
第一创业创和一个月滚动持有债券型集合资产管理计划

2021年第4季度报告

2021年12月31日

基金管理人:第一创业证券股份有限公司

基金托管人:兴业银行股份有限公司

报告送出日期:2022年01月24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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2022年1月14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2021年12月09日起至2021年12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	第一创业创和一个月滚动持有债券
基金主代码	970106
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021年12月09日
报告期末基金份额总额	50,820,760.57份
投资目标	本集合计划投资目标为通过在严格管理风险和保障必要流动性的前提下，为集合计划持有人追求资产的长期稳健增值。
投资策略	1、信用债投资策略 2、收益率曲线策略 3、杠杆放大策略 4、资产支持证券投资策略 5、国债期货策略
业绩比较基准	中债综合指数收益率*95%+1年期定期存款利率（税后）*5%
风险收益特征	本集合计划为债券型集合资产管理计划，长期来看，其预期风险和预期收益水平低于股票型集合计划、混合型集合计划，高于货币型集合计划。

基金管理人	第一创业证券股份有限公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司

§ 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（2021年12月09日 - 2021年12月31日）
1. 本期已实现收益	75,140.40
2. 本期利润	105,573.53
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0021
4. 期末基金资产净值	51,743,679.62
5. 期末基金份额净值	1.0182

注：1、上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，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。

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
自基金合同生效起至今	0.21%	0.01%	0.34%	0.03%	-0.13%	-0.02%

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

第一创业创和一个月滚动持有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



§ 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		
崔易	本基金的基金经理	2021-12-09	-	5	崔易，女，中国人民大学经济学硕士，于2019年加入第一创业证券，现任资产管理部大集合投资经理。拥有超过5年金融从业经验。曾任万联证券股份有限公司信用研究员、第一创业证券资产管理部信用研究员。擅长信用债精选投资，秉承以宏观基本面和行业基本面研判为基础，自上而下发现投资机

					会，风格稳健。崔易最近三年未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚。
--	--	--	--	--	-------------------------------------

注：1、本基金首任基金经理的任职日期为本基金合同生效日，离任日期、后任基金经理的任职日期指公司作出决定的日期；

2、证券从业年限的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关决定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》和《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》等有关法律法规及各项实施准则、本基金基金合同和其他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基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，未发现损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011年修订）》和《第一创业证券股份有限公司资管业务公平交易管理办法》，通过建立有纪律、规范化的投资研究和决策流程、交易流程、强化事后监控及分析手段等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有投资组合，切实防范利益输送。本报告期，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，未发现本基金有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

2021年三季度，债券市场走出了倒“V”字形态。9月开始能耗双控升级、限电限产背景下，黑色系大宗商品价格飙升。10月公布9月PPI同比上涨10.7%，创下历史新高，通胀预期高企。另外，央行领导发言使得降准预期落空，10月伊始债市收益率快速上行，10年国债收益率触及3.04%。后发改委颁布一系列措施，动力煤期货价格回落，通胀压力缓解。央行等量续作MLF、加码净投放，资金面整体宽松，债市情绪回暖。10月下旬公布经济金融数据显示国内经济增速放缓，高层发言也多次提到经济下行压力，货币政策放松预期又起，债市主导逻辑由通胀切换为经济基本面下行与宽货币预期，债市收益率进入下行通道。12月3日国常会再度提及降准，12月6日降准落地，预期兑现，10年期

国债收益率下行5BP后窄幅震荡。中央经济工作会议提出我国经济面临三重压力，强调“稳字当头”、“稳中求进”，央行四季度例会提到“发挥好货币政策工具的总量和结构双重功能，更加主动有为”，债市进入对宽信用、稳增长与货币宽松加码的纠结中。年末央行加大投放力度，跨年资金面由紧转松，市场对政策利率降息的预期迅速升温，致使收益率“抢跑”，10年期国债一度突破2.8%的低点。全季来看，债券收益率整体下行，10年国债、国开债收益率分别下行10bp、12bp。

产品运作方面，本产品采取中短久期、中高评级信用债配置策略，以获取票息收益为主，同时择机参与可转债波段操作，力争获取稳健投资回报。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末第一创业创和一个月滚动持有债券基金份额净值为1.0182元，本报告期内，基金份额净值增长率为0.21%，同期业绩比较基准收益率为0.34%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期内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	46,968,461.30	76.57
	其中：债券	46,968,461.30	76.57
	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	7,980,131.97	13.01
	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	5,658,593.34	9.22
8	其他资产	736,143.29	1.20

9	合计	61,343,329.90	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投资股票。

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	3,002,100.00	5.80
	其中：政策性金融债	3,002,100.00	5.80
4	企业债券	24,725,200.00	47.78
5	企业短期融资券	3,000,600.00	5.80
6	中期票据	12,570,200.00	24.29
7	可转债（可交换债）	3,670,361.30	7.09
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	46,968,461.30	90.77

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	102101140	21知识城MTN003(权益出资)	40,000	4,053,600.00	7.83
2	127613	PR淮南01	60,000	3,715,800.00	7.18
3	163079	19株国06	35,000	3,521,700.00	6.81
4	102103035	21江宁国资MTN001	35,000	3,500,700.00	6.77

5	175542	20沪投01	30,000	3,071,700.00	5.94
---	--------	--------	--------	--------------	------

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

根据本基金合同规定，本基金不参与股指期货交易。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金合同规定，本基金不参与股指期货交易。

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

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本报告期内，未出现基金投资的前十名证券发行主体被监管部门立案调查或编制日前一年受到公开谴责、处罚的情况。

5.11.2 根据基金合同规定，本基金的投资范围不包括股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	2,399.17
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	711,452.04
5	应收申购款	22,292.08
6	其他应收款	-
7	其他	-

8	合计	736,143.29
---	----	------------

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	110059	浦发转债	1,478,260.00	2.86
2	113021	中信转债	1,136,801.30	2.20
3	113042	上银转债	1,055,300.00	2.04

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2021年12月09日)基金份额总额	50,115,678.45
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	705,082.12
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	-
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	50,820,760.57

注：基金合同生效日：2021年12月9日

§ 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

基金合同生效日管理人持有的本基金份额	4,876,537.88
基金合同生效日起至报告期期末买入/申购总份额	-
基金合同生效日起至报告期期末卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	4,876,537.88
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	9.60

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内无基金管理人运用固有资金投资本基金的交易明细。

§ 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

本报告期内，未出现影响投资者决策的其他重要信息。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会同意合同变更的文件；
- 2、第一创业创和一个月滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同；
- 3、第一创业创和一个月滚动持有债券型集合资产管理计划托管协议；
- 4、第一创业创和一个月滚动持有债券型集合资产管理计划招募说明书；
- 5、管理人及托管人业务资格批件、营业执照；
- 6、报告期内披露的各项公告及定期报告。

9.2 存放地点

深圳市福田区中心区福华一路115号投行大厦20楼

9.3 查阅方式

www.firstcapital.com

第一创业证券股份有限公司

2022年01月24日