

# 招商恒鑫 30 个月封闭式债券型证券投资基金 2024 年中期报告

2024 年 06 月 30 日

基金管理人：招商基金管理有限公司

基金托管人：中信银行股份有限公司

送出日期：2024 年 8 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及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。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 8 月 29 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 2024 年 1 月 1 日起至 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.....	4
2.4 信息披露方式 .....	5
2.5 其他相关资料 .....	5
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	5
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现 .....	6
§4 管理人报告.....	6
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	6
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 .....	7
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	8
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.....	8
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 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明.....	11
§5 托管人报告.....	11
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 .....	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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的真实、准确和完整发表意见 .....	11
§6 半年度财务会计报告（未经审计） .....	12
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	13
6.3 净资产变动表 .....	15
6.4 报表附注 .....	16
§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 .....	36
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.....	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	36
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.....	37
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.....	37
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.....	37
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.....	38
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	38

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	38
7.12 投资组合报告附注.....	38
§8 基金份额持有人信息.....	39
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	39
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	39
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.....	40
§9 重大事件揭示 .....	40
9.1 基金份额持有人大会决议.....	40
9.2 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.....	40
9.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	40
9.4 基金投资策略的改变.....	40
9.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	40
9.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	40
9.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	41
9.8 其他重大事件 .....	42
§10 备查文件目录.....	43
10.1 备查文件目录.....	43
10.2 存放地点.....	43
10.3 查阅方式.....	43

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	招商恒鑫 30 个月封闭式债券型证券投资基金
基金简称	招商恒鑫 30 个月封闭债
基金主代码	017800
交易代码	017800
基金运作方式	契约型封闭式
基金合同生效日	2023 年 2 月 22 日
基金管理人	招商基金管理有限公司
基金托管人	中信银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	7,925,622,949.55 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险的前提下，力争基金资产长期稳健增值，为基金份额持有人提供超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	<p>本基金在封闭期初，将视债券、银行存款、债券回购等大类资产的市场环境进行封闭期组合构建。</p> <p>本基金的具体投资策略包括：（一）资产配置策略、（二）子单元管理策略、（三）持有到期型单元的投资策略、（四）采用市值法估值债券的投资策略、（五）信用债投资策略、（六）杠杆投资策略、（七）国债期货投资策略、（八）可转换债券和可交换债券投资策略。</p> <p>未来，随着市场的发展和基金管理运作的需要，基金管理人可以在不改变投资目标的前提下，遵循法律法规的规定，在履行适当程序后，相应调整或更新投资策略，并在招募说明书更新中公告。</p>
业绩比较基准	中债综合（全价）指数收益率*90%+两年期定期存款利率（税后）*10%
风险收益特征	本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，但低于混合型基金、股票型基金。

### 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	招商基金管理有限公司	中信银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	潘西里
	联系电话	0755-83196666
	电子邮箱	cmf@cmfchina.com
客户服务电话	400-887-9555	95558
传真	0755-83196475	010-85230024
注册地址	深圳市福田区深南大道	北京市朝阳区光华路 10 号院 1

	7088 号	号楼 6-30 层、32-42 层
办公地址	深圳市福田区深南大道 7088 号	北京市朝阳区光华路 10 号院 1 号楼 6-30 层、32-42 层
邮政编码	518040	100020
法定代表人	王小青	方合英

## 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
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.cmfchina.com">http://www.cmfchina.com</a>
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	招商基金管理有限公司	深圳市福田区深南大道 7088 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(2024 年 1 月 1 日 - 2024 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	133,075,013.25
本期利润	146,960,157.28
加权平均基金份额本期利润	0.0185
本期加权平均净值利润率	1.83%
本期基金份额净值增长率	1.84%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	152,878,751.63
期末可供分配基金份额利润	0.0193
期末基金资产净值	8,098,605,081.85
期末基金份额净值	1.0218
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	4.41%

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收益。

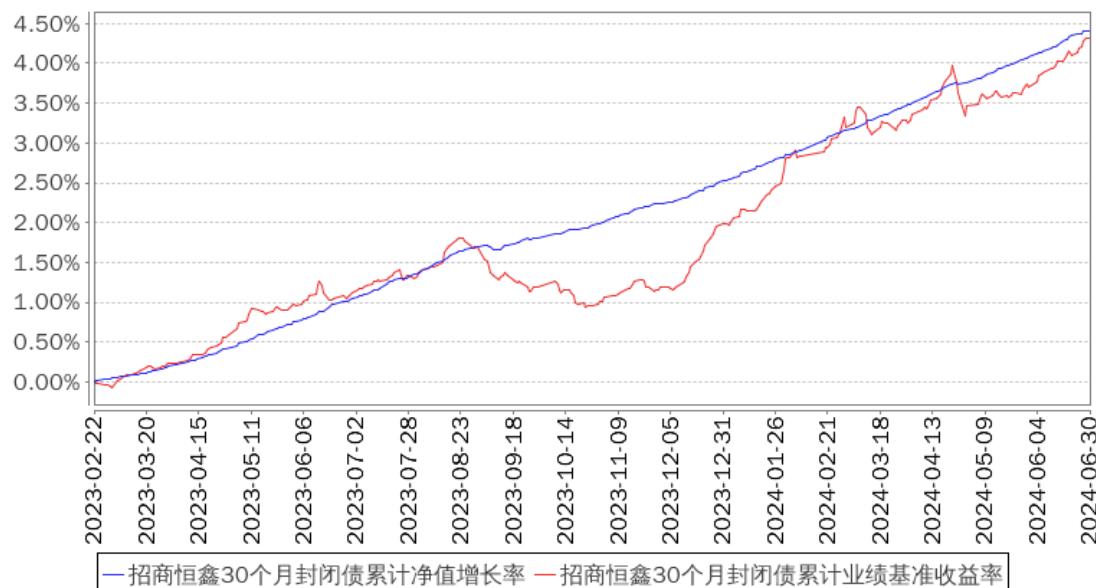
### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.31%	0.02%	0.60%	0.03%	-0.29%	-0.01%
过去三个月	0.91%	0.01%	1.00%	0.06%	-0.09%	-0.05%
过去六个月	1.84%	0.01%	2.28%	0.06%	-0.44%	-0.05%
过去一年	3.33%	0.01%	3.16%	0.05%	0.17%	-0.04%
自基金合同生效起至今	4.41%	0.01%	4.32%	0.05%	0.09%	-0.04%

#### 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

招商恒鑫30个月封闭债累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金建仓期为 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

### § 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

招商基金管理有限公司于 2002 年 12 月 27 日经中国证监会【2002】100 号文批准设立。目前，公司注册资本金为人民币 13.1 亿元，招商银行股份有限公司持有公司全部股权的 55%，招商证券股份有限公司持有公司全部股权的 45%。

招商基金管理有限公司拥有公开募集证券投资基金管理、基金销售、全国社会保障基金境内委托管理、企业年金和职业年金基金投资管理、合格境内机构投资者、特定客户资产管理、保险资金投资管理、基本养老保险基金投资管理、公募基金投资顾问业务试点资格。

#### 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		
李家辉	本基金 基金经理	2023 年 2 月 22 日	-	6	男，博士。2017 年 7 月加入招商基金管理有限公司固定收益投资部，曾任研究员、从事债券研究分析工作，曾任招商添瑞 1 年定期开放债券型发起式证券投资基金、招商添文 1 年定期开放债券型发起式证券投资基金、招商添润 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、招商添琪 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、招商招盛纯债债券型证券投资基金基金经理，现任招商鑫福中短债债券型证券投资基金、招商添利两年定期开放债券型证券投资基金、招商招诚半年定期开放债券型发起式证券投资基金、招商鑫诚短债债券型证券投资基金、招商鑫嘉中短债债券型证券投资基金、招商鑫利中短债债券型证券投资基金、招商恒鑫 30 个月封闭式债券型证券投资基金、招商稳福短债 14 天滚动持有债券型发起式证券投资基金、招商稳恒中短债 60 天持有期债券型证券投资基金、招商稳乐中短债 90 天持有期债券型证券投资基金基金经理。

注：1、本基金首任基金经理的任职日期为本基金合同生效日，后任基金经理的任职日期以及历任基金经理的离任日期为公司相关会议作出决定的公告（生效）日期；

2、证券从业年限计算标准遵从中国证监会《证券基金经营机构董事、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遵规守信情况的说明

基金管理人声明：在本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关法律法规及其各项实施准则的规定以及本基金的基金合同等基金法律文件的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的前提下，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，无损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围以及投资运作符合有关法律法规及基金合同的规定。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

基金管理人已建立较完善的研究方法和投资决策流程，确保各投资组合享有公平的投资决策机会。基金管理人建立了所有组合适用的投资对象备选库，制定明确的备选库建立、维护程序。基金管理人拥有健全的投资授权制度，明确投资决策委员会、投资组合经理等各投资决策主体的职责和权限划分，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。基金管理人的相关研究成果向内部所有投资组合开放，在投资研究层面不存在各投资组合间不公平的问题。

基金管理人按照法规要求，对连续四个季度期间内、不同时间窗下（如日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合间的同向交易的交易价差进行分析，相关投资组合经理也对分析中发现的价格差异次数占比超过正常范围的情况进行了合理性解释。报告期内，公司旗下投资组合同向交易价差分析中未发现异常情形。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

基金管理人严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。确因投资组合的投资策略或流动性等需要而发生的同日反向交易，基金管理人要求相关投资组合经理提供决策依据，并留存记录备查，完全按照有关指数的构成比例进行投资的组合等除外。

本报告期内，本基金各项交易均严格按照相关法律法规、基金合同的有关要求执行，公司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的 5% 的交易共有 6 次，为旗下指数及量化组合因投资策略需要而发生反向交易。报告期内未发现有可能导致不公平交易和利益输送的重大异常交易行为。

#### 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

宏观经济回顾：

2024 年上半年，国内经济先向上修复，一季度表现尚可，进入二季度后边际上有所走弱，地产仍相对低迷，制造业和出口链条表现尚可。投资方面，6 月固定资产投资完成额累计同比增长 3.9%，投资端数据上半年呈现走弱态势，其中房地产开发投资累计同比下降 10.1%，地产投资表现仍然低迷，随着近期一系列地产新政推出，部分城市二手房交易量出现明显抬升，持续关注后续地产销售表现；6 月不含电力的基建投资累计同比增长 5.4%，由于当前地方债务管控力度较强、新增项目审批严格，基建增速上半年呈现下行趋势；6 月制造业投资累计同比增长 9.5%，上半年制造业投资表现相对较好，考虑当前中美库存周期位于底部、重点领域技改及设备更新项目在持续推进、政策扶持力度大，制造业投资韧性较强。消费方面，6 月社会消费品零售总额累计同比增长 3.7%，上半年消费数据持续在偏弱区间运行。对外贸易方面，6 月出口金额累计同比增速为 3.6%，上半年出口仍具韧性，主要与外需表现较好有关。生产方面，6 月 PMI 指数为 49.5%，5 月以来连续两个月转为荣枯线以下，6 月的生产指数和新订单指数分别为 50.6% 和 49.5%，生产表现略好于需求。

#### 债券市场回顾：

2024 年一季度债市整体走强，各等级各期限债券品种收益率全线下行，10 年期国债收益率从 2.56% 下行至 2.29%。期限结构上，长期品种表现更好，尤其是 30 年期国债。信用利差整体表现为压窄，等级利差同样压窄。具体来看，2024 年 1 月，债市仍然延续 2023 年 12 月的行情，1 月 24 日央行宣布降准 0.5% 并结构性降息，进一步助推债券市场行情，同时股市表现偏弱，10 年期国债收益率下行至 2.44%。2 月，地产销售和地产链条高频数据表现偏弱，春节后复工率不及预期，2 月 20 日央行再度下调 5 年期 LPR 利率 25bp，中小行也继续跟随调整存款挂牌利率，10 年期国债收益率下行至 2.34% 附近。3 月债市转为震荡，10 年期国债先下行至 2.3% 以下，后因债市供给担忧、资金面不松、降息预期落空等因素有小幅调整，不过由于资产荒现象明显，债券市场利率仍在低位徘徊。

二季度债市延续走强趋势，各债券品种收益率普遍下行，10 年国债收益率从 2.29% 下行约 8bp 至 2.21%，且中短端利率品种收益率下行幅度大于长端和超长端。由于禁止手工补息导致的非银资金面宽松，信用债表现整体好于利率债，信用利差收窄，且中低等级信用利差收窄幅度大于高等级。具体来看，4 月初市场利率定价自律机制倡议，要求银行业金融机构禁止通过手工补息的方式高息揽储，中短端债券品种收益率、存单收益率下行，并带动整个收益率曲线下行；4 月下旬，央行提示债券市场利率风险，债市出现连续调整。5 月中下旬国务院多部委、地方政府、银行召开房地产会议讨论保交楼和存量房收储，央行则发布多项关于地产政策的调整，随后上海、深圳、广州等多个城市发布了楼市新政，对利率走势形成扰动，但由于基本面数据较为疲弱，非银资产荒仍存在，叠加央行 5 月末 OMO 净投放较大，资金面担忧缓解，综合作用下债市仍走强。进入 6 月，资金面相对平稳宽松，DR007 阶段性低于 OMO 政策利率，公布的金融数据、经济数据走势偏弱，地产政策调整后地

产销售略有好转但绝对水平一般，股市表现偏弱，多因素影响下，债市强势情绪不改，收益率继续下行。

基金操作：

回顾 2024 年上半年的基金操作，我们严格遵照基金合同的相关约定，按照既定的投资流程进行了规范运作。债券投资方面，本组合在市场收益率波动过程中积极调整仓位，顺应市场趋势，优化资产配置结构，努力提高组合收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金份额净值增长率为 1.84%，同期业绩基准增长率为 2.28%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

市场展望：

展望来看，人民银行公告决定近期开展“国债借入操作”后，债市尤其是长端利率品种有所调整，价值有所凸显，但其他影响因素如基本面、资产荒等格局仍未改变，我们倾向于认为债市机会大于风险，维持相对积极的仓位。目前资金利率偏高，短端品种收益率下行空间已不大，相对价值有限，后续仍有压缩期限利差的可能性。在存贷款利率持续下降的背景下，债市需求旺盛，资产荒仍持续，较低的信用利差水平可能难以改变，未来可以重视长端债券品种因供给等压力形成调整后的配置机会。

### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金的估值业务严格按照相关的法律法规、基金合同以及《招商基金管理有限公司基金估值委员会管理办法》进行。基金核算部负责日常的基金资产的估值业务，执行基金估值政策。另外，公司设立由投资和研究部门、风险管理部、基金核算部、法律合规部负责人和基金经理代表组成的估值委员会。公司估值委员会的相关成员均具备相应专业胜任能力和相关工作经历。公司估值委员会主要负责制定、修订和完善基金估值政策和程序，定期评价现有估值政策和程序的适用性及对估值程序执行情况进行监督。

投资和研究部门以及基金核算部共同负责关注相关投资品种的动态，评判基金持有的投资品种是否处于不活跃的交易状态或者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了影响证券价格的重大事件，从而确定估值日需要进行估值测算或者调整的投资品种；投资和研究部门定期审核公允价值的确认和计量；研究部提出合理的数量分析模型对需要进行估值测算或者调整的投资品种进行公允价值定价与计量并定期对估值政策和程序进行评价，以保证其持续适用；基金核算部定期审核估值政策和程序的一致性，并负责与托管行沟通估值调整事项；风险管理部负责估值委员会工作流程中的风险控制；法律

合规部负责日常的基金估值调整结果的事后复核监督工作；法律合规部与基金核算部共同负责估值调整事项的信息披露工作。

基金经理代表向估值委员会提供估值参考信息，参与估值政策讨论；对需采用特别估值程序的证券，基金及时启动特别估值程序，由公司估值委员会集体讨论议定特别估值方案，咨询会计事务所的专业意见，并与托管行沟通后由基金核算部具体执行。

本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。截止报告期末本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司、中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定提供相关债券品种、流通受限股票的估值参考数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内实施的利润分配金额为 173,571,138.26 元。

#### 4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内，本基金未发生连续二十个工作日出现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

作为本基金的托管人，中信银行严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金 2024 年上半年的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，履行了托管人的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

#### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，基金管理人的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的 2024 年中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

## § 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：招商恒鑫 30 个月封闭式债券型证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	4,024,271.20	5,837,626.52
结算备付金		381,804.34	3,205,400.95
存出保证金		6,952.34	19,616.97
交易性金融资产	6.4.7.2	1,722,110,723.83	2,390,770,873.95
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		1,700,697,092.14	2,348,553,141.59
资产支持证券投资		21,413,631.69	42,217,732.36
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	-	-
债权投资	6.4.7.5	8,289,854,163.52	8,577,253,481.57
其中：债券投资		8,211,879,556.38	8,496,380,257.66
资产支持证券投资		77,974,607.14	80,873,223.91
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		33,294,400.00	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		10,049,672,315.23	10,977,086,999.96
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 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		1,947,195,047.02	2,848,003,408.78
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		1,988,289.57	2,066,950.13
应付托管费		662,763.20	688,983.35
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		1,020,462.07	901,755.42
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.7	200,671.52	209,839.45
负债合计		1,951,067,233.38	2,851,870,937.13
净资产：			
实收基金	6.4.7.8	7,925,622,949.55	7,925,622,949.55
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.9	172,982,132.30	199,593,113.28
净资产合计		8,098,605,081.85	8,125,216,062.83
负债和净资产总计		10,049,672,315.23	10,977,086,999.96

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0218 元，基金份额总额 7,925,622,949.55 份。

## 6.2 利润表

会计主体：招商恒鑫 30 个月封闭式债券型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 2 月 22 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		191,625,314.76	106,871,800.86
1.利息收入		145,599,361.38	84,594,014.27
其中：存款利息收入	6.4.7.10	87,454.48	8,417,997.52
债券利息收入		144,307,401.72	74,255,495.45
资产支持证券利息收入		1,197,372.85	-
买入返售金融资产收入		7,132.33	1,920,521.30

其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”号填列）		32,140,809.35	20,636,338.83
其中：股票投资收益	6.4.7.11	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.12	31,697,921.51	20,685,927.59
资产支持证券投资收益	6.4.7.13	442,883.66	159,626.79
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	-	-
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		4.18	-209,215.55
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	13,885,144.03	1,641,447.76
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-	-
减：二、营业总支出		44,665,157.48	24,515,537.48
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	11,987,971.56	8,375,099.05
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	3,995,990.46	2,791,699.74
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		27,957,476.06	9,238,185.13
其中：卖出回购金融资产支出		27,957,476.06	9,238,185.13
6. 信用减值损失	6.4.7.19	-42,461.12	3,729,890.97
7. 税金及附加		616,823.50	315,006.42
8. 其他费用	6.4.7.20	149,357.02	65,656.17
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		146,960,157.28	82,356,263.38
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		146,960,157.28	82,356,263.38
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		146,960,157.28	82,356,263.38

注：根据最新《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>》中的利润表格式的要求：上年度可比期间“证券出借利息收入”项目的“本期”金额列示于本期“其他利息收入”项目的“上年度可比期间”金额中。

### 6.3 净资产变动表

会计主体：招商恒鑫 30 个月封闭式债券型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 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	7,925,622,949.55	-	199,593,113.28	8,125,216,062.83
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	7,925,622,949.55	-	199,593,113.28	8,125,216,062.83
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-	-	-26,610,980.98	-26,610,980.98
（一）、综合收益总额	-	-	146,960,157.28	146,960,157.28
（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）	-	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-	-
（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）	-	-	-173,571,138.26	-173,571,138.26
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	7,925,622,949.55	-	172,982,132.30	8,098,605,081.85
项目	上年度可比期间 2023 年 2 月 22 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 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	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	7,925,622,949.55	-	-	7,925,622,949.55
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-	-	82,356,263.38	82,356,263.38
(一)、综合收益总额	-	-	82,356,263.38	82,356,263.38
(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）	-	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-	-
(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)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	7,925,622,949.55	-	82,356,263.38	8,007,979,212.93

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：

\_\_\_\_徐勇\_\_\_\_ 欧志明\_\_\_\_ 何剑萍\_\_\_\_

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

招商恒鑫 30 个月封闭式债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)系由基金管理人招商基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《招商恒鑫 30 个月封闭式债券型证券投资基金基金合同》及其他有关法律法规的规定，经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2022]3249 号文准予公开募集注册。本基金为契约型

封闭式基金，存续期限为 30 个月，即基金合同生效日起至封闭期到期日止。本基金首次设立募集基金份额为 7,925,622,949.55 份，经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)验证，并出具了编号为德师报(验)字(23)第 00052 号验资报告。《招商恒鑫 30 个月封闭式债券型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)于 2023 年 2 月 22 日正式生效。本基金的基金管理人为招商基金管理有限公司，基金托管人为中信银行股份有限公司(以下简称“中信银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同及截至报告期末最新公告的基金招募说明书的有关规定，本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行的债券(包括国债、地方政府债、金融债、央行票据、公司债、企业债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、政府支持机构债、政府支持债券、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、国债期货、现金以及法律法规或中国证监会允许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。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，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：本基金对债券的投资比例不低于基金资产的 80%，本基金采用摊余成本法估值的债券资产不低于基金净资产的 50%(如因基金资产价格波动等原因导致摊余成本法计量的债券资产被动低于上述比例的，应在 2 个月内调整至符合比例要求)，采用交易策略且相应以市价法估值的债券资产不低于基金净资产的 20%。本基金不投资于股票等资产，本基金投资于可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券的比例不超过基金资产总值的 10%。本基金每个交易日日终在扣除国债期货需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如法律法规的相关规定发生变更，基金管理人在履行适当程序后，可对上述资产配置比例进行调整。

本基金业绩比较基准为：中债综合(全价)指数收益率  $\times$  90% + 两年期定期存款利率(税后)  $\times$  10%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称“企业会计准则”)、中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

#### **6.4.4 重要会计政策和会计估计**

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。

#### **6.4.5 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**

本基金在本报告期间未发生重大会计政策变更。

##### **6.4.5.2 会计估计变更的说明**

本基金本报告期间未发生重大会计估计变更。

##### **6.4.5.3 差错更正的说明**

本基金本报告期内无需要说明的重大会计差错更正。

#### **6.4.6 税项**

根据财税[2008]1 号《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[2016]36 号《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《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《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《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》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 证券投资基金(封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖债券免征增值税；2018 年 1 月 1 日起，公开募集证券投资基金管理人运营公开募集证券投资基金过程中发生的资管产品运营业务，以基金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。

(2) 对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，暂不计缴企业所得税。

(3) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

#### **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 2024 年 6 月 30 日
活期存款	4,024,271.20
等于： 本金	4,023,568.82
加： 应计利息	702.38
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	4,024,271.20

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 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	982,700,472.57	14,944,637.80	1,007,431,637.80	9,786,527.43
	银行间市场	672,090,280.39	10,949,454.34	693,265,454.34	10,225,719.61
	合计	1,654,790,752.96	25,894,092.14	1,700,697,092.14	20,012,247.04
资产支持证券	21,080,766.37	241,731.69	21,413,631.69	91,133.63	
基金	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	1,675,871,519.33	26,135,823.83	1,722,110,723.83	20,103,380.67	

#### 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

本基金本报告期末无衍生金融工具。

#### 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

本基金本报告期末无各项买入返售金融资产。

#### 6.4.7.4.2 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。

#### 6.4.7.5 债权投资

##### 6.4.7.5.1 债权投资情况

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日					
	初始成本	利息调整	应计利息	减：减值准备	账面价值	
债券	交易所市场	2,945,000,000.00	-205,377.54	33,489,904.67	1,220,972.19	2,977,063,554.94
	银行间市场	5,163,000,000.00	10,246,192.06	63,251,606.05	1,681,796.67	5,234,816,001.44
	小计	8,108,000,000.00	10,040,814.52	96,741,510.72	2,902,768.86	8,211,879,556.38
资产支持证券	77,142,000.00	-	-19.03	854,776.20	22,150.03	77,974,607.14
其他	-	-	-	-	-	-
合计	8,185,142,000.00	10,040,795.49	97,596,286.92	2,924,918.89	8,289,854,163.52	

##### 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

单位：人民币元

减值准备	第一阶段	第二阶段	第三阶段	合计
	未来 12 个月预期信用损失	整个存续期预期信用损失(未发生信用减值)	整个存续期预期信用损失(已发生信用减值)	
期初余额	2,967,380.01	-	-	2,967,380.01
本期从其他阶段转入	-	-	-	-
本期转出至其他阶段	-	-	-	-
本期新增	4,272,916.28	-	-	4,272,916.28
本期转回	4,315,377.40	-	-	4,315,377.40
其他变动	-	-	-	-
期末余额	2,924,918.89	-	-	2,924,918.89

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

#### 6.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 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	81,999.18
其中：交易所市场	-
银行间市场	81,999.18
应付利息	-
预提费用	118,672.34
合计	200,671.52

#### 6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	7,925,622,949.55	7,925,622,949.55
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期末	7,925,622,949.55	7,925,622,949.55

注：本期申购含红利再投、转换入份(金)额，本期赎回含转换出份(金)额。

#### 6.4.7.9 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
上年度末	193,374,876.64	6,218,236.64	199,593,113.28
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	193,374,876.64	6,218,236.64	199,593,113.28
本期利润	133,075,013.25	13,885,144.03	146,960,157.28
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-173,571,138.26	-	-173,571,138.26
本期末	152,878,751.63	20,103,380.67	172,982,132.30

#### 6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	35,826.72
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	51,560.58
其他	67.18
合计	87,454.48

#### 6.4.7.11 股票投资收益

##### 6.4.7.11.1 股票投资收益项目构成

本基金本报告期内无股票投资收益。

##### 6.4.7.11.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金本报告期内无买卖股票差价收入。

##### 6.4.7.11.3 股票投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无股票赎回差价收入。

##### 6.4.7.11.4 股票投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无股票申购差价收入。

##### 6.4.7.11.5 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期内无证券出借差价收入。

#### 6.4.7.12 债券投资收益

##### 6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	40,950,365.89
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-9,252,444.38
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	31,697,921.51

##### 6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	765,497,264.41
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	748,611,637.20
减：应计利息总额	26,137,346.59
减：交易费用	725.00
买卖债券差价收入	-9,252,444.38

### 6.4.7.12.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无债券赎回差价收入。

### 6.4.7.12.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无债券申购差价收入。

## 6.4.7.13 资产支持证券投资收益

### 6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
资产支持证券投资收益——利息收入	442,609.62
资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入	274.04
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	442,883.66

### 6.4.7.13.2 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
卖出资产支持证券成交总额	21,246,561.86
减：卖出资产支持证券成本总额	20,901,625.96
减：应计利息总额	344,661.86
减：交易费用	-
资产支持证券投资收益	274.04

### 6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无资产支持证券投资赎回差价收入。

### 6.4.7.13.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无资产支持证券投资申购差价收入。

## 6.4.7.14 贵金属投资收益

### 6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

### 6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内无买卖贵金属差价收入。

### 6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无贵金属赎回差价收入。

#### 6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无贵金属申购差价收入。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

##### 6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内无衍生工具买卖权证差价收入。

##### 6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期内无衍生工具其他投资收益。

#### 6.4.7.16 股利收益

本基金本报告期内无股利收益。

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	13,885,144.03
——股票投资	-
——债券投资	13,812,318.07
——资产支持证券投资	72,825.96
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	13,885,144.03

#### 6.4.7.18 其他收入

本基金本报告期内无其他收入。

#### 6.4.7.19 信用减值损失

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
银行存款	-
买入返售金融资产	-
债权投资	-42,461.12
其他债权投资	-
其他	-
合计	-42,461.12

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
审计费用	50,000.00
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
其他	39,684.68
合计	149,357.02

#### 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，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报告批准报出日，本基金无需要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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 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
招商基金管理有限公司	基金管理人
中信银行股份有限公司	基金托管人
招商证券股份有限公司(以下简称“招商证券”)	基金管理人的股东

注：基金的主要关联方包含基金管理人、基金管理人的股东及子公司、基金托管人等。

#### 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

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的股票交易。

###### 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 2 月 22 日 (基金合同生效日)至 2023 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
招商证券	110,191,300.00	100.00%	2,679,937,950.00	78.74%

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 2 月 22 日(基金合同生效日)至 2023 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
招商证券	-	-	3,793,516,000.00	96.26%

#### 6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

#### 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 2 月 22 日(基金合同生效日)至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	11,987,971.56	8,375,099.05
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,738,293.92	1,227,722.78
应支付基金管理人的净管理费	10,249,677.64	7,147,376.27
应支付投资顾问的投资顾问费	-	-

注：支付基金管理人的基金管理人报酬按前一日基金资产净值×0.30%的年费率计提，逐日

累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 2 月 22 日(基金合同生效日)至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	3,995,990.46	2,791,699.74

注：支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值  $\times 0.10\%$  的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日基金托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

#### 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

本基金本报告期内及上年度可比期间无与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间无与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况。

##### 6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间无与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

##### 6.4.10.5.2 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

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

#### 6.4.10.6 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 2 月 22 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中信银行-活期	4,024,271.20	35,826.72	4,493,059.62	384,083.97

注：本基金的银行存款由基金托管人中信银行股份有限公司保管，按银行约定利率计息。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 6.4.11 利润分配情况

#### 6.4.11.1 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

金额单位：人民币元

序号	权益登记日	场内除息日	场外除息日	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
1	2024 年 1 月 12 日	-	2024 年 1 月 12 日	0.2190	173,571,138.26	-	173,571,138.26	-
合计	-	-	-	0.2190	173,571,138.26	-	173,571,138.26	-

#### 6.4.12 期末（2024 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

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 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

截至本报告期末 2024 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额人民币 1,947,195,047.02 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
102001002	20 陕煤化 MTN002	2024 年 7 月 2 日	100.71	654,000	65,861,442.75
102280327	22 建发地产 MTN002A(并购)	2024 年 7 月 2 日	101.59	600,000	60,953,238.85
102281172	22 晋能煤业 MTN008	2024 年 7 月 2 日	100.61	1,000,000	100,606,257.91
102281280	22 新建元 MTN001	2024 年 7 月 2 日	100.15	800,000	80,119,585.91
102281296	22 光大控股 MTN001	2024 年 7 月 2 日	100.06	1,900,000	190,119,571.03
102281589	22 陆家嘴 MTN001	2024 年 7 月 2 日	102.01	131,000	13,363,477.21
102380528	23 晋能煤业 MTN002A	2024 年 7 月 2 日	100.82	1,000,000	100,819,537.99

102101312	21 供销 MTN002	2024 年 7 月 3 日	102.70	100,000	10,270,162.82
102103183	21 晋能电力 MTN018	2024 年 7 月 3 日	103.61	207,000	21,448,138.70
102280101	22 河钢集 MTN001	2024 年 7 月 3 日	101.52	1,200,000	121,828,368.81
102280275	22 鞍钢集 MTN001	2024 年 7 月 3 日	100.80	2,500,000	252,002,674.70
102281674	22 晋能煤业 MTN017	2024 年 7 月 3 日	102.90	1,400,000	144,058,751.90
102281846	22 中建投资 MTN003	2024 年 7 月 3 日	100.98	32,000	3,231,250.19
102281864	22 豫投资 MTN002	2024 年 7 月 3 日	101.32	45,000	4,559,178.64
102380213	23 晋能电力 MTN003	2024 年 7 月 3 日	101.03	1,157,000	116,892,129.96
132100164	21 三峰环境 GN001	2024 年 7 月 3 日	101.11	400,000	40,445,721.74
102001002	20 陕煤化 MTN002	2024 年 7 月 10 日	100.71	83,000	8,358,562.31
102102264	21 河钢集 MTN005(革 命老区)	2024 年 7 月 10 日	102.43	600,000	61,458,172.53
102103051	21 河钢集 MTN006(革 命老区)	2024 年 7 月 10 日	102.21	600,000	61,323,954.62
102103089	21 晋能电力 MTN014	2024 年 7 月 10 日	103.75	40,000	4,149,814.52
102103183	21 晋能电力 MTN018	2024 年 7 月 10 日	103.61	893,000	92,527,477.60
102200106	22 宝马金融 MTN001BC(品 种二)	2024 年 7 月 10 日	100.76	19,000	1,914,499.34
102281307	22 首钢 MTN003	2024 年 7 月 10 日	99.93	87,000	8,693,887.50
102281432	22 晋能煤业 MTN014(科 创票据)	2024 年 7 月 10 日	100.34	700,000	70,237,260.35
102281571	22 晋能煤业 MTN015(科 创票据)	2024 年 7 月 10 日	102.94	1,000,000	102,943,040.60
102281846	22 中建投资 MTN003	2024 年 7 月 10 日	100.98	913,000	92,191,606.99
102380152	23 晋能电力	2024 年 7 月	101.30	1,000,000	101,296,222.63

	MTN002	10 日			
132280046	22 湖南钢铁 GN002	2024 年 7 月 10 日	99.80	500,000	49,899,206.10
132280048	22 融和融资 GN002(碳中 和债)	2024 年 7 月 10 日	100.34	1,000,000	100,340,314.51
合计	-	-	-	20,561,000	2,081,913,508.71

#### 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交易所市场债券正回购交易而抵押的债券。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

本基金为债券型基金，本基金的运作涉及的金融工具主要包括债券投资、资产支持证券投资等。与这些金融工具有关的风险，以及本基金的基金管理人管理这些风险所采取的风险管理政策如下所述。

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人从事风险管理的目标是提升本基金风险调整后收益水平，保证本基金的基金资产安全，维护基金份额持有人利益。基于该风险管理目标，本基金的基金管理人风险管理的基本策略是识别和分析本基金运作时本基金面临各种类型的风险，确定适当的风险容忍度，并及时可靠地对各种风险进行监督，将风险控制在限定的范围之内。本基金目前面临的主要风险包括：市场风险、信用风险和流动性风险。

本基金的基金管理人建立了以全面、独立、互相制约以及定性和定量相结合为原则的，监事会、董事会及下设风险控制委员会、督察长、风险管理委员会、法律合规部和风险管理部等多层次的风险管理组织架构体系。

##### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指金融工具的一方到期无法履行约定义务致使本基金遭受损失的风险。本基金的信用风险主要存在于银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资、资产支持证券投资及其他。

本基金的银行存款存放于本基金的基金托管人，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在证券交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估并采用券款对付交割方式，以控制相应的信用风险。

对于与债券投资、资产支持证券投资等投资品种相关的信用风险，本基金的基金管理人通过对投资品种的信用等级评估来选择适当的投资对象，并限制单个投资品种的持有比例来管理信用风险。附注 6.4.13.2.1 至 6.4.13.2.6 列示了本基金所持有的债券投资及资产支持证券投资的信用评级，该信用评级不包括本基金所持有的国债、央行票据、政策性金融债。

#### 6.4.13.2.1 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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	20,501,777.05	81,842,097.43
合计	20,501,777.05	81,842,097.43

注：上述评级均由经中国证监会核准从事证券市场资信评级业务的评级机构做出。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

#### 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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
AAA	6,337,532,758.00	7,154,172,805.97
AAA 以下	229,216,870.61	306,002,579.94
未评级	3,314,674,437.38	3,302,915,915.91
合计	9,881,424,065.99	10,763,091,301.82

注：上述评级均由经中国证监会核准从事证券市场资信评级业务的评级机构做出。

#### 6.4.13.2.5 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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
AAA	95,546,377.40	115,059,383.63
AAA 以下	3,841,861.43	8,031,572.64
未评级	-	-
合计	99,388,238.83	123,090,956.27

注：上述评级均由经中国证监会核准从事证券市场资信评级业务的评级机构做出。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

### 6.4.13.3 流动性风险

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金流动性风险来源于基金约定开放日兑付赎回资金的流动性风险，以及因部分投资品种交易不活跃而出现的变现风险以及因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理价格变现投资的风险。本基金所持有的金融资产主要在证券交易所和银行间同业市场交易。除附注 6.4.12 所披露的流通受限不能自由转让的基金资产外，本基金未持有其他有重大流动性风险的投资品种。除卖出回购金融资产外，本基金所持有的金融负债的合约约定到期日均为一年以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)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。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人在基金合同约定巨额赎回条款，设计了非常情况下赎回资金的处理模式，控制因开放模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

日常流动性风险管理中，本基金的基金管理人每日监控和预测本基金的流动性指标，通过对投资品种的流动性指标来持续地评估、选择、跟踪和控制基金投资的流动性风险。同时，本基金通过预留一定的现金头寸，并且在需要时可通过卖出回购金融资产方式融入短期资金，以缓解流动性风险。

### 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

利率风险是指利率敏感性金融工具的公允价值及将来现金流受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的基金管理人日常通过对利率水平的预测、分析收益率曲线及优化利率重新定价日组合等方法对上述利率风险进行管理。

下表统计了本基金面临的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 年 6 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	4,024,271.20	-	-	-	4,024,271.20
结算备付金	381,804.34	-	-	-	381,804.34

存出保证金	6,952.34	-	-	-	6,952.34
交易性金融资产	737,870,101.49	973,589,816.86	10,650,805.48	-	1,722,110,723.83
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
债权投资	4,878,468,600.01	3,411,385,563.51	-	-	8,289,854,163.52
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	33,294,400.00	33,294,400.00
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	5,620,751,729.38	4,384,975,380.37	10,650,805.48	33,294,400.00	10,049,672,315.23
负债					
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	1,988,289.57	1,988,289.57
应付托管费	-	-	-	662,763.20	662,763.20
应付清算款	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	1,947,195,047.02	-	-	-	1,947,195,047.02
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	1,020,462.07	1,020,462.07
其他负债	-	-	-	200,671.52	200,671.52
负债总计	1,947,195,047.02	-	-	3,872,186.36	1,951,067,233.38
利率敏感度缺口	3,673,556,682.36	4,384,975,380.37	10,650,805.48	29,422,213.64	8,098,605,081.85
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	5,837,626.52	-	-	-	5,837,626.52
结算备付金	3,205,400.95	-	-	-	3,205,400.95
存出保证金	19,616.97	-	-	-	19,616.97
交易性金融资产	975,652,028.25	1,248,834,597.60	166,284,248.10	-	2,390,770,873.95
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
债权投资	1,085,422,111.92	7,491,831,369.65	-	-	8,577,253,481.57
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	2,070,136,784.61	8,740,665,967.25	166,284,248.10	-	10,977,086,999.96
负债					
应付赎回款	-	-	-	-	-

应付管理人报酬	-	-	-	2,066,950.13	2,066,950.13
应付托管费	-	-	-	688,983.35	688,983.35
应付清算款	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	2,848,003,408.78	-	-	-	2,848,003,408.78
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	901,755.42	901,755.42
其他负债	-	-	-	209,839.45	209,839.45
负债总计	2,848,003,408.78	-	-	3,867,528.35	2,851,870,937.13
利率敏感度缺口	-777,866,624.17	8,740,665,967.25	166,284,248.10	-3,867,528.35	8,125,216,062.83

注：上表按金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1.若市场利率平行上升或下降 50 个基点		
	2.其他市场变量保持不变		
	3.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（2024 年 6 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）	
	1. 市场利率平行上升 50 个基点	-9,469,978.23	-12,824,472.71
	2. 市场利率平行下降 50 个基点	9,569,297.79	12,939,875.21

注：非浮动利率的债权投资因市场利率变化对基金净资产的影响不重大，故上表不包括本基金本报告期末所持有的非浮动利率的债权投资。

#### 6.4.13.4.2 其他价格风险

其他价格风险是指以交易性金融资产的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险，该风险可能与特定投资品种相关，也有可能与整体投资品种相关。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，其他价格风险对于本基金的基金净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

本基金本报告期末及上年度末无其他价格风险敞口。

#### 6.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

本基金本报告期末及上年度末无其他价格风险的敏感性分析。

#### 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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	-	-
第二层次	1,722,110,723.83	2,390,770,873.95
第三层次	-	-
合计	1,722,110,723.83	2,390,770,873.95

##### 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。

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。

#### 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

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，除债权投资外，其余金融工具因其剩余期限较短，因此账面价值与公允价值相若。

本期末，本基金持有的债权投资的账面价值为人民币 8,289,854,163.52 元，公允价值为人民币 8,381,544,786.92 元，属于第二层次。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期内无需要说明有助于理解和分析会计报表的其他事项。

## § 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	10,011,964,887.35	99.62
	其中：债券	9,912,576,648.52	98.64
	资产支持证券	99,388,238.83	0.99
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	4,406,075.54	0.04
8	其他各项资产	33,301,352.34	0.33
9	合计	10,049,672,315.23	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

本基金报告期内无买入股票。

### 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

本基金报告期内无卖出股票。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金报告期内无买卖股票。

## 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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	567,267,466.09	7.00
	其中：政策性金融债	10,650,805.48	0.13
4	企业债券	3,478,811,172.45	42.96
5	企业短期融资券	20,501,777.05	0.25
6	中期票据	5,845,996,232.93	72.19
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	9,912,576,648.52	122.40

### 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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	163260	20 海国 02	2,900,000	294,931,876.85	3.64
2	102280275	22 鞍钢集 MTN001	2,500,000	252,002,674.70	3.11
3	102281316	22 奔驰财务 MTN002BC	2,500,000	250,440,099.48	3.09
4	137648	22 安信 C3	2,100,000	213,730,640.10	2.64
5	102380213	23 晋能电力 MTN003	2,000,000	202,060,725.94	2.50

### 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

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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	260252	G 电建 5A	700,000	67,981,636.85	0.84
2	260415	23 电建 A1	100,000	10,254,668.49	0.13
3	260121	G 电建 4A	100,000	9,992,970.29	0.12
4	199495	徐租 5 优 2	110,000	7,317,101.77	0.09
5	143250	金旅 2A2	80,000	3,841,861.43	0.05

### 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

根据本基金合同规定，本基金不参与股指期货交易。

## 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

为有效控制债券投资的系统性风险，本基金根据风险管理的原则，以套期保值为目的，适度运用国债期货，提高投资组合的运作效率。在国债期货投资时，本基金将首先分析国债期货各合约价格与最便宜可交割券的关系，选择定价合理的国债期货合约，其次，考虑国债期货各合约的流动性情况，最终确定与现货组合的合适匹配，以达到风险管理的目标。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1

报告期内基金投资的前十名证券除 22 安信 C3 (证券代码 137648)、22 首钢 MTN003 (证券代码 102281307) 外其他证券的发行主体未有被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

1、22 安信 C3 (证券代码 137648)

根据 2023 年 8 月 25 日发布的相关公告，该证券发行人因未依法履行职责被上海证监局给予警示。

根据 2023 年 12 月 6 日发布的相关公告，该证券发行人因未依法履行职责被北京证券交易所给予警示。

根据 2024 年 1 月 16 日发布的相关公告，该证券发行人因未及时披露公司重大事件被上海证券交易所给予警示。

根据 2024 年 5 月 21 日发布的相关公告，该证券发行人因违规经营被河北证监局给予警示。

2、22 首钢 MTN003 (证券代码 102281307)

根据发布的相关公告，该证券发行人在报告期内因未按期申报税款，多次受到监管机构的处罚。

对上述证券的投资决策程序的说明：本基金投资上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

### 7.12.2

根据基金合同规定，本基金的投资范围不包括股票。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

金额单位：人民币元

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	6,952.34
2	应收清算款	33,294,400.00
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	33,301,352.34

### 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

本基金的固定收益投资采用摊余成本法或市价法进行估值，本报告投资组合报告公允价值和占基金资产净值比例是以各固定收益投资的摊余成本或市值计算所得。

## § 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

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
803	9,870,016.13	7,923,018,549.28	99.97%	2,604,400.27	0.03%

### 8.2 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	78,303.37	0.0010%

### 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	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	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## § 9 重大事件揭示

### 9.1 基金份额持有人大会决议

本报告期未召开基金份额持有人大会。

### 9.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 9.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的重大诉讼事项。

### 9.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略无改变。

### 9.5 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。

### 9.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 9.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，基金管理人没有受到监管部门的稽查或处罚，亦未收到关于基金管理人的高级管理人员受到监管部门的稽查或处罚的书面通知或文件。

#### 9.6.2 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，本基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

## 9.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 9.7.1 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	
渤海证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
华龙证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
华鑫证券	1	-	-	-	-	-
联储证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中信建投 证券	1	-	-	-	-	-

注：本报告期内，基金交易佣金根据券商季度综合评分结果给与分配，券商综合评分根据研究报告质量、路演质量、联合调研质量等维度进行打分，从多家服务券商中选取符合法律规范经营的综合能力靠前的券商给与佣金分配，季度评分和佣金分配分别由专人负责。

### 9.7.2 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	
	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
渤海证券	-	-	-	-	-	-

川财证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华龙证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
联储证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
招商证券	110,191,300.00	100.00%	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-

## 9.8 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	招商恒鑫 30 个月封闭式债券型证券投资基金 2023 年度第一次分红公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-01-10
2	招商基金管理有限公司关于终止北京中期时代基金销售有限公司办理旗下基金销售业务的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-01-18
3	招商基金管理有限公司旗下基金 2023 年第 4 季度报告提示性公告	证券时报及基金管理人网站	2024-01-19
4	招商恒鑫 30 个月封闭式债券型证券投资基金 2023 年第 4 季度报告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-01-19
5	招商恒鑫 30 个月封闭式债券型证券投资基金更新的招募说明书（二零二四年第一号）	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-02-21
6	招商恒鑫 30 个月封闭式债券型证券投资基金基金产品资料概要更新	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-02-21
7	招商基金管理有限公司旗下基金 2023 年年度报告提示性公告	证券时报及基金管理人网站	2024-03-29

8	招商恒鑫 30 个月封闭式债券型证券投资基金 2023 年年度报告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-03-29
9	招商基金管理有限公司旗下基金 2024 年第 1 季度报告提示性公告	证券时报及基金管理人网站	2024-04-19
10	招商恒鑫 30 个月封闭式债券型证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-04-19
11	招商基金管理有限公司关于提醒投资者持续完善身份信息资料的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-05-18
12	招商恒鑫 30 个月封闭式债券型证券投资基金 基金产品资料概要更新	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-06-28

## § 10 备查文件目录

### 10.1 备查文件目录

- 1、中国证券监督管理委员会批准设立招商基金管理有限公司的文件；
- 2、中国证券监督管理委员会批准招商恒鑫 30 个月封闭式债券型证券投资基金设立的文件；
- 3、《招商恒鑫 30 个月封闭式债券型证券投资基金基金合同》；
- 4、《招商恒鑫 30 个月封闭式债券型证券投资基金托管协议》；
- 5、《招商恒鑫 30 个月封闭式债券型证券投资基金招募说明书》；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照。

### 10.2 存放地点

招商基金管理有限公司

地址：深圳市福田区深南大道 7088 号

### 10.3 查阅方式

上述文件可在招商基金管理有限公司互联网站上查阅，或者在营业时间内到招商基金管理有限公司查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人招商基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-887-9555

网址：<http://www.cmfchina.com>

招商基金管理有限公司

2024 年 8 月 30 日