

财达证券稳达三个月滚动持有债券型集合资产管理计划

2022 年中期报告

2022 年 06 月 30 日

基金管理人:财达证券股份有限公司

基金托管人:招商银行股份有限公司

送出日期:2022 年 08 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2022年08月19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2022年3月28日起至6月30日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录.....	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§ 2 基金简介.....	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§ 3 主要财务指标和基金净值表现.....	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	8
§ 4 管理人报告.....	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
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.....	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 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	13
§ 6 中期财务会计报告(未经审计).....	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	15
6.3 净资产(基金净值)变动表.....	17
6.4 报表附注.....	18
§ 7 投资组合报告.....	44
7.1 期末基金资产组合情况.....	44
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	45
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.....	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	45
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.....	46
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.....	46
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.....	46
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.....	46
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	47
7.12 投资组合报告附注.....	47
§ 8 基金份额持有人信息.....	48
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	48
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	48
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.....	49

§ 9 开放式基金份额变动.....	49
§ 10 重大事件揭示.....	49
10.1 基金份额持有人大会决议.....	49
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.....	50
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	50
10.4 基金投资策略的改变.....	50
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	50
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.....	50
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	50
10.8 其他重大事件.....	51
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	51
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.....	51
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	51
§ 12 备查文件目录.....	51
12.1 备查文件目录.....	51
12.2 存放地点.....	51
12.3 查阅方式.....	52

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	财达证券稳达三个月滚动持有债券型集合资产管理计划	
基金简称	稳达三个月滚动持有	
基金主代码	970146	
交易代码	970146	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022年03月28日	
基金管理人	财达证券股份有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	216,959,251.78份	
基金合同存续期	3年	
下属分级基金的基金简称	稳达三个月滚动持有债券A	稳达三个月滚动持有债券C
下属分级基金的交易代码	970146	970147
报告期末下属分级基金的份额总额	166,670,082.99份	50,289,168.79份

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	在严格控制风险、保持资产良好流动性的基础上，通过主动管理，获取证券的利息收益和资本利得收益，以追求资产持续稳健的增值。
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>本资产管理计划将充分发挥管理人的资产配置能力，在货币市场工具、利率债、信用债等资产之间进行灵活配置。以债券类资产为主要配置，同时依托丰富的投资经验和优秀的风险控制能力在控制组合回撤风险的基础上增厚组合收益，力争获取持续稳定的收益。</p>

	<p>2、债券资产投资策略</p> <p>管理人在宏观经济形势、货币及财政政策研究的基础上，以预测未来市场利率的走势和债券市场供求关系为核心，结合收益率期限结构和利差分析，来构建债券组合。在运作过程中将实施积极的、动态的债券投资组合管理，争取获取较高的债券组合收益。</p> <p>3、货币市场工具投资策略</p> <p>本资产管理计划将在确定总体流动性要求的基础上，结合不同类型货币市场工具的流动性和货币市场预期收益水平、银行存款的期限、债券逆回购的预期收益率来确定货币市场工具的配置，并定期对货币市场工具组合平均剩余期限以及投资品种比例进行适当调整。</p> <p>4、资产支持证券投资策略</p> <p>本集合计划将在基本面分析和债券市场宏观分析的基础上，对资产支持证券的交易结构风险、信用风险、提前偿还风险和利率风险等进行分析，采取包括收益率曲线策略、信用利差曲线策略、预期利率波动率策略等积极主动的投资策略，投资于资产支持证券。</p> <p>5、可转债投资策略</p> <p>本资产管理计划将采用定性与定量相结合的方法来构建可转债投资组合，重点投资价值被市场低估、发债公司具有较好发展潜力、基础股票具有较高上升预期的个券品种。</p>
<p>业绩比较基准</p>	<p>本集合计划的业绩比较基准为：中债总财富(1-3年)指数收益率*90%+一年期定期存款利率(税后)*10%。</p>
<p>风险收益特征</p>	<p>本集合计划为债券型集合资产管理计划，其预期风险和预期收益高于货币市场基金和货币型集合资产管理计划，低于股票型基金、股票型集合资产管理计划、混合型基金和混合型集合资产管理计划。</p>

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
----	-------	-------

名称	财达证券股份有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	康云龙
	联系电话	0311-66006326
	电子邮箱	kangyunlong@cdzq.com
客户服务电话	95363	95555
传真	0311-66006200	0755-83195201
注册地址	石家庄市桥西区自强路35号	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
办公地址	河北省石家庄市桥西区自强路35号	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
邮政编码	050000	518040
法定代表人	翟建强	缪建民

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2022年03月28日(基金合同生效日)-20
---------------	---------------------------------

	22年06月30日)	
	稳达三个月滚动持有债券A	稳达三个月滚动持有债券C
本期已实现收益	1,399,892.83	127,864.34
本期利润	1,805,033.26	148,295.91
加权平均基金份额本期利润	0.0109	0.0077
本期加权平均净值利润率	1.06%	0.76%
本期基金份额净值增长率	1.60%	1.25%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2022年06月30日)	
期末可供分配利润	3,826,418.18	370,799.35
期末可供分配基金份额利润	0.0230	0.0074
期末基金资产净值	171,846,797.01	50,916,293.01
期末基金份额净值	1.0311	1.0125
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2022年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	1.60%	1.25%

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

（2）本期已实现收益指集合计划本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动损益。

（3）期末可供分配利润，为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

（4）本集合计划合同于 2022 年 03 月 28 日生效，报告期自基金合同生效日起算，自合同生效日起至本报告期末不满半年。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

稳达三个月滚动持有债券A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④

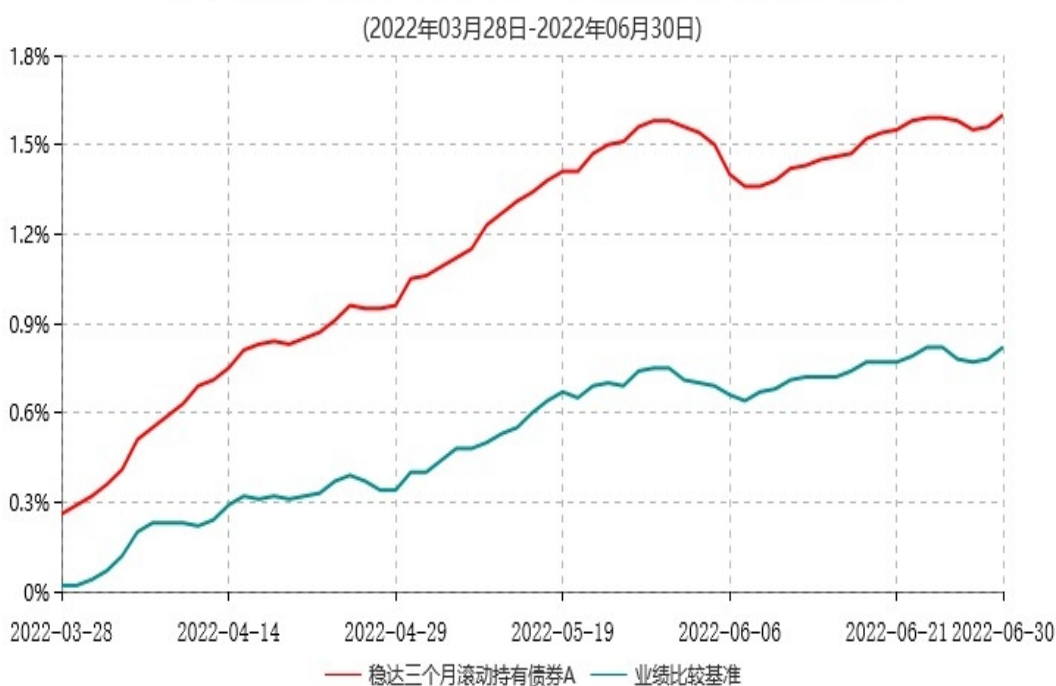
过去一个月	0.04%	0.03%	0.11%	0.02%	-0.07%	0.01%
过去三个月	1.23%	0.03%	0.75%	0.02%	0.48%	0.01%
自基金合同生效起至今	1.60%	0.05%	0.82%	0.02%	0.78%	0.03%

稳达三个月滚动持有债券C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.01%	0.03%	0.11%	0.02%	-0.10%	0.01%
过去三个月	1.15%	0.03%	0.75%	0.02%	0.40%	0.01%
自基金合同生效起至今	1.25%	0.03%	0.82%	0.02%	0.43%	0.01%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

稳达三个月滚动持有债券A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



稳达三个月滚动持有债券C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2022年03月28日-2022年06月30日)



2022年3月28日，财达证券稳达三号集合资产管理计划正式变更为财达证券稳达三个月滚动持有债券型集合资产管理计划，即本集合计划。按照本集合计划合同的约定，管理人应自资产管理合同生效日起6个月内使集合计划的投资组合比例符合资产管理合同的有关约定。截至本报告期末，本集合计划尚处在建仓期。

注：基金合同生效起至披露时点不满一年。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

财达证券根据《财达证券稳达三号集合资产管理计划资产管理合同》及《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》的要求，截至2022年3月28日，旗下已有2只大集合产品完成公募化改造，分别为“财达证券稳达中短债债券型集合资产管理计划”、“财达证券稳达三个月滚动持有债券型集合资产管理计划”。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金 经理（助理） 期限	证 券 从	说明

		任职日期	离任日期	业年限	
孔雀	基金经理	2022-03-28	-	12年	孔雀，硕士研究生学历，2017年12月加入财达证券，担任财达证券稳达一号、稳达三号集合资产管理计划投资经理

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

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

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期，财达证券股份有限公司作为本集合计划管理人，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券法》、《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》、计划合同以及其它有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用计划资产，为集合计划份额持有人谋求最大利益，无损害集合计划持有人利益的行为，本集合计划投资组合符合有关法规及计划合同的约定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本集合计划存在异常交易行为。

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2022年上半年初始国内经济面临较大下行压力，在货币政策宽松的加持下，市场收益率下行，随后政策加码宽信用预期增强，叠加海外加息周期的约束，债市收益率震荡上行。进入二季度，上海疫情向全国扩散，经济担忧开始升温，收益率总体下行。6月以来，疫情进入常态化，经济持续弱复苏，债市收益率整体震荡上行。

在经济基本面偏弱且面临扰动的背景下，银行间市场流动性维持宽松，资金利率中枢持续下行。上半年经济面临需求不足，财政政策虽然发力但并未形成超额供给，货币政策整体保持宽松，同时机构大多面临配置压力，整体环境有利于债市。

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2022年06月30日，稳达三个月滚动持有债券A基金份额净值为1.0311元，本报告期份额净值增长率为1.60%；稳达三个月滚动持有债券C份额净值为1.0125元，本报告期份额净值增长率为1.25%，同期业绩比较基准增长率为0.82%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，下半年经济或呈缓慢修复状态。当前出口处于较高增速，下半年面临高基数及需求弱化的预期。预计基建仍是下半年扩大投资、拉动需求、实现稳增长的重要抓手。当前地产市场持续低迷，销售偏弱，企业融资能力弱化，预计地产投资全年或成为拖累。疫情反复下企业经营预期恢复程度不足，部分企业面临要素短缺、原材料成本上涨等因素使得制造业投资增速恢复较慢。疫情影响下居民生活半径收缩，消费场景受限，消费回暖节奏偏慢，未来随着疫情影响逐步消退，复苏力度有望加强，但同时需要关注到居民未来收入预期下降带来的消费意愿和消费能力不足。预计货币政策仍将坚持稳健基调，聚焦国内基本面，更加注重总量和结构工具的有效结合。财政政策需要关注存量政策的落地生效和增量政策推出的可能性及节奏。综上所述，管理人将继续本着谨慎、稳健、安全的原则，积极关注经济和政策面的变化，在严格控制信用风险的前提下，根据市场变化灵活调整投资策略，为投资者谋取稳定回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及集合计划合同约定，本集合计划管理人为准确、及时进行基金估值和份额净值计价，制定了集合计划估值和份额净值计价的业务管理制度，建立了估值委员会，使用可靠的估值业务系统，设有完善的风险监测、控制和报告机制。

本集合计划托管人审阅本集合计划管理人采用的估值原则及技术，并复核、审查集合计划资产净值和集合计划份额申购、赎回价格。会计师事务所对估值调整导致集合计划资产净值的变化在 0.25%以上时对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性发表专业意见。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

报告期内未进行收益分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，本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

托管人声明：

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

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

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

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

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 中期财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：财达证券稳达三个月滚动持有债券型集合资产管理计划

报告截止日：2022年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2022年06月30日
资 产：		
银行存款	6.4.7.1	7,672,766.15
结算备付金		738,764.95
存出保证金		11,349.10
交易性金融资产	6.4.7.2	200,775,569.86
其中：股票投资		-
基金投资		-
债券投资		200,775,569.86
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
其他投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	15,000,150.00
债权投资	6.4.7.5	-
其中：债券投资		-
资产支持证券投资		-
其他投资		-
其他债权投资	6.4.7.6	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-
应收清算款		-
应收股利		-
应收申购款		1,988,995.46
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.8	-
资产总计		226,187,595.52
负债和净资产	附注号	本期末 2022年06月30日
负 债：		

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		-
应付清算款		2,998,257.53
应付赎回款		35,337.59
应付管理人报酬		142,034.60
应付托管费		17,706.85
应付销售服务费		107,530.90
应付投资顾问费		-
应交税费		71,436.67
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.9	52,201.36
负债合计		3,424,505.50
净资产：		
实收基金	6.4.7.10	216,959,251.78
其他综合收益	6.4.7.11	-
未分配利润	6.4.7.12	5,803,838.24
净资产合计		222,763,090.02
负债和净资产总计		226,187,595.52

注：报告截止日2022年6月30日，基金份额总额216,959,251.78份，其中，A类基金份额净值1.0311元，基金份额总额166,670,082.99份；C类基金份额净值1.0125元，基金份额总额50,289,168.79份。

6.2 利润表

会计主体：财达证券稳达三个月滚动持有债券型集合资产管理计划

本报告期：2022年03月28日（基金合同生效日）至2022年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022年03月28日（基金合同
----	-----	------------------------

		生效日) 至2022年06月30 日
一、营业总收入		3,002,557.62
1. 利息收入		39,624.54
其中：存款利息收入	6.4.7.13	13,976.82
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		26,417.13
其他利息收入		-769.41
2. 投资收益（损失以“-”填列）		1,805,437.93
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-
基金投资收益	6.4.7.15	-
债券投资收益	6.4.7.16	1,755,780.13
资产支持证券投资收益	6.4.7.17	49,657.80
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.18	-
股利收益	6.4.7.19	-
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-
其他投资收益		-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	1,157,495.15
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	-
减：二、营业总支出		310,905.53
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	147,175.92
2. 托管费	6.4.10.2.2	49,058.66
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	12,721.85
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		44,941.73
其中：卖出回购金融资产支出		44,941.73

6. 信用减值损失	6.4.7.23	-
7. 税金及附加		10,243.50
8. 其他费用	6.4.7.24	46,763.87
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		2,691,652.09
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2,691,652.09
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		2,691,652.09

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：财达证券稳达三个月滚动持有债券型集合资产管理计划

本报告期：2022年03月28日（基金合同生效日）至2022年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2022年03月28日（基金合同生效日）至2022年06月30日			
	实收基金	其他综合 收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产 （基金净值）	175,530,445.94	-	2,648,893.58	178,179,339. 52
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产 （基金净值）	175,530,445.94	-	2,648,893.58	178,179,339. 52
三、本期增减变动额 （减少以“-”号填 列）	41,428,805.84	-	3,154,944.66	44,583,750.5 0
（一）、综合收益总 额	-	-	2,694,532.65	2,694,532.65
（二）、本期基金份	41,428,805.84	-	460,412.01	41,889,217.8

额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)				5
其中: 1. 基金申购款	98,767,925.46	-	1,673,683.93	100,441,609.39
2. 基金赎回款	-57,339,119.62	-	-1,213,271.92	-58,552,391.54
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	216,959,251.78	-	5,803,838.24	222,763,090.02

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署:

康云龙

李冬梅

李冬梅

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

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

股份有限公司(以下简称“财达证券”),托管人为招商银行股份有限公司(以下简称“招商银行”)。

本集合计划主要投资于具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行的债券(包括国债、地方政府债、金融债、政策性金融债券、企业债、公司债、次级债、可转换债券(含可分离交易可转债的纯债部分)、证券公司发行的短期公司债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许集合计划投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本计划不直接从二级市场买入股票、权证等权益类资产,也不参与一级市场的新股申购或增发新股,仅可持有因可转债转股所形成的股票、因所持股票所派发的权证以及因投资可分离债券而产生的权证等,以及法律法规或中国证监会允许投资的其他非固定收益类品种(但须符合中国证监会的相关规定)。因上述原因持有的股票和权证等资产,本计划应在其可交易之日起的10个交易日内卖出。本集合计划不投资于股票等资产,也不投资于可交换债券。如法律法规或监管机构以后允许集合计划投资其他品种,管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本集合计划的投资组合比例为:本计划债券资产的比例不低于集合计划资产的80%;本计划所持有现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于计划资产净值的5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。如果法律法规或监管机构变更投资品种的投资比例限制,管理人在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准为:中债总财富(1-3年)指数收益率*90%+一年期定期存款利率(税后)*10%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《财达证券稳达三个月滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同》和在财务报表附注6.4.4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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2022年中期财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2022年06月30日的财务状况以及2022年上半年的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度，即每年1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为2022年3月28日（基金合同生效日）至2022年6月30日止期间。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的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。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂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。本基金持有的其他各类应付款项等。

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

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且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；或者(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。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

6.4.4.7 实收基金

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

6.4.4.8 损益平准金

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

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

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

日常经营活动中与交易相关的经济利益很可能流入本计划，相关的收入能够可靠计量且满足收入确认标准时，确认相关的收入。

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。

债券利息收入按债券票面价值与票面利率或债券发行价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。

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。

买入返售金融资产收入，按融出资金应付或实际支付的总额及实际利率(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。

股票投资收益/(损失)以卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本的差额确认。

债券投资收益/(损失)以卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本和应收利息的差额确认。

资产支持证券投资收益/(损失)为卖出资产支持证券交易日的成交总额扣除应结转的资产支持证券投资成本和应收利息的差额确认。

基金投资收益/(损失)以卖出/赎回基金交易日的成交总额扣除应结转的基金投资成本的差额确认。

基金红利收入按持有份额计算红利收入金额，于红利日确认并计入投资收益。

股利收入按上市公司宣告的分红派息比例计算，于除息日确认并计入投资收益。

公允价值变动损益于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值变动形成的利得或损失确认，并于相关金融资产卖出或到期转出时计入投资收益。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按资产管理合同约定的费率和计算方法逐日确认。其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

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

6.4.4.12 外币交易

无。

6.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1)该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2)本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3)本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

交易所上市交易或挂牌转让的不含权固定收益品种，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值。交易所上市交易或挂牌转让的含权固定收益品种，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价进行估值。交易所上市交易的可转换债券以每日收盘价作为估值全价。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。交易所市场挂牌转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值。对在交易所市场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估值日的公允价值；对于活跃市场报价未能代表估值日公允价值的情况下，应对市场报价进行调整以确认估值日

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，应采用估值技术确定其公允价值。首次公开发行未上市的债券，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，按成本估值。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净价估值。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净价或推荐估值净价估值。对于含投资人回售权的固定收益品种，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。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，在发行利率与二级市场利率不存在明显差异，未上市期间市场利率没有发生大的变动的情况下，按成本估值。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金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

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

财政部、国家税务总局《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》(财税[2016]36号)、《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》(财税[2016]140号)、《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》(财税[2017]2号)、《关于资管产品增值税有关问题的通知》(财税[2017]56号)及《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》(财税[2017]90号)对增值税做出相关规定。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，自2018年1月1日(含)起，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

(1) 增值税

根据财税[2016]140号文件的规定，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。

根据财税[2017]56号文件的规定，自2018年1月1日(含)起，资管产品管理人(以下称管理人)运营资管产品过程中发生的增值税应税行为(以下称资管产品运营业务)，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。

根据财税[2017]90号文件的规定，自2018年1月1日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：（一）提供贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；（二）转让2017年12月31日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的股票收盘价（2017年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。本计划增值税的附加税费，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。

（2）印花税

根据《财政部、国家税务总局关于证券交易印花税改为单边征收问题的通知》（财税明电[2008]2号）文件的规定，对买卖、继承、赠与所书立的A股、B股股权转让书据的出让方按千分之一的税率征收证券（股票）交易印花税，对受让方不再征税。计划管理人运用资产管理计划买卖股票，卖出股票按 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 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30日
活期存款	7,672,766.15
等于：本金	7,672,122.30
加：应计利息	643.85
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	7,672,766.15

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	-	-	-	-	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	70,620,860.00	1,288,769.86	72,533,869.86	624,240.00
	银行间市场	125,045,010.00	2,257,200.00	128,241,700.00	939,490.00
	合计	195,665,870.00	3,545,969.86	200,775,569.86	1,563,730.00
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	195,665,870.00	3,545,969.86	200,775,569.86	1,563,730.00	

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

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 2022年06月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	15,000,150.00	-
银行间市场	-	-
合计	15,000,150.00	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.8 其他资产

无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付交易费用	6,822.49
其中：交易所市场	-
银行间市场	1,037.50
应付利息	-
预提信披费	22,758.72
预提审计费	13,620.15
其他	9,000.00
预提费用-账户维护费	0.00
合计	52,201.36

6.4.7.10 实收基金

6.4.7.10.1 稳达三个月滚动持有债券A

金额单位：人民币元

项目 (稳达三个月滚动持有债券A)	本期 2022年03月28日（基金合同生效日）至2022年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额

基金合同生效日	175,530,445.94	175,530,445.94
本期申购	48,423,856.67	48,423,856.67
本期赎回（以“-”号填列）	-57,284,219.62	-57,284,219.62
本期末	166,670,082.99	166,670,082.99

6.4.7.10.2 稳达三个月滚动持有债券C

金额单位：人民币元

项目 (稳达三个月滚动持有债券C)	本期 2022年03月28日（基金合同生效日）至2022年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	-	-
本期申购	50,344,068.79	50,344,068.79
本期赎回（以“-”号填列）	-54,900.00	-54,900.00
本期末	50,289,168.79	50,289,168.79

6.4.7.11 其他综合收益

无。

6.4.7.12 未分配利润

6.4.7.12.1 稳达三个月滚动持有债券A

单位：人民币元

项目 (稳达三个月滚动持有债券A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	2,545,843.74	103,049.84	2,648,893.58
本期利润	1,413,340.15	1,132,896.59	2,546,236.74
本期基金份额交易产生的变动数	-132,765.71	114,349.41	-18,416.30
其中：基金申购款	876,114.12	318,082.70	1,194,196.82
基金赎回款	-1,008,879.83	-203,733.29	-1,212,613.12
本期已分配利润	-	-	-

本期末	3,826,418.18	1,350,295.84	5,176,714.02
-----	--------------	--------------	--------------

6.4.7.12.2 稳达三个月滚动持有债券C

单位：人民币元

项目 (稳达三个月滚动持有 债券C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	127,864.34	20,431.57	148,295.91
本期基金份额交易产 生的变动数	242,935.01	235,893.30	478,828.31
其中：基金申购款	243,330.88	236,156.23	479,487.11
基金赎回款	-395.87	-262.93	-658.80
本期已分配利润	-	-	-
本期末	370,799.35	256,324.87	627,124.22

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年03月28日（基金合同生效日）至2022年06月30 日
活期存款利息收入	7,374.32
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	6,527.80
其他	74.70
合计	13,976.82

6.4.7.14 股票投资收益——买卖股票差价收入

无。

6.4.7.15 基金投资收益

无。

6.4.7.16 债券投资收益

6.4.7.16.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年03月28日（基金合同生效日）至2022年 06月30日
债券投资收益——利息收入	1,690,122.62
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	65,657.51
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	1,755,780.13

6.4.7.16.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年03月28日（基金合同生效日）至2022年06月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	15,314,811.79
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	15,000,000.00
减：应计利息总额	248,991.78
减：交易费用	162.50
买卖债券差价收入	65,657.51

6.4.7.16.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.16.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.17 资产支持证券投资收益

6.4.7.17.1 资产支持证券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年03月28日（基金合同生效日）至2022年06月30日
资产支持证券投资收益——利息收入	49,657.80
资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入	-
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	49,657.80

6.4.7.17.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入
无。

6.4.7.17.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入
无。

6.4.7.17.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入
无。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入
无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益
无。

6.4.7.19 股利收益

无。

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2022年03月28日（基金合同生效日）至2022年06月30日
1. 交易性金融资产	1,192,220.00
——股票投资	-
——债券投资	1,192,270.00
——资产支持证券投资	-50.00
——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	34,724.85
合计	1,157,495.15

6.4.7.21 其他收入

无。

6.4.7.23 信用减值损失

无。

6.4.7.24 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2022年03月28日（基金合同生效日）至2022年06月30日
审计费用	13,620.15
信息披露费	22,758.72

账户维护费-中债登	4,500.00
账户维护费-上清所	4,500.00
银行汇划费	1,385.00
合计	46,763.87

6.4.7.25 分部报告

分部报告适用于QDII基金，本基金不适用。本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.8 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，本基金无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
财达证券	基金管理人、基金销售机构
招商银行股份有限公司	基金托管人
邯鄹钢铁集团有限责任公司	基金管理人股东的子公司

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

无。

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年03月28日（基金合同生效日）至2022年06月30日	
	成交金额	占当期债券买卖成交总额的比例
财达证券	10,000,000.00	100.00%

6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年03月28日（基金合同生效日）至2022年06月30日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
财达证券	615,800,000.00	100.00%

6.4.10.1.5 基金交易

无。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年03月28日（基金合同生效日）至2022年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
财达证券	10,787.99	100.00%	5,784.99	100.00%

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2022年03月28日（基金合同生效日）至2022年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	147,175.92
其中：支付销售机构的客户维护费	-

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

每日应计提的集合计划管理费=前一日集合计划资产净值×0.30%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2022年03月28日（基金合同生效日）至2022年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	49,058.66

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

日托管费=前一日集合计划资产净值×0.10%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2022年03月28日（基金合同生效日）至2022年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	稳达三个月滚动持有债券A	稳达三个月滚动持有债券C	合计
财达证券	0.00	12,721.85	12,721.85
合计	-	12,721.85	12,721.85

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

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

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

无。

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

份额单位：份

稳达三个月滚动持有债券A

关联方名称	本期末 2022年06月30日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
邯郸钢铁集团有限责任公司	4,851,043.18	2.91%

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 2022年03月28日（基金合同生效日）至2022年06月30日	
	期末余额	当期利息收入
招商银行	7,672,766.15	7,374.32

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

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

无。

6.4.12 期末（2022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

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

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

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

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

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

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

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

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指因交易对手无法履约或其信用评级、履约能力等改变而给公司带来损失的可能性。公司信用风险主要来源于信用交易业务、自营的固定收益业务等。

在信用交易业务的信用风险管理方面，加强对信用交易业务的主动管控，不断完善、优化制度和流程，严把项目准入关，严格客户资质审核，并通过风险指标计算表来量化评估项目中可能存在的风险。公司通过建立逐日盯市制度，对达到平仓线的账户进行强制平仓，加强监控和违约项目处理，防范信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本报告期末无余额。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本报告期末无余额。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本报告期末无余额。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022年06月30日
AAA	98,526,108.22
AAA以下	71,956,993.15
未评级	30,292,468.49
合计	200,775,569.86

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本报告期末无余额。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本报告期末无余额。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

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

同时，公司财务部门统筹安排自有资金的资金调度，加强日间资金流动性管理和监控，在保证安全的前提下，通过适当的现金管理工具，如银行协议存款、债券回购等，

加强自有资金流动性管理。公司信用交易、证券投资以及资产管理等业务决策委员会在公司董事会授权额度内对业务投资、融资进行授权，根据市场状况、风险敞口等，在确保流动性的基础上，决定各类投资、融资的额度。公司关注并加强资金流动性风险管理，在满足监管指标的基础上，结合公司风险管理的实际情况，充分考量公司的风险偏好和风险承受，对各项风险业务加强资金流动性风险管理。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

6.4.13.3.2 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。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指由于金融资产价格、利率、汇率及其他市场因素的不利波动使公司发生潜在损失的风险。公司涉及的市场风险主要是指在以自有资金进行各类投资时因利率变动、汇率变动和证券市场价格变动而导致亏损的可能性。

6.4.13.4.1 利率风险

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

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022年0 6月30 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	7,672,766.15	-	-	-	7,672,766.15
结算备付金	738,764.95	-	-	-	738,764.95
存出保证金	11,349.10	-	-	-	11,349.10
交易性金融资产	10,446,594.52	190,328,975.34	-	-	200,775,569.86
买入返售金融资产	15,000,150.00	-	-	-	15,000,150.00
应收申购款	-	-	-	1,988,995.46	1,988,995.46
应收利息	-	-	-	-	-
资产总计	33,869,624.72	190,328,975.34	-	1,988,995.46	226,187,595.52
负债					
应付赎回款	-	-	-	35,337.59	35,337.59
应付管理人报酬	-	-	-	142,034.60	142,034.60
应付托管费	-	-	-	17,706.85	17,706.85
应付销售服务费	-	-	-	107,530.90	107,530.90
应交税费	-	-	-	71,436.67	71,436.67
应付交易费用	-	-	-	6,822.49	6,822.49
其他负债	-	-	-	45,378.87	45,378.87
应付证券清算款	-	-	-	2,998,257.53	2,998,257.53
负债总计	-	-	-	3,424,505.50	3,424,505.50

计					
利率敏 感度缺 口	33,869,624.72	190,328,975.34	-	-1,435,510.04	222,763,090.02

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末 2022年06月30日
	市场利率上升25个基点	-1,083,479.37
	市场利率下降25个基点	1,091,470.85

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

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

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

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值层次第一层次是产品在计量日能获得相同资产或负债在活跃市场上报价的，以该报价为依据确定公允价值；第二层次是产品在计量日能获得类似资产或负债在活跃市场上的报价，或相同或类似资产或负债在非活跃市场上的报价的，以该报价为依据做必要调整确定公允价值；第三层次是产品无法获得相同或类似资产可比市场交易价格的，以其他反映市场参与者对资产或负债定价时所使用的参数为依据确定公允价值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

金额单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022年06月30日
第一层次	-
第二层次	200,775,569.86
第三层次	-
合计	200,775,569.86

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

无。

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

(1) 公允价值

(a) 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。

(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2022年06月30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属于第二层次的余额为人民币200,775,569.86元，无划分为第一和第三层次的金融工具。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金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。

(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2022年06月30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。

§ 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	200,775,569.86	88.77
	其中：债券	200,775,569.86	88.77
	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	15,000,150.00	6.63
	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	8,411,531.10	3.72

8	其他各项资产	2,000,344.56	0.88
9	合计	226,187,595.52	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本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。

7.4.2 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。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期末未持有股票。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	30,292,468.49	13.60
	其中：政策性金融债	30,292,468.49	13.60
4	企业债券	72,533,869.86	32.56
5	企业短期融资券	-	-

6	中期票据	97,949,231.51	43.97
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	200,775,569.86	90.13

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	184065	21周口02	100,000	10,640,931.51	4.78
2	102101443	21国药租赁MTN001	100,000	10,463,010.96	4.70
3	102103128	21川华西MTN001	100,000	10,421,660.27	4.68
4	102103160	21邯鄹交建MTN002(乡村振兴)	100,000	10,406,643.84	4.67
5	102103140	21华远陆港MTN001	100,000	10,365,424.66	4.65

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本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

本基金本报告期末无股指期货投资。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末无国债期货投资。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 基金投资前十名证券的发行主体未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 本基金本报告期末未持有股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	11,349.10
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,988,995.46
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,000,344.56

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本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

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
稳达三个月滚动持有债券A	1,176	141,726.26	16,358,654.27	9.81%	150,311,428.72	90.19%
稳达三个月滚动持有债券C	290	173,410.93	9,887,284.95	19.66%	40,401,883.84	80.34%
合计	1,466	147,994.03	26,245,939.22	12.10%	190,713,312.56	87.90%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	稳达三个月滚动持有债券A	2,830,821.34	1.70%
	稳达三个月滚动持有债券C	513,041.40	1.02%
	合计	3,343,862.74	1.54%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	稳达三个月滚动持有债券A	0
	稳达三个月滚动持有债券C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	稳达三个月滚动持有债券A	0~10
	稳达三个月滚动持有债券C	0
	合计	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	稳达三个月滚动持有债券A	稳达三个月滚动持有债券C
基金合同生效日(2022年03月28日)基金份额总额	140,701,671.74	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	48,423,856.67	50,344,068.79
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	22,455,445.42	54,900.00
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	166,670,082.99	50,289,168.79

注：基金合同生效日：2022年03月28日

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人发生的重大人事变动如下：

- (1) 财达证券股份有限公司基金行业高级管理人员变更公告（胡恒松）
- (2) 财达证券股份有限公司关于高级管理人员变更公告（康云龙）

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人、基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
财达证券	2	-	-	10,787.99	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	成交金额	占当期债	成交金额	占当期权	成交金额	占当期基

		券成交总 额的比例		券回购成 交总额的 比例		证成交总 额的比例		金成交总 额的比例
财达证 券	10,000,000. 00	100.00%	615,800,000. 00	100.00%	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	《关于财达证券股份有限公司旗下部分基金在上海天天基金销售有限公司销售并参加其申购费率优惠活动的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2022-05-30

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本集合计划报告期内未出现单一投资者持有集合计划份额比例达到或超过20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

2022年5月30日基金管理人发布了《关于财达证券股份有限公司旗下部分基金在上海天天基金销售有限公司销售并参加其申购费率优惠活动的公告》。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

12.2 存放地点

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

12.3 查阅方式

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

财达证券股份有限公司
二〇二二年八月三十日