

财信 30 天持有期债券型证券投资基金

2026 年中期报告

2026 年 06 月 30 日

基金管理人:财信基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2026 年 08 月 29 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。

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2026年08月27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2026年1月1日起至2026年6月30日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
§ 2 基金简介	4
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
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 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	6
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
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	11
§ 5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
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	11
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	11
§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)	11
6.1 资产负债表	11
6.2 利润表	13
6.3 净资产变动表	14
6.4 报表附注	14
§ 7 投资组合报告	35
7.1 期末基金资产组合情况	35
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	35
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	35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	35
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	36
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	36
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	36
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	36
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	37
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	37
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	37
7.12 投资组合报告附注	37

§ 8 基金份额持有人信息	38
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	38
8.2 盈利投资者数量占比	38
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	38
8.4 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	39
§ 9 开放式基金份额变动	39
§ 10 重大事件揭示	39
10.1 基金份额持有人大会决议	39
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	39
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	40
10.4 基金投资策略的改变	40
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	40
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	40
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	40
10.8 其他重大事件	41
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	41
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	41
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	42
§ 12 备查文件目录	42
12.1 备查文件目录	42
12.2 存放地点	42
12.3 查阅方式	42

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	财信 30 天持有期债券型证券投资基金	
基金简称	财信 30 天持有债券	
基金主代码	026027	
基金运作方式	开放式	
基金合同生效日	2025 年 11 月 17 日	
基金管理人	财信基金管理有限公司	
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	384,337,231.55 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	财信 30 天持有债券 A	财信 30 天持有债券 C
下属分级基金的交易代码	026027	026028
报告期末下属分级基金的份 额总额	275,464,342.46 份	108,872,889.09 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过基金管理人积极主动的投资管理，力争为基金份额持有人实现长期稳定的投资收益。
投资策略	1、资产配置策略 通过对宏观经济、市场利率、债券供求、情景分析等因素的前瞻性分析和定量指标跟踪，捕捉不同经济周期及周期更迭中的投资机会，确定固定收益类资产、现金及货币市场工具等大类资产的配置比例。 2、固定收益类资产投资策略 本基金将在控制市场风险与流动性风险的前提下，根据对财政政策、货币政策的深入分析以及对宏观经济的持续跟踪，结合不同债券品种的到期收益率、流动性、市场规模等情况，灵活运用久期策略、期限结构配置策略、信用债策略、可转换债券策略等多种投资策略，实施积极主动的组合管理，并根据对债券收益率曲线形态、息差变化的预测，对债券组合进行动态调整。 3、回购策略 在有效控制风险情况下，通过合理质押组合中持仓的债券进行正回购，用融回资金做加杠杆操作，提高组合收益。为提高资金使用效率，在适当时点和相关规定的范围内进行逆回购，以增加组合收益率。 4、国债期货投资策略 本基金投资于国债期货的目的为套期保值。 本基金参与国债期货的主要目的是套期保值。基金管理人将

	根据不同的市场行情动态管理国债期货合约数量，力争在控制风险的前提下萃取收益。 5、资产支持证券投资策略 本基金资产支持证券的投资将采用自下而上的方法，结合信用管理和流动性管理，重点考察资产支持证券的资产池现金流变化、信用风险情况、市场流动性等，采用量化方法对资产支持证券的价值进行评估，精选违约或逾期风险可控、收益率较高的资产支持证券项目，在有效分散风险的前提下为投资人谋求较高的投资组合回报率。 6、证券公司短期公司债券投资策略 本基金将通过对证券行业分析、证券公司资产负债分析、公司现金流分析等调查研究，分析证券公司短期公司债券的违约风险及合理的利差水平，对证券公司短期公司债券进行独立、客观的价值评估。本基金投资证券公司短期公司债券，基金管理人将根据审慎原则，制定严格的投资决策流程、风险控制制度，并经董事会批准，防范信用风险、流动性风险等各种风险。
业绩比较基准	中债综合全价（总值）指数收益率*90%+一年期定期存款利率（税后）*10%
风险收益特征	本基金为债券型证券投资基金，其预期风险和预期收益水平低于股票型基金和混合型基金，高于货币市场基金。

注：本基金由财信证券 30 天持有期债券型集合资产管理计划变更而来。自 2026 年 7 月 18 日起本基金业绩比较基准调整为：中债-综合全价（总值）指数收益率*90%+一年期定期存款基准利率*10%，具体说明请参见管理人于 2026 年 6 月 18 日披露的相关公告。

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		财信基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杨敏	王小飞
	联系电话	0731-81610960	021-60637103
	电子邮箱	yangmin@chasingfunds.cn	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		400-036-6770	021-60637228
传真		400-036-6770	021-60635778
注册地址		湖南省长沙市岳麓区观沙岭街道滨江路 188 号滨江基金产业园 3 栋 201 和 3 栋 301	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		湖南省长沙市岳麓区观沙岭街道滨江路 188 号滨江基金产业园 3 栋 201 和 3 栋 301	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		410023	100033
法定代表人		龙海戔	张金良

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
登载基金中期报告的管理人互联网网址	https://mfund.hnchasing.com
基金中期报告置备地点	湖南省长沙市岳麓区观沙岭街道滨江路 188 号滨江基金产业园 3 栋 201 和 3 栋 301

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	财信基金管理有限公司	湖南省长沙市岳麓区观沙岭街道滨江路 188 号滨江基金产业园 3 栋 201 和 3 栋 301

§ 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（2026 年 01 月 01 日-2026 年 06 月 30 日）	
	财信 30 天持有债券 A	财信 30 天持有债券 C
本期已实现收益	1,477,992.83	1,788,488.68
本期利润	1,688,111.88	2,060,147.36
加权平均基金份额本期利润	0.0148	0.0190
本期加权平均净值利润率	1.46%	1.78%
本期基金份额净值增长率	1.96%	1.86%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2026 年 06 月 30 日）	
期末可供分配利润	4,643,092.39	8,162,133.60
期末可供分配基金份额利润	0.0169	0.0750
期末基金资产净值	281,131,966.70	117,035,022.69
期末基金份额净值	1.0206	1.0750
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2026 年 06 月 30 日）	
基金份额累计净值增长率	2.06%	1.93%

注：1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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，采用期末资产负债表中未分配利润期末余额和未分配利润中已实现部分期末余额的孰低数。表中的“期末”均指报告期最后一个自然日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

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

财信 30 天持有债券 A 净值表现

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
过去三个月	0.73%	0.07%	0.60%	0.03%	0.13%	0.04%
过去六个月	1.96%	0.06%	0.90%	0.03%	1.06%	0.03%
自基金合同生效起至今	2.06%	0.05%	0.52%	0.04%	1.54%	0.01%

财信 30 天持有债券 C 净值表现

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
过去三个月	0.68%	0.06%	0.60%	0.03%	0.08%	0.03%
过去六个月	1.86%	0.06%	0.90%	0.03%	0.96%	0.03%
自基金合同生效起至今	1.93%	0.05%	0.52%	0.04%	1.41%	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

财信30天持有债券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

(2025年11月17日-2026年06月30日)



财信30天持有债券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

(2025年11月17日-2026年06月30日)



§ 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

财信基金管理有限公司（简称“财信基金”）成立于 2024 年 11 月 26 日，注册资本 1.52 亿元，总部位于湖南省长沙市，由财信证券股份有限公司全资设立，实际控制人为湖南省人民政府。2025 年 8 月 26 日，财信基金取得中国证监会核发的《经营证券期货业务许可证》，正式获准展业，经营范围包括公开募集证券投资基金管理、私募资产管理。截至 2026 年 6 月 30 日，财信基金共管理 5 只开放式基金。

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		
彭朝阳	本基金的基金经理，财信美璟混合型证券投资基金、财信蓉泽债券型证券投资基金的基金经理，公司总经理助理、投资部总经理。	2025-11-17	-	13 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任中保康联人寿保险股份有限公司投资岗，国华人寿保险股份有限公司投资经理岗，东吴证券股份有限公司投资经理岗，财通基金管理有限公司固定收益部总监，弦高（苏

					州)资产管理有限公司副总经理兼投资总监,蜂巢基金管理有限公司研究员、基金经理等职务。2025 年 1 月加入财信基金管理有限公司,任总经理助理,兼任投资部总经理。
--	--	--	--	--	---

注: 1、对基金的首任基金经理,其“任职日期”为基金合同生效日,“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期,对非首任基金经理,“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期;

2、证券从业的含义遵从行业协会的相关规定。

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》等有关法律法规及基金合同、基金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和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内基金运作合法合规,无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 公平交易制度的执行情况

公司建立科学、制衡的投资决策体系,加强交易分配环节的内部控制,通过持续完善工作制度、流程和提高技术手段保证公平交易原则的实现。同时,公司还通过事后分析、监察稽核和信息披露等手段加强对公平交易过程和结果的监督。在投资决策的内部控制方面,公司建立了严格的投资备选库制度及投资授权制度,投资组合的投资标的必须来源于公司备选库,投资组合经理在授权范围内可以自主决策,超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易过程中,按照公平交易原则,公平分配投资指令。公司对投资交易实施全程动态监控,通过投资交易系统对投资交易过程进行实时监控及预警,实现投资风险的事中风险控制;通过对投资、研究及交易等全流程的独立监察稽核,实现投资风险的事后控制。

本报告期内,公司公平交易制度总体执行情况良好,不同的投资组合受到了公平对待,未发生任何不公平的交易事项。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,未发生基金管理人管理的所有投资组合参与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。

本报告期内,未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 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

2026 年上半年,债市整体呈震荡下行格局。1-2 月受“春季复苏”预期升温及政府债集中发行

影响，长债承压，在“资产荒”延续的大背景下，银行主动增持了短端利率债；3 月中东地缘冲突引发避险情绪，推动收益率短暂下行，但随着油价飙升引发输入性通胀担忧，长端国债收益率转而向上；4-5 月，社融信贷走弱，资金面充裕，带动债券走出了一波较为顺畅的下行行情；6 月债券市场由前期顺畅下行转向低位震荡，受政府债供给放量、理财赎回扰动及交易盘止盈影响，呈现“长端弱、短端抗跌”的分化格局。

操作层面，本基金延续既定的投资策略，在收益率低位阶段控制组合久期、平滑净值波动，结合资金面及供给扰动适当降低利率债交易仓位，在收益率回调后择机进行配置。信用债方面，继续以短久期高等级信用债和大行次级债作为底仓，在控制回撤的基础上追求票息收益和阶段性交易机会。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末财信 30 天持有债券 A 基金份额净值为 1.0206 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 1.96%，同期业绩比较基准收益率为 0.90%；截至报告期末财信 30 天持有债券 C 基金份额净值为 1.0750 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 1.86%，同期业绩比较基准收益率为 0.90%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2026 年上半年，宏观层面呈现“总量稳、结构分、价格修复”的特征。这一运行格局基本落在年初“前低后高、逐步攀升”的预判框架内，但二季度回落幅度略超预期，这意味着下半年稳增长的压力有所加大，也意味着政策需要在下半年更多发力，以确保实现全年 5% 左右的增长目标。我们认为三季度专项债发行将明显提速，8—9 月或迎来供给高峰，全年 3.9 万亿元新增专项债额度有望在 10 月底前基本发行完毕；若四季度经济仍面临压力，不排除启用“准财政”工具（如政策性开发性金融工具等）形成增量对冲的可能，特别国债方面亦存在追加发行额度的空间。若经济数据持续偏弱，货币政策有望进一步宽松，降准降息等工具仍存在运用空间；当前实际利率仍偏高，降息有助于降低实体融资成本、提振信贷需求。

下半年利率整体看震荡向下，交易结构层面，考虑到基金久期已处高位、分歧度处于低位，整体结构相对脆弱，短期十年国债缺乏有效向下突破的动能，叠加三季度基本面以及债券供给扰动增多，可以逢调介入心态参与。四季度若经济再度走弱、政策加码降息，长端利率有望下行，可在收益率上行时逐步拉长久期，博弈资本利得。

4.6 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。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。主管运营的高管任主席，估值委员会成员包含投资、研究、会计和风控等岗位专业人员，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，并具有较为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的估值相关数据。

本基金本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.7 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进行利润分配。

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

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

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《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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，本基金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。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、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。

§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：财信 30 天持有期债券型证券投资基金

报告截止日：2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	16,063,677.71	967,296.14
结算备付金		2,583,510.91	772,998.38
存出保证金		1,274,000.00	8,658.11
交易性金融资产	6.4.7.2	377,907,478.90	152,027,675.87
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		377,907,478.90	152,027,675.87
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	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		631,798.26	11.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		398,460,465.78	153,776,639.50
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 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		-	18,001,164.59
应付清算款		-	-
应付赎回款		65,159.21	155,583.29
应付管理人报酬		93,720.72	43,241.05
应付托管费		15,620.13	4,957.55
应付销售服务费		18,422.77	19,406.13
应付投资顾问费		-	-
应交税费		4,361.78	361.32
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	96,191.78	147,800.75
负债合计		293,476.39	18,372,514.68
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	384,337,231.55	129,594,585.89

未分配利润	6.4.7.11	13,829,757.84	5,809,538.93
净资产合计		398,166,989.39	135,404,124.82
负债和净资产总计		398,460,465.78	153,776,639.50

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 384,337,231.55 份。其中财信 30 天持有债券 A 基金份额净值 1.0206 元，基金份额总额 275,464,342.46 份；财信 30 天持有债券 C 基金份额净值 1.0750 元，基金份额总额 108,872,889.09 份。

6.2 利润表

会计主体：财信 30 天持有期债券型证券投资基金
本报告期：2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
一、营业总收入		4,650,250.75
1. 利息收入		24,440.81
其中：存款利息收入	6.4.7.12	24,440.81
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		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		4,144,032.21
其中：股票投资收益		-
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	4,338,341.43
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.14	-194,309.22
股利收益		-
其他投资收益		-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	481,777.73
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）		-
减：二、营业总支出		901,991.51
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	338,873.17
2. 托管费	6.4.10.2.2	56,478.98
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	114,572.33
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		297,223.62
其中：卖出回购金融资产支出		297,223.62
6. 信用减值损失		-

7. 税金及附加		3,868.97
8. 其他费用	6.4.7.16	90,974.44
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		3,748,259.24
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		3,748,259.24
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		3,748,259.24

6.3 净资产变动表

会计主体：财信 30 天持有期债券型证券投资基金
本报告期：2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	129,594,585.89	5,809,538.93	135,404,124.82
二、本期期初净资产	129,594,585.89	5,809,538.93	135,404,124.82
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	254,742,645.66	8,020,218.91	262,762,864.57
（一）、综合收益总额	-	3,748,259.24	3,748,259.24
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	254,742,645.66	4,271,959.67	259,014,605.33
其中：1. 基金申购款	346,827,123.05	8,336,146.67	355,163,269.72
2. 基金赎回款	-92,084,477.39	-4,064,187.00	-96,148,664.39
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	384,337,231.55	13,829,757.84	398,166,989.39

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：

荀航	何美劲	何美劲
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

财信 30 天持有期债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）变更自财信证券 30 天持有期债券型集合资产管理计划。财信证券 30 天持有期债券型集合资产管理计划为参照公开募集证券投资基金运作的参公大集合，变更自原大集合“财富 1 号集合资产管理计划”。财富 1 号集合资产管理计

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》、《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》等相关法律、行政法规及中国证监会的规定，财信证券 30 天持有期债券型集合资产管理计划变更管理人为财信基金管理有限公司，财信证券 30 天持有期债券型集合资产管理计划变更为财信 30 天持有期债券型证券投资基金。根据《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》的约定，前述变更事宜，无需召开集合计划份额持有人大会。上述变更已经中国证监会 2025 年 11 月 5 日证监许可[2025]2455 号文准予变更注册。本基金托管人为中国建设银行股份有限公司，登记机构为财信基金管理有限公司。

自 2025 年 11 月 17 日起，《财信 30 天持有期债券型证券投资基金基金合同》生效，《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》同时失效。

本基金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）。本基金不直接投资股票，因投资可转换债券、可交换债券转股所获得的股票，本基金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，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：本基金投资于债券资产比例不低于基金资产的 80%；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，本基金保持不低于基金资产净值 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，基金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：中债综合全价（总值）指数收益率*90%+一年期定期存款利率（税后）*10%。自 2026 年 7 月 18 日起本基金业绩比较基准调整为：中债-综合全价（总值）指数收益率*90%+一年期定期存款基准利率*10%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》（以下合称“企业会计准则”）的要求，同时亦按照中国证券投资基金业协会（以下简称“基金业协会”）颁布的《公开募集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》、《证券投资基金会计核算业务指引》及中国证监会、基金业协会发布的其他有关基金行业实务操作的规定编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 6.4.2 中所列示的中国证监会和基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2026 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策，会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币，编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(a) 金融资产的分类

本基金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。

本基金通常根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征，在初始确认时将金融资产分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以摊余成本计量的金融资产。

除非本基金改变管理金融资产的业务模式，在此情形下，所有受影响的相关金融资产在业务模式发生变更后的首个报告期间的第一天进行重分类，否则金融资产在初始确认后不得进行重分类。

本基金将同时符合下列条件且未被指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，分类为以摊余成本计量的金融资产：

— 本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标；

— 该金融资产的合同条款规定，在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。

除上述以摊余成本计量的金融资产外，本基金将其余所有的金融资产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。本基金现无分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

管理金融资产的业务模式，是指本基金如何管理金融资产以产生现金流量。业务模式决定本基

金所管理金融资产现金流量的来源是收取合同现金流量、出售金融资产还是两者兼有。本基金以客观事实为依据、以关键管理人员决定的对金融资产进行管理的特定业务目标为基础，确定管理金融资产的业务模式。

本基金对金融资产的合同现金流量特征进行评估，以确定相关金融资产在特定日期产生的合同现金流量是否仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。其中，本金是指金融资产在初始确认时的公允价值；利息包括对货币时间价值、与特定时期未偿付本金金额相关的信用风险、以及其他基本借贷风险、成本和利润的对价。此外，本基金对可能导致金融资产合同现金流量的时间分布或金额发生变更的合同条款进行评估，以确定其是否满足上述合同现金流量特征的要求。

(b) 金融负债的分类

本基金将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及以摊余成本计量的金融负债。

-以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

该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。

-以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

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。

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

(a) 金融工具的初始确认

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。

(b) 后续计量

-以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产以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。

-以摊余成本计量的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产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。

-以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债以公允价值进行后续计量，除与套期会计有关外，产生的利得或损失（包括利息费用）计入当期损益。

-以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

(c) 金融工具的终止确认

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；
- 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；
- 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：

- 所转移金融资产在终止确认日的账面价值；
- 因转移金融资产而收到的对价。

金融负债（或其一部分）的现时义务已经解除的，本基金终止确认该金融负债（或该部分金融负债）。

(d) 金融工具的减值

本基金以预期信用损失为基础，对下列项目进行减值会计处理并确认损失准备：

- 以摊余成本计量的金融资产

本基金持有的其他以公允价值计量的金融资产不适用预期信用损失模型。

预期信用损失的计量

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，是指本基金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。

在计量预期信用损失时，本基金需考虑的最长期限为面临信用风险的最长合同期限（包括考虑续约选择权）。

整个存续期预期信用损失，是指因金融工具整个预计存续期内所有可能发生的违约事件而导致的预期信用损失。

未来 12 个月内预期信用损失，是指因资产负债表日后 12 个月内（若金融工具的预计存续期少于 12 个月，则为预计存续期）可能发生的金融工具违约事件而导致的预期信用损失，是整个存续期预期信用损失的一部分。

本基金对满足下列情形的金融工具按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备，对其他金融工具按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备：

- 该金融工具在资产负债表日只具有较低的信用风险；或
- 该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加。

预期信用损失准备的列报

为反映金融工具的信用风险自初始确认后的变化，本基金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，应当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。

核销

如果本基金不再合理预期金融资产合同现金流量能够全部或部分收回，则直接减记该金融资产的账面余额。这种减记构成相关金融资产的终止确认。这种情况通常发生在本基金确定债务人没有

资产或收入来源可产生足够的现金流量以偿还将被减记的金额。但是，被减记的金融资产仍可能受到本基金催收到期款项相关执行活动的影响。

已减记的金融资产以后又收回的，作为减值损失的转回计入收回当期的损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，根据企业会计准则的规定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。

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，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，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，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，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，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

对不存在活跃市场的金融工具，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公允价值。采用估值技术确定公允价值时，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。

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，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，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

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- 本基金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；
- 本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

6.4.4.7 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。

6.4.4.8 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净资产比例计算的金额。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净资产比例计算的金额。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。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

利息收入

存款利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认为利息收入。

证券出借业务利息收入按出借起始日证券账面价值及出借费率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额，在证券实际出借期间内逐日计提。因借入人未能按期归还产生的罚息，实际发生时扣除适用情况下的相关税费后的净额计入证券出借业务利息收入。

投资收益

股票投资收益、债券投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其初始计量金额的差额确认，处置时产生的交易费用计入投资收益。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资，在其持有期间，按票面金额和票面利率计算的利息计入投资收益。

公允价值变动收益

公允价值变动收益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、衍生工具、以公允价值计量且其变动计入当期损益的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。不包括本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资在持有期间按票面利率计算的利息。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务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。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

在符合有关基金分红条件的前提下，本基金可进行收益分配。每次收益分配比例等具体分红方案见基金管理人届时发布的相关分红公告。本基金收益分配方式为现金分红。

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。

本基金各基金份额类别在费用收取上不同，其对应的可分配收益可能有所不同。同一类别的每一基金份额享有同等分配权。

法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

6.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

编制财务报表时，本基金需要运用估计和假设，这些估计和假设会对会计政策的应用及资产、负债、收入和支出的金额产生影响。实际情况可能与这些估计不同。本基金对估计涉及的关键假设和不确定因素的判断进行持续评估，会计估计变更的影响在变更当期和未来期间予以确认。

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，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《关于固定收益品种的估值处理标准》在银行间债券市场、上海证券交易所、深圳证券交易所、北京证券交易所及中国证监会认可的其他交易场所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），采用第三方估值基准服务机构提供的价格数据进行估值。

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

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 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。

6.4.5.3 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。

6.4.6 税项

根据财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《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》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、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》、财税[2017]2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《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[2025]4号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(a) 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，以管理人为增值税纳税人，暂

适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。

证券投资基金管理人运用基金买卖债券取得的金融商品转让收入免征增值税；对金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税，对该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(b)对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(c)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20%的个人所得税。

(d)对基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日
活期存款	15,953,776.74
等于：本金	15,952,020.64
加：应计利息	1,756.10
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	109,900.97
等于：本金	109,899.62
加：应计利息	1.35
减：坏账准备	-
合计	16,063,677.71

注：其他存款为券商资金账户本金及应计利息。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 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	7,372,841.25	19,696.16	7,441,156.16	48,618.75
	银行间市场	366,532,291.43	3,501,322.74	370,466,322.74	432,708.57
	合计	373,905,132.68	3,521,018.90	377,907,478.90	481,327.32
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		373,905,132.68	3,521,018.90	377,907,478.90	481,327.32

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

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	36,380,000.00	-	-	-
--国债期货	36,380,000.00	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	36,380,000.00	-	-	-

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
TL2609	30 年期国债期货 2609 合约	32	36,400,000.00	20,000.00
合计				20,000.00
减：可抵销期货暂收款				20,000.00
净额				0.00

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
无。

6.4.7.5 债权投资

无。

6.4.7.6 其他债权投资

无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

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 2026 年 06 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	25,279.60
其中：交易所市场	-
银行间市场	25,279.60
应付利息	-
预提费用	70,912.18
合计	96,191.78

6.4.7.10 实收基金

财信 30 天持有债券 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	25,270,538.19	25,270,538.19
本期申购	292,984,777.75	292,984,777.75
本期赎回（以“-”号填列）	-42,790,973.48	-42,790,973.48
本期末	275,464,342.46	275,464,342.46

财信 30 天持有债券 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额

上年度末	104,324,047.70	104,324,047.70
本期申购	53,842,345.30	53,842,345.30
本期赎回（以“-”号填列）	-49,293,503.91	-49,293,503.91
本期末	108,872,889.09	108,872,889.09

注：若本基金有分红及转换业务，申购含红利再投、转换入；赎回含转换出。

6.4.7.11 未分配利润

财信 30 天持有债券 A

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
本期期初	-2,068.46	28,548.99	26,480.53
本期利润	1,477,992.83	210,119.05	1,688,111.88
本期基金份额交易产生的变动数	3,167,168.02	785,863.81	3,953,031.83
其中：基金申购款	3,693,183.39	946,284.75	4,639,468.14
基金赎回款	-526,015.37	-160,420.94	-686,436.31
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,643,092.39	1,024,531.85	5,667,624.24

财信 30 天持有债券 C

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
本期期初	6,883,331.58	-1,100,273.18	5,783,058.40
本期利润	1,788,488.68	271,658.68	2,060,147.36
本期基金份额交易产生的变动数	339,627.74	-20,699.90	318,927.84
其中：基金申购款	4,143,257.97	-446,579.44	3,696,678.53
基金赎回款	-3,803,630.23	425,879.54	-3,377,750.69
本期已分配利润	-	-	-
本期末	9,011,448.00	-849,314.40	8,162,133.60

6.4.7.12 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
活期存款利息收入	6,956.76
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	10.60
结算备付金利息收入	10,257.52
其他	7,215.93
合计	24,440.81

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
债券投资收益——利息收入	2,953,408.94
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	1,384,932.49
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	4,338,341.43

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,077,368,466.79
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,067,985,879.78
减：应计利息总额	7,975,679.52
减：交易费用	21,975.00
买卖债券差价收入	1,384,932.49

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
国债期货投资收益	-169,000.00
减：其他衍生工具收益应缴纳增值税	21,646.61
减：交易费用	3,662.61
合计	-194,309.22

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
1. 交易性金融资产	461,777.73
——股票投资	-
——债券投资	461,777.73
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-

2. 衍生工具	20,000.00
——权证投资	—
——期货投资	20,000.00
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	481,777.73

6.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
审计费用	11,404.81
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	—
银行汇划费	10,762.26
账户维护费	9,300.00
合计	90,974.44

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，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

关联方名称	与本基金的关系
财信基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司	基金托管人
财信证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金销售机构、基金证券经纪商

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。

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

无。

6.4.10.1.4 债券回购交易

无。

6.4.10.1.5 基金交易

无。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行交易。

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
	2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	338,873.17
其中：应支付销售机构的客户维护费	89,527.33
应支付基金管理人的净管理费	249,345.84

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.30%年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。
管理费的计算方法如下：

$$H=E\times 0.30\%\div 365$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	56,478.98

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.05%年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。
托管费的计算方法如下：

$$H=E\times 0.05\%\div 365$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	财信 30 天持有债券 A	财信 30 天持有债券 C	合计
财信证券股份有限公司	-	47,410.98	47,410.98
财信基金管理有限公司	-	6,224.40	6,224.40
合计	-	53,635.38	53,635.38

注：支付基金销售机构的基金销售服务费按前一日 C 类基金份额对应的基金资产净值 0.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付给基金管理人，再由基金管理人计算并支付给各基金销售机构。C 类基金份额的销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div 365$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

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

无。

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 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	15,953,776.74	6,956.76
财信证券股份有限公司	109,899.62	10.60

注：1、本基金的银行存款由托管人中国建设银行股份有限公司保管。

2、本基金证券资金账户的存款为本基金存放于证券经纪商财信证券股份有限公司的证券交易结算资金。

3、上述账户按银行同业利率或约定利率计息。

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

无。

6.4.12 期末（2026 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

本基金本报告期末无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无因从事证券交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

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

本基金管理人秉承“坚持开始就要做对”的风险管理理念，在强化全面风险管理的同时，平衡业务发展规模、速度与质量，坚持风险收益相匹配。公司建立由董事会及其下设的风险控制委员会、经营管理层及其下设的风险管理委员会、督察长、风险管理部门及各个业务部门、岗位组成的风险管理组织架构，对风险实行多层次、全方位的管理。从投资决策的层次看，公司实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制，基金投资决策委员会、投资分管领导、基金经理在各自授权范围内对投资行为实施分级管理，并承担相应的风险控制职责；从岗位分工看，研究、投资、交易、风控合规及会计核算等部门从不同环节、不同角度协同参与基金投资运作的风险管控。总体上，公司已建立起贯穿基金运作全流程的风险识别、评估、监测、应对及报告机制，形成健全、闭环的风险管理体系，全力保障基金份额持有人的合法权益。

本基金为债券型基金，预期收益和预期风险理论上高于货币市场基金，低于股票型基金和混合型基金。本基金在日常投资运作中，主要面临信用风险、流动性风险及市场风险，本基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将上述风险控制在限定范围内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指因证券发行人出现拒绝支付本金或利息而违约，或由于债券发行人信用评级下降而导致债券价格下跌，或由于交易对手违约之情形，从而造成资产组合资产受到损失的风险。本基金管理人建立了黑名单标准及内部信用评级体系，对不同信用等级的债券进行内部信用评级并实施

分級管控，同时通过债券库管理及分散化投资方式防范信用风险。针对交易对手，本基金管理人建立了交易对手信用评级体系，对不同等级的交易对手实施分級管控，确保交易对手的信用可靠，同时建立逆回购质押券管控机制，根据质押券信用等级实施分級管控。本基金管理人建立了完善的投后跟踪及风险预警机制，对重大投资定期跟踪评估。

6.4.13.2.1 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 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
AAA	155,416,730.97	72,845,949.58
AAA 以下	-	-
未评级	222,490,747.93	79,181,726.29
合计	377,907,478.90	152,027,675.87

- 注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。
2. 未评级债券为国债、政策性金融债及未有第三方机构评级的企业发行的债券。
3. 债券投资以全价列示。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指资产组合因市场交易量不足、导致不能以合理价格及时进行证券买卖而造成组合损失的风险，或者资产组合无法及时足额支付合同约定的现金支付安排所引起的违约风险。本基金采用分散投资、控制流动性受限资产比例、现金比例等方式防范流动性风险。本基金管理人建立了完善的压力测试、大额申购、巨额赎回机制以及头寸管理等，有效保障基金份额持有人利益。

于 2026 年 06 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（净资产）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理。独立风险管理部门持续监控持仓集中度、流动性受限资产比例及组合短期变现能力等指标。

在日常流动性管理上，本基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保当日净赎回申请不超过该价值。对于逆回购交易，通过合理分散到期日与交易对手集中度、进行穿透式尽职调查及严格的准入管理、动态调整交易额度等措施，有效控制回购交易的流动性风险和交易对手风险。同时，建立逆回购交易质押品管理制度，可接受质押品的券种和资质要求与基金合同约定保持一致，规定依据质押品资质确定质押率，并持续监测质押品风险状况，确保足额质押。在投资集中度方面，本基金持有单一公司证券市值不超过基金资产净值的 10%，且与本基金管理人旗下其他基金合计持有同一公司证券不超过该证券的 10%；与本基金管理人其他开放式基金共同持有单一上市公司可流通股股票不超过其 15%，全部投资组合合计不超过其 30%。

本基金投资具有良好流动性的金融工具，所持证券主要于证券交易所或银行间同业市场交易，亦可通过卖出回购融入短期资金，回购上限一般不超过债券投资的公允价值；除本报告期末本基金持有的流动性受限资产章节所列示券种流通暂时受限制不能自由转让外，其余均能及时变现。评估结果显示组合高流动性资产比重较高，组合变现比例能力较好。

6.4.13.4 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、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率变动引起组合中资产特别是债券投资的市场价格变动，从而影响基金投资收益的风险。

本基金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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 06 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	16,063,677.71	-	-	-	16,063,677.71
结算备付金	2,583,510.91	-	-	-	2,583,510.91
存出保证金	1,274,000.00	-	-	-	1,274,000.00
交易性金融资产	71,532,873.42	306,374,605.48	-	-	377,907,478.90
应收申购款	-	-	-	631,798.26	631,798.26
资产总计	91,454,062.04	306,374,605.48	-	631,798.26	398,460,465.78
负债					
应付赎回款	-	-	-	65,159.21	65,159.21
应付管理人报酬	-	-	-	93,720.72	93,720.72
应付托管费	-	-	-	15,620.13	15,620.13
应付销售服务费	-	-	-	18,422.77	18,422.77
应交税费	-	-	-	4,361.78	4,361.78
其他负债	-	-	-	96,191.78	96,191.78
负债总计	-	-	-	293,476.39	293,476.39
利率敏感度缺口	91,454,062.04	306,374,605.48	-	338,321.87	398,166,989.39
上年度末	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

2025 年 12 月 31 日					
资产					
货币资金	967,296.14	-	-	-	967,296.14
结算备付金	772,998.38	-	-	-	772,998.38
存出保证金	8,658.11	-	-	-	8,658.11
交易性金融资产	30,751,986.85	121,275,689.02	-	-	152,027,675.87
应收申购款	-	-	-	11.00	11.00
资产总计	32,500,939.48	121,275,689.02	-	11.00	153,776,639.50
负债					
卖出回购金融资产款	18,001,164.59	-	-	-	18,001,164.59
应付赎回款	-	-	-	155,583.29	155,583.29
应付管理人报酬	-	-	-	43,241.05	43,241.05
应付托管费	-	-	-	4,957.55	4,957.55
应付销售服务费	-	-	-	19,406.13	19,406.13
应交税费	-	-	-	361.32	361.32
其他负债	-	-	-	147,800.75	147,800.75
负债总计	18,001,164.59	-	-	371,350.09	18,372,514.68
利率敏感度缺口	14,499,774.89	121,275,689.02	-	-371,339.09	135,404,124.82

注：本表所示为本基金资产及负债的公允价值，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	若市场利率平行上升或下降 50 个基点		
	其他市场变量保持不变		
	仅存在公允价值变动对基金资产净值的影响		
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 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
	市场利率平行上升 50 个基点	-5,650,561.81	-1,578,185.28
	市场利率平行下降 50 个基点	5,650,561.81	1,578,185.28

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。

于 2026 年 06 月 30 日，本基金未持有交易性权益类资产，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金净资产无重大影响。

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。

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

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	-	-
第二层次	377,907,478.90	152,027,675.87
第三层次	-	-
合计	377,907,478.90	152,027,675.87

6.4.14.2.2 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。本基金本报告期持有的持续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。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括银行存款、买入返售金融资产、其他各类应收款项、卖出回购金融资产款和其他各类应付款项，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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	377,907,478.90	94.84
	其中：债券	377,907,478.90	94.84
	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	-	-
	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	18,647,188.62	4.68
8	其他各项资产	1,905,798.26	0.48
9	合计	398,460,465.78	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境内投资股票。

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港股通投资股票。

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初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期内未进行股票投资。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期内未进行股票投资。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内未进行股票投资。

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	7,441,156.16	1.87
2	央行票据	-	-
3	金融债券	360,300,747.40	90.49
	其中：政策性金融债	204,884,016.43	51.46
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	10,165,575.34	2.55
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	377,907,478.90	94.91

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	240203	24 国开 03	500,000	51,551,438.36	12.95
2	250208	25 国开 08	500,000	50,122,972.60	12.59
3	230403	23 农发 03	300,000	31,018,109.59	7.79
4	250218	25 国开 18	300,000	30,706,750.68	7.71
5	200205	20 国开 05	200,000	21,320,087.67	5.35

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

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括股指期货。

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

本基金参与国债期货的主要目的是套期保值。基金管理人将根据不同的市场行情动态管理国债期货合约数量，力争在控制风险的前提下萃取收益。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本报告期内，本基金投资国债期货对组合整体风险影响较小，符合既定的投资政策和目标。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到监管部门立案调查或报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形说明

国家开发银行在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行、国家外汇管理局处罚。

中国农业发展银行在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局处罚。

中国光大银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局、国家外汇管理局处罚。

中国银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局处罚。

中国农业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局处罚。

本基金基金经理依据基金合同及公司投资管理制度，在投资授权范围内，经正常投资决策程序对上述主体所发行证券进行了投资，投资决策程序符合公司投资制度的规定。

7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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	1,274,000.00
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	631,798.26
6	其他应收款	-

7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	1,905,798.26

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处于转股期的可转换债券。

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
财信 30 天持有 债券 A	139	1,981,757.86	259,511,498.77	94.21%	15,952,843.69	5.79%
财信 30 天持有 债券 C	1,244	87,518.40	14,668,645.74	13.47%	94,204,243.35	86.53%
合计	1,371	280,333.50	274,180,144.51	71.34%	110,157,087.04	28.66%

注：持有人户数按基金账号进行去重统计。

8.2 盈利投资者数量占比

本基金为债券型基金，免于披露本项数据。

8.3 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	财信 30 天持有债券 A	296,418.98	0.1076%
	财信 30 天持有债券 C	65,410.24	0.0601%

	合计	361,829.22	0.0941%
--	----	------------	---------

8.4 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	财信 30 天持有债券 A	0~10
	财信 30 天持有债券 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	财信 30 天持有债券 A	0~10
	财信 30 天持有债券 C	0
	合计	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	财信 30 天持有债券 A	财信 30 天持有债券 C
基金合同生效日（2025 年 11 月 17 日）基金份额总额	-	111,228,502.69
本报告期期初基金份额总额	25,270,538.19	104,324,047.70
本报告期基金总申购份额	292,984,777.75	53,842,345.30
减：本报告期基金总赎回份额	42,790,973.48	49,293,503.91
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	275,464,342.46	108,872,889.09

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

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，基金管理人于 2026 年 2 月 13 日聘任杨敏女士担任公司督察长职务，王彬彬女士不再担任公司督察长。

基金托管人中国建设银行股份有限公司研究决定，聘任陈颖钰为中国建设银行资产托管业务部总经理。

陈颖钰女士曾先后在中国建设银行财务会计、重组改制、资产负债、同业业务、金融科技等领域工作，并在中国建设银行总行同业业务中心、财务会计部、资产托管业务部以及山东省分行、建

信金融科技有限责任公司等机构担任领导职务，具有丰富的财会、科技和资金资产管理经验。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

无。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期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

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人无受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门无受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

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	
财信证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-

- 注：1、本基金采用证券公司交易结算模式，可豁免单个券商的交易佣金比例限制。
- 2、根据中国证监会的有关规定，我司在综合考量证券经营机构的经营状况，响应支持效率，满足交易结算需要，研究能力等因素的基础上，选择证券经纪商。
- 3、选择券商的程序：
- （1）本基金管理人根据上述标准进行评估并经公司证券交易结算机构评价小组审批确定选用的券商；
- （2）本基金管理人与被选择的券商签订证券经纪服务协议。

4、此处的佣金指基金通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计，不单指股票交易佣金。

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	财信 30 天持有期债券型证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	证监会电子化信息披露平台、基金管理人网站	2026-01-22
2	财信基金管理有限公司高级管理人员变更公告	证监会电子化信息披露平台、基金管理人网站、证券时报	2026-02-14
3	财信 30 天持有期债券型证券投资基金 2025 年年度报告	证监会电子化信息披露平台、基金管理人网站	2026-03-30
4	财信基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025 年度）	证监会电子化信息披露平台、基金管理人网站、证券时报	2026-03-31
5	财信基金管理有限公司关于财信 30 天持有期债券型证券投资基金增加销售机构的公告	证监会电子化信息披露平台、基金管理人网站、证券时报	2026-04-20
6	财信 30 天持有期债券型证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	证监会电子化信息披露平台、基金管理人网站	2026-04-21
7	2025 年度财信基金管理有限公司以股东身份（通过公募基金持股）参与股东大会投票信息披露审批	基金管理人网站	2026-04-26
8	财信基金管理有限公司关于旗下部分基金增加国泰海通证券股份有限公司为销售机构的公告	证监会电子化信息披露平台、基金管理人网站、证券时报	2026-05-29
9	财信基金管理有限公司关于旗下部分基金调整业绩比较基准并修订基金合同等法律文件的公告	证监会电子化信息披露平台、基金管理人网站、证券时报	2026-06-18

§ 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20260210-20260324, 20260326-20260630	19,971,040.54	68,687,167.64	0	88,658,208.18	23.07%
	2	20260519-20260630	0	98,211,549.79	0	98,211,549.79	25.55%
产品特有风险							
报告期内本基金出现了单一投资者份额占比达到或超过 20%的情况。 未来本基金如果出现巨额赎回甚至集中赎回，基金管理人可能无法及时变现基金资产，可能对基金份额净值产生一定的影响；极端情况下可能引发基金的流动性风险，发生暂停赎回或延缓支付赎回款项；若个别投资者巨额赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于 5000 万元，还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会准予财信证券 30 天持有期债券型集合资产管理计划变更注册的文件
- (二) 《财信 30 天持有期债券型证券投资基金基金合同》
- (三) 《财信 30 天持有期债券型证券投资基金托管协议》
- (四) 《财信 30 天持有期债券型证券投资基金招募说明书》
- (五) 财信基金管理有限公司开放式基金业务规则
- (六) 报告期内在证监会规定媒介上披露的各项公告

12.2 存放地点

湖南省长沙市岳麓区观沙岭街道滨江路 188 号滨江基金产业园 3 栋 201 和 3 栋 301

12.3 查阅方式

投资者可到基金管理人的办公场所及网站免费查阅备查文件，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复印件。

基金管理人网站：<https://mfund.hnchasing.com>

财信基金管理有限公司
二〇二六年八月二十九日