

# 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 年年度报告

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

送出日期:2022 年 03 月 31 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。本年度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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2022年3月21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。

本报告中财务资料已经审计。立信会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自2021年12月09日起至2021年12月31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	5
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、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	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	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.9 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	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	13
§6 审计报告	14
6.1 审计报告基本信息	14
6.2 审计报告的基本内容	14
§7 年度财务报表	17
7.1 资产负债表	17
7.2 利润表	18
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	20
7.4 报表附注	21
§8 投资组合报告	44
8.1 期末基金资产组合情况	44
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	45
8.3 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	45
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	45
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	45
8.6 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	46
8.7 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	46
8.8 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	47
8.9 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	47

8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	47
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	47
8.12	投资组合报告附注	47
§9	基金份额持有人信息	48
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	48
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	48
9.3	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	49
§10	开放式基金份额变动	49
§11	重大事件揭示	49
11.1	基金份额持有人大会决议	49
11.2	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	49
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	49
11.4	基金投资策略的改变	49
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	50
11.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	50
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	50
11.8	其他重大事件	50
§12	影响投资者决策的其他重要信息	51
12.1	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	51
12.2	影响投资者决策的其他重要信息	51
§13	备查文件目录	51
13.1	备查文件目录	51
13.2	存放地点	51
13.3	查阅方式	51

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	第一创业创和一个月滚动持有债券型集合资产管理计划
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
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
报告期末基金份额总额	50,820,760.57份
基金合同存续期	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。

注：本报告所述的“基金”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。

### 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		第一创业证券股份有限公司	兴业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	邱巍	陈玮
	联系电话	95358	021-52629999
	电子邮箱	qiuwei@fcsc.com	chenw823@cib.com.cn
客户服务电话		95358	95561
传真		0755-25832402	021-62535823
注册地址		深圳市福田区福华一路115号 投行大厦20楼	福建省福州市湖东路154号
办公地址		深圳市福田区福华一路115号 投行大厦19楼	上海市浦东新区银城路167号
邮政编码		518048	200041
法定代表人		刘学民	吕家进

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露 报纸名称	深圳证券时报传媒有限公司
登载基金年度报告正文 的 管理人互联网网址	www.firstcapital.com.cn
基金年度报告备置地点	深圳市福田区福华一路115号投行大厦19楼

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	立信会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市黄浦区南京东路61号四楼
注册登记机构	第一创业证券股份有限公司	深圳市福田区福华一路115号投行大厦19楼

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 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	本期2021年12月09日（基金合同生效日）- 2021年12月
---------------	----------------------------------

	31日
本期已实现收益	75,140.40
本期利润	105,573.53
加权平均基金份额本期利润	0.0021
本期加权平均净值利润率	0.21%
本期基金份额净值增长率	0.21%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	2021年末
期末可供分配利润	922,919.05
期末可供分配基金份额利润	0.0182
期末基金资产净值	51,743,679.62
期末基金份额净值	1.0182
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	2021年末
基金份额累计净值增长率	0.21%

注：①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，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。

## 3.2 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

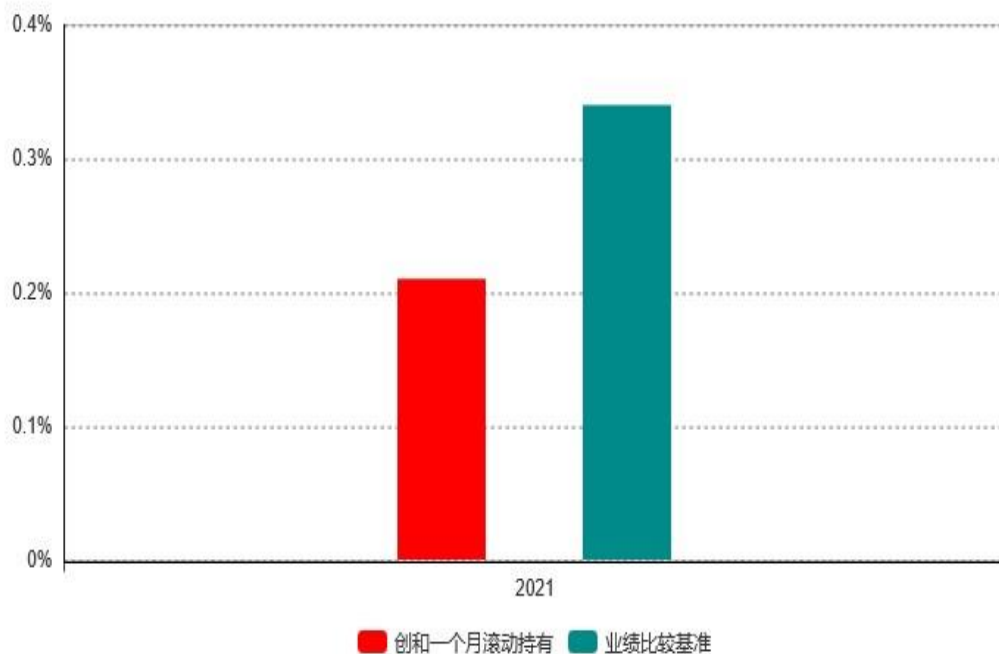
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
自基金合同生效起至今	0.21%	0.01%	0.34%	0.03%	-0.13%	-0.02%

### 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

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



### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较





### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自基金合同生效日（2021年12月9日）至本报告期末未发生利润分配。

## § 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

第一创业证券股份有限公司（以下简称“公司”或“第一创业证券”）前身是1993年4月成立的佛山证券公司，注册地为深圳市。2016年5月，经中国证券监督管理委员会核准，第一创业证券首次公开发行股票21,900万股并在深圳证券交易所上市，股票代码：002797.SZ。截止2021年12月31日，公司注册资本42.024亿元。

公司系经中国证监会批准成立的合法存续的证券公司。根据中国证监会批复（证监机构字[2002]364号文），公司于2002年12月4日起获得证券公司资产管理业务资格，2013年取得保险资金受托资格，经营资产管理业务十余年，持续构建立体化投研体系、打造全方位营销体系、建设系统化运营体系，有着丰富的管理经验。公司始终坚持客户利益至上，致力于为客户实现长期稳定的投资回报，做客户投资理财的亲密伙伴。第一创业证券根据《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2021年12月31日，旗下已有2只大集合产品完成公募化改造，分别为“第一创业创享纯债债券型集合资产管理计划”和“第一创业创和一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		
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。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。
--	--	--	--	--	------------------------------

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》的相关规定。

#### 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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011年修订）》等法律法规制定了《第一创业证券股份有限公司资管业务公平交易管理办法》，该《办法》涵盖了境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，同时对授权、研究分析与投资决策、交易执行的内部控制、交易指令的分配执行、公平交易监控、报告措施及信息披露、禁止行为等方面进行了全面规范。

##### 4.3.2 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。本报告期内，公平交易制度总体执行情况良好。

##### 4.3.3 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情况，未发生交易所公开竞价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

2021年债券市场走出了一波震荡向上的行情。一季度，债市的走势波折且纠结，10年期国债收益率冲高回落，主要分为三个阶段：阶段一是在2020年末信用事件爆发后，为了对冲信用风险冲击，央行不断释放流动性维稳信号，交易所天量回购、两次MLF超预期投放、跨年资金超量投放，流动性极度宽松，前期踏空的机构纷纷选择进场，利率下行态势走向高潮，走出了一波反弹行情。阶段二，春节前央行提前收紧流动性，连续“地量”投放，资金利率上行并突破中枢水平，体感上的“紧”令市场对宽松是否延续开始怀疑，1月下旬开始债市走出了一波下跌行情。阶段三，虽然大宗商品的上行、美债的上行超预期，纠结心态下债市对利空钝化，进入窄幅区间震荡行情，国内债市依旧坚挺的原因主要有：国内股市的下跌带来的risk-off，以及资金面一直保持稳定宽松。

进入二季度，资金整体呈宽松状态，债市“慢牛”持续。二季度地方债发行不及预期，银行间资金面维持平稳偏松的状态下，市场对基本面、通胀以及金融数据的反应“钝化”，叠加机构“资产荒”，收益率持续下行。

三季度债市走势整体先扬后抑。7月份资金面延续宽松，新增发行尚未对市场造成实质性影响，市场延续了二季度以来的看多情绪。8月份，新增发行对市场的影响逐渐显现，同时资金面并未出现边际改善，市场多空情绪相当，走势平稳。9月份，由于跨季影响资金价格中枢明显抬升，供给端对市场的影响更加明显，同时叠加大宗商品价格上涨和美债收益率上行，债市并未出现新增利多消息，市场出现了回调下跌，收益率开始上行。

四季度债市走出了倒“V”字形态。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。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。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”，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。

全年来看，10年期国债、10年期国开收益率分别下行40BP、50BP，总体而言，流动性宽松与资产荒格局下，债市呈现慢牛格局。

报告期内，本基金坚持稳健投资策略，以票息配置策略为主，信用精选严控信用风险，同时保持了适中的杠杆水平，并根据市场变化灵活调整组合久期，在兼顾安全性、流动性和收益性的情况下，力争获取稳健投资回报。

#### 4.4.2 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%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2022年，国内经济“稳增长”与海外货币政策退出宽松为两条主要线索。国内方面，经济面临需求收缩、供给冲击、预期转弱的三重压力，中央经济工作会议重提“坚持以经济建设为中心”，国内宏观政策定调“稳增长”。纵观国内经济，疫情反复仍对消费复苏形成压制，而随着全球疫情防控正常化及价格支撑作用弱化，出口或将趋于回落。“能耗双控”放松背景下，制造业投资保持韧性。随着房地产调控政策纠偏、财政发力、支出节奏前置，地产及基建投资增速或边际企稳回升，但在严控地方隐性债务、“房住不炒”政策基调下难以高速增长。海外方面，欧美等主要经济体通胀高企，货币政策转向有加快的趋势。

目前债券收益率处于历史低位区间水平，债券趋势性行情仍需等待。本产品将采取中短久期、中高评级信用债配置策略，以获取票息收益为主。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

在本报告期内，管理人持续加强合规管理、风险管理和监察稽核工作。合规管理方面，管理人积极跟踪法律法规变化和监管动态更新，认真评估其对业务的影响，不断完善内控制度建设，对公司制定的各项规章制度、操作流程等方面进行持续修订和优化；开展合规宣导，不断增强管理员工的合规意识，促进合规文化的建设，通过合规培训等各种多样形式，并结合最新的法律法规变化、监管政策更新及行业风险事件，加深员工对法律法规、监管政策及风险的理解，从而使得法律法规、监管政策等合规要点在管理人内部得到切实落实。风险管理方面，管理人严格落实事前严格监督审查、事中严格指标监控、事后及时分析管理的三阶段工作部署，在持续对日常投资运作进行监督的同时，加强对基金流动性风险的管理和风控指标的强制合规管理，督促投研交易业务的合规开展。监察稽核方面，管理人根据《证券投资基金管理公司管理办法》、《证券投资基金管理公司监察稽核报告内容与格式指引（试行）》及《第一创业证券股份有限公司稽核审计工作制度》的规定，每季度以及年度对公司对标公募基金法律法规要求规范整改的包括本基金在内的大集合资产管理业务的管理及运作情况进行了检查，检视事项涵盖了公司治理、投资管理、营销与销售、后台运营管理及人力资源等方面，此外，管理人根据《证券投资基金管理公司内部控制指导意见》等法律法规，关注大集合资产管理业务相关内部控制的健全性和有效性，报告期内未发现本基金的管理及运作存在重大异常。

#### 4.7 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、中国证券投资基金业协会相关指引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管理委员会及大集合资产管理业务估值工作小组，估值管理委员会负责确定公司客户资产管理计划整体估值原则与估值政策，对估值相关重大议题进行审议和决策；大集合资产管理业务估值工作小组负责对估值相关一般议题进行审议和决策。估值管理委员会与大集合资产管理业务估值工作小组成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备投资、研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在直接的重大利益冲突。

定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

#### 4.9 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

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 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

报告期内，本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

#### 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

报告期内，本基金托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为。基金管理人在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

#### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本基金托管人认真复核了本年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	信会师报字[2022]第ZA30141号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	第一创业创和一个月滚动持有债券型集合资产管理计划全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了第一创业创和一个月滚动持有债券型集合资产管理计划（以下简称“第一创业创和一个月滚动持有债券”）财务报表，包括2021年12月31日的资产负债表，2021年12月9日（基金合同生效日）至2021年12月31日止期间的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中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，公允反映了第一创业创和一个月滚动持有债券2021年12月31日的财务状况以及2021年12月9日（基金合同生效日）至2021年12月31日的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。

	<p>按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于第一创业创和一个月滚动持有债券，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
<p>强调事项</p>	<p>-</p>
<p>其他事项</p>	<p>-</p>
<p>其他信息</p>	<p>-</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>第一创业创和一个月滚动持有债券的基金管理人第一创业证券股份有限公司管理层（以下简称“管理层”）负责按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“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财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估第一创业创和一个月滚动持有债券的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督第一创业创和一个月滚动持有债券的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执</p>

	<p>行以下工作：</p> <p>（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>（2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>（3）评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>（4）对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对第一创业创和一个月滚动持有债券持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致第一创业创和一个月滚动持有债券不能持续经营。</p> <p>（5）评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与管理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	立信会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	王斌、唐成
会计师事务所的地址	上海市黄浦区南京东路61号四楼
审计报告日期	2022-03-29



## § 7 年度财务报表

## 7.1 资产负债表

会计主体：第一创业创和一个月滚动持有债券型集合资产管理计划

报告截止日：2021年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021年12月31日
<b>资产：</b>		
银行存款	7.4.7.1	4,776,104.78
结算备付金		882,488.56
存出保证金		2,399.17
交易性金融资产	7.4.7.2	46,968,461.30
其中：股票投资		-
基金投资		-
债券投资		46,968,461.30
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	7,980,131.97
应收证券清算款		-
应收利息	7.4.7.5	711,452.04
应收股利		-
应收申购款		22,292.08
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		61,343,329.90
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021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	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		9,499,914.50
应付证券清算款		-
应付赎回款		-
应付管理人报酬		41,350.78
应付托管费		6,891.75
应付销售服务费		6,465.49
应付交易费用	7.4.7.7	9,527.48
应交税费		12,751.16
应付利息		2,749.12
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	20,000.00
负债合计		9,599,650.28
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	7.4.7.9	50,820,760.57
未分配利润	7.4.7.10	922,919.05
所有者权益合计		51,743,679.62
负债和所有者权益总计		61,343,329.90

注：①报告截止日2021年12月31日，基金份额净值1.0182元，基金份额总额50,820,760.57份；

②本财务报表的实际编制期间为2021年12月9日（基金合同生效日）至2021年12月31日。

## 7.2 利润表

会计主体：第一创业创和一个月滚动持有债券型集合资产管理计划

本报告期：2021年12月09日（基金合同生效日）至2021年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021年12月09日（基金合同 生效日）至2021年12月31 日

<b>一、收入</b>		132,570.07
1. 利息收入		115,772.73
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,807.46
债券利息收入		111,294.22
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		2,671.05
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-13,635.79
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-
基金投资收益	7.4.7.13	-
债券投资收益	7.4.7.14	-13,635.79
资产支持证券投资收益	7.4.7.14.5	-
贵金属投资收益	7.4.7.15	-
衍生工具收益	7.4.7.16	-
股利收益	7.4.7.17	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	30,433.13
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.19	-
<b>减：二、费用</b>		26,996.54
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	9,698.26
2. 托管费	7.4.10.2.2	1,616.37
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	6,465.49
4. 交易费用	7.4.7.20	2,158.26
5. 利息支出		5,434.79
其中：卖出回购金融资产支出		5,434.79
6. 税金及附加		361.55
7. 其他费用	7.4.7.21	1,261.82
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		105,573.53
减：所得税费用		-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		105,573.53
-------------------	--	------------

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：第一创业创和一个月滚动持有债券型集合资产管理计划

本报告期：2021年12月09日（基金合同生效日）至2021年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2021年12月09日（基金合同生效日）至2021年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	50,819,178.45	816,920.78	51,636,099.23
二、本期经营活动产生 的基金净值变动数 (本期利润)	-	105,573.53	105,573.53
三、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)	1,582.12	424.74	2,006.86
其中：1. 基金申购款	705,082.12	11,751.09	716,833.21
2. 基金赎回 款	-703,500.00	-11,326.35	-714,826.35
四、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）	-	-	-
五、期末所有者权益 (基金净值)	50,820,760.57	922,919.05	51,743,679.62

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署：

王芳

孙蕤

姚凯

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

第一创业创和一个月滚动持有债券型集合资产管理计划（以下简称“本基金”）由创金稳定收益1期集合资产管理计划转型而来。创金稳定收益1期集合资产管理计划的管理人第一创业证券股份有限公司于2021年12月1日发布《关于“创金稳定收益1期集合资产管理计划”变更为“第一创业创和一个月滚动持有债券型集合资产管理计划”及法律文件变更的公告》。根据公告，创金稳定收益1期集合资产管理计划名称变更为第一创业创和一个月滚动持有债券型集合资产管理计划，创金稳定收益1期集合资产管理计划份额转换为第一创业创和一个月滚动持有债券型集合资产管理计划份额。合同变更后，本基金的托管人、注册登记机构不变。自2021年12月9日起，《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》、《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》生效。本基金自资产管理合同变更生效日起存续期不得超过3年。本基金自资产管理合同变更生效日起3年后，按照中国证监会的有关规定执行。本基金的管理人为第一创业证券股份有限公司，托管人为兴业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《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》的有关规定，本基金的投资对象是具有良好流动性的金融工具，包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府机构债、地方政府债、可转换债券（含可分离交易的可转债）、可交换债、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具、国债期货以及经中国证监会允许投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。本基金不直接投资于股票等权益类资产，但可持有因可转换债券和可交换债券转股所形成的股票等权益资产。因上述原因持有的股票，本基金将在其可交易之日起的10个交易日内卖出。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。本基金的投资组合比例为：投资于债券资产的比例不低于集合计划资产的80%，其中投资于可转换债券（含可分离交易的可转债）及可交换债券的比例合计不超过集合计划资产的20%。本基金每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后应当保持不低于集合计划资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：中债综合指数收益率\*95%+1年期定期存款利率（税后）\*5%。

本财务报表由本基金的管理人第一创业证券于2022年3月29日批准报出。

### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表系按照财政部2006年2月颁布的《企业会计准则-基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业

会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《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〉》、《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》及其他中国证监会、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。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于2021年12月31日的财务状况以及2021年12月9日（基金合同生效日）至2021年12月31日的经营成果和基金净值变动情况。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，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2021年12月9日（基金合同生效日）至2021年12月31日。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

本基金在初始确认时按取得资产或承担负债的目的，把金融资产和金融负债分为不同类别：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、应收款项、持有至到期投资、可供出售金融资产和其他金融负债。本基金现无金融资产分类为持有至到期投资和可供出售金融资产。本基金现无金融负债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。

本基金持有的债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，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。

初始确认后，金融资产和金融负债的后续计量如下：（1）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以公允价值计量，公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益；（2）应收款项以实际利率法按摊余成本计量；（3）除以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债以外的金融负债采用实际利率法按摊余成本进行后续计量。

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：（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，且本基金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，虽然本基金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。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：（1）所转移金融资产的账面价值；（2）因转移而收到的对价。

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，本基金终止确认该金融负债或其一部分。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

（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。

与上述投资品种形同，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，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。

#### 7.4.4.6 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。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日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。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量，并于会计期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；



(5) 债券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(6) 资产支持证券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 公允价值变动收益/（损失）系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(8) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

#### 7.4.4.10 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基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

本基金的交易费用于进行股票、债券、权证等交易发生时按照确定的金额确认。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产利息支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额，在资金实际占用期间内以实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的支出差异较小的可采用直线法。

本基金的其他费用如无需在受益期内预提或分摊，则于发生时直接计入基金损益；如需采用预提或待摊的方法，预提或待摊时计入基金损益。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 本集合计划收益分配方式为仅现金分红；

(2) 集合计划收益分配后集合计划份额净值不能低于面值，即收益分配基准日的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；

(3) 每一集合计划份额享有同等分配权；

(4) 在符合上述原则和具备收益分配条件的情况下，本集合计划可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准；

(5) 在对计划份额持有人利益无实质不利影响的前提下，管理人可调整计划收益的分配原则和支付方式，不需召开计划份额持有人大会审议；

(6) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 7.4.4.12 外币交易

无。

#### 7.4.4.13 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。

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。

#### 7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

对于在发行时明确一定期限限售期的股票，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，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》，在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值日流通受限股票的价值。

根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》（以下简称“估值处理标准”），在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

#### 7.4.6 税项

##### （一）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；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

## （二）增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自2016年5月1日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，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。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。

本基金增值税的附加税费，包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等，按照实际缴纳增值税税额的适用比例计算，由管理人申报缴纳。

## （三）企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金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，暂不征收企业所得税。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末	
	2021年12月31日	
活期存款	4,776,104.78	
定期存款	-	
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	-	
合计	4,776,104.78	

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末			
	2021年12月31日			
	成本	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	28,368,458.17	28,395,561.30	27,103.13
	银行间市场	18,571,498.00	18,572,900.00	1,402.00
	合计	46,939,956.17	46,968,461.30	28,505.13
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	46,939,956.17	46,968,461.30	28,505.13	

### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

### 7.4.7.4 买入返售金融资产

#### 7.4.7.4.1 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 2021年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	7,980,131.97	-
合计	7,980,131.97	-

#### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日
应收活期存款利息	502.88
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	147.51
应收债券利息	708,666.92
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	2,133.52
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	1.21
合计	711,452.04

## 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

## 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日
交易所市场应付交易费用	3,169.62
银行间市场应付交易费用	6,357.86
合计	9,527.48

## 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用-审计费	20,000.00
合计	20,000.00

## 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年12月09日（基金合同生效日）至2021年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	50,819,178.45	50,819,178.45
本期申购	705,082.12	705,082.12
本期赎回（以“-”号填列）	-703,500.00	-703,500.00
本期末	50,820,760.57	50,820,760.57

## 7.4.7.10 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
基金合同生效日	1,361,850.26	-544,929.48	816,920.78
本期利润	75,140.40	30,433.13	105,573.53
本期基金份额交易产生的变动数	657.31	-232.57	424.74
其中：基金申购款	19,527.41	-7,776.32	11,751.09
基金赎回款	-18,870.10	7,543.75	-11,326.35
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,437,647.97	-514,728.92	922,919.05

## 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年12月09日（基金合同生效日）至2021年12月31日
活期存款利息收入	1,496.16
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	308.58
其他	2.72
合计	1,807.46

## 7.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金本报告期内无股票投资收益。

## 7.4.7.13 基金投资收益

本基金本报告期内无基金投资收益。

## 7.4.7.14 债券投资收益

## 7.4.7.14.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年12月09日（基金合同生效日）至2021年12月31日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-13,635.79
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	-13,635.79

#### 7.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年12月09日（基金合同生效日）至2021年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	21,530,437.55
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	21,441,824.57
减：应收利息总额	102,248.77
买卖债券差价收入	-13,635.79

#### 7.4.7.14.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无债券赎回差价收入。

#### 7.4.7.14.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无债券申购差价收入。

#### 7.4.7.14.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。



#### 7.4.7.15 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

#### 7.4.7.16 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

#### 7.4.7.17 股利收益

本基金本报告期内无股利收益。

#### 7.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2021年12月09日（基金合同生效日）至2021年12月31日
1. 交易性金融资产	30,433.13
——股票投资	-
——债券投资	30,433.13
——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	30,433.13

#### 7.4.7.19 其他收入

本基金本报告期内无其他收入。

#### 7.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年12月09日（基金合同生效日）至2021年12月31日
交易所市场交易费用	1,343.26
银行间市场交易费用	815.00
合计	2,158.26

#### 7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年12月09日（基金合同生效日）至2021年12月31日
审计费用	1,261.82
信息披露费	-
汇划手续费	-
合计	1,261.82

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金没有需要披露的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
第一创业证券股份有限公司	基金管理人、基金销售机构
兴业银行股份有限公司	基金托管人
北京首都创业集团有限公司	基金管理人持股5%以上股东
华熙昕宇投资有限公司	基金管理人持股5%以上股东
第一创业证券承销保荐有限责任公司	基金管理人的全资子公司
第一创业投资管理有限公司	基金管理人的全资子公司

深圳第一创业创新资本管理有限公司	基金管理人的全资子公司
第一创业期货有限责任公司	基金管理人的全资子公司
创金合信基金管理有限公司	基金管理人的控股子公司
银华基金管理股份有限公司	基金管理人的参股公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行股票交易。

###### 7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行权证交易。

###### 7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年12月09日（基金合同生效日）至2021年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例
第一创业证券股份有限公司	22,387,550.91	100.00%

###### 7.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年12月09日（基金合同生效日）至2021年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
第一创业证券股份有限公司	37,200,000.00	100.00%

###### 7.4.10.1.5 基金交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行基金交易。

###### 7.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年12月09日（基金合同生效日）至2021年12月31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
第一创业证券股份有限公司	1,521.03	100.00%	3,169.62	100.00%

注：上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，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。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年12月09日（基金合同生效日）至2021年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	9,698.26
其中：支付销售机构的客户维护费	4,416.77

注：本集合计划的管理费按前一日集合计划资产净值的0.30%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.30\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的集合计划管理费

E为前一日的集合计划资产净值

集合计划管理费每日计提，逐日累计至每季季末，按季支付，由管理人向托管人发送集合计划管理费划款指令，托管人复核后于次月前5个工作日内从集合计划财产中一次性支付给管理人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年12月09日（基金合同生效日）至2021年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,616.37

注：本集合计划的托管费按前一日集合计划资产净值的0.05%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的集合计划托管费

E为前一日的集合计划资产净值

集合计划托管费每日计提，逐日累计至每季季末，按季支付，由管理人向托管人发送集合计划托管费划款指令，托管人复核后于次月前5个工作日内从集合计划财产中一次性支付给托管人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

#### 7.4.10.2.3 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
	2021年12月09日（基金合同生效日）至2021年12月31日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
第一创业证券股份有限公司	6,465.49
合计	6,465.49

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0.20%年费率计提。本销售服务费将用于本集合计划的销售与份额持有人服务，管理人将在集合计划年度报告中对该项费用的列支情况作专项说明。

销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的集合计划销售服务费

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，逐日累计至每季季末，按季支付，由管理人向托管人发送集合计划销售服务费划款指令，托管人复核后于次月前5个工作日内从集合计划财产中一次性支付给各销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内无与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.4.1 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
----	----

	2021年12月09日（基金合同生效日）至2021年12月31日
基金合同生效日（2021年12月09日）持有的基金份额	4,876,537.88
报告期初持有的基金份额	4,876,537.88
报告期间申购/买入总份额	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00
报告期末持有的基金份额	4,876,537.88
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	9.60%

#### 7.4.10.4.2 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

报告期末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

#### 7.4.10.5 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 2021年12月09日（基金合同生效日）至2021年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
兴业银行股份有限公司	4,776,104.78	1,496.16

注：本基金的银行存款由托管行兴业银行股份有限公司保管，按银行同业利率或约定利率计算。

#### 7.4.10.6 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在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无须作说明的其他关联交易事项。

#### 7.4.11 利润分配情况—按摊余成本法核算的货币市场基金之外的基金

本基金本报告期内无利润分配。

#### 7.4.12 期末（2021年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

#### 7.4.12.2 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。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2021年12月31日止，本基金从事证券交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额9,499,914.50元，截至2021年1月4日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，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。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的金融工具风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，围绕风险管理总体目标及基本原则，建立了四级风险管理体系：董事会及其风险管理委员会、董事会授权的经理层及其下设执行委员会、履行专项风险管理职责的相关部门、业务及职能部门。各部门负责人为其所在部门风险管理的第一责任人，公司员工在其岗位职责范围内承担相应的风险管理责任。本基金管理人设立风险管理部门，对公司的风险管理进行独立评估、监控、检查并及时向管理层汇报。

##### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的投资范围及投资比例符合相关法律法规的要求、相关监管机构的相关规定及本基金的合同要求。本基金管理人通过建立和完善内部信用评级体系和交易对手库，对发行人及债券投资进行内部评级，对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能出现的信用风险。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行兴业银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所（场内）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，违约风险很小；在银行间同业市场或其他场外市场进行交易前均对交易对手和债券资质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。

本基金的基金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。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

#### 7.4.13.2.1 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 2021年12月31日
A-1	-
A-1以下	-
未评级	6,002,700.00
合计	6,002,700.00

注：①债券评级取自第三方评级机构的债项评级；

②未评级债券包括发行期限一年（含）以内的国债、政策性金融债、央行票据及未有第三方机构评级的短期融资券和超短期融资券。

#### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

#### 7.4.13.2.4 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 2021年12月31日
AAA	26,882,961.30
AAA以下	8,572,500.00
未评级	5,510,300.00



合计	40,965,761.30
----	---------------

注：①债券评级取自第三方评级机构的债项评级；

②未评级债券包括发行期限大于一年的国债、政策性金融债、央行票据及未有第三方机构评级的信用债（同业存单、资产支持证券除外）。

#### 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是在市场或持有资产流动性不足的情况下，基金管理人可能无法迅速、低成本地调整基金投资组合，从而对基金收益造成不利影响。流动性风险一般存在两种形式：资产变现风险和现金流风险。

##### (1) 资产变现风险

资产变现风险是指由于基金持有的某个券种的头寸相对于市场正常的交易量过大，或由于停牌造成交易无法在当前的市场价格下成交。

##### (2) 现金流风险

现金流风险是指基金因现金流不足导致无法应对正常基金支付义务的风险。

本基金管理人专业审慎、勤勉尽责地管控本基金流动性风险，建立了以压力测试为核心的流动性风险监测与预警机制，确保本基金组合的资产变现能力与投资者赎回需求相匹配。

#### 7.4.13.3.1 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，本基金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，本基金主要投资于合同约定的具有良好流动性的金融工具。基金管理人持续监测本基金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，基金管理人持续监测本基金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，基金管理人将采用本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。

#### 7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金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，包括利率风险和其他价格风险。

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金管理人定期监控组合中债券投资部分的利率风险，通过及时调整投资组合久期等方法管理利率风险。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021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
<b>资产</b>							
银行存款	4,776,104.78	-	-	-	-	-	4,776,104.78
结算备付金	298,052.76	-	-	-	-	584,435.80	882,488.56
存出保证金	2,399.17	-	-	-	-	-	2,399.17
交易性金融资产	-	-	6,002,700.00	39,910,461.30	1,055,300.00	-	46,968,461.30
买入返售金融资产	7,980,131.97	-	-	-	-	-	7,980,131.97
应收利息	-	-	-	-	-	711,452.04	711,452.04
应收申购款	-	-	-	-	-	22,292.08	22,292.08
资产总计	13,056,688.68	-	6,002,700.00	39,910,461.30	1,055,300.00	1,318,179.92	61,343,329.90
<b>负债</b>							
卖出回购金融资产款	9,499,914.50	-	-	-	-	-	9,499,914.50
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	41,350.78	41,350.78
应付托管费	-	-	-	-	-	6,891.75	6,891.75
应付销售服务费	-	-	-	-	-	6,465.49	6,465.49
应付交易费用	-	-	-	-	-	9,527.48	9,527.48
应交税费	-	-	-	-	-	12,751.16	12,751.16
应付利息	-	-	-	-	-	2,749.12	2,749.12
其他负债	-	-	-	-	-	20,000.00	20,000.00

负债总计	9,499,914.50	-	-	-	-	99,735.78	9,599,650.28
利率敏感度缺口	3,556,774.18	-	6,002,700.00	39,910,461.30	1,055,300.00	1,218,444.14	51,743,679.62

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。

#### 7.4.13.4.1.2 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 2021年12月31日
	市场利率上升25个基点	-183,841.18
	市场利率下降25个基点	183,841.18

#### 7.4.13.4.2 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。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 以公允价值计量的资产和负债

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。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于2021年12月31日，本基金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中划分为第一层次的余额为人民币3,670,361.30元，划分为第二层次的余额为人民币43,298,100.00元，无属于第三层次的余额。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

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，本基金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。

本基金本期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。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2021年12月31日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 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	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	其他各项资产	736,143.29	1.20
9	合计	61,343,329.90	100.00

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 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境内股票。

### 8.2.2 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通过港股通投资的股票。

## 8.3 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。

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金本报告期末未持有股票。

### 8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金本报告期末未持有股票。

### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期末未持有股票。

## 8.5 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	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

#### 8.6 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	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

#### 8.7 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

**8.8 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。

**8.9 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。

**8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**

**8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末投资股指期货。

**8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策**

本基金本报告期末投资股指期货。

**8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

**8.11.1 本期国债期货投资政策**

本基金本报告期末投资国债期货。

**8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末投资国债期货。

**8.11.3 本期国债期货投资评价**

本基金本报告期末投资国债期货。

**8.12 投资组合报告附注**

**8.12.1** 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。

**8.12.2** 根据基金合同规定，本基金的投资范围不包括股票。

**8.12.3 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	2,399.17
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	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	736,143.29

#### 8.12.4 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	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

#### 8.12.5 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。

### § 9 基金份额持有人信息

#### 9.1 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
277	183,468.45	5,983,872.88	11.77%	44,836,887.69	88.23%

#### 9.2 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	5,662,155.24	11.14%

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研发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

## § 10 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	-
本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。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 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，本基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 11.3 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，未出现涉及本基金管理业务、本基金基金财产、本基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略无重大改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金应支付给立信会计师事务所（特殊普通合伙）审计费用20,000元，该会计师事务所自本基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

### 11.6 管理人、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，未出现管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 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	
第一创业证券	2	-	-	3,169.62	100.00%	-

#### 11.7.2 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
第一创业证券	22,387,550.91	100.00%	37,200,000.00	100.00%	-	-	-	-

### 11.8 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	第一创业创和一个月滚动持有债券型集合资产管理计划合同变更生效公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-12-09
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开放日常申购（赎回、转换、定期定额投资）业务公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-12-09
3	第一创业证券股份有限公司关于第一创业创和一个月滚动持有债券型集合资产管理计划开展	中国证监会指定报刊及网站	2021-12-09

	申购（含定期定额投资申购）费率优惠的公告		
4	第一创业证券股份有限公司关于旗下集合资产管理计划（参照公募基金运作）执行新金融工具相关会计准则的公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-12-31

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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。

### 12.2 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。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 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。

### 13.2 存放地点

深圳市福田区福华一路115号投行大厦19楼

### 13.3 查阅方式

投资者可登录管理人官网（[www.firstcapital.com.cn](http://www.firstcapital.com.cn)）进行查阅。

第一创业证券股份有限公司  
二〇二二年三月三十一日