

财富证券财富 12 个月定期开放（002 期）集合资产管理计划 资产管理报告

（2023 年 1 月 1 日-2023 年 12 月 31 日）

第一节 重要提示

本报告由集合资产管理计划管理人编制。集合资产管理计划托管人中国工商银行股份有限公司深圳市分行于2024年3月28日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容。

管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用集合资产管理计划资产，但不保证集合资产管理计划一定盈利。

集合资产管理计划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集合资产管理计划说明书。

本报告相关财务资料已经审计。

本报告中的内容由管理人负责解释。

第二节 集合资产管理计划概况

| | |
|-----------|------------------------------|
| 名称： | 财富证券财富12个月定期开放（002期）集合资产管理计划 |
| 类型： | 固定收益类 |
| 成立日： | 2019年3月14日 |
| 报告期末份额总额： | 50,142,259.65 |
| 业绩报酬计提基准： | 2023年1月1日至2023年3月14日，业绩报酬 |

计提基准为5.25%/年；

2023年3月14日至2023年12月31日，业绩报

酬计提基准为5.00%/年。

管理人：财信证券股份有限公司

托管人：中国工商银行股份有限公司深圳市分行

投资账户信息：

沪市A股账户：D890170822

深市A股账户：0899190871

中债债券账户账号：00000033746

上清债券账户账号：B2196371

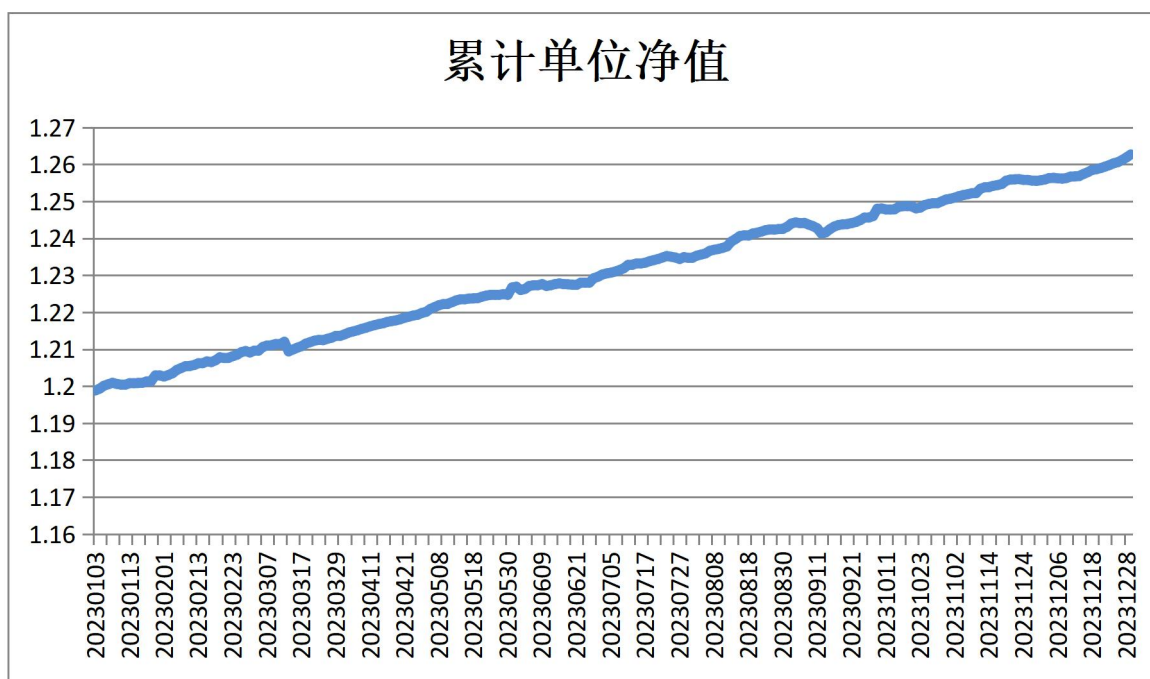
期货账户：/

第三节 资产管理计划投资表现

一、主要财务指标（单位：人民币元）

| | |
|-----------------------|---------------|
| 本期已实现收益 | 2,562,652.85 |
| 本期利润 | 4,003,578.62 |
| 每份额本期已实现收益 | 0.0511 |
| 期末资产净值 | 52,827,370.38 |
| 期末每份额净值 | 1.0535 |
| 期末每份额累计净值 | 1.2629 |
| 产品运作杠杆水平（期末资产总值/资产净值） | 104.89% |

二、 集合资产管理计划净值表现



第四节 管理人履职报告

一、 履职情况

报告期内，我司以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用资产管理计划资产，严格按照相关法律法规要求及资产管理合同的要求履行管理人职责，包括：依法办理资产管理计划的销售、登记、备案事宜；对所管理的不同资产管理计划的受托财产分别管理、分别记账，进行投资；按照资产管理合同的约定确定收益分配方案，及时向投资者分配收益；进行资产管理计划会计核算并编制资产管理计划财务会计报告；依法计算并披露资产管理计划净值，确定参与、退出价格；办理与受托财产管理业务活动有关的信息披露事项；保存受托财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；以管理人名义，代表投资者利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；法律、行政法规和中国证监会规定的其他职责。

二、投资业绩

截至 2023 年 12 月 31 日，本集合计划单位净值 1.0535 元，累计单位净值 1.2629 元，本期累计单位净值增长率 5.41%。

三、投资策略回顾与展望

2023 年债券市场整体呈现牛市行情。上半年在经济走弱、央行意外降息等政策推动下，10 年国债一度下探至 2.60% 位置。随后宽信用政策预期升温，利率触底反弹，后续在金融数据偏弱和央行二度降息的推动下，债市开启一波上涨。四季度经济增速企稳回升，政策组合拳继续发力，特殊再融资债以及特别国债等大量发行，债市小幅回调保持低位宽幅震荡。

城投债 2023 年在“资产荒”的主线下表现优异，收益率整体下行，信用利差压缩。随着四季度特殊再融资债和金融机构支持化债等一揽子政策逐步落地，城投信仰再度得到充值，短期流动性压力得到极大改善，城投债受到市场热烈追捧，一级发行利率大幅下行，二级信用利差大幅压缩。

展望今年，预计在财政政策扩张、货币政策配合之下，经济看点在于逆周期调节政策下基建投资的韧性，以及在政府支出增加以及通胀回升的提振下消费增速中枢有望小幅抬升。从经济内生动能修复的节奏上，随着海外经济需求进一步走弱，我国经济内生动能或将再次迎来曲折修复过程。预计今年债券市场将呈现宽幅震荡行情，大幅上行的风险有限，但在经济整体复苏的背景下，趋势性下行的可能性也较小。

2024 年投资将呈现攻守兼备的特点，其中，进攻主要采用流动性较好的信用债和中长久期利率债，防守则体现在信用债资产的配置上，主要聚焦中短久期相对票息较高一些的城投品种，同时谨慎信用

资质过度下沉，尤其需规避低等级主体的久期暴露，防范利差走阔带来的估值波动。

第五节 集合资产管理计划财务报告

一、集合资产管理计划资产负债表

编制单位：财信证券股份有限公司

2023年12月31日

单位：人民币元

| 资 产 | 附注 | 期末余额 | 期初余额 | 负债和所有者权益 | 附注 | 期末余额 | 期初余额 |
|----------|-------|---------------|----------------|-----------|-------|--------------|---------------|
| 资产： | | | | 负债： | | | |
| 货币资金 | 六、（一） | 162,014.81 | 781,198.18 | 短期借款 | | | |
| 结算备付金 | 六、（二） | | 98,714.45 | 交易性金融负债 | | | |
| 存出保证金 | 六、（三） | 1,771.14 | 372.46 | 衍生金融负债 | | | |
| 衍生金融资产 | | | | 卖出回购金融资产款 | 六、（五） | 2,473,518.90 | 30,661,186.96 |
| 交易性金融资产 | 六、（四） | 55,246,314.49 | 150,096,680.78 | 应付清算款 | 六、（六） | | 3,493.70 |
| 买入返售金融资产 | | | | 应付赎回款 | | | |

| | | | | | | | |
|---------|--|--|--|-------------|-------|---------------------|----------------------|
| 发放贷款和垫款 | | | | 应付管理人报酬 | 六、（七） | 65,971.04 | 18,097.95 |
| 债权投资 | | | | 应付托管费 | 六、（八） | 2,638.83 | 723.91 |
| 其他债权投资 | | | | 应付销售服务费 | | | |
| 应收清算款 | | | | 应付交易费用 | | | |
| 应收利息 | | | | 应付投资顾问费 | | | |
| 应收股利 | | | | 应交税费 | 六、（九） | 20,137.74 | 20,837.51 |
| 应收申购款 | | | | 应付利息 | | | |
| 其他资产 | | | | 应付利润 | | | |
| | | | | 其他负债 | 六、（十） | 20,463.55 | 21,274.63 |
| | | | | 负债合计 | | 2,582,730.06 | 30,725,614.66 |

| | | | | | | | |
|-------|--|---------------|----------------|-------------|--------|---------------|----------------|
| | | | | 所有者权益： | | | |
| | | | | 实收资金 | 六、（十一） | 50,142,259.65 | 117,542,337.50 |
| | | | | 其他综合收益 | | | |
| | | | | 未分配利润 | 六、（十二） | 2,685,110.73 | 2,709,013.71 |
| | | | | 所有者权益合计 | | 52,827,370.38 | 120,251,351.21 |
| 资产合计： | | 55,410,100.44 | 150,976,965.87 | 负债与持有人权益总计： | | 55,410,100.44 | 150,976,965.87 |

注：银行存款含托管户保管的银行存款余额。

二、集合资产管理计划经营业绩表

编制单位：财信证券股份有限公司

2023 年度

单位：人民币元

| 项目 | 附注 | 本期数 | 上期数 |
|--------------------------|--------|--------------|--------------|
| 一、收入 | | 4,731,614.27 | 7,112,435.49 |
| 1.利息收入 | 六、（十三） | 82,802.68 | 6,647.99 |
| 2.投资收益（损失以-填列） | 六、（十四） | 3,206,534.57 | 7,858,630.00 |
| 其中：以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益 | | | |
| 3.公允价值变动收益（损失以-填列） | 六、（十五） | 1,442,277.02 | -752,842.50 |
| 4.汇兑收益（损失以-号填列） | | | |
| 5.其他业务收入 | | | |
| 二、费用 | | 728,035.65 | 1,645,862.41 |
| 1.管理人报酬 | 六、（十六） | 327,988.78 | 612,254.79 |
| 2.托管费 | 六、（十七） | 13,119.49 | 24,490.06 |
| 3.销售服务费 | | | |
| 4.交易费用 | | | |
| 5.投资顾问费 | | | |
| 6.利息支出 | 六、（十八） | 325,383.21 | 914,328.00 |
| 其中：卖出回购金融资产利息支出 | 六、（十八） | 325,383.21 | 914,328.00 |
| 7.信用减值损失 | | | |
| 8.税金及附加 | 六、（二十） | 14,344.17 | 28,289.56 |
| 9.其他费用 | 六、（十九） | 47,200.00 | 66,500.00 |
| 三、利润总额 | | 4,003,578.62 | 5,466,573.08 |
| 减：所得税费用 | | | |
| 四、净利润 | | 4,003,578.62 | 5,466,573.08 |

| | | | |
|----------|--|--------------|--------------|
| 五、其他综合收益 | | | |
| 六、综合收益总额 | | 4,003,578.62 | 5,466,573.08 |

注：利息收入含托管户保管的银行存款当期产生的利息收入。

三、所有者权益变动表

| 项 目 | 本期数 | | | | 上期数 | | | |
|----------------------|----------------|------|--------------|----------------|----------------|------|---------------|----------------|
| | 实收资金 | 综合收益 | 未分配利润 | 所有者权益合计 | 实收资金 | 综合收益 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、上期期末余额 | 117,542,337.50 | | 2,709,013.71 | 120,251,351.21 | 123,618,353.25 | | 5,264,075.55 | 128,882,428.80 |
| 加：会计政策变更 | | | | | | | | |
| 前期差错更正 | | | | | | | | |
| 其他 | | | | | | | | |
| 二、本期期初余额 | 117,542,337.50 | | 2,709,013.71 | 120,251,351.21 | 123,618,353.25 | | 5,264,075.55 | 128,882,428.80 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | -67,400,077.85 | | -23,902.98 | -67,423,980.83 | -6,076,015.75 | | -2,555,061.84 | -8,631,077.59 |
| （一）综合收益总额 | | | 4,003,578.62 | 4,003,578.62 | | | 5,466,573.08 | 5,466,573.08 |
| （二）产品持有人申购和赎回 | -67,400,077.85 | | | -67,400,077.85 | -6,076,015.75 | | | -6,076,015.75 |
| 其中：1、产品申购 | 3,570,000.00 | | | 3,570,000.00 | 48,404,000.00 | | | 48,404,000.00 |
| 2、产品赎回 | -70,970,077.85 | | | -70,970,077.85 | -54,480,015.75 | | | -54,480,015.75 |

| | | | | | | | | |
|---------------------|---------------|--|---------------|---------------|----------------|--|---------------|----------------|
| （三）利润分配 | | | -4,027,481.60 | -4,027,481.60 | | | -8,021,634.92 | -8,021,634.92 |
| （四）其他综合收益结转 留存收益 | | | | | | | | |
| 四、本期期末余额 | 50,142,259.65 | | 2,685,110.73 | 52,827,370.38 | 117,542,337.50 | | 2,709,013.71 | 120,251,351.21 |

第六节 投资组合报告

一、 期末资产组合情况

| 项目名称 | 项目市值（元） | 占总资产比例（%） |
|--------------|---------------|-----------|
| 股 票 | 0.00 | 0.00 |
| 债 券 | 55,246,314.49 | 99.70 |
| 资产支持证券投资 | 0.00 | 0.00 |
| 基 金 | 0.00 | 0.00 |
| 其中：货币市场基金 | 0.00 | 0.00 |
| 买入返售金融资产 | 0.00 | 0.00 |
| 银行存款及结算备付金合计 | 162,014.81 | 0.29 |
| 其他资产 | 1,771.14 | 0.00 |
| 资产合计 | 55,410,100.44 | 100.00 |

备注：因四舍五入原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

二、 期末市值占集合计划资产净值前五名证券明细

股票
无

基金
无

债券

| 序号 | 交易市场 | 市场代码 | 证券名称 | 数量 | 证券市值 | 市值占净值(%) |
|----|------|--------|----------|------------|---------------|----------|
| 1 | 上交所 | 251476 | 23 绵控 03 | 100,000.00 | 10,505,956.16 | 19.89 |
| 2 | 上交所 | 152972 | 21 宁城 05 | 90,000.00 | 9,516,427.40 | 18.01 |
| 3 | 上交所 | 167144 | 20 上城 01 | 80,000.00 | 8,378,652.05 | 15.86 |
| 4 | 上交所 | 114270 | 22 鹰控 03 | 60,000.00 | 6,120,632.88 | 11.59 |
| 5 | 上交所 | 114863 | 23 黄交 01 | 50,000.00 | 5,193,287.67 | 9.83 |

资产支持证券

无

三、 资产管理计划投资组合风险提示

本资管产品投资于固定收益类资产，面临市场风险、信用风险、管理风险、流动性风险等。其中，市场风险又包括政策风险、经济周期风险、利率风险、汇率风险、上市公司经营风险、购买力风险、再投资风险等。本资管产品所投资债券发行人为企业的，存在出现违约、拒绝支付到期本息，或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下降的风险。在产品运作过程中，管理人的知识、经验、判断、决策、技能等，会影响对信息的获取和对经济形势、金融市场价格走势的判断，可能产生管理风险。产品所持有的债券可能因市场交易量不足，导致不能迅速、低成本地转变为现金，存在流动性风险。

本资产管理计划不存在投资期货的情况。

本资产管理计划不存在投资非标准化债权类资产的情况。

第七节 向关联方支付的相关费用

(一) 资产管理计划固定管理费

单位：人民币元

| 关联方名称 | 项目 | 本期 |
|------------|----------------------|-----------------------|
| | | 2023年1月1日至2023年12月31日 |
| 财信证券股份有限公司 | 当期发生的资产管理计划应支付的固定管理费 | 327,988.78 |

注：本集合计划的年管理费率为0.5%，每日管理费计算方法：

$$T = E \times 0.5\% \div 365;$$

T为每日管理费；

E为前一日的集合计划资产净值（成立日按当日总份额计提）。

本集合计划管理费自计划成立之日起，每日计提，逐日累计，按季支付。经管理人和托管人核对后，于每自然季末月的20日后5个工作日内由托管人根据管理人划款指令从本集合计划资产中支付，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。若集合计划现金形式资产不足以支付的，则顺延至下一个工作日支付，以此类推。

(二) 资产管理计划托管费

单位：人民币元

| 关联方名称 | 项目 | 本期 |
|-------------------|--------------------|-----------------------|
| | | 2023年1月1日至2023年12月31日 |
| 中国工商银行股份有限公司深圳市分行 | 当期发生的资产管理计划应支付的托管费 | 13,119.49 |

注：本集合计划的年托管费率为0.02%，每日托管费计算方法：

$$T = E \times 0.02\% \div 365;$$

T为每日托管费；

E为前一日的集合计划资产净值（成立日按当日总份额计提）。

本集合计划托管费自计划成立之日起，每日计提，逐日累计，按季支付。经管理人和托管人核对后，于每自然季末月的20日后5个工作日内由托管人根据管理人划款指令从本集合计划资产中支付，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。若集合计划现金形式资产不足以支付的，则顺延至下一个工作日支付，以此类推。

(三) 业绩报酬

单位：人民币元

| 关联方名称 | 项目 | 本期 |
|------------|-----------|-----------------------|
| | | 2023年1月1日至2023年12月31日 |
| 财信证券股份有限公司 | 当期计提的业绩报酬 | 0.00 |

注：在业绩报酬计提日，集合计划委托人所持每笔份额在每个运作周期内的年化收益率大于该运作周期的业绩报酬计提基准时，管理人计算应收取业绩报酬的每笔集合计划份额在每个运作周期的年化收益率（R），对超出业绩报酬计提基准的持有期差额收益按【60%】比例计提为业绩报酬。

每笔集合计划份额每个运作周期内持有期间的年化收益率 R 计算如下：

$$R = \frac{A - B}{B'} \times \frac{365}{T} \times 100\%$$

A 为该笔份额在本业绩报酬计提基准日的累计单位净值；

B 为该笔份额上一个业绩报酬计提基准日的累计单位净值（若上一个业绩报酬计提基准日不存在，推广期参与的为本集合计划成立日，存续期参与的为参与申请日）；

B' 为该笔份额上一个业绩报酬计提基准日的单位净值（若上一个业绩报酬计提基准日不存在，推广期参与的为本集合计划成立日，存续期参与的为参与申请日）；

T 表示该笔份额在每个运作周期的持有期天数；

本集合计划每个运作周期的业绩报酬计提基准会有所不同，第 i 个运作周期业绩报酬计提基准（ r_i ）会在该运作周期开始的开放日前在管理人网站公布。其中，第 1 个运作周期的业绩报酬计提基准（ r_1 ）会以推广期公告的形式在管理人网站公布。当 $R > r_i$ 时，管理人提取 R 大于 r_i 的剩余收益部分的 60% 作为业绩报酬；当 $R \leq r_i$ 时，管理人不提取业绩报酬。

$$H = M \times (R - r_i) \times \frac{T}{365} \times 60\%$$

其中：

H 为该笔份额在本次业绩报酬计提日应计提的业绩报酬

M=该笔份额数×该笔份额上一个业绩报酬计提基准日的单位净值（若上一个业绩报酬计提基准日不存在，推广期参与的为本集合计划成立日，存续期参与的为参与申请日）；

T 表示该笔份额在每个运作周期的持有期天数；

已计提的业绩报酬无回拨机制。业绩报酬的计算保留到小数点后 2 位，小数点后第 3 位四舍五入，由此带来的收益和损失归入集合计划资产。

若业绩报酬计提基准日为本集合计划的分红日，则由管理人按上述方法计算应计提的业绩报酬金额，然后在分红时从分红金额中扣除业绩报酬；当分红金额不足以扣除业绩报酬时，以分红金额为限进行扣除。

若业绩报酬计提基准日为本集合计划的退出日，则由管理人按上述方法计算应计提的业绩报酬金额，在委托人退出时扣除。

(四) 券商佣金

单位：人民币元

| 关联方名称 | 项目 | 本期 |
|------------|---------------------|-----------------------|
| | | 2023年1月1日至2023年12月31日 |
| 财信证券股份有限公司 | 当期发生的资产管理计划应支付的券商佣金 | 33,283.07 |

注：本集合计划通过管理人开立的资管专用交易单元进行沪深交易所场内交易。

第八节 收益分配情况

| 分配时间 | 单位分红 | 总分红金额 |
|------------|--------|--------------|
| 2023年3月14日 | 0.0342 | 4,027,481.60 |

备注：单位分红金额截位四位小数。

第九节 集合计划份额变动

单位：份

| | |
|----------|----------------|
| 期初份额总额 | 117,542,337.50 |
| 红利再投资份额 | 0.00 |
| 报告期间参与份额 | 3,570,000.00 |
| 报告期间退出份额 | 70,970,077.85 |
| 报告期末份额总额 | 50,142,259.65 |

第十节 投资经理变更、重大关联交易等涉及投资者权益

的重大事项

本资产管理计划在本报告期内未发生投资经理变更。

本资产管理计划在本报告期内未发生重大关联交易。

第十一节 风险准备金的提取、投资管理、使用、年末结余情况

本集合计划已按照相关规定要求计算风险资本准备。

第十二节 信息披露的查阅方式

网址：zg.stock.hnchasing.com

信息披露电话：0731－84403481（服务时间为工作日上午9:00-11:30，下午13:00-17:00）

投资者对本报告书如有任何疑问，可咨询管理人财信证券股份有限公司。

财信证券股份有限公司

2024年4月12日

托管人履职报告

(2023年01月01日-2023年12月31日)

本报告期内，本托管人在对财富证券财富12个月定期开放（002期）集合资产管理计划的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和资产管理合同的有关规定，不存在任何损害资产管理计划份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了托管人应尽的义务。

本报告期内，托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、资产管理合同和托管协议的规定，对本资产管理计划管理人的投资运作进行了必要的监督，对资产净值的计算、份额参与与退出价格计算、以及费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本计划管理人存在损害份额持有人利益的行为。

本报告期内，本托管人依法对财信证券股份有限公司编制和披露的财富证券财富12个月定期开放（002期）集合资产管理计划2023年年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

中国工商银行股份有限公司深圳市分行

资产托管和养老金运营中心

2024年03月28日