,991.12	99.46
	其中：债券	374,715,004.81	92.21
	资产支持证券	29,423,986.31	7.24
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	879,023.95	0.22
	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	893,484.33	0.22
8	其他各项资产	442,097.54	0.11
9	合计	406,353,596.94	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	20,465,754.69	5.53
2	央行票据	-	-
3	金融债券	51,284,306.12	13.85
	其中：政策性金融债	51,284,306.12	13.85
4	企业债券	115,600,976.72	31.23
5	企业短期融资券	80,925,936.27	21.86
6	中期票据	55,965,398.10	15.12
7	可转债(可交换债)	1,302,955.87	0.35
8	同业存单	49,169,677.04	13.28
9	其他	-	-
10	合计	374,715,004.81	101.23

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	210313	21进出13	200,000	20,442,459.02	5.52
2	042480211	24东楚投资CP001	200,000	20,126,526.03	5.44
3	127767	PR钱投债	500,000	10,415,701.37	2.81
4	102101064	21赣州开投MTN002	100,000	10,400,907.10	2.81
5	152575	20郑发01	100,000	10,361,753.43	2.80

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	18,898,643.84	5.11

2	180644	尚水1优	100,000	10,525,342.47	2.84
---	--------	------	---------	---------------	------

**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**

本基金本报告期末未投资国债期货。

**7.11.2 本期国债期货投资评价**

本基金本报告期末未投资国债期货。

**7.12 投资组合报告附注**

**7.12.1** 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国进出口银行多家分行在本报告编制日前一年内受到金融监督管理局地方监管局的处罚。国家开发银行在本报告编制日前一年内被交易商协会启动自律调查，其多家分行在本报告编制日前一年内受到金融监督管理局地方监管局的处罚。

经分析，上述处罚事项未对证券投资价值产生实质影响，本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

除上述主体外，本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责、处罚。

**7.12.2** 本基金不投资股票，因此不存在投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况。

**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	2,836.23
2	应收清算款	270,594.31
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	168,667.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	442,097.54

**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	127064	杭氧转债	283,016.58	0.08
2	110062	烽火转债	235,021.10	0.06
3	110059	浦发转债	220,553.42	0.06
4	110075	南航转债	161,183.97	0.04
5	113024	核建转债	110,360.27	0.03
6	110077	洪城转债	105,384.38	0.03
7	127084	柳工转2	74,752.60	0.02
8	127032	苏行转债	50,283.51	0.01
9	123108	乐普转2	31,875.66	0.01
10	113053	隆22转债	30,524.38	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
3,855	92,467.03	1,039,497.02	0.29%	355,420,910.52	99.71%

注：机构持有份额中包含一个产品投资者持有份额，持有份额9,763.72份。

### 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	1,564,123.53	0.44%

### 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	368,547,197.73
本报告期基金总申购份额	120,125,403.15
减：本报告期基金总赎回份额	132,212,193.34
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	356,460,407.54

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。

## §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2024年1月10日起总裁助理左军姿同志履行公司高级管理人员职责；自2023年06月28日起，蒋天翼先生新任公司副总裁。

本报告期内，本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。2023年5月24日，我司收到法院书记员通知，本案将延长审限。为延长审限，2023年5月29日，我司向法院邮寄了《庭外和解申请书》。2023年6月15日，法院组织双方召开了调解协调会。2023年7月6日，我司和律师就调解事项与桂阳农商行进行当面沟通。

2024年3月25日，我司收到桂阳农商行发送的《关于珠江8号定向资产管理计划调解的函》。2024年3月29日，我司向桂阳农商行发送《关于<关于珠江8号定向资产管理计划调解的函>的回函》。

2024年5月21日，我司收到《湖南省郴州市中级人民法院民事裁定书（2023）湘10民终441号》，主要判决内容为：撤销湖南省桂阳县人民法院（2022）湘1021民初930号民事判决，本案发回湖南省桂阳县人民法院重新审理。

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。  
本报告期无涉及基金财产、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至今，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

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

#### 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	-	-	14,312.59	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	54,838,062.17	100.00%	317,577,000.00	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	财信证券股份有限公司基金行业高级管理人员变更公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-01-11
2	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	中国证监会规定报刊及网站	2024-01-19
3	财信证券30天持有期债券型集合资产管理计划基金经理变更公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-02-21
4	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	中国证监会规定报刊及网站	2024-02-23
5	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	中国证监会规定报刊及网站	2024-02-23
6	财信证券30天持有期债券型集合资产管理计划基金经理变更公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-03-27
7	财信证券30天持有期债券型集合资产管理计划2023年年度审计报告	中国证监会规定报刊及网站	2024-03-29
8	财信证券30天持有期债券型集合资产管理计划2023年年度报告	中国证监会规定报刊及网站	2024-03-29
9	财信证券30天持有期债券型集合资产管理计划招募说明	中国证监会规定报刊及网站	2024-03-29

	书更新		
10	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	中国证监会规定报刊及网站	2024-03-29
11	财信证券股份有限公司基金行业高级管理人员变更公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-04-05
12	财信证券30天持有期债券型集合资产管理计划2024年第1季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2024-04-19
13	财信证券30天持有期债券型集合资产管理计划关于基金股票交易费率计提标准调整的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-05-23
14	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	中国证监会规定报刊及网站	2024-06-25

### §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托管协议》；
- (4) 各期间《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》及更新；
- (5) 各期间《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》及更新；

- (6) 管理人经营证券期货业务许可证、营业执照；
- (7) 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](http://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  
二〇二四年八月三十日