

# 财信证券 30 天持有期债券型集合资产管理计划

## 2022 年年度报告

2022 年 12 月 31 日

基金管理人:财信证券股份有限公司

基金托管人:中国建设银行股份有限公司

送出日期:2023 年 03 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2023年3月20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。天健会计师事务所（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2022年5月20日起至2022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	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、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
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	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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	15
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
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	15
§6 审计报告	15
6.1 审计报告基本信息	15
6.2 审计报告的基本内容	15
§7 年度财务报表	18
7.1 资产负债表	18
7.2 利润表	20
7.3 净资产（基金净值）变动表	21
7.4 报表附注	22
§8 投资组合报告	47
8.1 期末基金资产组合情况	47
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	48
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	48
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	48
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	48
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	49
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	49
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	49

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	49
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	49
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	49
8.12 投资组合报告附注	50
§9 基金份额持有人信息	50
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	50
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	51
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	51
§10 开放式基金份额变动	51
§11 重大事件揭示	51
11.1 基金份额持有人大会决议	51
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	51
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	52
11.4 基金投资策略的改变	52
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	52
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	52
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	53
11.8 其他重大事件	53
§12 影响投资者决策的其他重要信息	55
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	55
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	56
§13 备查文件目录	56
13.1 备查文件目录	56
13.2 存放地点	56
13.3 查阅方式	56

## §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	726,494,324.24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	010-67595853
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	田国立

### 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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	zg.stock.hnchasing.com
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	天健会计师事务所(特殊普通合伙)	浙江省杭州市西湖区灵隐街道西溪路128号
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、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

<b>3.1.1 期间数据和指标</b>	本期2022年05月20日（基金合同生效日） - 2022年12月31日
本期已实现收益	39,358,318.12
本期利润	13,140,732.31
加权平均基金份额本期利润	0.0055
本期加权平均净值利润率	0.55%
本期基金份额净值增长率	-0.39%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	2022年末
期末可供分配利润	-2,798,490.99
期末可供分配基金份额利润	-0.0039
期末基金资产净值	723,695,833.25
期末基金份额净值	0.9961
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	2022年末
基金份额累计净值增长率	-0.39%

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、减预估附加税。

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。

4、基金合同生效日为2022年5月20日。截至2022年12月31日，本基金合同生效不满一年。

#### 3.2 基金净值表现

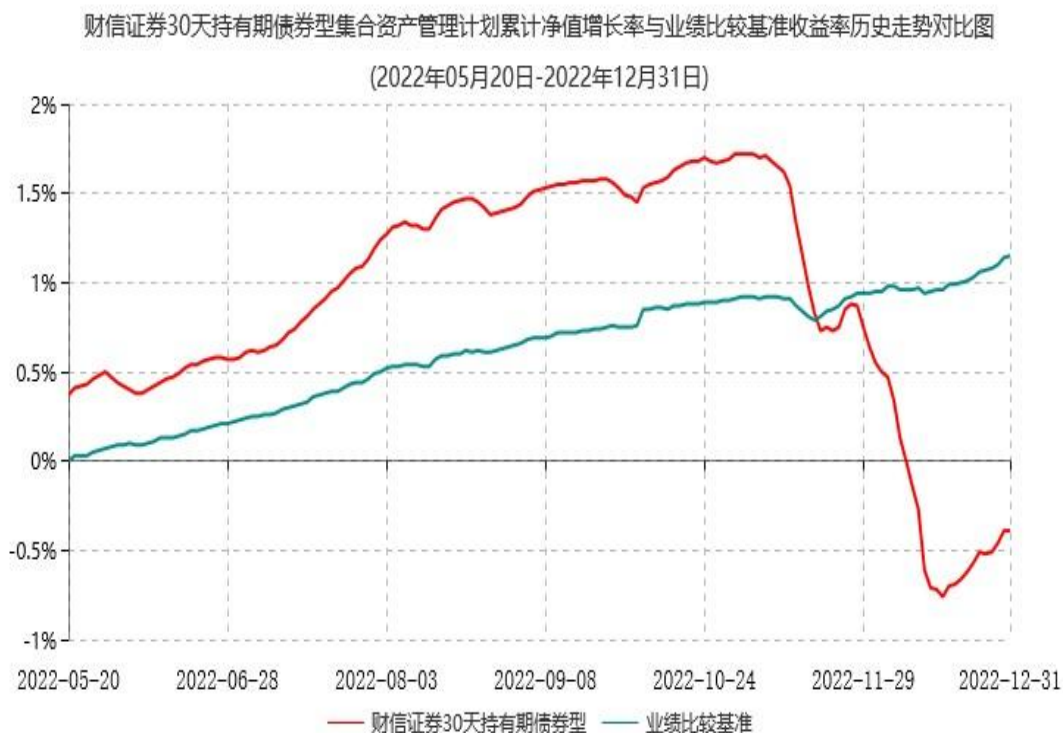
##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	①-③	②-④
----	----------	-------------	------------	--------------	-----	-----

				④		
过去三个月	-1.81%	0.08%	0.39%	0.02%	-2.20%	0.06%
过去六个月	-0.96%	0.06%	0.92%	0.01%	-1.88%	0.05%
自基金合同生效起至今	-0.39%	0.07%	1.15%	0.01%	-1.54%	0.06%

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。截至2022年12月31日，本基金合同生效不满一年。

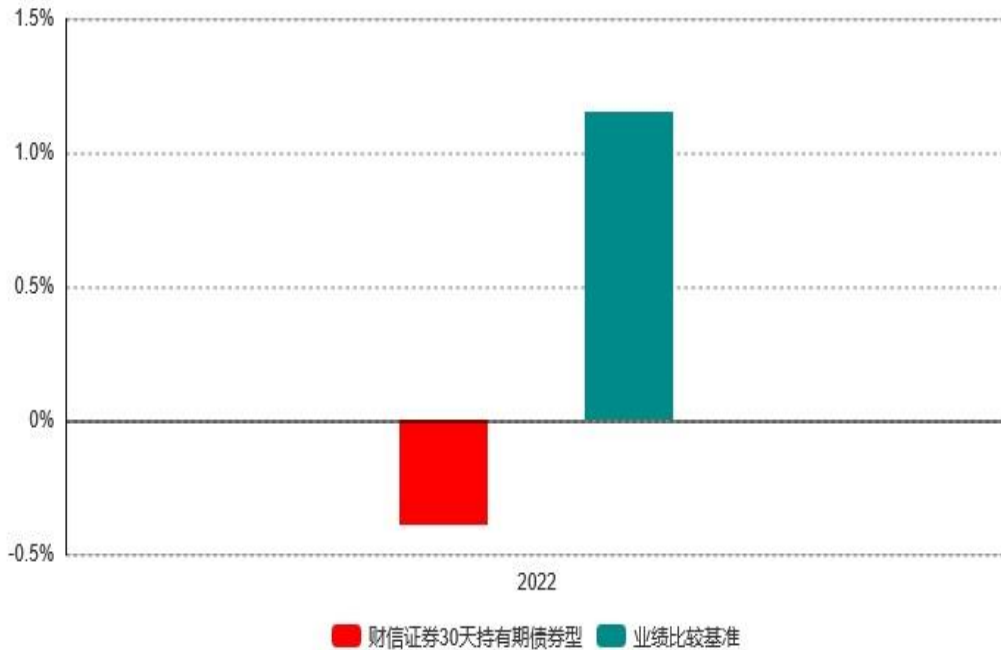
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



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。截至2022年12月31日，本基金合同生效不满一年。

### 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





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。截至2022年12月31日，本基金合同生效不满一年。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

截止本报告期末，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 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，注册资本66.98亿元。截至2021年12月31日，公司总资产超650亿元，净资产超140亿元。

公司作为拥有全业务牌照的全国性综合类证券公司，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。连续三年获评企业债券主承销商信用评价、公司债券业务执业能力评价双A类券商，并连续七年跻身国家发改委企业债券主承销商信用评价行业前20位。近年来，公司还荣获湖南省脱贫攻坚先进集体、湖南省文明标兵单位、湖南省科学技术二等奖、湖南金融力量、

企业债承销机构杰出贡献奖、中国区交易所债券投行君鼎奖、中国区债券项目君鼎奖、文化建设券商君鼎奖、中国证券业成长APP君鼎奖、最佳投资顾问卓越组织奖等多个奖项。截至2022年末，公司共管理产品121只（不含延期清算），其中专项计划1只；公司资管规模合计26,745,868,217.88 元，包括专项计划规模280,000,000.00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	-	11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。
赵昶	本基金的基金经理、财信证券资管投资部投资经理	2022-05-20	-	5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。
卜基鑫	本基金的基金经理、财信证券资管投资部投资经理	2022-09-27	-	5年	中国籍，经济学学士，5年固定收益从业经验，历任债券交易员，投资经理助理；2020年加入财信证券

					股份有限公司，现任资管投资部投资经理。
翟舒	本基金的基金经理助理、财信证券资管投资部投资经理助理	2022-05-20	-	15 年	中国籍，理学硕士，2007 年入职财信证券，曾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，现任资管投资部投资经理助理。

注：

- (1) 张艳、赵昉为本基金合同生效后的首任基金经理，“任职日期”即基金合同生效日。
- (2) “离任日期”指根据投资决策小组会议确定的离任日期。
- (3) 证券从业年限的计算标准为：自从事证券投研、交易等相关工作起至本报告期末的总年限，不满1年部分的不计入。

#### 4.1.3 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，本基金管理人严格遵守《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，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理基金资产，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，不存在违反基金合同和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》和有关法律法规的规定，针对债券类资产的一级市场申购和二级市场交易等投资管理活动，在授权、投资研究、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节，建立了业务管理办法和细则，交易室管理细则，公平交易管理细则，异常交易管理制度等公平交易相关的制度或细则。通过加强投资决策、交易执行的内部控制，完善对投资交易行为的监控，履行相关的报告和信息披露义务，公平对待旗下管理的所有产品，严格遵守相

应的制度和流程，切实防范投资管理业务中的不公平交易和利益输送行为，保护投资者合法权益。

#### 4.3.2 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。

#### 4.3.3 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

2022年地缘政治冲突爆发，美联储激进加息，全球经济增长放缓，外需走弱叠加疫情反复波动，导致国内出口进口双收缩，投资和消费增速持续下滑，经济多重承压下艰难前行。2022年GDP全年增速为3.0%，一到四季度增速分别为：4.80%、0.40%、3.90%和2.90%，呈现“v”字走势，债券市场表现如下：2022年1-3月份、4-7月份以及8-10月份均经历“宽货币发力”到“宽信用预期”再到“数据不及预期”的过程，期间收益率均在窄幅震荡。2022年11月份之后，经济企稳压力加大，疫情防控20条出台叠加地产政策放松，市场出现剧烈回调，收益率大幅度上行，同时引发理财赎回负反馈效应，导致信用债收益率上行幅度较大，信用利差走阔。

本基金在报告期内维持中高等级信用债策略，主要关注中短期限高评级信用债，同时控制账户久期，择时择机参与波段交易。

#### 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0.9961元，本报告期内，基金份额净值增长率为-0.39%，同期业绩比较基准收益率为1.15%。

### 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2023年，国外方面，欧美经济衰退阴影逐渐变为现实，美联储预计加息步伐将放缓，减少了对国内政策的掣肘。国内方面，随着疫情优化经济稳步修复增长的基本面不会改变，财政政策将加力提效，货币政策将更加精准有力。出口对经济的拉动将逐步

减弱，经济的增长将主要依靠内需。地产投资将伴随着政策的逐步落地，减轻对经济的拖累，基建将持续发力。消费方面，疫情管控措施优化后，消费限制取消，预计也将呈现缓慢修复的特征。

展望2023年债券市场，市场对于经济恢复的乐观预期将对现券走势产生影响，整体中枢将有所抬升，但是抬升的幅度和斜率预计仍将会围绕宽信用的预期和现实反复博弈，因此预计2023年债市波动将会加大。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，基金管理人根据国家法律法规、监管要求与业务发展实际情况，积极推动主动合规风险管理，完善并执行内部合规风险控制机制，有效保障法律法规、监管要求和各项规章制度的落实，保证公司各项业务合法合规、稳健有序运作开展。

本年度，主要监察稽核工作如下：

##### 1、合规管理方面

基金管理人本着诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用本基金资产，在严格控制风险的基础上，为投资者谋求最大利益。报告期内，本基金运作合法合规，无损害投资者利益的行为，投资管理符合有关法规的规定。具体合规管理工作如下：

(1)跟踪法律法规与监管动态，对公司内部管理制度不断进行修订、完善，进一步优化业务流程；认真履行合规审查职能，对有关公司内部规章制度、重大决策、新产品及新业务方案、合同、监管要求出具合规审查意见的报送材料或报告等进行合规审查，严把合规质量关；持续开展合规宣导与培训，通过线上线下、培训等形式，及时向员工传达最新法律法规与监管政策精神，切实增强员工整体合规意识，推进公司合规文化建设；及时解答公司各部门的日常合规咨询；定期开展针对公司及员工的经营管理和执业行为合规性的各项检查，及时排查合规风险隐患，提出整改措施与建议，促进合规管理水平的提升。同时，建立违法违规行为及合规风险隐患报告、处置机制，指导公司处理违法违规行为与合规风险事件，提出处理意见，督促整改落实，对相关员工进行合规问责。

(2)切实落实反洗钱、信息隔离工作。深入践行“风险为本”的工作方法，落实反洗钱最新法规和监管要求，要求业务办理人员了解客户身份、履行客户身份识别义务、了解客户及其交易目的和交易性质，了解实际控制客户的自然人和交易实际受益人，核对客户有效身份证件或其他身份证明文件，登记客户身份基本信息并留存有效身份证件或其他身份证明文件复印件或影印件，并提供客户反洗钱所需材料。加强客户身份识别、大额和可疑交易报告，建立受益所有人识别机制。定期组织公司洗钱风险自评估工作，完善洗钱风险控制措施，做好反洗钱宣传培训、系统支持、内部检查、信息报送等各项反洗钱工作。定期开展核查工作，对可疑交易报告、客户身份资料保存等反洗钱义务履行情况进行核查；信息隔离方面，组织、指导公司做好信息隔离相关工作，加强信息隔离墙的日

常管理与使用,组织敏感信息监测工作,控制敏感信息的不当流动与使用,防范利益冲突,不断优化信息隔离管理工作机制。报告期内未发生敏感信息的不当流动及跨墙活动。

## 2、风险管理方面

本基金的投资决策、投资交易程序、投资权限等各方面均符合相关规定要求;交易行为合法合规,未出现异常交易、操纵市场的现象;未发现内幕交易的情况;相关的信息披露和财务数据真实、完整、准确、及时。具体风险管理工作如下:

(1)制度及流程建设。公司根据《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》、《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》、《关于规范债券市场参与者债券交易业务的通知》、《关于进一步加强证券投资基金经营机构债券交易监管的通知》、《证券投资基金经营机构债券投资交易业务内控指引》等相关监管要求,结合实际业务开展情况,持续就“内部信用评级体系建设、交易对手尽职调查及额度授信、即时通讯工具管控”等方面的制度及流程进行了完善。

(2)风险监控。公司落实事前产品风险等级及产品估值方法评估机制,建立系统前端的风险控制指标设置体系,对系统暂不支持前端控制的相关风控指标,实现人工前端审核机制,确保产品各相关风险控制指标在产品合同及公司内外规定的范围内。公司安排专人对事中风险进行实时监控并预警提示,同时,事后根据内部风险控制制度及流程的执行情况,对相关责任部门及责任人员进行考核问责。事前风险评估、事中风险监控及事后考核机制的层层贯穿,确保公司风险可测、可控、可承受。

(3)风险自查及整改。自债券交易相关监管规定颁布以来,我司高度重视、认真领会、严格遵照落实。本年度,我司多次组织公司内控部门及债券交易业务各相关部门进行全面自查整改,并采取了一系列合规风控措施持续推进公司债券交易业务的规范运行。

## 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。

## 4.8 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。

#### 4.9 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

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《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、托管协议的规定，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。

#### 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

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，内容真实、准确和完整。

### §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	天健审[2023]2-54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	财信证券30天持有期债券型集合资产管理计划 全体持有人

<p>审计意见</p>	<p>我们审计了财信证券30天持有期债券型集合资产管理计划(以下简称财信30天计划)财务报表,包括2022年12月31日的资产负债表,2022年度的利润表、净资产变动表,以及相关财务报表附注。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的规定编制,公允反映了财信30天计划2022年12月31日的财务状况,以及2022年度的经营成果和净资产变动情况。</p>
<p>形成审计意见的基础</p>	<p>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。按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于财信30天计划及其管理人财信证券股份有限公司(以下简称计划管理人),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>无</p>
<p>其他事项</p>	<p>无</p>
<p>其他信息</p>	<p>无</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表,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。在编制财务报表时,管理层负责评估财信30天计划的持续经营能力,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。计划管理人治理层(以下简称治理层)负责监督财信30天计划的财务报告过程。</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</p>





会计师事务所的地址	浙江省杭州市西湖区灵隐街道西溪路128号
审计报告日期	2023-03-17

## §7 年度财务报表

### 7.1 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：2022年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022年12月31日
<b>资产：</b>		
银行存款	7.4.7.1	613,331.88
结算备付金		22,808,048.01
存出保证金		27,912.84
交易性金融资产	7.4.7.2	706,906,704.33
其中：股票投资		-
基金投资		-
债券投资		676,745,131.84
资产支持证券投资		30,161,572.49
贵金属投资		-
其他投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
债权投资		-
其中：债券投资		-
资产支持证券投资		-
其他投资		-
其他债权投资		-
其他权益工具投资		-
应收清算款		2,388,931.56

应收股利		-
应收申购款		634,000.00
递延所得税资产		-
其他资产		-
资产总计		733,378,928.62
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022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		4,499,231.09
应付清算款		-
应付赎回款		2,829,707.93
应付管理人报酬		406,644.87
应付托管费		81,328.98
应付销售服务费		1,339,607.88
应付投资顾问费		-
应交税费		112,643.54
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.5	413,931.08
负债合计		9,683,095.37
<b>净资产：</b>		
实收基金	7.4.7.6	726,494,324.24
其他综合收益		-
未分配利润	7.4.7.7	-2,798,490.99
净资产合计		723,695,833.25
负债和净资产总计		733,378,928.62

注：本财务报表的编制期间为2022年5月20日(基金合同生效日)至2022年12月31日。报告截止日2022年12月31日，基金份额净值0.9961元，基金份额总额726494324.24份。

## 7.2 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：2022年05月20日（基金合同生效日）至2022年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022年05月20日（基金合同生效日）至2022年12月31日
<b>一、营业总收入</b>		<b>30,152,122.53</b>
1.利息收入		293,808.68
其中：存款利息收入	7.4.7.8	169,355.18
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		124,453.50
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		56,151,314.19
其中：股票投资收益		-
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.9	55,676,392.19
资产支持证券投资收益	7.4.7.10	474,922.00
贵金属投资收益		-
衍生工具收益		-
股利收益		-
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）	7.4.7.11	-26,293,000.34
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>		17,011,390.22
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	7,479,885.06
2. 托管费	7.4.10.2.2	1,495,977.01
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	4,487,931.04
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		3,267,084.48
其中：卖出回购金融资产支出		3,267,084.48
6. 信用减值损失		-
7. 税金及附加		117,106.25
8. 其他费用	7.4.7.12	163,406.38
<b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>		13,140,732.31
减：所得税费用		-
<b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>		13,140,732.31
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-
<b>六、综合收益总额</b>		13,140,732.31

注：本基金合同生效日为2022年5月20日，因此无上年度可比期间数据。

### 7.3 净资产（基金净值）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：2022年05月20日（基金合同生效日）至2022年12月31日

单位：人民币元

项目	本期			
	2022年05月20日（基金合同生效日）至2022年12月31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）	3,313,783,054.70	-	-	3,313,783,054.70
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）	3,313,783,054.70	-	-	3,313,783,054.70

三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-2,587,288,730.46	-	-2,798,490.99	-2,590,087,221.45
（一）、综合收益总额	-	-	13,140,732.31	13,140,732.31
（二）、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）	-2,587,288,730.46	-	-15,939,223.30	-2,603,227,953.76
其中：1.基金申购款	1,578,645,612.91	-	12,907,610.09	1,591,553,223.00
2.基金赎回款	-4,165,934,343.37	-	-28,846,833.39	-4,194,781,176.76
（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）	726,494,324.24	-	-2,798,490.99	723,695,833.25

注：本基金合同生效日为2022年5月20日，因此无上年度可比期间数据。

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：

刘宛晨

杨光

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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 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，于2010年1月14日经中国证监会证监许可〔2010〕67号文核准设立，并于2010年6月9日正式成立。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”，截至2022年5月18日，财富1号集合资产管理计划已完成变更征询工作，合同变更满足生效条件，于2022年5月20日生效。根据2022年5月20日变更生效的《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2022年5月20日变更生效的《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，本集合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）。本集合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，本集合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。

#### 7.4.2 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。

#### 7.4.3 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。

## 7.4.4 重要会计政策和会计估计

### 7.4.4.1 会计年度

会计年度自公历1月1日起至12月31日止。本产品于2022年5月20日变更生效，本期会计期间为2022年5月20日至2022年12月31日。

### 7.4.4.2 记账本位币

采用人民币为记账本位币。

### 7.4.4.3 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。

### 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

#### (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）。

### 3. 金融资产转移的确认依据和计量方法

本计划转移了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，终止确认该金融资产，并将转移中产生或保留的权利和义务单独确认为资产或负债；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，继续确认所转移的金融资产。本计划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的，分别下列情况处理：(1) 未保留对该金融资产控制的，终止确认该金融资产，并将转移中产生或保留的权利和义务单独确认为资产或负债；(2) 保留了对该金融资产控制的，按照继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，将下列两项金额的差额计入当期损益：(1) 所转移金融资产在终止确认日的账面价值；(2) 因转移金融资产而收到的对价，与原直接计入其他综合收益的公允价值变动累计额中对应终止确认部分的金额（涉及转移的金融资产为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）之和。转移了金

融资产的一部分，且该被转移部分整体满足终止确认条件的，将转移前金融资产整体的账面价值，在终止确认部分和继续确认部分之间，按照转移日各自的相对公允价值进行分摊，并将下列两项金额的差额计入当期损益：(1) 终止确认部分的账面价值；(2) 终止确认部分的对价，与原直接计入其他综合收益的公允价值变动累计额中对应终止确认部分的金额（涉及转移的金融资产为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）之和。

#### 7.4.4.5 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) 证券交易所上市的有价证券的估值

1) 交易所上市的有价证券(包括股票等)，以其估值日在证券交易所挂牌的市价(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或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，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或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

2) 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；

3) 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；

4) 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；

5) 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；在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；

6) 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。

(2) 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。

(3) 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。

(4) 国债期货合约,一般以估值当日结算价进行估值,估值当日无结算价的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化的,采用最近交易日结算价估值。

#### (5) 存款的估值方法

持有的银行定期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。

#### (6) 同业存单的估值方法

投资同业存单,按估值日第三方估值机构提供的估值净价估值;选定的第三方估值机构未提供估值价格的,按成本估值。

(7) 送股、转增股、配股,按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值;该日无交易的,以最近一日的市价(收盘价)估值。

(8) 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

(9) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的,集合计划管理人可根据具体情况与集合计划托管人商定后,按最能反映公允价值的价格估值。

(10) 当发生大额申购或赎回情形时,集合计划管理人可以采用摆动定价机制,以确保集合计划估值的公平性。

(11) 相关法律法规以及监管部门有强制规定的,从其规定。如有新增事项,按国家最新规定估值。

### 5. 金融工具减值计量和会计处理

本计划以预期信用损失为基础,对以摊余成本计量的金融资产、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进行减值处理并确认损失准备。

预期信用损失,是指以发生违约的风险为权重的金融工具信用损失的加权平均值。信用损失,是指本计划按照原实际利率折现的、根据合同应收的所有合同现金流量与预

期收取的所有现金流量之间的差额，即全部现金短缺的现值。其中，对于本计划购买或源生的已发生信用减值的金融资产，按照该金融资产经信用调整的实际利率折现。

对于购买或源生的已发生信用减值的金融资产，本计划在资产负债表日仅将自初始确认后整个存续期内预期信用损失的累计变动确认为损失准备。

除上述计量方法以外的金融资产，本计划在每个资产负债表日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加。如果信用风险自初始确认后已显著增加，本计划按照整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备；如果信用风险自初始确认后未显著增加，本计划按照该金融工具未来12个月内预期信用损失的金额计量损失准备。

本计划利用可获得的合理且有依据的信息，包括前瞻性信息，通过比较金融工具在资产负债表日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。

于资产负债表日，若本计划判断金融工具只具有较低的信用风险，则假定该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加。

本计划以单项金融工具或金融工具组合为基础评估预期信用风险和计量预期信用损失。当以金融工具组合为基础时，本计划以共同风险特征为依据，将金融工具划分为不同组合。

本计划在每个资产负债表日重新计量预期信用损失，由此形成的损失准备的增加或转回金额，作为减值损失或利得计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融资产，损失准备抵减该金融资产在资产负债表中列示的账面价值；对于以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的债权投资，本计划在其他综合收益中确认其损失准备，不抵减该金融资产的账面价值。

#### **7.4.4.6 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。

#### **7.4.4.7 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。

#### **7.4.4.8 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)。

#### **7.4.4.9 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。

#### **7.4.4.10 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。

#### **7.4.4.11 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。

#### **7.4.4.12 外币交易**

本基金本报告期内无外币交易。

#### **7.4.4.13 分部报告**

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

本集合计划本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

### 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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

#### 7.4.5.2 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。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期未发生差错更正。

### 7.4.6 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。

### 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 2022年12月31日
活期存款	613,331.88
等于：本金	612,715.22
加：应计利息	616.66

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	613,331.88

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31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	316,165,539.97	4,716,995.58	319,047,984.18	-1,834,551.37
	银行间市场	355,915,967.14	4,917,147.66	357,697,147.66	-3,135,967.14
	合计	672,081,507.11	9,634,143.24	676,745,131.84	-4,970,518.51
资产支持证券	30,338,000.00	197,572.49	30,161,572.49	-374,000.00	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	702,419,507.11	9,831,715.73	706,906,704.33	-5,344,518.51	

#### 7.4.7.3 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。

#### 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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付交易费用	274,631.08
其中：交易所市场	234,066.68
银行间市场	40,564.40
应付利息	-
预提费用	139,300.00
合计	413,931.08

#### 7.4.7.6 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年05月20日（基金合同生效日）至2022年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	3,313,783,054.70	3,313,783,054.70
本期申购	1,578,645,612.91	1,578,645,612.91
本期赎回（以“-”号填列）	-4,165,934,343.37	-4,165,934,343.37
本期末	726,494,324.24	726,494,324.24

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。



## 7.4.7.7 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	-	-	-
本期利润	39,358,318.12	-26,217,585.81	13,140,732.31
本期基金份额交易产生的变动数	-29,730,950.84	13,791,727.54	-15,939,223.30
其中：基金申购款	6,329,542.87	6,578,067.22	12,907,610.09
基金赎回款	-36,060,493.71	7,213,660.32	-28,846,833.39
本期已分配利润	-	-	-
本期末	9,627,367.28	-12,425,858.27	-2,798,490.99

## 7.4.7.8 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年05月20日（基金合同生效日）至2022年12月31日
活期存款利息收入	42,703.68
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	126,410.56
其他	240.94
合计	169,355.18

## 7.4.7.9 债券投资收益

## 7.4.7.9.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年05月20日（基金合同生效日）至2022年12月31日
债券投资收益——利息收入	56,715,922.52

债券投资收益——买卖债券 (债转股及债券到期兑付) 差价收入	-1,039,530.33
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	55,676,392.19

#### 7.4.7.9.2 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05月20日（基金合同生效日）至2022年12月31日
卖出债券（债转股 及债券到期兑付） 成交总额	3,646,670,758.81
减：卖出债券（债 转股及债券到期兑 付）成本总额	3,579,612,038.88
减：应计利息总额	67,853,062.67
减：交易费用	245,187.59
买卖债券差价收入	-1,039,530.33

#### 7.4.7.10 资产支持证券投资收益

##### 7.4.7.10.1 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05月20日（基金合同生效日）至2022年12月31 日
资产支持证券投资收益—— 利息收入	474,922.00
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	474,922.00

#### 7.4.7.10.2 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 2022年05月20日（基金合同生效日）至2022年12月31 日
卖出资产支持证券成交总额	38,780,700.34
减：卖出资产支持证券成本 总额	37,662,000.00
减：应计利息总额	1,118,700.34
减：交易费用	-
资产支持证券投资收益	-

#### 7.4.7.11 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年05月20日（基金合同生效日）至2022年12月31日
1.交易性金融资产	-26,921,454.79
——股票投资	-
——债券投资	-26,547,454.79
——资产支持证券投资	-374,000.00
——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	-628,454.45
合计	-26,293,000.34

#### 7.4.7.12 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年05月20日（基金合同生效日）至2022年12月31日
审计费用	48,575.59
信息披露费	61,918.17
汇划手续费	25,012.62
帐户维护费	27,900.00
合计	163,406.38

#### 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，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

##### 7.4.9.1 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

##### 7.4.9.2 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	本计划的管理人
中国建设银行股份有限公司	本计划的托管人
湖南财信典当有限责任公司	与本计划管理人受同一控制人控制

深圳惠和投资有限公司	本计划管理人的子公司
湖南财信数字科技有限公司	与本计划管理人受同一控制人控制
湖南省财信信托有限责任公司	与本计划管理人受同一控制人控制
湖南省财信信托有限责任公司—财信财盈FO F7号集合资金信托计划	与本计划管理人受同一控制人控制的关联方发行的SPV
财信期货有限公司	本计划管理人的子公司

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。

#### 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 2022年05月20日（基金合同生效日）至2022年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例
财信证券股份有限公司	1,113,431,505.98	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 2022年05月20日（基金合同生效日）至2022年12月31日	
	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	15,987,840,000.00	100.00%

**7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年05月20日（基金合同生效日）至2022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	占期末应付佣金总量的比例
财信证券股份有限公司	388,805.42	100.00%	234,066.68	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、经手费和由券商承担的证券结算风险计划后的净额列示。

**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 2022年05月20日（基金合同生效日）至2022年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	7,479,885.06
其中：支付销售机构的客户维护费	249,618.79

注：本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。

**7.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期
	2022年05月20日（基金合同生效日）至2022年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,495,977.01

注：本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。

#### 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
	2022年05月20日（基金合同生效日）至2022年12月31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	2,846,540.03
中国建设银行股份有限公司	18,676.95
合计	2,865,216.98

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次性支付。若遇法定节假日、休息日等，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

本基金本报告期末与关联方通过银行间同业市场进行债券（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 2022年05月20日（基金合同生效日）至2022年12月31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
报告期初持有的基金份额	0.00
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	390,000,000.00
报告期末持有的基金份额	100,000,000.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	13.76%

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。

**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**

份额单位：份

关联方名称	本期末 2022年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
深圳惠和投资有限公司	2,109,022.25	0.29%
湖南财信典当有限责任公司	2,987,452.70	0.41%

**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 2022年05月20日（基金合同生效日）至2022年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	613,331.88	42,703.68

#### 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出现承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联方交易事项。

#### 7.4.11 利润分配情况--固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期未进行利润分配。

#### 7.4.12 期末（2022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

本基金本报告期末持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

##### 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

本基金本报告期末进行银行间市场债券正回购。

###### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2022年12月31日止，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4,499,231.09元，于2023年1月3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。

#### 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

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。

#### 7.4.13.2 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。

##### 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 2022年12月31日
A-1	-
A-1以下	-
未评级	30,182,490.41
合计	30,182,490.41

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。

##### 7.4.13.2.2 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12月31日
AAA	363,569,375.21
AAA以下	232,120,784.03
未评级	50,872,482.19
合计	646,562,641.43

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

#### 7.4.13.2.3 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 2022年12月31日
AAA	2,338,690.30
AAA以下	27,822,882.19
未评级	-
合计	30,161,572.49

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。

#### 7.4.13.3 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。

##### 7.4.13.3.1 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。

#### 7.4.13.4 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。市场风险主要包括：

#### 7.4.13.4.1 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。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 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							
银行存款	612,715.22	-	-	-	-	616.66	613,331.88
结算备付金	22,297,010.94	-	-	-	-	511,037.07	22,808,048.01
存出保证金	27,899.09	-	-	-	-	13.75	27,912.84
交易性金融资产	11,994,000.00	20,000,000.00	96,715,000.00	460,536,988.60	107,829,000.00	9,831,715.73	706,906,704.33
应收清算款	-	-	-	-	-	2,388,931.56	2,388,931.56
应收申购款	-	-	-	-	-	634,000.00	634,000.00
资产总计	34,931,625.25	20,000,000.00	96,715,000.00	460,536,988.60	107,829,000.00	13,366,314.77	733,378,928.62
负债							
卖出回购金融资产款	4,499,955.00	-	-	-	-	-723.91	4,499,231.09
应付赎回款	-	-	-	-	-	2,829,707.93	2,829,707.93
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	406,644.87	406,644.87
应付托管费	-	-	-	-	-	81,328.98	81,328.98
应付销售服务费	-	-	-	-	-	1,339,607.88	1,339,607.88
应交税费	-	-	-	-	-	112,643.54	112,643.54
其他负债	-	-	-	-	-	413,931.08	413,931.08
负债总计	4,499,955.00	-	-	-	-	5,183,140.37	9,683,095.37
利率敏感度缺口	30,431,670.25	20,000,000.00	96,715,000.00	460,536,988.60	107,829,000.00	8,183,174.40	723,695,833.25

#### 7.4.13.4.1.2 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 2022年12月31日
	1. 市场利率下降25个基点	2,993,748.74
2. 市场利率上升25个基点	-2,993,748.74	

#### 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。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日	
	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	676,745,131.84	93.51
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	676,745,131.84	93.51

#### 7.4.13.4.3.2 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。

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 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。

##### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 7.4.14.2.1 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12月31日
第一层次	-
第二层次	706,906,704.33
第三层次	-
合计	706,906,704.33

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2022年12月31日。

###### 7.4.14.2.2 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。

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

无。

#### 7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

无。

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## §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	706,906,704.33	96.39
	其中：债券	676,745,131.84	92.28
	资产支持证券	30,161,572.49	4.11
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	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	23,421,379.89	3.19
8	其他各项资产	3,050,844.40	0.42
9	合计	733,378,928.62	100.00

## 8.2 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。

## 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

本基金本报告期内未投资股票。

### 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

本基金本报告期内未投资股票。

### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内未投资股票。

## 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	50,872,482.19	7.03
	其中：政策性金融债	50,872,482.19	7.03
4	企业债券	530,496,612.67	73.30
5	企业短期融资券	30,182,490.41	4.17
6	中期票据	65,193,546.57	9.01
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-



10	合计	676,745,131.84	93.51
----	----	----------------	-------

### 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	2080265	20衡阳高新01	500,000	50,597,109.59	6.99
2	200407	20农发07	400,000	40,699,660.27	5.62
3	152575	20郑发01	300,000	30,538,750.69	4.22
4	2080381	20桂阳城投债	300,000	30,521,589.04	4.22
5	2080342	20醴陵高新债	300,000	30,470,958.90	4.21

### 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

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	17,842,389.04	2.47
2	180644	尚水1优	100,000	9,980,493.15	1.38
3	183247	青租14A1	100,000	2,338,690.30	0.32

### 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 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。

### 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

本基金将按照法律法规要求，以套期保值为目的参与国债期货投资。

#### 8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未参与国债期货投资。

## 8.12 投资组合报告附注

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

8.12.2 本基金本报告期内未投资股票。

### 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	27,912.84
2	应收清算款	2,388,931.56
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	634,000.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,050,844.40

### 8.12.4 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处于转股期的可转换债券。

### 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。

### 8.12.6 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。

## §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
5,014	144,893.16	106,264,208.11	14.63%	620,230,116.13	85.37%

## 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	4,096,409.04	0.56%

## 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(2022年05月20日)基金份额总额	3,313,783,054.70
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	1,578,645,612.91
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	4,165,934,343.37
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	726,494,324.24

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。

## §11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 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，自2022年09月26日起，谭宏欣先生不再担任督察长，仍任公司首席风险官；新任督查长为公司合规总监李赛男女士。

### 11.3 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。

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。

### 11.4 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。

### 11.5 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，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。

### 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

#### 11.6.1 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。

### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内本基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚情况。

### 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	
财信证券	2	-	-	388,805.42	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
财信证券	1,113,431,505.98	100.00%	15,987,840,000.00	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	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	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报（提示性公告）	2022-05-20
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	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报（提示性公告）	2022-05-20
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	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报（提示性公告）	2022-05-20

4	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	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报（提示性公告）	2022-05-20
5	财信证券股份有限公司关于财信证券30天持有期债券型集合资产管理计划资产管理合同等法律文件生效的公告	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报	2022-05-20
6	财信证券股份有限公司财信证券30天持有期债券型集合资产管理计划开放申购、赎回业务公告	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报	2022-05-20
7	财信证券股份有限公司关于财信证券30天持有期债券型集合资产管理计划增加浙江同花顺基金销售有限公司为代销机构的公告	管理人网站	2022-05-23
8	财信证券30天持有期债券型集合资产管理计划关于基金经理张艳女士因休假暂停履行职务的公告	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报	2022-06-21
9	财信证券股份有限公司关于财信证券30天持有期债券型集合资产管理计划增加北京度小满基金销售有限公司为代销机构的公告	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报	2022-06-23
10	财信证券股份有限公司关于财信证券30天持有期债券型集合资产管理计划增加北京雪球基金销售有限公司为代销机构的公告	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报	2022-07-08
11	财信证券股份有限公司关于财信证券30天持有期债券型集合资产管理计划增加奕丰基金销售有限公司为代销机	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报	2022-07-18

	构的公告		
12	财信证券股份有限公司关于财信证券30天持有期债券型集合资产管理计划更新代销机构状态的公告	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报	2022-07-20
13	财信证券30天持有期债券型集合资产管理计划2022年第2季度报告	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报（提示性公告）	2022-07-21
14	财信证券股份有限公司高级管理人员变更公告	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报	2022-09-26
15	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	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报	2022-09-27
16	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）	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报	2022-09-28
17	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）	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报	2022-09-28
18	财信证券30天持有期债券型集合资产管理计划2022年第3季度报告	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报（提示性公告）	2022-10-26
19	财信证券股份有限公司关于财信证券30天持有期债券型集合资产管理计划增加东方财富证券股份有限公司为代销机构的公告	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报	2022-10-27

## §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

无

## §13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会《关于准予财富1号集合资产管理计划合同变更的回函》；
- (2) 《财信证券30天持有期债券型集合资产管理计划资产管理合同》；
- (3) 《财信证券30天持有期债券型集合资产管理计划招募说明书》；
- (4) 《财信证券30天持有期债券型集合资产管理计划托管协议》；
- (5) 《财信证券30天持有期债券型集合资产管理计划产品资料概要》；
- (6) 《财信证券30天持有期债券型集合资产管理计划基金产品资料概要（更新）》；
- (7) 《财信证券30天持有期债券型集合资产管理计划招募说明书（更新）》；
- (8) 管理人经营证券期货业务许可证、营业执照；
- (9) 报告期内披露的各项公告

### 13.2 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

### 13.3 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  
二〇二三年三月三十日