

# 国联恒鑫纯债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:国联基金管理有限公司

基金托管人:南京银行股份有限公司

送出日期:2024 年 08 月 30 日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人南京银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年8月23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01月01日起至2024年06月30日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	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 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	16
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	18
6.3 净资产变动表	19
6.4 报表附注	21
§7 投资组合报告	46
7.1 期末基金资产组合情况	46
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	47
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	47
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	47
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	48
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	48
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	48
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	49
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	49
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	49
7.12 投资组合报告附注	49
§8 基金份额持有人信息	50
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	50
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	50
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	51

§9 开放式基金份额变动.....	51
§10 重大事件揭示.....	52
10.1 基金份额持有人大会决议.....	52
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.....	52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	52
10.4 基金投资策略的改变.....	52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	52
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	52
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	52
10.8 其他重大事件.....	54
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	54
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.....	54
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	54
§12 备查文件目录.....	55
12.1 备查文件目录.....	55
12.2 存放地点.....	55
12.3 查阅方式.....	55

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	国联恒鑫纯债债券型证券投资基金		
基金简称	国联恒鑫纯债		
基金主代码	007560		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2019年08月20日		
基金管理人	国联基金管理有限公司		
基金托管人	南京银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	1,779,140,595.61份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称	国联恒鑫纯债A	国联恒鑫纯债C	国联恒鑫纯债E
下属分级基金的交易代码	007560	007561	018964
报告期末下属分级基金的份额总额	1,774,166,260.38份	4,970,500.54份	3,834.69份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在积极控制风险的基础上，力争长期内实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	<ol style="list-style-type: none"> <li>1、大类资产配置</li> <li>2、债券投资策略 <ol style="list-style-type: none"> <li>(1) 久期管理策略</li> <li>(2) 期限结构配置策略</li> <li>(3) 债券的类别配置策略</li> <li>(4) 骑乘策略</li> <li>(5) 息差策略</li> </ol> </li> <li>3、资产支持证券投资策略</li> </ol>
业绩比较基准	中债综合指数（全价）收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期风险和预期收益低于股票型及混合型基金，高于货币市场基金。

## 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		国联基金管理有限公司	南京银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	曹健	王峰
	联系电话	010-56517000	021-24198808
	电子邮箱	caojian@gfund.com	wangf@njcbtg.com
客户服务电话		400-160-6000; 010-56517299	95302
传真		010-56517001	025-86776189
注册地址		深圳市福田区福田街道岗厦社区金田路3086号大百汇广场31层02-04单元	南京市建邺区江山大街88号
办公地址		北京市东城区安定门外大街208号玖安广场A座11层	南京市建邺区江山大街88号
邮政编码		100011	210019
法定代表人		王瑶	谢宁

注：2024年2月7日，本基金托管人南京银行股份有限公司法定代表人变更为谢宁先生。

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.gfund.com
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	国联基金管理有限公司	北京市东城区安定门外大街208号玖安广场A座11层
会计师事务所	上会会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市静安区威海路755号文新报业大厦25楼

## §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01月01日-2024年06月30日)		
	国联恒鑫纯 债A	国联恒鑫纯 债C	国联恒鑫纯 债E
本期已实现收益	31,759,799.93	51,282.43	100.57
本期利润	49,157,052.29	61,375.48	184.52
加权平均基金份额本期利润	0.0277	0.0208	0.0266
本期加权平均净值利润率	2.60%	1.96%	2.49%
本期基金份额净值增长率	2.63%	2.47%	2.47%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2024年06月30日)		
期末可供分配利润	12,870,255.44	28,248.91	279.90
期末可供分配基金份额利润	0.0073	0.0057	0.0730
期末基金资产净值	1,841,215,221.83	5,149,385.86	4,155.62
期末基金份额净值	1.0378	1.0360	1.0837
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2024年06月30日)		
基金份额累计净值增长率	18.23%	17.10%	3.91%

注：1、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，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、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。

### 3.2 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

##### 国联恒鑫纯债A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.28%	0.01%	0.65%	0.03%	-0.37%	-0.02%
过去三个月	1.35%	0.03%	1.06%	0.07%	0.29%	-0.04%
过去六个月	2.63%	0.03%	2.42%	0.07%	0.21%	-0.04%
过去一年	4.64%	0.03%	3.27%	0.06%	1.37%	-0.03%
过去三年	11.35%	0.05%	6.58%	0.05%	4.77%	0.00%
自基金合同生效起至今	18.23%	0.06%	7.53%	0.06%	10.70%	0.00%

##### 国联恒鑫纯债C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.26%	0.01%	0.65%	0.03%	-0.39%	-0.02%
过去三个月	1.28%	0.03%	1.06%	0.07%	0.22%	-0.04%
过去六个月	2.47%	0.03%	2.42%	0.07%	0.05%	-0.04%
过去一年	4.33%	0.03%	3.27%	0.06%	1.06%	-0.03%
过去三年	10.70%	0.05%	6.58%	0.05%	4.12%	0.00%
自基金合同生效起至今	17.10%	0.06%	7.53%	0.06%	9.57%	0.00%

##### 国联恒鑫纯债E

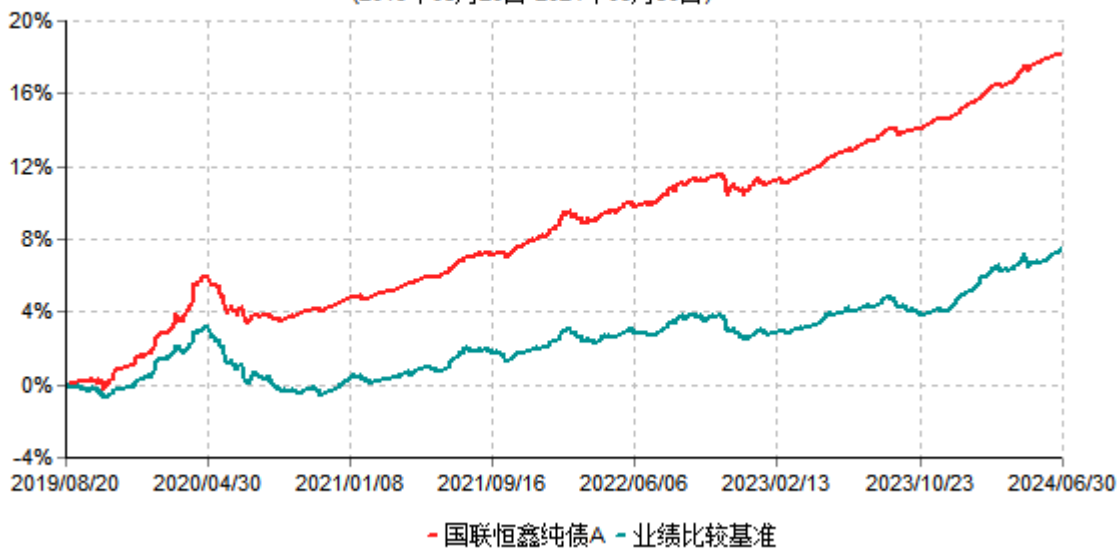
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.27%	0.01%	0.65%	0.03%	-0.38%	-0.02%



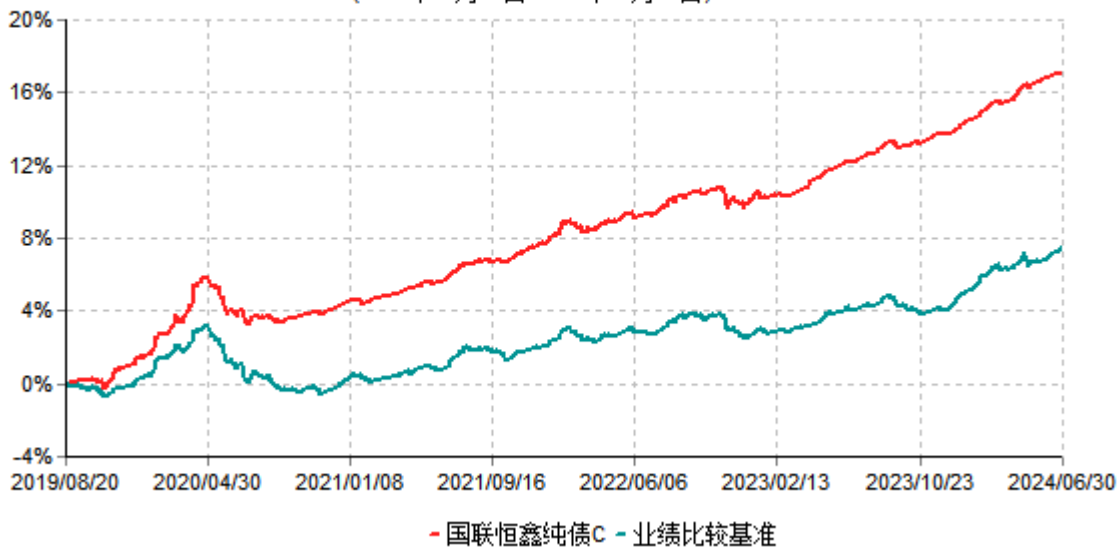
过去三个月	1.27%	0.03%	1.06%	0.07%	0.21%	-0.04%
过去六个月	2.47%	0.03%	2.42%	0.07%	0.05%	-0.04%
自基金合同生效起至今	3.91%	0.03%	3.06%	0.06%	0.85%	-0.03%

### 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

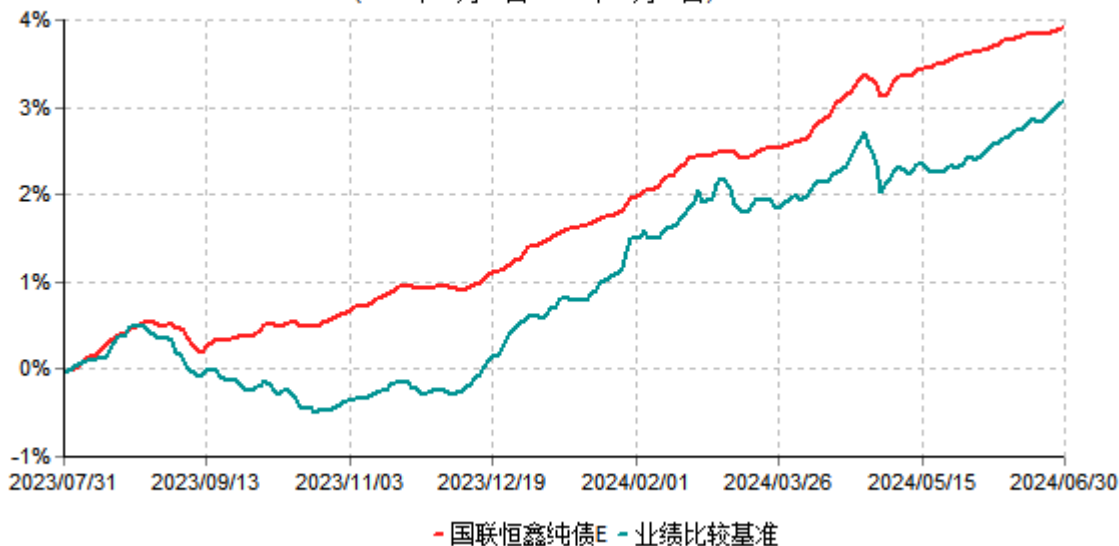
国联恒鑫纯债A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2019年08月20日-2024年06月30日)



国联恒鑫纯债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  
(2019年08月20日-2024年06月30日)



国联恒鑫纯债E累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2023年07月31日-2024年06月30日)



注：按基金合同和招募说明书的约定，本基金自基金合同生效日起6个月内为建仓期，建仓期结束时本基金的各项投资比例符合基金合同的有关约定。自2023年7月28日，本基金增加E类基金份额，自2023年7月31日起E类存在有效基金份额。

## §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

本基金管理人为国联基金管理有限公司，成立于2013年5月31日，由国联证券股份有限公司与上海融晟投资有限公司共同出资，注册资金7.5亿元人民币。截至2024年6月30日，国联基金管理有限公司共管理87只基金，包括国联货币市场基金、国联国企改革灵活配置混合型证券投资基金、国联新机遇灵活配置混合型证券投资基金、国联鑫起点灵活配置混合型证券投资基金、国联国证钢铁行业指数型证券投资基金、国联中证煤炭指数型证券投资基金、国联新经济灵活配置混合型证券投资基金、国联日日盈交易型货币市场基金、国联产业升级灵活配置混合型证券投资基金、国联竞争优势股票型证券投资基金、国联现金增利货币市场基金、国联上海清算所银行间1-3年中高等级信用债指数发起式证券投资基金、国联恒泰纯债债券型证券投资基金、国联鑫思路灵活配置混合型证券投资基金、国联物联网主题灵活配置混合型证券投资基金、国联盈泽中短债债券型证券投资基金、国联恒信纯债债券型证券投资基金、国联睿祥纯债债券型证券投资基金、国联核心成长灵活配置混合型证券投资基金、国联沪港深大消费主题灵活配置混合型发起式证券投资基金、国联鑫价值灵活配置混合型证券投资基金、国联聚商3个月定期开

放债券型发起式证券投资基金、国联季季红定期开放债券型证券投资基金、国联智选红利股票型证券投资基金、国联聚安3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国联医疗健康精选混合型证券投资基金、国联聚业3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国联恒裕纯债债券型证券投资基金、国联聚明3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国联恒惠纯债债券型证券投资基金、国联央视财经50交易型开放式指数证券投资基金、国联央视财经50交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国联策略优选混合型证券投资基金、国联聚汇3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国联恒鑫纯债债券型证券投资基金、国联高股息精选混合型证券投资基金、国联睿享86个月定期开放债券型证券投资基金、国联中证500交易型开放式指数证券投资基金、国联聚通3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国联睿嘉39个月定期开放债券型证券投资基金、国联中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国联恒安纯债债券型证券投资基金、国联智选对冲策略3个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金、国联品牌优选混合型证券投资基金、国联中债1-5年国开行债券指数证券投资基金、国联聚锦一年定期开放债券型发起式证券投资基金、国联融慧双欣一年定期开放债券型证券投资基金、国联价值成长6个月持有期混合型证券投资基金、国联创业板两年定期开放混合型证券投资基金、国联成长优选混合型证券投资基金、国联景瑞一年持有期混合型证券投资基金、国联景颐6个月持有期混合型证券投资基金、国联行业先锋6个月持有期混合型证券投资基金、国联鑫锐研究精选一年持有期混合型证券投资基金、国联景盛一年持有期混合型证券投资基金、国联恒益纯债债券型证券投资基金、国联恒阳纯债债券型证券投资基金、国联低碳经济3个月持有期混合型证券投资基金、国联景泓一年持有期混合型证券投资基金、国联金融鑫选3个月持有期混合型证券投资基金、国联匠心优选混合型证券投资基金、国联添益进取3个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、国联恒利纯债债券型证券投资基金、国联高质量成长混合型证券投资基金、国联景惠混合型证券投资基金、国联聚优一年定期开放债券型发起式证券投资基金、国联恒泽纯债债券型证券投资基金、国联研发创新混合型证券投资基金、国联优势产业混合型证券投资基金、国联医药消费混合型证券投资基金、国联成长先锋一年持有期混合型证券投资基金、国联益海30天滚动持有短债债券型证券投资基金、国联益泓90天滚动持有债券型证券投资基金、国联兴鸿优选混合型证券投资基金、国联恒通纯债债券型证券投资基金、国联融盛双盈债券型证券投资基金、国联养老目标日期2045三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、国联中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金、国联恒润纯债债券型证券投资基金、国联添安稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、国联消费精选混合型证券投资基金、国联融誉双华6个月持有期债券型证券投资基金、国联泓安3个月定期开放债券型证券投资基金、国联中债0-3年政策性金融债指数证券投资基金、国联智选先锋股票型证券投资基金、国联益诚30天持有期债券型发起式证券投资基金、国联利率债债券型证券投资基金。

## 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		
霍顺朝	国联聚安3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国联睿嘉39个月定期开放债券型证券投资基金、国联恒鑫纯债债券型证券投资基金、国联景盛一年持有期混合型证券投资基金、国联恒益纯债债券型证券投资基金、国联聚明3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国联恒利纯债债券型证券投资基金的基金经理。	2023-09-22	-	9	霍顺朝先生，中国国籍，毕业于清华大学经济学专业，研究生、硕士学位，具有基金从业资格，证券从业年限9年。2015年3月至2021年4月历任国融证券股份有限公司研究员、投资主办、投资顾问授权代表；2021年4月至2023年2月任建信理财有限责任公司投资经理。2023年5月加入公司，现任固收投资三部基金经理。

注：（1）上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写；基金合同生效日起即任职，则任职日期为基金合同生效日。

（2）证券基金从业的含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》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

报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项配套法规、基金合同和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，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。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定，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

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，本公司制定了《公平交易管理办法》并严格执行，公司通过建立科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，在研究、决策、交易执行等各环节，通过制度、流程、技术手段等各方面措施确保了公平对待所管理的投资组合，保证公平交易原则的实现。

本报告期内，上述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，未发生不公平的交易事项。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

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

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2024年上半年在各种有利因素的推动下，债券市场走势强劲。其中信用债强于利率债，长期限信用债、中长期限二级资本债受到追捧，市场交易活跃度提升，逐步成为市场的主流品种之一。资产荒背景下，信用利差、期限利差进一步压缩。市场参与机构方中，基金、保险、理财、券商、农商等机构交投活跃。2024年上半年的债券市场可以分为三个阶段：

第一个阶段：年初至3月上旬的收益率下行阶段。主线为“博弈降准降息预期+基本面信息扰动”，期间债市收益率总体下行，利率曲线牛平，30年国债表现占优。降准降息预期主要是因为经济表现不及预期，市场对宽松政策期待较高。1月24日央行意外宣布降准50个基点，虽然短期内打消了市场的降准降息预期，但并没有影响市场的乐观情绪。1月底公布的PMI数据为49.2，继续位于荣枯线以下，基本面的有利因素助推了债券市场的情绪。两会定调2024年的赤字率为3%+1万亿的特别国债，基本符合市场预期，债券市场对于强刺激的担忧减弱，带动了收益率的下行，潘行长提到“目前我国银行业存款准备金率平均在7%，后续仍然有降准空间”则将做多情绪进一步推升，10年国债盘中最低突破2.25%，30年国债盘中最低突破2.4%。

第二阶段：3月中旬到4月底，收益率震荡及调整阶段。主线为“地产宽松预期+超长债供给预期+机构行为扰动”。在3月初收益率下行到阶段性低点后，市场围绕债券收益率水平、债券供给等因素反复开展交易。各地的地方放松政策不断推出，市场围绕放松的力度、节奏、效果等不断地进行交易。两会确定新增的1万亿特别国债，市场也围

绕发行期限、发行时间点等反复交易。央行也在4月下旬提升了长债的风险，央行对于长期利率的提示也增加了市场的波动。

第三阶段：5月-6月，收益率调整后继续下行阶段。主线为“超长债供给落地+手工补息被禁止”。5月13日，超长期特别国债供给节奏落地，总体分22期发行，债市两大利空因素之一落地。4月开始各地陆续放开限购，包括一线城市也逐步放开限购，5月18日央行取消全国层面首套住房和二套住房商业性个人住房贷款利率政策下限。地产政策不断松绑，开始市场尚有定价，但是随着效果逐步被验证，对债券市场的影响越来越小。5月和6月，基本面的恢复也出现了反复，比如中国5月官方制造业PMI49.5，中国4月M1货币供应年率-1.4%，预期1.20%，中国5月M1货币供应年率-4.2%，预期-1.7%，M1连续两个月出现了负增长。4月以来由于“手工补息”被禁止，非银配置资金充裕成为客观现象并延续至6月，资产荒背景下，银行理财、基金等机构配置力量增强，成为本轮行情的主要参与机构。随着6月市场对于央行表态逐渐钝化以及政府债发行暂未放量，非银机构配置资金充裕为债市收益率进一步下行奠定了较好的基础。

整体上来看，利率债方面，1年期国债在从2.08%下行到1.54%，10年期国债从2.56%下行到2.21%，1年期国开从2.2%下行到1.69%，10年期国开从2.68%下行到2.29%。信用债方面，以短融中票为例，1年期AAA信用债从2.52%下行到2.02%，3年期AAA信用债从2.71%下行到2.14%。5年期AAA信用债从2.94%下行到2.26%。

本基金采取相对稳健的配置策略，适当调整组合杠杆、久期，配置上以中高等级信用债和利率债为主。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末国联恒鑫纯债A基金份额净值为1.0378元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为2.63%，同期业绩比较基准收益率为2.42%；截至报告期末国联恒鑫纯债C基金份额净值为1.0360元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为2.47%，同期业绩比较基准收益率为2.42%；截至报告期末国联恒鑫纯债E基金份额净值为1.0837元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为2.47%，同期业绩比较基准收益率为2.42%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，如下几个因素将会影响债券市场的走势：1、宏观经济复苏的情况。目前经济对出口比较依赖，但是欧美的PMI呈下行趋势，出口能否继续支撑仍存疑虑；国内消费则受制于收入、就业预期，扩张程度存疑；地产销售除个别城市外，并未看到显著起色，销售对投资的传导作用更加弱化。经济恢复的成色仍需要验证，如果出现边际走弱可能对债券市场的支撑进一步增强。2、债券的发行节奏。目前特别国债按照节奏发行，地方债的发行节奏偏慢，如果后续地方债的发行出现短期淤积，可能会产生短期的供需不匹配。3、监管机构的指导。今年从4月份开始，央行多次喊话债券市场，提

示债券市场存在的一些风险，如果央行对市场继续进行指导甚至进一步采取行动，则债券市场也面临一定的波动压力。4、机构交易行为。今年市场呈现出非银机构配置资金充裕的局面，非银成为市场相对重要的参与力量，目前基金、券商交易行为明显，都在积极的寻找资本利得来提高投资收益，在利率低位、利差偏低的背景下，容易造成市场的波动增大。总体上看，债券市场面临的一定的机会，但是也可能面临波动增大的局面。

#### 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。本基金管理人制定了基金估值和份额净值计价的业务管理制度，明确基金估值的程序和技术；设立估值委员会，估值委员会成员由具有专业胜任能力和相关工作经历的高级管理人员、投资研究部门、基金运营部门、风险管理部门、法律合规部门人员组成，负责研究、指导基金估值业务，基金经理根据公司制度参加估值委员会会议，但不介入基金日常估值业务；使用可靠的估值业务系统，估值人员熟悉各类投资品种的估值原则及具体估值程序；估值流程中包含风险监测、控制和报告机制。本基金日常估值由基金管理人与基金托管人一同进行，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。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内本基金进行了收益分配，符合法律法规和基金合同约定。2024年06月13日，国联恒鑫纯债A每10份分配0.490元，国联恒鑫纯债C每10份分配0.400元。

## §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

本报告期内，南京银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对国联恒鑫纯债债券型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《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

本报告期内，本托管人根据《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，对本基金的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基

金份额申购赎回价格的计算、利润分配以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

### 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

本报告期内，由国联基金管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

## §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：国联恒鑫纯债债券型证券投资基金

报告截止日：2024年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	7,600,140.78	3,314,514.62
结算备付金		-	-
存出保证金		12,171.28	6,926.55
交易性金融资产	6.4.7.2	1,990,548,365.39	2,332,546,456.17
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		1,782,066,183.36	2,101,652,158.05
资产支持证券投资		208,482,182.03	230,894,298.12
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		22,075.11	20,100.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		1,998,182,752.56	2,335,887,997.34
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024年06月30日</b>	<b>上年度末 2023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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		150,056,646.68	459,578,246.44
应付清算款		-	-
应付赎回款		846,128.22	-
应付管理人报酬		463,240.26	476,125.07
应付托管费		154,413.42	158,708.38
应付销售服务费		1,820.47	62.42
应付投资顾问费		-	-
应交税费		175,879.22	208,803.16
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	115,860.98	196,062.32
负债合计		151,813,989.25	460,618,007.79
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	1,779,140,595.61	1,770,727,785.61
未分配利润	6.4.7.8	67,228,167.70	104,542,203.94
净资产合计		1,846,368,763.31	1,875,269,989.55
负债和净资产总计		1,998,182,752.56	2,335,887,997.34

注：报告截止日2024年06月30日，基金份额总额1,779,140,595.61份，其中A类基金份额的份额总额为1,774,166,260.38份，份额净值1.0378元；C类基金份额的份额总额为4,970,500.54份，份额净值1.0360元；E类基金份额的份额总额为3,834.69份，份额净值1.0837元。

## 6.2 利润表

会计主体：国联恒鑫纯债债券型证券投资基金

本报告期：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024年01月01日至 2024年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至202 3年06月30日
一、营业总收入		58,317,967.23	32,712,366.89
1.利息收入		60,609.02	1,692,640.98
其中：存款利息收入	6.4.7.9	5,196.96	68,310.22
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		55,412.06	1,624,330.76
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-” 填列）		40,848,257.34	24,431,358.88
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-	-
基金投资收益	6.4.7.11	-	-
债券投资收益	6.4.7.12	36,980,961.87	24,205,307.28
资产支持证券投资 收益	6.4.7.13	3,867,295.47	226,051.60
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	-	-
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	17,407,429.36	5,587,301.60
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	1,671.51	1,001,065.43
<b>减：二、营业总支出</b>		9,099,354.94	5,121,544.29
1.管理人报酬		2,830,378.96	1,961,233.24
2.托管费		943,459.67	653,744.40
3.销售服务费		4,548.61	262.58
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		5,071,232.55	2,356,307.33
其中：卖出回购金融资产支出		5,071,232.55	2,356,307.33
6.信用减值损失	6.4.7.19	-	-
7.税金及附加		141,627.55	49,573.88
8.其他费用	6.4.7.20	108,107.60	100,422.86
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		49,218,612.29	27,590,822.60
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		49,218,612.29	27,590,822.60
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		49,218,612.29	27,590,822.60

### 6.3 净资产变动表

会计主体：国联恒鑫纯债债券型证券投资基金

本报告期：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024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	1,770,727,785.61	104,542,203.94	1,875,269,989.55
二、本期期初净资产	1,770,727,785.61	104,542,203.94	1,875,269,989.55

产			
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	8,412,810.00	-37,314,036.24	-28,901,226.24
（一）、综合收益总额	-	49,218,612.29	49,218,612.29
（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）	8,412,810.00	703,111.27	9,115,921.27
其中：1.基金申购款	16,806,046.15	1,184,674.02	17,990,720.17
2.基金赎回款	-8,393,236.15	-481,562.75	-8,874,798.90
（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）	-	-87,235,759.80	-87,235,759.80
四、本期期末净资产	1,779,140,595.61	67,228,167.70	1,846,368,763.31
项目	上年度可比期间		
	2023年01月01日至2023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	372,398,997.94	26,120,961.23	398,519,959.17
二、本期期初净资产	372,398,997.94	26,120,961.23	398,519,959.17
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	1,398,283,543.59	42,449,447.37	1,440,732,990.96
（一）、综合收益总额	-	27,590,822.60	27,590,822.60

(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)	1,398,283,543.59	99,854,219.30	1,498,137,762.89
其中: 1.基金申购款	3,168,229,960.49	232,858,978.00	3,401,088,938.49
2.基金赎回款	-1,769,946,416.90	-133,004,758.70	-1,902,951,175.60
(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)	-	-84,995,594.53	-84,995,594.53
四、本期期末净资产	1,770,682,541.53	68,570,408.60	1,839,252,950.13

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:

王瑶

周妹云

李克

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

国联恒鑫纯债债券型证券投资基金(原名为中融恒鑫纯债债券型证券投资基金,以下简称“本基金”)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[2019]1003号《关于准予中融恒鑫纯债债券型证券投资基金注册的批复》核准,由基金发起人国联基金管理有限公司(原中融基金管理有限公司)依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《中融恒鑫纯债债券型证券投资基金基金合同》(“基金合同”)发起,于2019年8月20日募集成立。本基金的基金管理人为国联基金管理有限公司,基金托管人为南京银行股份有限公司。

根据本基金的基金管理人2023年9月6日发布的《国联基金管理有限公司关于旗下基金更名事宜的公告》本基金自2023年9月8日起更名为国联恒鑫纯债债券型证券投资基金。

本基金募集期为自2019年8月1日至2019年8月15日，本基金为契约型开放式基金，存续期限不定，本基金共募集有效净认购资金200,011,702.23元，折合200,011,702.23份国联恒鑫纯债基金份额(其中：A类基金份额为200,005,579.28份；C类基金份额为6,122.95份)。有效认购资金在募集期间产生的利息为人民币35,554.99元，折合35,554.99份国联恒鑫纯债基金份额(其中：A类基金份额为35,552.71份；C类基金份额为2.28份)，以上收到的实收基金共计人民币200,047,257.22元，折合200,047,257.22份国联恒鑫纯债基金份额(其中：A类基金份额为200,041,131.99份；C类基金份额为6,125.23份)，有效认购户数为342户。按照基金合同的有关约定计入基金份额持有人的基金账户。本基金募集资金经上会会计师事务所(特殊普通合伙)验资。

本基金自2023年7月28日起增加E类基金份额，形成A类、C类和E类三类基金份额并分别设置对应的基金代码，分别计算基金份额净值和基金份额累计净值并单独公告。新增的E类基金份额不收取申购费用，但从本类别基金资产中计提销售服务费，在赎回时根据持有期限收取赎回费用。

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》和基金合同等有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括债券(国债、金融债、公司债、企业债、地方政府债、次级债、可分离交易可转债的纯债部分、短期融资券、超短期融资券、中期票据)、同业存单、货币市场工具、资产支持证券、债券回购、央行票据、银行存款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)。本基金业绩比较基准为：中债综合指数(全价)收益率。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的《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")编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《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》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第3号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《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>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以基金持续经营为基础列报。

#### 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06月30日的财务状况以及2024年半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 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

本基金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

无。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

无。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局国家税务总局财税[1998]55号《关于证券投资基金税收问题的通知》、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[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》、财税[2016]46号文《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号文《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《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号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、国发[1985]19号发布和国务院令[2011]第588号修订的《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例》、国务院令[2005]第448号《国务院关于修改〈征收教育费附加的暂行规定〉的决定》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

1、资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。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。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应

税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

2、对证券投资基金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，暂不缴纳企业所得税。

3、对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴个人所得税，个人从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

4、对基金取得的债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税，暂不缴纳企业所得税。

5、基金卖出股票缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

6、基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价，暂免于缴纳印花税、企业所得税和个人所得税。

7、本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费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06月30日
活期存款	7,600,140.78
等于：本金	7,599,800.58
加：应计利息	340.20
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-



加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	7,600,140.78

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024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	520,025,821.39	4,151,846.61	533,199,846.61	9,022,178.61
	银行间市场	1,208,164,218.74	20,490,236.75	1,248,866,336.75	20,211,881.26
	合计	1,728,190,040.13	24,642,083.36	1,782,066,183.36	29,234,059.87
资产支持证券	206,331,785.94	540,702.03	208,482,182.03	1,609,694.06	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	1,934,521,826.07	25,182,785.39	1,990,548,365.39	30,843,753.93	

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：无。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：无。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

#### 6.4.7.5 其他资产

注：无。

#### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024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	17,053.38
其中：交易所市场	-
银行间市场	17,053.38
应付利息	-
预提费用	98,807.60
合计	115,860.98

#### 6.4.7.7 实收基金

##### 6.4.7.7.1 国联恒鑫纯债A

金额单位：人民币元

项目 (国联恒鑫纯债A)	本期 2024年01月01日至2024年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,770,461,125.38	1,770,461,125.38
本期申购	4,986,089.46	4,986,089.46

本期赎回（以“-”号填列）	-1,280,954.46	-1,280,954.46
本期末	1,774,166,260.38	1,774,166,260.38

#### 6.4.7.7.2 国联恒鑫纯债C

金额单位：人民币元

项目 (国联恒鑫纯债C)	本期 2024年01月01日至2024年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	256,109.96	256,109.96
本期申购	11,812,646.66	11,812,646.66
本期赎回（以“-”号填列）	-7,098,256.08	-7,098,256.08
本期末	4,970,500.54	4,970,500.54

#### 6.4.7.7.3 国联恒鑫纯债E

金额单位：人民币元

项目 (国联恒鑫纯债E)	本期 2024年01月01日至2024年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	10,550.27	10,550.27
本期申购	7,310.03	7,310.03
本期赎回（以“-”号填列）	-14,025.61	-14,025.61
本期末	3,834.69	3,834.69

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.8 未分配利润

##### 6.4.7.8.1 国联恒鑫纯债A

单位：人民币元

项目 (国联恒鑫纯债A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	67,856,892.82	36,671,872.03	104,528,764.85
本期期初	67,856,892.82	36,671,872.03	104,528,764.85
本期利润	31,759,799.93	17,397,252.36	49,157,052.29

本期基金份额交易产生的变动数	198,363.60	109,581.62	307,945.22
其中：基金申购款	236,308.96	148,026.19	384,335.15
基金赎回款	-37,945.36	-38,444.57	-76,389.93
本期已分配利润	-86,944,800.91	-	-86,944,800.91
本期末	12,870,255.44	54,178,706.01	67,048,961.45

#### 6.4.7.8.2 国联恒鑫纯债C

单位：人民币元

项目 (国联恒鑫纯债C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	7,569.51	5,261.59	12,831.10
本期期初	7,569.51	5,261.59	12,831.10
本期利润	51,282.43	10,093.05	61,375.48
本期基金份额交易产生的变动数	260,355.86	135,281.77	395,637.63
其中：基金申购款	458,602.79	341,144.51	799,747.30
基金赎回款	-198,246.93	-205,862.74	-404,109.67
本期已分配利润	-290,958.89	-	-290,958.89
本期末	28,248.91	150,636.41	178,885.32

#### 6.4.7.8.3 国联恒鑫纯债E

单位：人民币元

项目 (国联恒鑫纯债E)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	598.86	9.13	607.99
本期期初	598.86	9.13	607.99
本期利润	100.57	83.95	184.52
本期基金份额交易产生的变动数	-419.53	-52.05	-471.58
其中：基金申购款	520.45	71.12	591.57
基金赎回款	-939.98	-123.17	-1,063.15

本期已分配利润	-	-	-
本期末	279.90	41.03	320.93

### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年01月01日至2024年06月30日	
活期存款利息收入	4,317.19	
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	792.46	
其他	87.31	
合计	5,196.96	

### 6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

注：无。

### 6.4.7.11 基金投资收益

注：无。

### 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01月01日至2024年06月30日	
债券投资收益——利息收入	38,805,641.06	
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-1,824,679.19	
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	36,980,961.87	

#### 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01月01日至2024年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,228,136,212.57
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,198,496,242.32
减：应计利息总额	31,459,799.44
减：交易费用	4,850.00
买卖债券差价收入	-1,824,679.19

#### 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01月01日至2024年06月30日
资产支持证券投资收益——利息收入	3,874,667.51
资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入	-7,372.04
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	3,867,295.47

##### 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01月01日至2024年06月30日
----	-------------------------------

卖出资产支持证券成交总额	128,818,256.15
减：卖出资产支持证券成本总额	126,579,267.31
减：应计利息总额	2,246,360.88
减：交易费用	-
资产支持证券投资收益	-7,372.04

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

注：无。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

注：无。

#### 6.4.7.16 股利收益

注：无。

#### 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01月01日至2024年06月30日
1.交易性金融资产	17,407,429.36
——股票投资	-
——债券投资	16,054,350.55
——资产支持证券投资	1,353,078.81
——基金投资	-
——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	17,407,429.36

**6.4.7.18 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
基金赎回费收入	1,668.29
转换费收入	3.22
合计	1,671.51

**6.4.7.19 信用减值损失**

注：无。

**6.4.7.20 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
审计费用	29,835.26
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	108,107.60

**6.4.7.21 分部报告**

无。

**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**

无。

**6.4.8.2 资产负债表日后事项**



截至财务报表批准日，本基金于2024年8月23日进行了收益分配，A类份额每10份基金份额分配0.19元，C类份额每10份基金份额分配0.17元，E类份额不参与此次收益分配。

## 6.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方无发生变化的情况。

### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
国联基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
南京银行股份有限公司	基金托管人
国联证券股份有限公司	基金管理人股东
上海融晟投资有限公司	基金管理人股东
国联（北京）资产管理有限公司	基金管理人子公司

注：以下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

注：无。

#### 6.4.10.1.2 权证交易

注：无。

#### 6.4.10.1.3 债券交易

注：无。

#### 6.4.10.1.4 债券回购交易

注：无。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：无。

### 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01月01日至20 24年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至20 23年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,830,378.96	1,961,233.24
其中：应支付销售机构的客户维护费	3,358.06	397.63
应支付基金管理人的净管理费	2,827,020.90	1,960,835.61

注：①支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值的年费率计提，每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.30%/当年天数。

②客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

## 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024 年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	943,459.67	653,744.40

注：①支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值的年费率计提，每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值×0.10%/当年天数。

## 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售 服务费的 各关联方 名称	本期 2024年01月01日至2024年06月30日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	国联恒鑫纯债A	国联恒鑫纯债C	国联恒鑫纯债E	合计
国联基金 管理有限	-	-	10.52	10.52

公司				
合计	-	-	10.52	10.52
获得销售 服务费的 各关联方 名称	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	国联恒鑫纯债A	国联恒鑫纯债C	国联恒鑫纯债E	合计
国联基金 管理有限 公司	-	-	-	-
合计	-	-	-	-

注：本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类、E类份额的销售服务费年费率为0.30%。

销售服务费计提的计算公式如下：

$H = E \times 0.30\% / \text{当年天数}$

H为该类基金份额每日应计提的销售服务费

E为该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

单位：人民币元

上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日						
银行 间市 场交 易的 各关 联方 名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
国联 证券 股份 有限 公司	-	9,898,090.00	-	-	-	-

**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**

注：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**

注：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 2024年01月01日至2024年06月30日		上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
南京银行股份有限公司	7,600,140.78	4,317.19	423,046.25	66,792.51

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，按银行同业利率计息。本基金用于证券交易结算的资金通过托管人托管结算资金专用存款账户转存于中国证券登记结算有限责任公司，按银行同业利率计息。

**6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

注：无

**6.4.10.7 其他关联交易事项的说明**

无

**6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金**

国联恒鑫纯债A

单位：人民币元

序号	权益登记日	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	2024-06-13	2024-06-13	0.490	86,930,345.48	14,455.43	86,944,800.91	-
合计			0.490	86,930,345.48	14,455.43	86,944,800.91	-

## 国联恒鑫纯债C

单位：人民币元

序号	权益 登记日	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	2024-0 6-13	2024-06-1 3	0.400	249,642.4 5	41,316.44	290,958.8 9	-
合计			0.400	249,642.4 5	41,316.44	290,958.8 9	-

**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**

注：无。

**6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

注：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**

截至本报告期末2024年06月30日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额是150,056,646.68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
102101574	21华能MTN00 1(可持续挂钩)	2024-07-03	102.73	100,000	10,273,000.00
102103021	21南京地铁MT N003	2024-07-01	102.38	590,000	60,404,200.00
102103021	21南京地铁MT N003	2024-07-03	102.38	390,000	39,928,200.00
102103096	21华能MTN00 2(可持续挂钩)	2024-07-03	102.27	500,000	51,135,000.00
合计				1,580,000	161,740,400.00

**6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

无。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金的基金管理人实行全面、系统的风险管理，风险管理覆盖公司所有战略环节、业务环节和操作环节，构建了分工明确、相互协作、彼此牵制的风险管理组织结构，形成了由四大防线共同筑成的风险管理体系。本基金管理人的各个业务部门为第一道防线，各业务部门总监作为风险责任人，负责制订本部门的作业流程以及风险控制措施；公司专属风险管理部门法律合规部和风险管理部为第二道防线，负责对公司业务的法律合规风险、投资管理风险和运作风险进行监控管理；公司经营管理层和公司内控及风险管理委员会为第三道防线，负责对风险状况进行全面监督并及时制定相应的对策和实施监控措施；董事会下属的风险与合规委员会为第四道防线，负责审查公司对公司内外部风险识别、评估和分析等情况，及公司内部控制、风险管理政策、风险管理制度的执行情况等。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。信用等级评估以内部信用评级为主，外部信用评级为辅。此外，本基金的基金管理人根据信用产品的信用评级，通过单只信用产品投资占基金资产净值的比例及占发行量的比例进行控制，通过分散化投资以分散信用风险。

按信用评级列示的债券、资产支持证券和同业存单的投资情况如下表所示，如无表格，则本基金于本报告期末及上年度末未持有除国债、地方政府债、政策性金融债、央行票据以外的债券。

#### 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06月30日	上年度末 2023年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	20,437,888.52	20,085,630.60
合计	20,437,888.52	20,085,630.60

注：短期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由债券发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。以上按短期信用评级的债券投资中包含超短期融资券等，不包含国债、地方政府债、政策性金融债、央行票据。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	32,076,979.42	57,387,707.70
合计	32,076,979.42	57,387,707.70

注：无。

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

#### 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06月30日	上年度末 2023年12月31日
--------	--------------------	---------------------

AAA	694,202,890.20	1,109,790,777.62
AAA以下	42,664,568.31	146,246,284.16
未评级	923,986,800.81	723,508,624.13
合计	1,660,854,259.32	1,979,545,685.91

注：长期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由债券发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。以上按长期信用评级的债券投资中不包含国债、地方政府债、政策性金融债、央行票据。

#### 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06月30日	上年度末 2023年12月31日
AAA	176,405,202.61	173,506,590.42
AAA以下	-	-
未评级	-	-
合计	176,405,202.61	173,506,590.42

注：资产支持证券的基础资产均为长周期资产，故全部归入本表分类予以列示。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

#### 6.4.13.3 流动性风险

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。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，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。

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的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》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度流动性受限资产比例、基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基



金的基金管理人在基金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，有效保障基金持有人利益。

本基金主要投资于上市交易的证券，除在附注6.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），其余均能及时变现。此外，本基金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，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。除附注6.4.12.3中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在1个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合约约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 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

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时关于未来现金流的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年0 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	7,600,140.78	-	-	-	7,600,140.78
存出保证金	12,171.28	-	-	-	12,171.28
交易性金融资产	826,925,234.86	1,021,642,893.37	141,980,237.16	-	1,990,548,365.39
应收申	-	-	-	22,075.11	22,075.11

购款					
资产总计	834,537,546.92	1,021,642,893.37	141,980,237.16	22,075.11	1,998,182,752.56
负债					
卖出回购金融资产款	150,056,646.68	-	-	-	150,056,646.68
应付赎回款	-	-	-	846,128.22	846,128.22
应付管理人报酬	-	-	-	463,240.26	463,240.26
应付托管费	-	-	-	154,413.42	154,413.42
应付销售服务费	-	-	-	1,820.47	1,820.47
应交税费	-	-	-	175,879.22	175,879.22
其他负债	-	-	-	115,860.98	115,860.98
负债总计	150,056,646.68	-	-	1,757,342.57	151,813,989.25
利率敏感度缺口	684,480,900.24	1,021,642,893.37	141,980,237.16	-1,735,267.46	1,846,368,763.31
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	3,314,514.62	-	-	-	3,314,514.62
存出保证金	6,926.55	-	-	-	6,926.55
交易性	1,061,780,225.62	1,044,265,585.96	226,500,644.59	-	2,332,546,456.17

金融资产					
应收申购款	-	-	-	20,100.00	20,100.00
资产总计	1,065,101,666.79	1,044,265,585.96	226,500,644.59	20,100.00	2,335,887,997.34
负债					
卖出回购金融资产款	459,578,246.44	-	-	-	459,578,246.44
应付管理人报酬	-	-	-	476,125.07	476,125.07
应付托管费	-	-	-	158,708.38	158,708.38
应付销售服务费	-	-	-	62.42	62.42
应交税费	-	-	-	208,803.16	208,803.16
其他负债	-	-	-	196,062.32	196,062.32
负债总计	459,578,246.44	-	-	1,039,761.35	460,618,007.79
利率敏感度缺口	605,523,420.35	1,044,265,585.96	226,500,644.59	-1,019,661.35	1,875,269,989.55

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	假定所有期限的利率均以相同幅度变动25个基点，其他变量不变；	
假设	其他市场变量保持不变；	
假设	此项影响并未考虑管理层为减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 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
	市场利率下降25个基点	6,886,557.25	7,109,335.96
	市场利率上升25个基点	-6,830,316.33	-7,050,766.83

注：利率风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的情况下，利率发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值可参考的公允价值产生的影响。

#### 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，无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场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，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定，因此无重大其他价格风险。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日		上年度末 2023年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	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	1,782,066,183.36	96.52	2,101,652,158.05	112.07
交易性金融资产—贵金属投	-	-	-	-

资				
衍生金融资产 —权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	230,894,298.12	12.31
合计	1,782,066,183.36	96.52	2,332,546,456.17	124.38

注：其他包括资产支持证券投资。

## 6.4.14 公允价值

### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

本基金以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债，其公允价值计量基于公允价值的输入值的可观察程度以及该等输入值对公允价值计量整体的重要性，被划分为三个层次：

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。

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。

第三层次输入值是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06月30日	上年度末 2023年12月31日
第一层次	-	-
第二层次	1,990,548,365.39	2,332,546,456.17
第三层次	-	-
合计	1,990,548,365.39	2,332,546,456.17

#### 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。

对于公开市场交易的证券、基金等投资，若出现交易不活跃（包括重大事项停牌、境内股票涨跌停等导致的交易不活跃）和非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允

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，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

基金本报告期末及上年度末均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，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## §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	1,990,548,365.39	99.62
	其中：债券	1,782,066,183.36	89.18
	资产支持证券	208,482,182.03	10.43
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	7,600,140.78	0.38
8	其他各项资产	34,246.39	0.00
9	合计	1,998,182,752.56	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

注：本基金本报告期末未持有境内股票。

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股股票。

## 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

注：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

注：本基金本报告期无股票累计买入金额。

### 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

注：本基金本报告期无股票累计卖出金额。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

注：本基金本报告期无股票累计买入、卖出金额。

## 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	100,774,035.52	5.46
	其中：政策性金融债	100,774,035.52	5.46
4	企业债券	704,701,801.69	38.17
5	企业短期融资券	20,437,888.52	1.11
6	中期票据	956,152,457.63	51.79
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-

9	其他	-	-
10	合计	1,782,066,183.36	96.52

### 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	102101826	21中建材集MTN001	1,800,000	184,976,852.46	10.02
2	102103021	21南京地铁MTN003	1,000,000	102,381,125.68	5.54
3	102383252	23青岛城投MTN003	900,000	93,840,009.84	5.08
4	240556	24山钢01	900,000	91,691,171.51	4.97
5	240401	24农发01	900,000	90,608,311.48	4.91

### 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	占基金资产净值比例（%）
1	261593	24新9A2	470,000	47,582,066.03	2.58
2	199991	23领航22	500,000	42,512,462.03	2.30
3	143844	23惠民3A	500,000	35,540,765.81	1.92
4	144195	融通优A1	448,000	28,807,558.25	1.56
5	199716	23鑫荣4A	400,000	17,422,115.86	0.94
6	260553	恒信70A2	120,000	12,090,302.47	0.65
7	262368	德银02A1	110,000	11,007,052.05	0.60
8	260094	泰供水03	60,000	6,185,046.58	0.33
9	260093	泰供水02	40,000	4,065,391.78	0.22
10	260383	焜皓4A2	350,000	1,962,265.01	0.11
11	260092	泰供水01	50,000	1,307,156.16	0.07

### 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



注：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

注：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

无

### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 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青岛国信发展(集团)有限责任公司外其他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。国家外汇管理局青岛市分局2023年11月28日发布对青岛国信发展(集团)有限责任公司的处罚(青汇罚决字[2023]12号)。前述发行主体受到的处罚未影响其正常业务运作，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规定。**

**7.12.2 基金投资的前十名股票未超过基金合同规定的备选库股票。**

### 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	12,171.28
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	22,075.11
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	34,246.39

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：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

注：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，各比例的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
国联恒鑫纯债A	348	5,098,178.91	1,769,910,572.89	99.76%	4,255,687.49	0.24%
国联恒鑫纯债C	285	17,440.35	-	0.00%	4,970,500.54	100.00%
国联恒鑫纯债E	4	958.67	-	0.00%	3,834.69	100.00%
合计	637	2,792,999.37	1,769,910,572.89	99.48%	9,230,022.72	0.52%

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比 例
基金管理人所有从业人员持有本基金	国联恒鑫纯债A	305.18	0.00%
	国联恒鑫纯债C	54.02	0.00%
	国联恒鑫纯债E	3,825.41	99.76%
	合计	4,184.61	0.00%

### 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

- 注：1、本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金；  
2、本基金基金经理未持有本开放式基金。

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

	国联恒鑫纯债A	国联恒鑫纯债C	国联恒鑫纯债E
基金合同生效日(2019年08月20日)基金份额总额	200,041,131.99	6,125.23	-
本报告期期初基金份额总额	1,770,461,125.38	256,109.96	10,550.27
本报告期基金总申购份额	4,986,089.46	11,812,646.66	7,310.03
减：本报告期基金总赎回份额	1,280,954.46	7,098,256.08	14,025.61
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,774,166,260.38	4,970,500.54	3,834.69

注：申购含红利再投、转换入份额及金额，赎回含转换出份额及金额。

## §10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开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

#### (1) 基金管理人的重大人事变动情况

本基金管理人于2024年4月10日发布公告，国联基金管理有限公司副总裁曹健先生转任公司督察长、公司督察长周妹云女士转任公司副总裁、刘鲁旦先生担任公司副总裁、马荣荣女士担任公司副总裁。

#### (2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

2024年2月7日，本基金托管人南京银行股份有限公司法定代表人变更为谢宁先生。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 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

本报告期内，为本基金进行审计的会计师事务所为上会会计师事务所（特殊普通合伙），本报告期内未变更为其提供审计服务的会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内管理人及其高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商	交	股票交易	应支付该券商的佣金	备

名称	易单元数量	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	注
东方财富证券	2	-	-	-	-	-
五矿证券	2	-	-	-	-	-

注：①为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即：

i 经营行为规范，在近一年内无重大违规行为。

ii 公司财务状况良好。

iii 有良好的内控制度，在业内有良好的声誉。

iv 有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告。

v 建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯和服务。

②券商专用交易单元选择程序：

i 对交易单元候选券商的研究服务进行评估

本基金管理人组织相关人员依据交易单元选择标准对交易单元候选券商的服务质量和研究实力进行评估，确定选用交易单元的券商。

ii 协议签署及通知托管人

本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	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
东方财富证券	44,813,440.00	35.90%	-	-	-	-	-	-

五矿证券	80,000,000.00	64.10%	-	-	-	-	-	-
------	---------------	--------	---	---	---	---	---	---

### 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	国联基金管理有限公司关于办公地址名称变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024-01-12
2	国联基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会指定报刊及网站	2024-04-10
3	国联基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会指定报刊及网站	2024-04-10
4	关于提高国联恒鑫纯债债券型证券投资基金E类份额净值精度的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024-04-12
5	国联恒鑫纯债债券型证券投资基金2024年第一次分红公告	中国证监会指定报刊及网站	2024-06-13

### §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	20240101-20240630	1,769,910,572.89	0.00	0.00	1,769,910,572.89	99.48%

#### 产品特有风险

本基金存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况，该类投资者大额赎回所持有的基金份额时，将可能产生流动性风险，即基金资产不能迅速变现，或者未能以合理的价格变现基金资产以支付投资者赎回款，对资产净值产生不利影响。

当开放式基金发生巨额赎回，基金管理人认为基金组合资产变现能力有限或认为因应对赎回导致的资产变现对基金单位份额净值产生较大的波动时，为了切实保护存量基金份额持有人的合法权益，可能出现延期支付赎回款等情形。同时为了公平对待所有投资者合法权益不受损害，管理人有权根据基金合同和招募说明书的约定，暂停或者拒绝申购、暂停赎回，基金份额持有人存在可能无法及时赎回持有的全部基金份额的风险。

#### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

2024年2月7日，本基金托管人南京银行股份有限公司法定代表人变更为谢宁先生。

## §12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会准予中融恒鑫纯债债券型证券投资基金注册的批复文件
- (2) 《国联恒鑫纯债债券型证券投资基金基金合同》
- (3) 《国联恒鑫纯债债券型证券投资基金托管协议》
- (4) 关于申请募集注册中融恒鑫纯债债券型证券投资基金之法律意见书
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照
- (6) 基金托管人业务资格批件、营业执照
- (7) 中国证监会要求的其他文件

### 12.2 存放地点

基金管理人或基金托管人的住所。

### 12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可在支付工本费后，在合理时间取得上述文件的复印件。

咨询电话：国联基金管理有限公司客户服务电话400-160-6000, (010) 56517299。

网址：<http://www.glfund.com/>

国联基金管理有限公司  
二〇二四年八月三十日