

# 长江收益增强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:长江证券(上海)资产管理有限公司

基金托管人:交通银行股份有限公司

报告送出日期: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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年08月26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

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>1</b>
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
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	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>8</b>
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	10
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	12

<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 .....	12
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 .....	12
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 .....	13
<b>§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)</b> .....	<b>13</b>
6.1 资产负债表 .....	13
6.2 利润表 .....	15
6.3 净资产变动表 .....	16
6.4 报表附注 .....	18
<b>§ 7 投资组合报告</b> .....	<b>37</b>
7.1 期末基金资产组合情况 .....	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	37
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 .....	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	40
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	41
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 .....	42
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 .....	42
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 .....	42
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 .....	42
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	42
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	42
7.12 投资组合报告附注 .....	43

<b>§ 8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>45</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	45
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	45
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 .....	46
<b>§ 9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>46</b>
<b>§ 10 重大事件揭示</b> .....	<b>46</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	46
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 .....	46
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	46
10.4 基金投资策略的改变 .....	46
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	47
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 .....	47
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	47
10.8 其他重大事件 .....	48
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>49</b>
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 .....	49
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	50
<b>§ 12 备查文件目录</b> .....	<b>50</b>
12.1 备查文件目录 .....	50
12.2 存放地点 .....	50
12.3 查阅方式 .....	50

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	长江收益增强债券型证券投资基金
基金简称	长江收益增强债券
基金主代码	003336
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 10 月 17 日
基金管理人	长江证券（上海）资产管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	157,747,685.25 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于固定收益类金融工具，适度参与权益类品种投资，在追求本金安全和保持资产流动性的基础上，力争实现资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金主要投资于固定收益类金融工具，在充分考虑基金资产的安全性基础上，把握相对确定的股票投资机会，在严格控制风险的前提下力争实现资产的稳定增值。
业绩比较基准	中国债券综合财富指数收益率×90%+沪深 300 指数收益率×10%
风险收益特征	本基金为债券型证券投资基金，属于较低预期收益、较低预期风险的证券投资基金品种，其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		长江证券（上海）资产管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	高杨	陆志俊
	联系电话	4001-166-866	95559
	电子邮箱	zgxxpl@cjsc.com.cn	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		4001-166-866	95559
传真		021-65779500	021-62701216
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 1198 号世纪汇一座 27 层	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号

办公地址	上海市虹口区新建路 200 号 国华金融中心 B 栋 19 层	中国（上海）长宁区仙霞路 18 号
邮政编码	200080	200336
法定代表人	杨忠	任德奇

注：自 2024 年 8 月 1 日起，基金管理人长江证券（上海）资产管理有限公司办公地址变更为上海市虹口区新建路 200 号国华金融中心 B 栋 19 层。

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.cjzcg1.com
基金中期报告备置地点	上海市虹口区新建路 200 号国华金融中心 B 栋 19 层

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	长江证券（上海）资产管理有限公司	上海市虹口区新建路 200 号国华金融中心 B 栋 19 层

## § 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）
本期已实现收益	-296,013.36
本期利润	2,504,496.91
加权平均基金份额本期利润	0.0152
本期加权平均净值利润率	1.23%
本期基金份额净值增长率	1.25%
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	35,929,261.34
期末可供分配基金份额利润	0.2278
期末基金资产净值	196,526,754.71
期末基金份额净值	1.2458
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	30.40%

注：（1）本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用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。(2) 期末可供分配利润采用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) 表中的“期末”均指报告期最后一日，即 6 月 30 日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。(4) 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。

### 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	-0.72%	0.20%	0.44%	0.05%	-1.16%	0.15%
过去三个月	0.74%	0.21%	1.36%	0.08%	-0.62%	0.13%
过去六个月	1.25%	0.29%	3.52%	0.09%	-2.27%	0.20%
过去一年	-0.99%	0.25%	4.32%	0.09%	-5.31%	0.16%
过去三年	1.08%	0.25%	9.71%	0.11%	-8.63%	0.14%
自基金合同生效起至今	30.40%	0.27%	33.53%	0.12%	-3.13%	0.15%

注：(1) 本基金的业绩比较基准为中国债券综合财富指数收益率×90%+沪深 300 指数收益率×10%；(2) 本基金基金合同生效日为 2016 年 10 月 17 日。

#### 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

长江收益增强债券型证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2016年10月17日-2024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

长江证券（上海）资产管理有限公司于 2014 年 9 月 16 日正式成立，是长江证券股份有限公司旗下专门从事证券资产管理、公开募集证券投资基金管理业务的全资子公司。注册地上海，注册资本 23 亿元人民币。

公司秉承“专业至臻，追求卓越”的理念，致力于为广大投资者创造稳定而丰厚的回报。公司以“客户导向、研究驱动、技术领先、内控先行”为业务发展策略，全方位参与客户资产配置和资产增值全过程，通过深度挖掘客户的投融资需求，紧跟市场创新步伐，以满足客户差异化需求。在严格控制风险的前提下，挑选优质投资品种，丰富创新产品架构，为客户提供多元化资产配置方案。

截至本报告期末，本基金管理人管理的基金有长江收益增强债券型证券投资基金、长江乐享货币市场基金、长江乐丰纯债定期开放债券型发起式证券投资基金、长江乐盈定期开放债券型发起式证券投资基金、长江乐越定期开放债券型发起式证券投资基金、长江乐鑫纯债定期开放债券型发起式证券投资基金、长江可转债债券型证券投资基金、长江安盈中短债六个月定期开放债券型证券投资基金、长江添利混合型证券投资基金、长江安享纯债 18 个月定期开放债券型证券投资基金、长江均衡成长混合型发起式证券投资基金、长江量化消费精选股票型发起式证券投资基金、长江新能源产业混合型发起式证券投资基金、长江沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金、长江双盈 6 个月持有期债券型发起式证券投资基金、长江红利回报混合型发起式证券投资基金、长江致惠 30 天滚动持有短债债券型发起式证券投资基金、长江鑫选 3 个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、长江智能制造混合型发起式证券投资基金、长江丰瑞 3 个月持有期债券型证券投资基金、长江新兴产业混合型发起式证券投资基金、长江启航混合型发起式证券投资基金、长江惠盈 9 个月持有期债券型发起式证券投资基金、长江时代精选混合型发起式证券投资基金、长江楚财一年持有期混合型发起式证券投资基金、长江乐睿纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金、长江长扬混合型发起式证券投资基金、长江长宏混合型发起式证券投资基金、长江安悦利率债债券型证券投资基金、长江 90 天持有期债券型证券投资基金、长江汇智量化选股混合型发起式证券投资基金、长江尊利债券型证券投资基金、长江智选 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）、长江聚利债券型证券投资基金、长江货币管家货币市场基金。

#### 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	说明
----	----	---------------------	----------	----

		任职日期	离任日期	年限	
漆志伟	基金经理	2016-10-17	-	15 年	国籍：中国。硕士研究生，具备基金从业资格。曾任东兴证券股份有限公司客服经理、华农财产保险股份有限公司投资经理。现任长江证券（上海）资产管理有限公司公募固定收益投资部总经理，长江收益增强债券型证券投资基金、长江乐盈定期开放债券型发起式证券投资基金、长江乐鑫定期开放债券型发起式证券投资基金、长江可转债债券型证券投资基金、长江安盈中短债六个月定期开放债券型证券投资基金、长江添利混合型证券投资基金、长江致惠 30 天滚动持有短债债券型发起式证券投资基金、长江丰瑞 3 个月持有期债券型证券投资基金、长江 90 天持有期债券型证券投资基金的基金经理。

注：（1）此处的任职日期、离职日期均指公司做出决定之日，若该基金经理自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）证券从业的含义遵从中国证监会《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合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等有关法律法规的规定，严格遵守基金合同和招募说明书约定，本着诚实信用、勤勉尽责、最大限度保护投资人合法权益等原则管理和运用基金资产，在控制风险的基础上为持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作合法合规，未发生损害基金份额持有人利益的行为，未发生内幕交易、操纵市场和不当关联交易及其他违规行为，信息披露及时、准确、完整，本基金与本基金管理人管理的其他基金资产、投资组合与公司资产之间严格分开、公平对待，基金管理保持独立运作，并通过科学决策、规范运作、精心管理和健全内控体系，有效保障投资人的合法权益。

### 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

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的相关规定，通过严格的内部风险控制制度和流程，对各环节的投资风险和管理风险进行有效控制，确保公平对待所管理的所有基金和投资组合，切实防范利益输送行为。

##### （一）本基金管理人所管理的基金或组合间同向交易价差分析

根据证监会公平交易指导意见，我们计算了公司旗下基金、组合同日同向交易记录配对。通过对这些配对的交易价差分析，我们发现有效配对溢价率均值大部分在 1%数量级及以下，且大部分溢价率均值通过 95%置信度下等于 0 的 t 检验。

##### （二）扩展时间窗口下的价差分析

本基金管理人选取 T=3 和 T=5 作为扩展时间窗口，将基金或组合交易情况分别在这两个时间窗口内作平均，并以此为依据，进行基金或组合间在扩展时间窗口中的同向交易价差分析。对于有足够多观测样本的基金配对（样本数=30），溢价率均值大部分在 1%数量级及以下。

##### （三）基金或组合间模拟溢价金额分析

对于不能通过溢价率均值为零的 t 检验的基金组合配对、对于在时间窗口中溢价率均值过大的基金组合配对，已要求基金经理对价差作出了解释，根据基金经理解释公司旗下基金或组合间没有可能导致不公平交易和利益输送的行为。

本报告期内，未出现违反公平交易制度的情况，公司旗下各基金不存在因非公平交易等导致的利益输送行为，公平交易制度的整体执行情况良好。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金与本基金管理人所管理的其他投资组合未发生大额同日反向交易。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

回顾上半年，我们可以看到宏观经济在地产周期长期拐点已现的背景下，地产相关产业链条较难如以往几轮短周期成为复苏的正向驱动，同时基建投资增速上半年受制于财政支出节奏偏慢而并未提速，制造业投资同比增速明显高于去年，特别在外需、新产业、大规模设备更新方面的投资均快于整体投资增速，成为了稳增长的重要支撑力量。从央行的态度来看，上半年央行对于降准降息政策较为审慎，仅在一月份进行过一次降准，降息则并未出现，可能是在美联储降息时点不断推迟的背景下需要稳定人民币汇率所致。财政政策基调则相对积极，但地方政府在落地时面临一定困难，导致上半年的地方财政支出增速偏低。

从资本市场表现上看，上半年债市在总需求相对供给不足的大背景下走势强劲，各期限收益率水平都有较为明显的下行，同时，期限利差和信用利差进一步缩窄至历史较低水平。长端和超长端利率债收益率刷新历史低点，信用债尤其是城投债在“化债”的大背景下也形成了“资产荒”效应，信用利差急剧压缩。权益市场方面，红利资产表现持续性较强，海外映射相关板块也有较为亮眼的表现，但内需相关品种表现不佳。

报告期内，本基金在债券配置上仍然保持了利率债和高等级信用债为主的配置思路，适度拉长了组合久期，加大了对超长端利率债的配置比例，整体使组合呈现“哑铃”型结构；在股票配置上，仍然保持相对积极的仓位，行业上相对均衡，虽然对净值表现有所拖累，但目前组合所配置品种估值均较为合理，甚至不少个股从低 PE 向低 PB 转变，基金经理仍倾向于认为市场情绪在未来即将迎来拐点，有望通过估值提升带动全市场的风险偏好转暖，从而提高产品权益部分的收益；可转债方面，上半年主要配置于银行品种，获取了不错的投资收益，6 月以后转债市场因信用风险事件出现大幅度调整，我们认为是较好的配置机会，希望通过提高转债的配置比例来提升组合收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 1.2458 元。本报告期内，基金份额净值增长率为 1.25%，同期业绩比较基准收益率为 3.52%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在决策当局提出高质量发展的要求下，政策维持多维度平稳发力，强刺激概率不高。海外方面，美联储降息预期相对飘忽，美国大选的不确定性增大，地缘政治格局多变，“黑天鹅”和“灰犀牛”事件发生的概率在加大，对我国的影响不容小觑，也对我国的对外开放水平和抗风险能力提出了更高的要求。

展望下半年的债券市场，“资产荒”或将延续，但其背后所反映的供需失衡程度或不会超过上半年，主要是因为政府债的发行量一般会在三季度开始明显提速；其次从机构的季节性投资行为来看，上半年受“早配早收益”思想影响会加大配置力度，但下半年在年度业绩考核和“落袋为安”的心理作用下配置意愿或将边际下降。在这样的经济环境和政策思路下，我们认为债市胜率仍在，但赔率或相对有限，预计利率中枢可能小幅下移，长期限债券波动加大，主要会受到来自政策和供给的扰动。权益市场方面，我们倾向于认为下半年可能对目前极低的风险偏好给出修正，触发因素有可能是国内内需刺激政策的进一步加大，也有可能是美联储降息甚至是某些产业的技术突破。在行业上我们比较看好涉及高端制造和自主可控的板块，在风格上仍然重点关注成长性较好的品种和低估值板块两头。

#### 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，本基金管理人严格按照《企业会计准则》、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金持有的投资品种进行估值，本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

根据中国证券监督管理委员会《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》和中国证券业协会基金估值工作小组《关于停牌股票估值的参考方法》等法律法规的有关规定，本基金管理人设立估值委员会并制定估值委员会制度。估值委员会由公司领导、运营部、财务部、权益研究部、固定收益研究部、法律合规部、风险管理部等相关部门工作人员组成。估值委员会成员具有会计核算经验、行业分析经验、金融工具应用等丰富的证券投资基金行业从业经验和专业能力，且之间不存在任何重大利益冲突。基金经理如果认为某证券有更能准确反应其公允价值的估值方法，可以向估值委员会申请对其进行专项评估。新的证券价格需经估值委员会和托管行同意后才能采纳，否则不改变用来进行证券估值的初始价格。估值委员会职责：根据相关估值原则研究相关估值政策和估值模型，拟定公司的估值政策、估值方法和估值程序，确保公司各基金产品净值计算的公允性，以维护广大投资者的利益。

报告期内，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

本报告期内，本基金不存在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

本报告期内，基金托管人在长江收益增强债券型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

#### 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

本报告期内，长江证券（上海）资产管理有限公司在长江收益增强债券型证券投资

基金投资运作、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、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

### 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，由长江证券（上海）资产管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关长江收益增强债券型证券投资基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、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：长江收益增强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
资产：			
货币资金	6.4.7.1	2,416,237.86	1,373.47
结算备付金		2,430,509.29	3,649,977.40
存出保证金		13,528.80	24,405.32
交易性金融资产	6.4.7.2	223,687,077.99	266,768,211.23
其中：股票投资		29,564,541.56	33,052,683.60
基金投资		-	-
债券投资		194,122,536.43	226,626,614.21
资产支持证 券投资		-	7,088,913.42
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		-	393,428.22
应收股利		-	-
应收申购款		20,709.28	34,692.95
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	376,000.00	-
资产总计		228,944,063.22	270,872,088.59
<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		30,005,729.65	59,220,144.07
应付清算款		1,920,763.86	12,782.44
应付赎回款		48,251.10	103,399.20
应付管理人报酬		81,370.66	89,512.95
应付托管费		16,274.14	17,902.59
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		5,425.16	12,328.92
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	339,493.94	439,859.52
负债合计		32,417,308.51	59,895,929.69

<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	157,747,685.25	171,464,713.29
未分配利润	6.4.7.8	38,779,069.46	39,511,445.61
净资产合计		196,526,754.71	210,976,158.90
负债和净资产总计		228,944,063.22	270,872,088.59

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.2458 元，基金份额总额 157,747,685.25 份。

## 6.2 利润表

会计主体：长江收益增强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 2023 年 06 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		3,722,541.72	9,324,984.67
1. 利息收入		24,868.00	28,992.54
其中：存款利息收入	6.4.7.9	24,868.00	28,992.54
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)		895,491.46	1,000,963.80
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-3,339,798.49	-4,645,106.85
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	3,897,268.29	5,383,122.16
资产支持证券投资收 益	6.4.7.12	32,114.52	42,034.52
贵金属投资收益		-	-

衍生工具收益	6.4.7.13	-	-
股利收益	6.4.7.14	305,907.14	220,913.97
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	2,800,510.27	8,275,940.32
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	1,671.99	19,088.01
<b>减：二、营业总支出</b>		1,218,044.81	2,059,406.86
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	505,823.93	747,832.86
2. 托管费	6.4.10.2.2	101,164.84	149,566.54
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		496,222.01	1,030,415.57
其中：卖出回购金融资产支出		496,222.01	1,030,415.57
6. 信用减值损失	6.4.7.17	-	-
7. 税金及附加		5,268.78	10,887.65
8. 其他费用	6.4.7.18	109,565.25	120,704.24
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		2,504,496.91	7,265,577.81
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		2,504,496.91	7,265,577.81
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		2,504,496.91	7,265,577.81

### 6.3 净资产变动表

会计主体：长江收益增强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	171,464,713.29	39,511,445.61	210,976,158.90
二、本期期初净资产	171,464,713.29	39,511,445.61	210,976,158.90
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-13,717,028.04	-732,376.15	-14,449,404.19
（一）、综合收益总额	-	2,504,496.91	2,504,496.91
（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）	-13,717,028.04	-3,236,873.06	-16,953,901.10
其中：1. 基金申购款	4,156,132.31	975,834.59	5,131,966.90
2. 基金赎回款	-17,873,160.35	-4,212,707.65	-22,085,868.00
（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	157,747,685.25	38,779,069.46	196,526,754.71
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	259,403,322.48	59,889,923.48	319,293,245.96
二、本期期初净资产	259,403,322.48	59,889,923.48	319,293,245.96
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-65,729,611.33	-9,874,616.13	-75,604,227.46
（一）、综合收益总额	-	7,265,577.81	7,265,577.81
（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）	-65,729,611.33	-17,140,193.94	-82,869,805.27
其中：1. 基金申购款	39,267,297.53	9,950,356.88	49,217,654.41
2. 基金赎回款	-104,996,908.86	-27,090,550.82	-132,087,459.68
（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	193,673,711.15	50,015,307.35	243,689,018.50

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：

杨忠

杨忠

何永生

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

长江收益增强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[2016] 1378 号文《关于准予长江收益增强债券型证券投资基金注册的批复》准予注册，由长江证券（上海）资产管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《长江收益增强债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，基金存续期限不定期，首次设立募集资金为 1,500,844,808.33 元，认购资金在募集期间产生的利息 67,599.57 元，合计为 1,500,912,407.90 元，按照每份基金份额面值人民币 1.00 元计算，折合基金份额为 1,500,912,407.90 份，业经中审众环会计师事务所（特殊普通合伙）众环验字（2016）010121 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《长江收益增强债券型证券投资基金基金合同》于 2016 年 10 月 17 日正式生效。本基金的基金管理人为长江证券（上海）资产管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《长江收益增强债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（含中小板、创业板及其他依法发行上市的股票）、固定收益类资产、国债期货、权证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相关规定）。本基金主要投资于固定收益类资产，包括国债、金融债、公司债、企业债、地方政府债、政府支持机构债、次级债、中小企业私募债券、可转换公司债券（含分离交易的可转换公司债券）、可交换债券、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、资产支持证券、债券回购、央行票据、银行存款（包括定期存款及其他银行存款）、同业存单等。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，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：本基金投资于债券的比例不低于基金资产的 80%；投资于股票、权证等权益类资产的投资比例合计不超过基金资产的 20%；其中基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%；本基金每个交易日日终，扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。当法律法规的相关规定变更时，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适当调整。

本基金的业绩比较基准为：中国债券综合财富指数收益率×90%+沪深 300 指数收益率×10%。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础编制财务报表。本财务报表按照财政部颁布的各项企业会

计准则、应用指南、解释、《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（以下简称“企业会计准则”），以及中国证监会颁布的《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〉》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》和中国证监会、中国证券投资基金业协会发布的其他有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则以及中国证监会、中国证券投资基金业协会发布的有关规定和允许的基金行业实务操作的要求，真实、完整地反映了本基金 2024 年 06 月 30 日的财务状况、自 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 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所采用的会计政策、会计估计一致。

#### 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

根据财政部、国家税务总局财税[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[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》、上证交字[2008]16 号《关于做好调整证券交易印花税率相关工作的通知》、深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、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》、财政部、税务总局、证监

会公告 2019 年第 78 号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、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《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]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股票、债券免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；金融机构开展的质押式买入返售金融资产及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入。

公开募集证券投资基金运营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) 对基金在 2018 年 1 月 1 日（含）以后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费附加。

(3) 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。

(4) 对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司在收到相关扣收税款当月的法定申报期内向主管税务机关申报缴纳；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，股息红利所得暂免征收个人所得税。

(5) 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，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

(6) 对于基金从事 A 股买卖，出让方按 0.10% 的税率缴纳证券（股票）交易印花税，对受让方不再缴纳印花税。

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体、纳税义务按上述税收法律法规执行。

## 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	2,416,237.86
等于：本金	2,416,179.90
加：应计利息	57.96
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	2,416,237.86

#### 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	30,495,031.48	-	29,564,541.56	-930,489.92
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	930,675.65	71,502,625.55	577,405.39
	银行间市场	118,102,003.56	1,127,810.88	3,390,096.44
	合计	2,058,486.53	194,122,536.43	3,967,501.83
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	218,591,579.55	2,058,486.53	223,687,077.99	3,037,011.91

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

#### 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买入返售金融资产余额。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 06 月 30 日
应收利息	376,000.00
其他应收款	-
待摊费用	-
合计	376,000.00

#### 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	5.35
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	25,653.23
其中：交易所市场	19,825.62
银行间市场	5,827.61
应付利息	-
预提费用	313,835.36
合计	339,493.94

#### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	171,464,713.29	171,464,713.29
本期申购	4,156,132.31	4,156,132.31
本期赎回（以“-”号填列）	-17,873,160.35	-17,873,160.35
本期末	157,747,685.25	157,747,685.25

注：上述申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

## 6.4.7.8 未分配利润

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	39,309,523.16	201,922.45	39,511,445.61
本期期初	39,309,523.16	201,922.45	39,511,445.61
本期利润	-296,013.36	2,800,510.27	2,504,496.91
本期基金份额交易产生的变动数	-3,084,248.46	-152,624.60	-3,236,873.06
其中：基金申购款	932,385.86	43,448.73	975,834.59
基金赎回款	-4,016,634.32	-196,073.33	-4,212,707.65
本期已分配利润	-	-	-
本期末	35,929,261.34	2,849,808.12	38,779,069.46

## 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	1,371.60
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	23,335.36
其他	161.04
合计	24,868.00

## 6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
卖出股票成交总额	32,720,165.38
减：卖出股票成本总额	35,990,871.10
减：交易费用	69,092.77
买卖股票差价收入	-3,339,798.49

## 6.4.7.11 债券投资收益

## 6.4.7.11.1 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	3,030,023.39
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	867,244.90

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	3,897,268.29

#### 6.4.7.11.2 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	156,341,256.23
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	153,432,929.16
减：应计利息总额	2,036,072.61
减：交易费用	5,009.56
买卖债券差价收入	867,244.90

#### 6.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无债券投资收益——赎回差价收入。

#### 6.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无债券投资收益——申购差价收入。

#### 6.4.7.12 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.12.1 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	41,308.48
资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入	-9,193.96
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	32,114.52

##### 6.4.7.12.2 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	7,009,915.07
减：卖出资产支持证券成本总额	7,011,176.98
减：应计利息总额	7,932.05
减：交易费用	-
资产支持证券投资收益	-9,193.96

#### 6.4.7.12.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无资产支持证券投资收益——赎回差价收入。

#### 6.4.7.12.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无资产支持证券投资收益——申购差价收入。

#### 6.4.7.13 衍生工具收益

##### 6.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

##### 6.4.7.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期无衍生工具收益——其他投资收益。

#### 6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
股票投资产生的股利收益	305,907.14
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	305,907.14

#### 6.4.7.15 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	2,800,510.27
——股票投资	-586,581.33
——债券投资	3,416,514.62
——资产支持证券投资	-29,423.02

——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	2,800,510.27

#### 6.4.7.16 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	1,671.99
合计	1,671.99

#### 6.4.7.17 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

#### 6.4.7.18 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	24,863.02
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
汇划手续费	6,429.89
银行间账户维护费	18,600.00
合计	109,565.25

### 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，本基金无须作披露的或有事项。

#### 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，本基金无须作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

本基金本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

##### 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
长江证券（上海）资产管理有限公司	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构
交通银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
长江证券股份有限公司（以下简称“长江证券”）	基金管理人母公司、基金销售机构

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

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

###### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

###### 6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间未产生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 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管理费	505,823.93	747,832.86
其中：应支付销售机构的客户维护费	191,404.20	254,524.53
应支付基金管理人的净管理费	314,419.73	493,308.33

注：（1）本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.5% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.5\% \div \text{当年天数}$$

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

（2）基金管理费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付；由基金管理人向基金托管人发送基金管理人报酬划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人，若遇节假日、休息日等，支付日期顺延。

#### 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	101,164.84	149,566.54

注：（1）本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.1% 年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

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

（2）基金托管费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付；由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金资产中一次性支付，若遇节假日、休息日等，支付日期顺延。

#### 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

本基金本报告期及上年度可比期间未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

本基金本报告期及上年度可比期间未发生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

本基金本报告期及上年度可比期间未发生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

本基金本报告期及上年度可比期间无基金管理人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

本基金本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

#### 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 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
交通银行股份有限公司	2,416,237.86	1,371.60	747,829.53	3,201.46

注：上述银行存款由基金托管人交通银行股份有限公司保管，按约定利率计息。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 6.4.10.8 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

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限证券。

#### 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 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为 18,005,729.65 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
150210	15 国开 10	2024-07-03	102.90	100,000	10,290,120.55
230026	23 付息国债 26	2024-07-03	103.89	86,000	8,934,406.79
合计				186,000	19,224,527.34

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 06 月 30 日止，本基金从事证券交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 12,000,000.00 元，于 2024 年 7 月 1 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末 2024 年 06 月 30 日止，本基金未持有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

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为债券型基金，其预期风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。本基金投资的金融工具主要包括债券投资及货币市场工具等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全员与全程结合、风控与发展并重的风险管理理念。董事会主要负责公司的风险管理战略和控制政策、协调突发重大风险等事项。在公司经营管理层下设风险管理委员会，制定公司日常经营过程中各类风险的防范和管理措施；在业务操作层面，一线业务部门负责对各自业务领域风险的管控，公司具体的风险管理职责由法律合规部、风险管理部负责，组织、协调并与各业务部门共同完成对法律风险、投资风险、操作风险、合规风险等风险类别的管理，并定期向公司专门的风险管理委员会报告公司风险状况。法律合规部和风险管理部分别由合规总监和首席风险官分管，配置有合规、风控方面专业人员。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之发行人出现违约、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在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，因此违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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。

##### 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	3,046,845.21	13,145,092.07
合计	3,046,845.21	13,145,092.07

注：（1）债券评级取自第三方评级机构的债项评级；（2）截至报告期末，本基金持有的未评级的债券包括债券期限在一年及一年以内的国债。

## 6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024 年 06 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
AAA	114,203,180.55	127,271,132.55
AAA 以下	14,775,037.75	45,088,447.78
未评级	62,097,472.92	41,121,941.81
合计	191,075,691.22	213,481,522.14

注：（1）债券评级取自第三方评级机构的债项评级；（2）截至报告期末，本基金持有的未评级的债券包括债券期限在一年以上的国债、政策性金融债、中期票据和公司债。

## 6.4.13.2.3 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024 年 06 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
AAA	-	7,088,913.42
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	-	7,088,913.42

注：资产支持证券评级取自第三方评级机构的债项评级。

## 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指在履行以交付现金或其他金融资产的方式结算的义务时发生资金短缺的风险。对于本基金而言，体现在所持金融工具变现的难易程度。

本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可在基金运作周期内的每个开放日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或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每个开放日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。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。

## 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。

本基金主要投资于公开发行的、信用级别较好的债券资产，高流动性资产比例较高。当在基金运作过程中遇到流动性风险时，可通过交易所回购、交易所协议回购和银行间回购、债券资产变现等多种操作缓解流动性风险。

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对于未来现金流影响的风险。

本基金持有交易所及银行间市场交易的固定收益品种，此外还持有银行存款、结算备付金等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。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	2,416,237.86	-	-	-	2,416,237.86
结算备付金	2,430,509.29	-	-	-	2,430,509.29
存出保证金	13,528.80	-	-	-	13,528.80
交易性金融资产	60,949,003.32	106,728,160.89	26,445,372.22	29,564,541.56	223,687,077.99

应收申购款	-	-	-	20,709.28	20,709.28
其他资产	-	-	-	376,000.00	376,000.00
资产总计	65,809,279.27	106,728,160.89	26,445,372.22	29,961,250.84	228,944,063.22
负债					
卖出回购金融资产款	30,005,729.65	-	-	-	30,005,729.65
应付清算款	-	-	-	1,920,763.86	1,920,763.86
应付赎回款	-	-	-	48,251.10	48,251.10
应付管理人报酬	-	-	-	81,370.66	81,370.66
应付托管费	-	-	-	16,274.14	16,274.14
应交税费	-	-	-	5,425.16	5,425.16
其他负债	-	-	-	339,493.94	339,493.94
负债总计	30,005,729.65	-	-	2,411,578.86	32,417,308.51
利率敏感度缺口	35,803,549.62	106,728,160.89	26,445,372.22	27,549,671.98	196,526,754.71
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	1,373.47	-	-	-	1,373.47
结算备付金	3,649,977.40	-	-	-	3,649,977.40
存出保证金	24,405.32	-	-	-	24,405.32
交易性金融资产	70,075,478.38	147,729,592.97	15,910,456.28	33,052,683.60	266,768,211.23
应收清算款	-	-	-	393,428.22	393,428.22
应收申购款	-	-	-	34,692.95	34,692.95
资产总计	73,751,234.57	147,729,592.97	15,910,456.28	33,480,804.77	270,872,088.59

负债					
卖出回购金融资产款	59,220,144.07	-	-	-	59,220,144.07
应付清算款	-	-	-	12,782.44	12,782.44
应付赎回款	-	-	-	103,399.20	103,399.20
应付管理人报酬	-	-	-	89,512.95	89,512.95
应付托管费	-	-	-	17,902.59	17,902.59
应交税费	-	-	-	12,328.92	12,328.92
其他负债	-	-	-	439,859.52	439,859.52
负债总计	59,220,144.07	-	-	675,785.62	59,895,929.69
利率敏感度缺口	14,531,090.50	147,729,592.97	15,910,456.28	32,805,019.15	210,976,158.90

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	该利率敏感性分析基于本基金于资产负债表日的利率风险状况		
	除利率之外的其他市场变量保持不变		
	该利率敏感性分析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		
	银行存款、结算备付金、存出保证金和部分应收申购款均以活期存款利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响；买入返售金融资产的利息收益和卖出回购金融资产款的利息支出在交易时已确定，不受利率变化影响		
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06月30日	上年度末 2023年12月31日
	市场利率上升25个基点	-1,714,088.73	-1,652,462.06
	市场利率下降25个基点	1,714,088.73	1,652,462.06

#### 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。本基金主要投资于交易所及银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

#### 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层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

第一层次输入值：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：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；

第三层次输入值：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	57,783,400.81	64,394,836.58
第二层次	165,903,677.18	202,373,374.65
第三层次	-	-
合计	223,687,077.99	266,768,211.23

###### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期持有的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

于 2024 年 06 月 30 日，本基金无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工具主要包括应收款项、卖出回购金融资产和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

于 2024 年 06 月 30 日，本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

### § 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	29,564,541.56	12.91
	其中：股票	29,564,541.56	12.91
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	194,122,536.43	84.79
	其中：债券	194,122,536.43	84.79
	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	4,846,747.15	2.12
8	其他各项资产	410,238.08	0.18
9	合计	228,944,063.22	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

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	545,600.00	0.28
B	采矿业	1,930,400.00	0.98
C	制造业	22,331,181.56	11.36
D	电力、热力、燃气及水生产和供应	-	-

	业		
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	1,130,100.00	0.58
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,370,960.00	1.21
J	金融业	413,600.00	0.21
K	房地产业	346,500.00	0.18
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	496,200.00	0.25
S	综合	-	-
	合计	29,564,541.56	15.04

### 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	600547	山东黄金	40,000	1,095,200.00	0.56
2	600183	生益科技	50,000	1,053,000.00	0.54
3	002475	立讯精密	20,000	786,200.00	0.40
4	600026	中远海能	50,000	780,500.00	0.40
5	002653	海思科	25,000	767,500.00	0.39
6	002179	中航光电	20,000	761,000.00	0.39
7	300979	华利集团	12,000	730,200.00	0.37
8	300408	三环集团	25,000	729,750.00	0.37
9	000977	浪潮信息	20,000	727,400.00	0.37
10	000768	中航西飞	30,000	720,900.00	0.37
11	688475	萤石网络	20,000	682,200.00	0.35
12	600809	山西汾酒	3,000	632,640.00	0.32
13	603225	新凤鸣	40,000	623,600.00	0.32
14	603019	中科曙光	15,000	622,500.00	0.32

15	603889	新澳股份	79,944	618,766.56	0.31
16	300679	电连技术	15,000	603,450.00	0.31
17	688169	石头科技	1,500	588,900.00	0.30
18	002429	兆驰股份	120,000	577,200.00	0.29
19	600737	中粮糖业	60,000	575,400.00	0.29
20	603986	兆易创新	6,000	573,720.00	0.29
21	002299	圣农发展	40,000	545,600.00	0.28
22	601689	拓普集团	10,000	536,100.00	0.27
23	002294	信立泰	20,000	532,600.00	0.27
24	003021	兆威机电	11,200	516,880.00	0.26
25	688188	柏楚电子	2,800	516,740.00	0.26
26	600521	华海药业	30,000	511,500.00	0.26
27	300360	炬华科技	30,000	510,000.00	0.26
28	300788	中信出版	20,000	496,200.00	0.25
29	002755	奥赛康	50,000	482,500.00	0.25
30	000895	双汇发展	20,000	475,400.00	0.24
31	000603	盛达资源	40,000	473,200.00	0.24
32	600835	上海机电	40,000	460,400.00	0.23
33	688111	金山办公	2,000	455,000.00	0.23
34	603806	福斯特	30,000	441,000.00	0.22
35	002920	德赛西威	5,000	435,450.00	0.22
36	300274	阳光电源	7,000	434,210.00	0.22
37	601058	赛轮轮胎	30,242	423,388.00	0.22
38	601318	中国平安	10,000	413,600.00	0.21
39	300494	盛天网络	40,000	402,000.00	0.20
40	300705	九典制药	15,000	401,100.00	0.20
41	000403	派林生物	15,000	399,900.00	0.20
42	301093	华兰股份	20,000	385,200.00	0.20
43	600085	同仁堂	10,000	382,100.00	0.19
44	300496	中科创达	8,000	364,720.00	0.19
45	603890	春秋电子	40,000	362,400.00	0.18
46	002155	湖南黄金	20,000	362,000.00	0.18
47	688041	海光信息	5,000	351,600.00	0.18
48	603565	中谷物流	40,000	349,600.00	0.18
49	000002	万科 A	50,000	346,500.00	0.18
50	603198	迎驾贡酒	6,000	345,000.00	0.18
51	688333	铂力特	7,000	339,150.00	0.17
52	688025	杰普特	8,000	323,120.00	0.16
53	600761	安徽合力	14,925	322,977.00	0.16
54	300418	昆仑万维	10,000	322,400.00	0.16
55	688212	澳华内镜	8,000	320,080.00	0.16
56	688631	莱斯信息	5,000	310,100.00	0.16
57	002085	万丰奥威	20,000	264,800.00	0.13

## 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	000002	万科 A	1,031,700.00	0.49
2	688390	固德威	949,902.45	0.45
3	601689	拓普集团	832,956.00	0.39
4	603806	福斯特	769,790.00	0.36
5	603890	春秋电子	760,600.00	0.36
6	000625	长安汽车	703,400.00	0.33
7	002179	中航光电	695,604.00	0.33
8	688475	萤石网络	677,087.84	0.32
9	688169	石头科技	659,250.68	0.31
10	300679	电连技术	636,454.00	0.30
11	603986	兆易创新	634,790.00	0.30
12	688308	欧科亿	629,390.50	0.30
13	002653	海思科	626,056.00	0.30
14	600521	华海药业	622,799.00	0.30
15	002180	纳思达	615,896.00	0.29
16	601881	中国银河	612,486.00	0.29
17	603939	益丰药房	606,395.00	0.29
18	000895	双汇发展	589,678.00	0.28
19	002920	德赛西威	571,196.00	0.27
20	600048	保利发展	565,200.00	0.27

注：（1）买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票；（2）本项“买入金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601689	拓普集团	1,153,695.10	0.55
2	300308	中际旭创	1,136,674.00	0.54
3	002353	杰瑞股份	965,412.00	0.46
4	603890	春秋电子	875,361.00	0.41
5	688390	固德威	813,132.82	0.39
6	601111	中国国航	745,000.00	0.35
7	688378	奥来德	727,772.31	0.34

8	000625	长安汽车	725,500.00	0.34
9	002180	纳思达	675,017.00	0.32
10	601058	赛轮轮胎	662,160.00	0.31
11	688496	清越科技	650,500.00	0.31
12	300607	拓斯达	645,558.40	0.31
13	603986	兆易创新	634,300.00	0.30
14	688308	欧科亿	626,475.37	0.30
15	300559	佳发教育	602,200.00	0.29
16	601888	中国中免	593,387.00	0.28
17	688122	西部超导	584,352.75	0.28
18	300638	广和通	579,600.00	0.27
19	002555	三七互娱	574,200.00	0.27
20	601881	中国银河	572,000.00	0.27

注：（1）卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票。（2）本项“卖出金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	33,089,310.39
卖出股票收入（成交）总额	32,720,165.38

注：（1）买入包括二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票。（2）“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 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	23,662,725.65	12.04
2	央行票据	-	-
3	金融债券	56,799,508.78	28.90
	其中：政策性金融债	10,290,120.55	5.24
4	企业债券	58,736,004.52	29.89
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	26,705,438.23	13.59
7	可转债(可交换债)	28,218,859.25	14.36
8	同业存单	-	-

9	其他	-	-
10	合计	194,122,536.43	98.78

## 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	2180511	21 西安高新债 02	100,000	11,146,849.18	5.67
2	102103364	21 鲁能源 MTN009B(高成长债)	100,000	10,567,629.51	5.38
3	149563	21 广发 06	100,000	10,524,364.38	5.36
4	2228024	22 工商银行二级 03	100,000	10,445,835.62	5.32
5	272380009	23 联合人寿资本补充债 01	100,000	10,437,060.27	5.31

## 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

根据基金合同约定，本基金不得参与股指期货交易。

## 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

本基金本着审慎性原则、在风险可控的前提下，以套期保值策略为目的，适度参与国债

期货的投资。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未进行国债期货投资。

### 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没有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。

7.12.2 本基金投资的前十名股票，没有超出基金合同规定的备选股票库。

### 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	13,528.80
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	376,000.00
5	应收申购款	20,709.28
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	410,238.08

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113056	重银转债	2,169,183.56	1.10
2	113052	兴业转债	2,164,353.42	1.10
3	113037	紫银转债	1,647,048.08	0.84
4	127032	苏行转债	1,257,030.14	0.64
5	113065	齐鲁转债	1,139,976.16	0.58
6	110073	国投转债	1,082,396.71	0.55
7	113060	浙 22 转债	1,000,818.85	0.51
8	127027	能化转债	642,536.99	0.33
9	123107	温氏转债	630,995.21	0.32

10	127020	中金转债	620,309.03	0.32
11	110075	南航转债	619,920.68	0.32
12	110079	杭银转债	603,836.16	0.31
13	127045	牧原转债	591,746.71	0.30
14	128141	旺能转债	572,621.92	0.29
15	113043	财通转债	555,774.66	0.28
16	110067	华安转债	554,574.66	0.28
17	118024	冠宇转债	548,269.86	0.28
18	127083	山路转债	533,983.97	0.27
19	113046	金田转债	520,660.27	0.26
20	118022	锂科转债	496,041.10	0.25
21	113647	禾丰转债	440,949.69	0.22
22	113634	珀莱转债	405,777.95	0.21
23	127050	麒麟转债	402,955.48	0.21
24	113050	南银转债	376,236.25	0.19
25	128133	奇正转债	359,601.37	0.18
26	113039	嘉泽转债	358,507.40	0.18
27	113051	节能转债	358,268.63	0.18
28	113045	环旭转债	356,367.21	0.18
29	113632	鹤 21 转债	352,835.97	0.18
30	110084	贵燃转债	348,983.01	0.18
31	127040	国泰转债	340,506.33	0.17
32	127016	鲁泰转债	339,772.36	0.17
33	113049	长汽转债	335,420.47	0.17
34	128109	楚江转债	332,479.56	0.17
35	111010	立昂转债	332,012.88	0.17
36	113048	晶科转债	317,543.01	0.16
37	123161	强联转债	295,044.66	0.15
38	118031	天 23 转债	278,553.70	0.14
39	113651	松霖转债	261,638.36	0.13
40	113631	皖天转债	253,178.08	0.13
41	110095	双良转债	241,690.03	0.12
42	128081	海亮转债	217,011.67	0.11
43	127015	希望转债	212,315.45	0.11
44	127049	希望转 2	207,005.15	0.11
45	127014	北方转债	146,296.30	0.07
46	110055	伊力转债	131,223.42	0.07
47	123101	拓斯转债	125,311.51	0.06
48	127035	濮耐转债	124,416.71	0.06
49	113673	岱美转债	123,698.82	0.06
50	113061	拓普转债	118,698.60	0.06
51	123090	三诺转债	116,821.23	0.06
52	127052	西子转债	113,014.25	0.06

53	127031	洋丰转债	112,502.19	0.06
54	128131	崇达转 2	110,826.44	0.06
55	113058	友发转债	110,013.84	0.06
56	128071	合兴转债	108,258.52	0.06
57	113605	大参转债	107,358.49	0.05
58	128134	鸿路转债	107,091.23	0.05
59	113633	科沃转债	106,746.85	0.05
60	113033	利群转债	101,659.01	0.05
61	113641	华友转债	101,467.01	0.05
62	110087	天业转债	101,180.52	0.05
63	123149	通裕转债	100,984.11	0.05
64	111009	盛泰转债	95,458.63	0.05
65	123216	科顺转债	95,367.64	0.05
66	110086	精工转债	89,133.42	0.05

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 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

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
63,550	2,482.26	100,000,000.00	63.39%	57,747,685.25	36.61%

#### 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	565,775.00	0.3587%

### 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、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	50~100

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2016年10月17日）基金份额总额	1,500,912,407.90
本报告期期初基金份额总额	171,464,713.29
本报告期基金总申购份额	4,156,132.31
减：本报告期基金总赎回份额	17,873,160.35
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	157,747,685.25

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 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、本报告期内，自2024年3月10日起，杨忠先生担任长江证券（上海）资产管理有限公司董事长、总经理（代任）；

2、本报告期内，基金管理人于2024年3月23日发布公告，长江证券（上海）资产管理有限公司法定代表人变更为杨忠先生；

3、本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及对公司运营管理和基金运作产生重大影响的，与基金管理人、基金财产、基金托管业务相关的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内未改变投资策略。

## 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期内继续选聘中审众环会计师事务所(特殊普通合伙)提供审计服务。

## 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

本报告期内，本基金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

本报告期内，本基金托管人及其高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

## 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	
广发证券	2	16,769,414.22	25.48%	12,257.87	25.26%	-
浙商证券	1	15,883,875.00	24.14%	11,688.72	24.08%	-
中金公司	1	12,446,966.00	18.91%	9,283.82	19.13%	-
兴业证券	1	8,937,605.19	13.58%	6,577.13	13.55%	-
国泰君安证券	1	6,372,671.00	9.68%	4,753.61	9.79%	-
国金证券	2	5,398,944.36	8.20%	3,973.14	8.19%	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东方财富证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-

注：1、基金专用交易单元的选择标准如下：

- (1) 公司财务状况良好，经营行为规范；
- (2) 具备较强的合规风控能力；
- (3) 具备较强的交易服务能力；
- (4) 具有较强的研究服务能力。

2、基金专用交易单元的选择程序如下：本基金管理人负责根据上述选择标准，考察后与确定选用交易单元的证券公司签订交易单元租用协议。

3、本报告期内，本基金租用的证券公司交易单元未发生变更。

### 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	
	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
广发证券	8,879,006.27	23.43%	431,600,000.00	16.84%
浙商证券	11,214,747.82	29.60%	107,800,000.00	4.21%
中金公司	5,959,061.75	15.73%	749,900,000.00	29.26%
兴业证券	2,072,345.07	5.47%	828,300,000.00	32.32%
国泰君安证券	319,495.69	0.84%	90,000,000.00	3.51%
国金证券	9,446,743.32	24.93%	355,000,000.00	13.85%
东吴证券	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-

### 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	长江证券（上海）资产管理有限公司关于旗下部分基金参加泛华普益基金销售有限公司费率优惠活动的公告	规定报刊、网站	2024-01-03
2	长江证券（上海）资产管理有限公司旗下部分基金 2023 年第四季度报告提示性公告	规定报刊、网站	2024-01-22
3	长江收益增强债券型证券投资基金 2023 年第四季度报告	规定网站	2024-01-22
4	长江证券（上海）资产管理有限公司关于董事长变更的公告	规定报刊、网站	2024-03-12
5	长江证券（上海）资产管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	规定报刊、网站	2024-03-12
6	长江证券（上海）资产管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	规定报刊、网站	2024-03-12
7	长江证券（上海）资产管理有限公司关于公司法定代表人变更的公告	规定报刊、网站	2024-03-23
8	长江收益增强债券型证券投资基金	规定网站	2024-03-29

	2023 年年度报告		
9	长江证券（上海）资产管理有限公司旗下部分基金 2023 年年度报告提示性公告	规定报刊、网站	2024-03-29
10	长江证券（上海）资产管理有限公司旗下部分基金 2024 年第一季度报告提示性公告	规定报刊、网站	2024-04-22
11	长江收益增强债券型证券投资基金 2024 年第一季度报告	规定网站	2024-04-22
12	长江证券（上海）资产管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料的公告	规定报刊、网站	2024-05-21
13	长江证券（上海）资产管理有限公司关于调整长江收益增强债券型证券投资基金在珠海盈米基金销售有限公司最低持有份额限制的公告	规定报刊、网站	2024-05-22
14	长江证券（上海）资产管理有限公司关于谨防虚假网站的重要提示	规定报刊、网站	2024-05-28
15	长江证券（上海）资产管理有限公司关于公司董事变更的公告	规定报刊、网站	2024-05-28
16	长江收益增强债券型证券投资基金基金产品资料概要更新	规定网站	2024-06-28

## § 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	100,000,000.00	-	-	100,000,000.00	63.39%

#### 产品特有风险

报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过 20%的情况，由此可能导致的特有风险包括但不限于：当投资者持有份额占比较为集中时，个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响；极端情况下基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请，可能带来流动性风险；如个别投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据基金合同约定决定部分延期赎回、暂停赎回或延期办理赎回申请，可能影响投资者赎回业务办理；持有基金份额占比较高的投资者在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。

## 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

- 1、中国证监会准予长江收益增强债券型证券投资基金募集申请的注册文件
- 2、长江收益增强债券型证券投资基金基金合同
- 3、长江收益增强债券型证券投资基金招募说明书
- 4、长江收益增强债券型证券投资基金托管协议
- 5、法律意见书
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 7、本报告期内按照规定披露的各项公告

### 12.2 存放地点

存放地点为基金管理人办公地址：上海市虹口区新建路 200 号国华金融中心 B 栋 19 层。

### 12.3 查阅方式

投资者可在营业时间至基金管理人办公地点免费查阅，亦可通过基金管理人网站查阅，网址为 [www.cjzcgf.com](http://www.cjzcgf.com)。

长江证券（上海）资产管理有限公司  
二〇二四年八月三十日