

长信稳鑫三个月定期开放债券型发起式证
券投资基金
2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：长信基金管理有限责任公司

基金托管人：江苏银行股份有限公司

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、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。

基金托管人江苏银行股份有限公司根据本基金基金合同规定，于 2024 年 8 月 28 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 2024 年 6 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	5
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	6
§ 4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
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	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	11
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、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内容的真实、准确和完整发表意见	12
§ 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	17
§ 7 投资组合报告	34
7.1 期末基金资产组合情况	34
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	34
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	34
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	34
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	35
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	35

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	35
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	35
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	35
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	35
7.11 投资组合报告附注	36
§ 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	39
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	39
§ 9 开放式基金份额变动	40
§ 10 重大事件揭示	40
10.1 基金份额持有人大会决议	40
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	40
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	40
10.4 基金投资策略的改变	40
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	40
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	41
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	41
10.8 其他重大事件	42
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	43
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	43
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	44
§ 12 备查文件目录	44
12.1 备查文件目录	44
12.2 存放地点	44
12.3 查阅方式	44

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	长信稳鑫三个月定期开放债券型发起式证券投资基金
基金简称	长信稳鑫三个月定开债券发起式
基金主代码	005575
交易代码	005575
基金运作方式	契约型、定期开放式
基金合同生效日	2018 年 1 月 19 日
基金管理人	长信基金管理有限责任公司
基金托管人	江苏银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	982,872,669.71 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过投资于债券品种，追求超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金将在基金合同约定的投资范围内，通过对宏观经济运行状况、国家货币政策和财政政策、国家产业政策及资本市场资金环境的研究，积极把握宏观经济发展趋势、利率走势、债券市场相对收益率、券种的流动性以及信用水平，优化固定收益类金融工具的资产比例配置。在有效控制风险的基础上，适时调整组合久期，以获得基金资产的稳定增值，提高基金总体收益率。
业绩比较基准	中债综合指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金和混合型基金，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	长信基金管理有限责任公司	江苏银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	周永刚
	联系电话	021-61009999
	电子邮箱	zhouyong@cxfund.com.cn
客户服务电话	4007005566	95319
传真	021-61009800	025-58588155
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 68 号 37 层	南京市中华路 26 号
办公地址	上海市浦东新区银城中路 68 号 9 楼、37 楼、38 楼	南京市中华路 26 号
邮政编码	200120	210001
法定代表人	刘元瑞	葛仁余

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	www.cxfund.com.cn
基金中期报告备置地点	上海市浦东新区银城中路 68 号 38 楼、江苏省南京市秦淮区中华路 26 号 25 楼

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	长信基金管理有限责任公司	上海市浦东新区银城中路 68 号 9 楼、37 楼、38 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1月1日-2024年6月30日)
本期已实现收益	18,465,484.49
本期利润	21,288,181.50
加权平均基金份额本期利润	0.0217
本期加权平均净值利润率	2.12%
本期基金份额净值增长率	2.15%
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	4,452,029.62
期末可供分配基金份额利润	0.0045
期末基金资产净值	998,767,879.10
期末基金份额净值	1.0162
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	27.37%

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、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（例如，封闭式基金交易佣金、开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

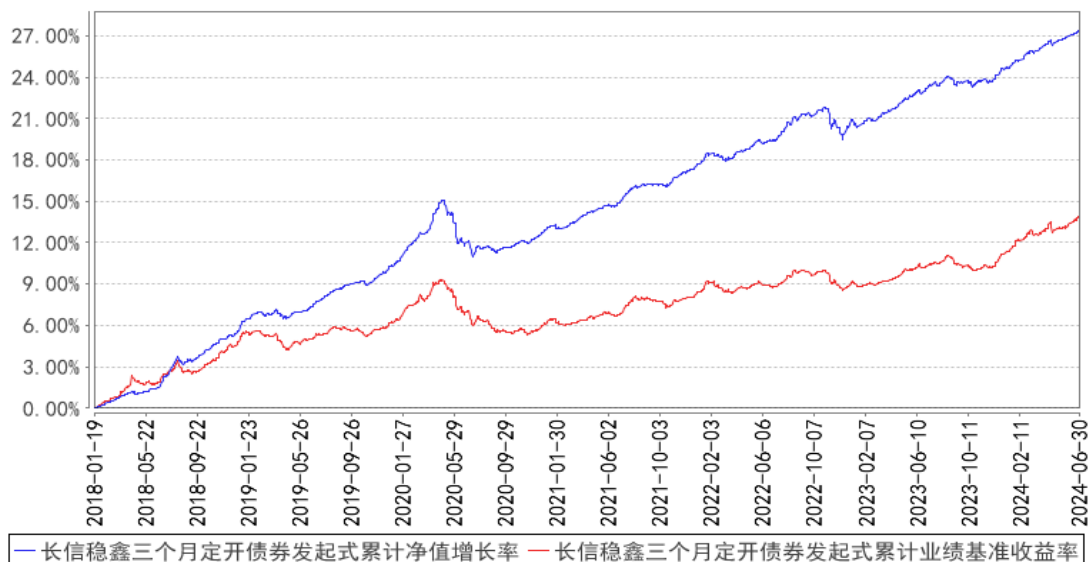
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	0.38%	0.02%	0.65%	0.03%	-0.27%	-0.01%
过去三个月	1.01%	0.03%	1.06%	0.07%	-0.05%	-0.04%
过去六个月	2.15%	0.04%	2.42%	0.07%	-0.27%	-0.03%
过去一年	3.40%	0.05%	3.27%	0.06%	0.13%	-0.01%
过去三年	10.75%	0.06%	6.58%	0.05%	4.17%	0.01%

自基金合同生效起至今	27.37%	0.06%	13.88%	0.06%	13.49%	0.00%
------------	--------	-------	--------	-------	--------	-------

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

长信稳鑫三个月定开债券发起式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：1、图示日期为 2018 年 1 月 19 日至 2024 年 6 月 30 日。

2、按基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起 6 个月内为建仓期；建仓期结束时，本基金各项投资比例已符合基金合同中的约定。

§ 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

长信基金管理有限责任公司是经中国证监会证监基金字【2003】63 号文批准，由长江证券股份有限公司、上海海欣集团股份有限公司、武汉钢铁股份有限公司共同发起设立。注册资本 1.65 亿元人民币。目前股权结构为：长江证券股份有限公司占 44.55%、上海海欣集团股份有限公司占 31.21%、武汉钢铁有限公司占 15.15%、上海彤胜投资管理中心（有限合伙）占 4.55%、上海彤骏投资管理中心（有限合伙）占 4.54%。

截至 2024 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 88 只开放式基金，即长信利息收益开放式证券投资基金、长信银利精选混合型证券投资基金、长信金利趋势混合型证券投资基金、长信增利动态策略混合型证券投资基金、长信利丰债券型证券投资基金、长信量化先锋混合型证券投资基金、长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金、长信利鑫债券型证券投资基金 (LOF)、长信内需成长混合型证券投资基金、长信可转债债券型证券投资基金、长信利众债券型证券投资基

金 (LOF)、长信纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信纯债壹号债券型证券投资基金、长信改革红利灵活配置混合型证券投资基金、长信量化中小盘股票型证券投资基金、长信利富债券型证券投资基金、长信利盈灵活配置混合型证券投资基金、长信利广灵活配置混合型证券投资基金、长信多利灵活配置混合型证券投资基金、长信睿进灵活配置混合型证券投资基金、长信量化多策略股票型证券投资基金、长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)、长信富海纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信利保债券型证券投资基金、长信金葵纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信富全纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信利泰灵活配置混合型证券投资基金、长信利发债券型证券投资基金、长信电子信息行业量化灵活配置混合型证券投资基金、长信富平纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信创新驱动股票型证券投资基金、长信稳益纯债债券型证券投资基金、长信利信灵活配置混合型证券投资基金、长信稳健纯债债券型证券投资基金、长信国防军工量化灵活配置混合型证券投资基金、长信先优债券型证券投资基金、长信稳势纯债债券型证券投资基金、长信中证 500 指数增强型证券投资基金、长信长金货币基金、长信稳通三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信低碳环保行业量化股票型证券投资基金、长信利尚一年定期开放混合型证券投资基金、长信乐信灵活配置混合型证券投资基金、长信全球债券证券投资基金、长信稳鑫三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信消费精选行业量化股票型证券投资基金、长信企业精选两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、长信量化价值驱动混合型证券投资基金、长信稳裕三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信稳进资产配置混合型基金中基金 (FOF)、长信利率债债券型证券投资基金、长信沪深 300 指数增强型证券投资基金、长信富安纯债半年定期开放债券型证券投资基金、长信双利优选混合型证券投资基金、长信富瑞两年定期开放债券型证券投资基金、长信颐天平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金 (FOF)、长信易进混合型证券投资基金、长信先锐混合型证券投资基金、长信稳健精选混合型证券投资基金、长信浦瑞 87 个月定期开放债券型证券投资基金、长信消费升级混合型证券投资基金、长信企业优选一年持有期灵活配置混合型证券投资基金、长信稳健均衡 6 个月持有期混合型证券投资基金、长信优质企业混合型证券投资基金、长信内需均衡混合型证券投资基金、长信 30 天滚动持有短债债券型证券投资基金、长信稳惠债券型证券投资基金、长信稳丰债券型证券投资基金、长信先进装备三个月持有期混合型证券投资基金、长信颐和平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金 (FOF)、长信颐年平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金 (FOF)、长信稳健增长一年持有期混合型证券投资基金、长信稳健成长混合型证券投资基金、长信企业成长三年持有期混合型证券投资基金、长信稳兴三个月定期开放债券型证券投资基金、长信稳航 30 天持有期中短债债券型证券投资基金、长信稳恒债券型证券投资基金、长信中证科创创

业 50 指数增强型证券投资基金、长信均衡策略一年持有期混合型证券投资基金、长信中证 1000 指数增强型证券投资基金、长信均衡优选混合型证券投资基金、长信 90 天滚动持有债券型证券投资基金、长信稳固 60 天滚动持有债券型证券投资基金、长信汇智量化选股混合型证券投资基金、长信 120 天滚动持有债券型证券投资基金、长信中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、长信优势行业混合型证券投资基金、长信 180 天持有期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		
陆莹	长信利息收益开放式证券投资基金、长信长金货币市场基金、长信稳鑫三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信浦瑞 87 个月定期开放债券型证券投资基金、长信稳惠债券型证券投资基金和长信中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金的基金经理、现金理财部副总监	2018 年 1 月 19 日	-	14 年	管理学学士，毕业于上海交通大学，具有基金从业资格，中国国籍。2010 年 7 月加入长信基金管理有限责任公司，曾任基金事务部基金会计，交易管理部债券交易员、交易主管，债券交易部副总监、总监、现金理财部总监、长信稳裕三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信纯债半年债券型证券投资基金、长信稳通三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信易进混合型证券投资基金、长信稳健纯债债券型证券投资基金、长信富瑞两年定期开放债券型证券投资基金和长信中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金的基金经理。现任现金理财部副总监、长信利息收益开放式证券投资基金、长信长金货币市场基金、长信稳鑫三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信浦瑞 87 个月定期开放债券型证券投资基金、长信稳惠债券型证券投资基金和长信中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金的基金经理。

注：1、首任基金经理任职日期以本基金成立之日为准；新增或变更基金经理的日期根据对外披露的公告日期填写；

2、证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》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

本基金管理人在报告期内，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、基金合同的规定，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

本基金将继续以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，在规范基金运作和严格控制投资风险的前提下，努力为基金份额持有人谋求最大利益。

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，公司已实行公平交易制度，并建立公平交易制度体系，已建立投资决策体系，加强交易执行环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，公司已通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，除完全按照有关指数的构成比例进行投资的组合外，其余各投资组合未发生参与交易所公开竞价同日反向交易且成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情形，未发现异常交易行为。

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

回顾 2024 年上半年，债券市场整体走势较强，债券收益率呈下行趋势，国债期货屡创新高。年初以来各期限债券收益率均有明显下行，调整主要出现在 3 月中旬和 4 月下旬，调整幅度分别为 10bp 和 15bp 左右，调整之后债券收益率继续下行，各品种债券收益率较年初下行 30-80bp 不等，期限利差和信用利差均有收窄，半年末处于年内低点和历史低位水平。一季度央行降准 0.5% 并定向降息，商业银行陆续调降存款利率，5 年期 LPR 超预期下调 25BP，政策利好债券市场。3 月公布的出口数据和 CPI 数据回暖，市场风险偏好提升，债市止盈情绪较强，季末资金、汇率波动及房地产政策调整等信息也对债市造成扰动。4 月央行表态“长期国债收益率将运行在与长期经济增长预期相匹配的合理区间内”，债市又出现一波明显调整，但央行公开市场操作对资金面较为呵护，同时经济数据出炉使得市场风险偏好回落，债券配置需求仍强，而政府债券供给减少且发行进度偏慢，调整之后债券收益率重新走低。上半年我们灵活调整组合久期和仓位，在风险可控的情况下，积极参与利率债和银行债波段交易，力争为组合贡献更多收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2024 年 6 月 30 日，长信稳鑫三个月定开债券发起式份额净值为 1.0162 元，份额累计净

值为 1.2476 元，本报告期内长信稳鑫三个月定开债券发起式净值增长率为 2.15%，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，三中全会强调“坚定不移实现全年经济社会发展目标”，下半年稳增长政策有望加码，财政政策或保持稳健，政府债供给将提速。7 月央行已下调公开市场操作利率 10bp，1 年期和 5 年期 LPR 随之下调 10bp，未来配合政府债券发行不排除会有降准可能，整体资金面预计维持宽松。短期央行或采取借券卖出的形式维持长端利率稳定波动并使收益率曲线偏陡峭，长期逻辑来看利率仍处于下行通道，在当前通胀水平和信贷提质增效背景下，债券供给带来的债市调整或有一定投资机会。未来我们将严格控制信用风险，合理配置各类资产，灵活运用杠杆，把握债券市场调整带来的投资机会，为投资者争取更好的组合收益。

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。基金托管人根据法律法规要求对基金管理公司采用的估值政策和程序进行核查，并对估值结果及净值计算进行复核。

根据相关法律法规，本基金管理人制订了健全、有效的估值政策和估值程序，设立了估值委员会，估值委员会是公司基金估值的主要决策机构，其主要职责是负责拟定公司的估值政策、估值方法及采用的估值程序和技术，对公司现有程序和技术进行复核和审阅，当发生了影响估值程序和技术的有效性、适用性的情况及时修订估值程序；估值委员会成员由基金事务部、投资、研究、交易等相关业务部门负责人以及基金事务部至少一名业务骨干共同组成，相关参与人员都具有丰富的证券行业工作经验，熟悉相关法规和估值方法，均具备估值业务所需的专业胜任能力。对于基金的估值政策和估值原则，公司已与基金托管人充分沟通，并达成一致意见。审计本基金的会计师事务所认可公司基金估值政策和程序的适当性。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供银行间同业市场及交易所交易的债券品种的估值数据以及流通受限股票的折扣率。参与估值流程各方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

本基金管理人根据相关法律法规和本基金基金合同约定已于 2024 年 5 月 15 日进行了利润分配，每 10 份基金份额派发红利 0.190 元。

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

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人—江苏银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规的规定以及《托管协议》的约定，尽职尽责履行了托管人应尽的义务，没有从事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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本基金托管人—江苏银行股份有限公司未发现长信基金管理有限责任公司在长信稳鑫三个月定期开放债券型发起式证券投资基金的投资运作、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存在损害基金份额持有人利益的行为，或违反《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违反基金合同规定的情况。

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，由基金管理人所编制和披露的长信稳鑫三个月定期开放债券型发起式证券投资基金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：长信稳鑫三个月定期开放债券型发起式证券投资基金

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	348,821.98	893,457.81
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	1,224,427,482.58	1,228,898,604.45
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		1,224,427,482.58	1,228,898,604.45
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-

衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		1,224,776,304.56	1,229,792,062.26
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		225,571,340.75	233,082,746.52
应付清算款		-	-
应付赎回款		1.01	-
应付管理人报酬		245,085.32	252,548.26
应付托管费		81,695.10	84,182.76
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	110,303.28	218,305.30
负债合计		226,008,425.46	233,637,782.84
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	982,872,669.71	982,872,670.52
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	15,895,209.39	13,281,608.90
净资产合计		998,767,879.10	996,154,279.42
负债和净资产总计		1,224,776,304.56	1,229,792,062.26

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0162 元，基金份额总额 982,872,669.71 份。

6.2 利润表

会计主体：长信稳鑫三个月定期开放债券型发起式证券投资基金

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1月1日至2023 年6月30日
一、营业总收入		24,274,144.58	24,381,321.54
1. 利息收入		136,761.16	3,008.29
其中：存款利息收入	6.4.7.13	2,380.24	3,008.29
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		134,380.92	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		21,314,686.41	17,193,856.99
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	21,314,686.41	17,193,856.99
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	-	-
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	2,822,697.01	7,184,456.26
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	-	-
减：二、营业总支出		2,985,963.08	3,863,468.64
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,495,063.24	1,474,290.50
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	498,354.44	491,430.14
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		889,410.04	1,794,845.44
其中：卖出回购金融资产支出		889,410.04	1,794,845.44
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	-

8. 其他费用	6.4.7.23	103,135.36	102,902.56
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		21,288,181.50	20,517,852.90
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		21,288,181.50	20,517,852.90
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		21,288,181.50	20,517,852.90

6.3 净资产变动表

会计主体：长信稳鑫三个月定期开放债券型发起式证券投资基金

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	982,872,670.52	-	13,281,608.90	996,154,279.42
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	982,872,670.52	-	13,281,608.90	996,154,279.42
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-0.81	-	2,613,600.49	2,613,599.68
（一）、综合收益总额	-	-	21,288,181.50	21,288,181.50
（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）	-0.81	-	-0.02	-0.83
其中：1. 基金申购款	0.18	-	-	0.18
2. 基金赎回款	-0.99	-	-0.02	-1.01
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净	-	-	-18,674,580.99	-18,674,580.99

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	982,872,669.71	-	15,895,209.39	998,767,879.10
项目	上年度可比期间 2023年1月1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	982,872,667.32	-	5,637,085.58	988,509,752.90
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	982,872,667.32	-	5,637,085.58	988,509,752.90
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	8.08	-	7,347,357.89	7,347,365.97
（一）、综合收益总额	-	-	20,517,852.90	20,517,852.90
（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）	8.08	-	0.08	8.16
其中：1. 基金申购款	10.06	-	0.10	10.16
2. 基金赎回款	-1.98	-	-0.02	-2.00
（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）	-	-	-13,170,495.09	-13,170,495.09
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-

四、本期期末净资产	982,872,675.40	-	12,984,443.47	995,857,118.87
-----------	----------------	---	---------------	----------------

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：

<u>刘元瑞</u>	<u>覃波</u>	<u>孙红辉</u>
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

长信稳鑫三个月定期开放债券型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”),经获得中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2017]2429号《关于准予长信稳鑫三个月定期开放债券型发起式证券投资基金注册的批复》,由长信基金管理有限责任公司作为管理人向社会公开募集,基金合同于2018年1月19日生效,首次设立募集规模为310,000,000.00份基金份额。本基金为契约型定期开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人和注册登记机构为长信基金管理有限责任公司,基金托管人为江苏银行股份有限公司。

本基金投资于具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的国债、央行票据、金融债、地方政府债、公司债、企业债、中期票据、短期融资券、超级短期融资券、中小企业私募债券、次级债券等债券资产,资产支持证券,债券回购,银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款),货币市场工具,国债期货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。本基金不投资于股票、权证,也不投资于可转换债券、可交换债券。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%;但在每次开放期开始前10个工作日、开放期及开放期结束后10个工作日的期间内,基金投资不受上述比例限制。在开放期内,每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后,本基金持有现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)以及到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%;在封闭期,每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于交易保证金一倍的现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)。如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制,基金管理人在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。

本基金的业绩比较基准为:中债综合指数收益率。

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。

本财务报表以本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 6 月 30 日的财务状况以及 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 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

6.4.6.1 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（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、债券的转让收入免征增值税；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；

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务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；

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，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；

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金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。对证券投资基金在 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，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定确定。

6.4.6.2 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税法》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

6.4.6.3 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（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、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，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，暂不征收企业所得税。

6.4.6.4 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

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	348,821.98

等于：本金	348,715.45
加：应计利息	106.53
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	348,821.98

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	20,541,800.00	474,986.30	21,274,986.30	258,200.00
	银行间市场	1,180,182,036.48	16,595,496.28	1,203,152,496.28	6,374,963.52
	合计	1,200,723,836.48	17,070,482.58	1,224,427,482.58	6,633,163.52
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	1,200,723,836.48	17,070,482.58	1,224,427,482.58	6,633,163.52	

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

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

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

本基金本报告期末无债权投资。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

本基金本报告期末无其他债权投资。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

本基金本报告期末无其他权益投资工具。

6.4.7.8 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.9 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	16,467.92
其中：交易所市场	-
银行间市场	16,467.92
应付利息	-
预提账户维护费	9,300.00
预提审计费	24,863.02
预提信息披露费	59,672.34
合计	110,303.28

6.4.7.10 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	982,872,670.52	982,872,670.52
本期申购	0.18	0.18
本期赎回（以“-”号填列）	-0.99	-0.99
基金拆分/份额折算前	-	-

基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	982,872,669.71	982,872,669.71

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

本基金本报告期无其他综合收益。

6.4.7.12 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	4,661,126.13	8,620,482.77	13,281,608.90
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	4,661,126.13	8,620,482.77	13,281,608.90
本期利润	18,465,484.49	2,822,697.01	21,288,181.50
本期基金份额交易产生的变动数	-0.01	-0.01	-0.02
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-0.01	-0.01	-0.02
本期已分配利润	-18,674,580.99	-	-18,674,580.99
本期末	4,452,029.62	11,443,179.77	15,895,209.39

6.4.7.13 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	2,380.24
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	-
其他	-
合计	2,380.24

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

本基金本报告期无股票投资收益。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 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	15,887,877.73
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	5,426,808.68
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	21,314,686.41

6.4.7.15.2 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	1,679,049,073.31
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,649,748,893.97
减：应计利息总额	23,851,545.66
减：交易费用	21,825.00
买卖债券差价收入	5,426,808.68

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无债券投资赎回差价收入。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无债券投资申购差价收入。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 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。

6.4.7.18.2 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。

6.4.7.19 股利收益

本基金本报告期无股利收益。

6.4.7.20 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	2,822,697.01
股票投资	-
债券投资	2,822,697.01
资产支持证券投资	-
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	2,822,697.01

6.4.7.21 其他收入

本基金本报告期无其他收入。

6.4.7.22 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.23 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	24,863.02
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
账户维护费	18,600.00
合计	103,135.36

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

截至本财务报告批准报出日，本基金未发生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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方无变化。

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
长信基金管理有限责任公司（“长信基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
江苏银行股份有限公司（“江苏银行”）	基金托管人

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

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均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1月1日至2023年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,495,063.24	1,474,290.50
其中：应支付销售机构的客户维护 费	-	-
应支付基金管理人的净管理费	1,495,063.24	1,474,290.50

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.30% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{基金管理费率} / \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	498,354.44	491,430.14

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{基金托管费年费率} / \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

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

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

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均未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

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

基金管理人在本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例 (%)	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例 (%)
江苏银行	982,872,461.34	99.99	982,872,461.34	99.99

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金费率按本基金招募说明书公布的费率执行。

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 1 月 1 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
江苏银行	348,821.98	2,380.24	264,824.30	2,934.52

注：本基金用于证券交易结算的资金通过本基金托管人的基金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。于 2024 年 6 月 30 日的相关余额在资产负债表中的“结算备付金”科目中单独列示（2023 年 6 月 30 日：同）。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期及上年度可比期间均未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

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
		场内	场外					
1	2024 年 5 月 15 日	-	2024 年 5 月 15 日	0.190	18,674,580.81	0.18	18,674,580.99	-
合计	-	-	-	0.190	18,674,580.81	0.18	18,674,580.99	-

6.4.12 期末（2024 年 6 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，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 225,571,340.75 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
210203	21 国开 03	2024 年 7 月 1 日	103.51	325,000	33,642,352.74
210208	21 国开 08	2024 年 7 月 1 日	104.34	1,500,000	156,511,516.39
230313	23 进出 13	2024 年 7 月 1 日	103.13	500,000	51,564,808.74

合计				2,325,000	241,718,677.87
----	--	--	--	-----------	----------------

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融出证券。

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

本基金在日常活动中面临各种金融工具的风险，主要包括：信用风险、流动性风险和市场风险。

本基金在下文主要论述上述风险敞口及其形成原因、风险管理目标、政策和过程以及计量风险的方法等。

本基金的基金管理人从事风险管理的目标是使本基金在风险和收益之间取得适当的平衡，以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。基于该风险管理目标，本基金的基金管理人已制定了政策和程序来辨别和分析这些风险，设定适当的风险限额并设计相应的内部控制程序，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人奉行全面风险管理体系理念，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。在董事会下设立风险控制委员会，负责对公司经营管理和基金业务运作的合法性、合规性进行全面的检查和评估等；在管理层层面设立内部控制委员会，主要职责是讨论审议公司内部控制制度及针对公司在经营管理和投资组合运作中的风险进行识别、评估并研究制订有效的防范措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部负责协调并与各部门合作完成运作风险管理工作，战略与产品研发部负责进行投资风险分析与绩效评估。监察稽核部向督察长负责，并向总经理汇报日常行政事务。

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，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的银行存款存放在本基金的托管人江苏银行股份有限公司，与该银行存款相关的信用风险不重大。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，本基金投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的10%。

本基金在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。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的债券投资。

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

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	196,292,133.70	-
合计	196,292,133.70	-

注：本基金持有同业存单的主体评级均为 AA+及以上评级。

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	696,622,821.70	572,981,257.97
AAA 以下	-	-
未评级	331,512,527.18	655,917,346.48
合计	1,028,135,348.88	1,228,898,604.45

注：未评级债券为国债、央行票据及政策性金融债等无信用评级债券。

6.4.13.2.5 按长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长期信用评级列示的资产支持证券投资。

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

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开放式基金每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和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。

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。本基金坚持组合管理、分散投资的原则开展投资活动，所持证券均在证券交易所或银行间同业市场交易，并严格遵守基金管理人流动性相关交易限制。

本基金主要投资于基金合同约定的具有良好流动性的金融工具，基金管理人流动性指标进行持续的监测和分析，定期开展压力测试，评估在不同的压力情境下资产变现情况的变化。

基金管理人持续监测本基金开放期内的赎回情况，当市场环境或投资者结构发生变化时，及时调整投资组合资产结构及比例，保持基金资产可变现规模和期限与负债赎回规模和期限的匹配。

同时，针对兑付赎回资金的流动性风险，基金管理人在基金合同中约定了巨额赎回条款，制定了发生巨额赎回时资金的处理模式，控制因开放模式而产生的流动性风险。

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

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。

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	6个月以内	6个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产						
货币资金	348,821.98	-	-	-	-	348,821.98
交易性金融资产	112,665,265.84	429,450,901.76	639,967,446.13	42,343,868.85	-	1,224,427,482.58
资产总计	113,014,087.82	429,450,901.76	639,967,446.13	42,343,868.85	-	1,224,776,304.56
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	1.01	1.01
应付管理人报	-	-	-	-	245,085.32	245,085.32

酬						
应付托管费	-	-	-	-	81,695.10	81,695.10
卖出回购金融资产款	225,571,340.75	-	-	-	-	225,571,340.75
其他负债	-	-	-	-	110,303.28	110,303.28
负债总计	225,571,340.75	-	-	-	437,084.71	226,008,425.46
利率敏感度缺口	-112,557,252.93	429,450,901.76	639,967,446.13	42,343,868.85	-437,084.71	998,767,879.10
上年度末 2023年 12月31日	6个月以内	6个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产						
货币资金	893,457.81	-	-	-	-	893,457.81
交易性金融资产	101,849,774.94	-	1,127,048,829.51	-	-	1,228,898,604.45
资产总计	102,743,232.75	-	1,127,048,829.51	-	-	1,229,792,062.26
负债						
应付管理人报酬	-	-	-	-	252,548.26	252,548.26
应付托管费	-	-	-	-	84,182.76	84,182.76
卖出回购金融资产款	233,082,746.52	-	-	-	-	233,082,746.52
其他负债	-	-	-	-	218,305.30	218,305.30
负债总计	233,082,746.52	-	-	-	555,036.32	233,637,782.84
利率敏感度缺口	-130,339,513.77	-	1,127,048,829.51	-	-555,036.32	996,154,279.42

注：表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
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）
	市场利率上升27个基点	-5,003,075.35	-6,507,085.08
	市场利率下降27个基点	5,003,075.35	6,507,085.08

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的债券和银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他市场价格风险。

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6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	1,224,427,482.58	122.59	1,228,898,604.45	123.36
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,224,427,482.58	122.59	1,228,898,604.45	123.36

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

本基金主要投资债券等固定收益品种，无重大其他价格风险，因此未进行其他价格风险的敏

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	1,224,427,482.58	1,228,898,604.45
第三层次	-	-
合计	1,224,427,482.58	1,228,898,604.45

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。本基金本报告期及上年度可比期间持有的持续以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末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

6.4.15.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

6.4.15.2 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,224,427,482.58	99.97
	其中：债券	1,224,427,482.58	99.97
	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	348,821.98	0.03
8	其他各项资产	-	-
9	合计	1,224,776,304.56	100.00

注：本基金本报告期末未通过港股通交易机制投资港股。本基金本报告期末未参与转融通证券出借业务。

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股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期内未买入股票。

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

本基金本报告期内未卖出股票。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内未投资股票。

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	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	945,167,787.51	94.63
	其中：政策性金融债	331,512,527.18	33.19
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	196,292,133.70	19.65
9	其他	82,967,561.37	8.31
10	合计	1,224,427,482.58	122.59

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	112413083	24 浙商银行 CD083	2,000,000	196,292,133.70	19.65
2	210208	21 国开 08	1,500,000	156,511,516.39	15.67
3	092280069	22 华夏银行二级资本债 01	600,000	63,292,393.44	6.34
4	2228007	22 浦发银行 01	600,000	60,929,403.28	6.10
5	2228028	22 中信银行 01	600,000	60,697,660.27	6.08

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 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.10.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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

报告期内本基金投资的前十名证券中，发行主体浙商银行股份有限公司于 2024 年 2 月 2 日收到国家金融监督管理总局浙江监管局行政处罚信息公开表（浙金罚决字〔2024〕4 号），经查，浙商银行股份有限公司存在以下情况：向小微企业客户转嫁成本，违规要求客户承担抵押评估费；向小微企业客户转嫁成本，违规要求客户承担抵押登记费。综上，根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条及相关审慎经营规则，国家金融监督管理总局浙江监管局决定对浙商银行处以罚款 55 万元。

报告期内本基金投资的前十名证券中，发行主体中信银行股份有限公司于 2023 年 11 月 16 日收到国家金融监督管理总局行政处罚信息公开表（金罚决字〔2023〕15 号），经查，中信银行股份有限公司存在以下问题：一、违反高管准入管理相关规定；二、关联贷款管理不合规；三、绩效考核不符合规定；四、重大关联交易信息披露不充分；五、统一授信管理不符合要求；六、内审人员配置不足；七、案件防控工作落实不到位；八、贷款风险分类不准确；九、并购贷款“三查”失职；十、违规发放并购贷款收购保险公司股权；十一、发放大量贷款代持本行不良；十二、流动资金贷款业务未严格执行贷款“三查”要求；十三、贷款资金用作归还本行理财融资；十四、固定资产贷款第一还款来源调查不实；十五、贴现资金直接转回出票人账户；十六、发放贷款偿还银行相关垫款；十七、批量转让不良资产未严格遵守真实转让原则；十八、通过同业业务投资已出表的不良资产；十九、利用空存空取规避信贷资金监控；二十、以贷转存；二十一、贷款用途监控及支付管理不到位；二十二、股票质押贷款管控不到位；二十三、部分个人贷款业务品种设计存在缺陷；二十四、承担委托贷款实质性风险；二十五、违规向非融资性担保公司提供授信；二十六、票据贸易背景审查不到位；二十七、未严格审查国内信用证业务贸易背景真实性；二十八、不良债权批量转让对象不合规；二十九、部分业务不符合国家政策要求；三十、资产证券化信息披露不准确；三十一、为企业入股金融机构提供融资；三十二、非标债权资产比例超监管标准；三十三、理财产品承接违约资产；三十四、利用管理费弥补投资损失；三十五、违规用于项目资本金；三十六、面向一般客户销售的理财产品投资权益类资产；三十七、通过同业投资归还本行不良贷款；三十八、未为每只理财产品开设独立的托管账户；三十九、改变资产交易价格，调节产品收益；四十、行长办公会有关决议不符合服务实体经济要求；四十一、理财业务与其他业务相互承接；四十二、超比例向并购项目提供理财融资；四十三、未严格落实授信批复条件；

四十四、理财资金被挪用；四十五、同业理财未按产品说明书进行投资；四十六、理财产品信息披露不合规；四十七、部分结构性存款业务不符合监管要求；四十八、代销信托产品审慎性不足；四十九、以同业返存模式吸收存款；五十、变更还款计划，分类不准确；五十一、同业投资业务风险审查和资金投向合规性审查不到位；五十二、部分新产品时点指标不符合新规监管标准；五十三、理财业务风险隔离不符合监管规定；五十四、理财与自营业务未严格分离；五十五、部分信用卡业务不合规；五十六、违反集团授信相关规定，形成不良。综上，根据《中华人民共和国商业银行法》第四十条、第七十三条、第七十四条，《中华人民共和国银行业监督管理法》第十九条、第二十条、第二十一条、第四十五条、第四十六条及相关审慎经营规则，国家金融监督管理总局决定对中信银行总行罚款 15242.59 万元、没收违法所得 462.59 万元，对分支机构罚款 6770 万元；罚没合计 22475.18 万元。

报告期内本基金投资的前十名证券中，发行主体中信银行股份有限公司于 2023 年 12 月 29 日收到国家金融监督管理总局行政处罚信息公开表（金罚决字〔2023〕69 号），经查，中信银行股份有限公司存在以下问题：一、部分重要信息系统应认定未认定，相关系统未建灾备或灾难恢复能力不符合监管要求；二、同城数据中心长期存在基础设施风险隐患未得到整改；三、对外包数据中心的准入前尽职调查和日常管理不符合监管要求，部分数据中心存在风险隐患；四、数据中心机房演练流于形式，部分演练为虚假演练，实际未开展；五、数据中心重大变更事项未向监管部门报告；六、运营中断事件报告不符合监管要求。综上，根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条和相关审慎经营规则，国家金融监督管理总局决定对中信银行处以罚款 400 万元。

报告期内本基金投资的前十名证券中，发行主体中国农业银行股份有限公司于 2023 年 8 月 15 日收到国家金融监督管理总局行政处罚信息公开表（金罚决字〔2023〕8 号），经查，中国农业银行股份有限公司存在以下情况：一、农户贷款发放后流入房地产企业；二、农村个人生产经营贷款贷后管理不到位；三、农户小额贷款发放后转为定期存款；四、违规向房地产开发企业提供融资；五、违规发放流动资金贷款；六、装修贷款发放不审慎；七、商业用房贷款发放不审慎；八、违规向关系人发放信用贷款；九、贷款风险分类不准确导致不良率失实；十、违规发放固定资产贷款；十一、对不具备法人资格的分支公司客户单独办理授信；十二、集团客户统一授信管理不到位；十三、贷款回流用于归还本行贷款；十四、贷款回流用于缴纳银承保证金；十五、贷款回流用于转存定期存款；十六、贴现资金回流出票人；十七、信贷资金流入证券账户；十八、贷后管理不尽责导致信贷资金实质被关联企业占用；十九、扶贫小额信贷“户贷企用”。综上，根据《中华人民共和国商业银行法》第四十条、第七十四条，《中华人民共和国银行业监督管理法》

第二十一条、第四十六条及相关审慎经营规则，国家金融监督管理总局决定对农业银行没收违法所得并处罚款合计 4420.184584 万元。其中，对总行罚款 1760.092292 万元，没收违法所得 60.092292 万元，对分支机构罚款 2600 万元。

报告期内本基金投资的前十名证券中，发行主体中国农业银行股份有限公司于 2023 年 11 月 16 日收到国家金融监督管理总局行政处罚信息公开表（金罚决字〔2023〕21 号），经查，中国农业银行股份有限公司存在以下情况：一、流动资金贷款被用于固定资产投资；二、贷款受托支付问题整改不到位；三、贷款风险分类不准确；四、个别精准扶贫贷款被挪用；五、不良资产转让流程问题整改不到位；六、小微企业划型不准确；七、贷款资金转存银承汇票保证金问题整改不到位；八、个人贷款违规流入房地产市场问题整改不到位；九、审计人员配备不足问题未整改；十、非现场数据报送不准确，整改不到位；十一、人员内部问责不到位；十二、向关系人发放信用贷款；十三、个人贷款管理不到位，部分贷款资金被挪用。综上，根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条，《中华人民共和国商业银行法》第四十条、第七十四条及相关审慎经营规则，国家金融监督管理总局决定对农业银行没收违法所得并处罚款合计 2710.9738 万元。其中，总行 570.9738 万元，分支机构 2140 万元。

报告期内本基金投资的前十名证券中，发行主体中国银行股份有限公司于 2023 年 12 月 28 日收到国家金融监督管理总局行政处罚信息公开表（金罚决字〔2023〕68 号），经查，中国银行股份有限公司存在以下情况：一、部分重要信息系统识别不全面，灾备建设和灾难恢复能力不符合监管要求；二、重要信息系统投产及变更未向监管部门报告，且投产及变更长期不规范引发重要信息系统较大及以上突发事件；三、信息系统运行风险识别不到位、处置不及时，引发重要信息系统重大突发事件；四、监管意见整改落实不到位，引发重要信息系统重大突发事件；五、信息科技外包管理不审慎；六、网络安全域未开展安全评估，网络架构重大变更未开展风险评估且未向监管部门报告；七、信息系统突发事件定级不准确，导致未按监管要求上报；八、迟报重要信息系统重大突发事件；九、错报漏报监管标准化（EAST）数据。综上，根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条和相关审慎经营规则，国家金融监督管理总局决定对中国银行处以罚款 430 万元。

对如上证券投资决策程序的说明：公司研究部门按照内部研究工作规范对该证券进行分析后将其列入基金投资对象备选库。在此基础上本基金的基金经理根据具体市场情况独立作出投资决策。该事件发生后，本基金管理人对该证券的发行主体进行了进一步了解与分析，认为此事件未对该证券投资价值判断产生重大的实质性影响。本基金投资于该证券的投资决策过程符合制度规定的投资权限范围与投资决策程序。

报告期内本基金投资的前十名证券中其余的发行主体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。

7.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金本报告期末未投资股票，不存在投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库的情形。

7.11.3 期末其他各项资产构成

本基金本报告期末未持有其他资产。

7.11.4 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。

7.11.5 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投资股票。

7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

§ 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 (%)
209	4,702,740.05	982,872,669.71	100.00	0.00	0.00

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	0.00	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

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
本基金基金经理持有本开放式基金	0

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份 额总数	持有份额占 基金总份 额比例(%)	发起份 额总数	发起份额占基金 总份额比例(%)	发起份额承 诺持有期限

基金管理人固有资金	0.00	0.00	0.00	0.00	-
基金管理人高级管理人员	0.00	0.00	0.00	0.00	-
基金经理等人员	0.00	0.00	0.00	0.00	-
基金管理人股东	0.00	0.00	0.00	0.00	-
其他	0.00	0.00	0.00	0.00	-
合计	0.00	0.00	0.00	0.00	-

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2018年1月19日）基金份额总额	310,000,000.00
本报告期期初基金份额总额	982,872,670.52
本报告期基金总申购份额	0.18
减：本报告期基金总赎回份额	0.99
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	982,872,669.71

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

10.2.1 基金管理人的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人无重大人事变动。

10.2.2 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

本报告期本基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金未更换会计师事务所。

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

本报告期内未发生基金管理人及高级管理人员受稽查或处罚等情形。

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，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 (%)	
安信证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-

注：1、本期租用证券公司交易单元的变更情况

本报告期内本基金租用证券公司交易单元没有变更。

2、专用交易单元的选择标准和程序

根据中国证监会《关于加强证券投资基金监管有关问题的通知》（证监基字【1998】29号）和《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字【2007】48号）的有关规定，本公司制定了租用证券公司专用交易单元的选择标准和程序。

（1）选择标准：

- 1) 券商基本面评价（财务状况、经营状况）；
- 2) 券商研究机构评价（报告质量、及时性和数量）；
- 3) 券商每日信息评价（及时性和有效性）；
- 4) 券商协作表现评价。

（2）选择程序：

首先根据租用证券公司专用交易单元的选择标准形成《券商服务评价表》，然后根据评分高低进行选择基金专用交易单元。

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	
	成交金额	占当期债券	成交金额	占当期债券回购成交总	成交金额	占当期权证
		券		回购成交总		证

		成交总额 的比例 (%)		额的比例 (%)		成交总额 的比例 (%)
安信证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-

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	长信基金管理有限责任公司关于提醒投资者防范不法分子假冒本公司工作人员名义从事诈骗活动的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2024-1-19
2	长信稳鑫三个月定期开放债券型发起式证券投资基金 2023 年第 4 季度报告	中国证监会电子披露网站、公司网站	2024-1-22
3	长信基金管理有限责任公司旗下全部基金 2023 年第四季度报告提示性公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2024-1-22
4	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金持有的停牌股票调整估值方法的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2024-2-6
5	长信基金管理有限责任公司关于增加华西证券股份有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2024-3-6
6	长信基金管理有限责任公司关于长信稳鑫三个月定期开放债券型发起式证券投资基金开放申购、赎回业务的公告	证券时报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2024-3-22
7	长信稳鑫三个月定期开放债券型发起式证券投资基金 2023 年年度报告	中国证监会电子披露网站、公司网站	2024-3-29
8	长信基金管理有限责任公司旗下全部基金 2023 年年度报告提示性公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2024-3-29
9	长信基金管理有限责任公司关于增加中航证券有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2024-4-1
10	长信稳鑫三个月定期开放债券型发起式证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	中国证监会电子披露网站、公司网站	2024-4-22
11	长信基金管理有限责任公司旗下全部基金 2024 年第一季度报告提示性公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2024-4-22
12	长信基金管理有限责任公司关于长信稳鑫三个月定期开放债券型发起式证券投资基金的分红公告	证券时报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2024-5-13

13	长信基金管理有限责任公司关于住所变更的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2024-6-15
14	长信基金管理有限责任公司关于暂停海银基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2024-6-15
15	长信基金管理有限责任公司关于增加德邦证券有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2024-6-20
16	长信基金管理有限责任公司关于增加麦高证券有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2024-6-24
17	长信基金管理有限责任公司关于增加信达证券股份有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2024-6-25
18	长信基金管理有限责任公司关于长信稳鑫三个月定期开放债券型发起式证券投资基金开放申购、赎回业务的公告	证券时报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2024-6-25
19	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金参加汉口银行股份有限公司申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2024-6-26
20	长信稳鑫三个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会电子披露网站、公司网站	2024-6-28

§ 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	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	982,872,461.34	0.00	0.00	982,872,461.34	99.99
产品特有风险							
<p>1、基金净值大幅波动的风险 单一持有基金比例过高的投资者连续大量赎回，可能会影响基金投资的持续性和稳定性，增加变现成本。同时，按照净值计算尾差处理规则可能引起基金份额净值异常上涨或下跌。</p> <p>2、赎回申请延期办理的风险 单一持有基金比例过高的投资者大额赎回后可能触发本基金巨额赎回条件，导致同期中小投资者小额赎回面临部分延期办理的情况。</p>							

3、基金投资策略难以实现的风险

单一持有基金比例过高的投资者大额赎回后，可能引起基金资产总净值显著降低，从而使基金在投资时受到限制，导致基金投资策略难以实现。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期未发生影响投资者决策的其他重要信息。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立基金的文件；
- 2、《长信稳鑫三个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《长信稳鑫三个月定期开放债券型发起式证券投资基金招募说明书》；
- 4、《长信稳鑫三个月定期开放债券型发起式证券投资基金托管协议》；
- 5、报告期内在指定报刊上披露的各种公告的原稿；
- 6、长信基金管理有限责任公司营业执照、公司章程及相关资格批复文件

12.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

12.3 查阅方式

长信基金管理有限责任公司网站：<https://www.cxfund.com.cn>。

长信基金管理有限责任公司

2024 年 8 月 30 日