

长安泓源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:长安基金管理有限公司

基金托管人:中国农业银行股份有限公司

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及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。本报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年08月29日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新和重要提示。

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 | 7 |
| 2.4 信息披露方式 | 7 |
| 2.5 其他相关资料 | 7 |
| §3 主要财务指标和基金净值表现 | 8 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标 | 8 |
| 3.2 基金净值表现 | 8 |
| §4 管理人报告 | 11 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况 | 11 |
| 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 | 12 |
| 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 | 12 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 | 13 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 | 13 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 | 14 |
| 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 | 14 |
| §5 托管人报告 | 14 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 | 14 |
| 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 | 14 |
| 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 | 14 |
| §6 半年度财务会计报告（未经审计） | 15 |
| 6.1 资产负债表 | 15 |
| 6.2 利润表 | 16 |
| 6.3 净资产变动表 | 18 |
| 6.4 报表附注 | 19 |
| §7 投资组合报告 | 49 |
| 7.1 期末基金资产组合情况 | 49 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 | 49 |
| 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 | 50 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 | 50 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 | 50 |
| 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 | 50 |
| 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 | 51 |
| 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 | 51 |
| 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 | 51 |
| 7.10 本基金投资股指期货的投资政策 | 51 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 | 51 |
| 7.12 投资组合报告附注 | 51 |
| §8 基金份额持有人信息 | 52 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 52 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 53 |

| | |
|---|----|
| 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..... | 53 |
| §9 开放式基金份额变动..... | 53 |
| §10 重大事件揭示..... | 54 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议..... | 54 |
| 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..... | 54 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼..... | 54 |
| 10.4 基金投资策略的改变..... | 54 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况..... | 54 |
| 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..... | 54 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况..... | 55 |
| 10.8 其他重大事件..... | 56 |
| §11 影响投资者决策的其他重要信息..... | 58 |
| 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..... | 58 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息..... | 58 |
| §12 备查文件目录..... | 58 |
| 12.1 备查文件目录..... | 58 |
| 12.2 存放地点..... | 59 |
| 12.3 查阅方式..... | 59 |

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | |
|-----------------|-------------------|-----------------|
| 基金名称 | 长安泓源纯债债券型证券投资基金 | |
| 基金简称 | 长安泓源纯债债券 | |
| 基金主代码 | 004897 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2019年05月10日 | |
| 基金管理人 | 长安基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 中国农业银行股份有限公司 | |
| 报告期末基金份额总额 | 1,426,753,740.08份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 长安泓源纯债债券A | 长安泓源纯债债券C |
| 下属分级基金的交易代码 | 004897 | 004898 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 1,069,032,925.53份 | 357,720,814.55份 |

2.2 基金产品说明

| | |
|------|---|
| 投资目标 | 在严格控制风险的前提下，通过积极主动的投资管理，追求超越业绩比较基准的投资回报和基金资产的长期稳健增值。 |
| 投资策略 | <p>1、久期策略</p> <p>久期策略主要指根据对经济、政策和市场的分析，确定债券组合的久期水平。</p> <p>本基金将全面、深入研究影响利率变化的宏观因素，如经济增长率、通货膨胀、国际收支等的变化，进而判断经济政策的基调和走向，结合债券市场资金供给结构、流动性充裕情况以及投资人避险情绪等的变化，判断和预测未来利率的可能走势，确定并调整投资组合的久期水平。当预期市场利率水平下降时，提高组合久期，以增强投资组合收益；当预期市场利率水平上升时，降低组合久期，以规避债券市场下跌带来的风险。</p> <p>2、类属配置策略</p> <p>类属配置策略即决定资金在不同类属债券间的配置。</p> <p>本基金将根据对经济周期和市场环境的把握，基于对财政政策、货币政策的深入分析及对宏观经济发展的持续跟踪，结合市场上主</p> |

要的债券配置机构的资金情况，并根据不同类型债券的风险来源、收益率水平、利息支付方式、利息税务处理、附加选择权价值、类属资产收益差异、市场偏好及流动性等因素，在债券一级市场和二级市场，银行间市场和交易所市场，银行存款、信用债券、利率债券等资产类别之间进行类属配置，确定具有最优风险收益特征的资产组合。

3、期限结构策略

期限结构策略指通过预测收益率曲线的形状和变化趋势，对不同期限的债券进行合理配置。本基金将分析同一类属债券的收益率曲线形态和期限结构变动，在给定组合久期以及其他组合约束条件的情形下，确定最优的期限结构。具体来看，可分为跟踪收益率曲线的骑乘策略和基于收益率曲线变化的子弹策略、哑铃策略及梯形策略。

4、信用债券策略

信用债券收益率等于基准收益率加信用利差，信用利差收益主要受两方面影响，一是该信用债券对应信用水平的市场平均信用利差曲线走势；二是该信用债券本身的信用变化。基于上述两方面因素，本基金采用以下投资策略：

基于信用利差曲线变化的策略：一是分析经济周期和相关市场变化对信用利差曲线的影响，二是分析信用债券市场容量、结构、流动性等变化趋势对信用利差曲线的影响，综合各种因素，分析信用利差曲线整体及分行业走势，确定信用债券总的投资比例及分行业的投资比例。

基于信用债券信用变化的策略：发行人信用发生变化后，本基金将采用变化后的债券信用级别所对应的信用利差曲线对信用债券定价。影响信用债券信用风险的因素包括行业风险、公司风险、现金流风险、资产负债风险和其他风险等。

5、资产支持证券投资策略

本基金将通过分析市场利率、发行条款、资产池结构及其资产池所处行业的景气变化、违约率、提前偿还率等影响资产支持证券内在价值的相关要素，并综合运用久期管理、收益率曲线变动分析、收益率利差分析和期权定价模型等方法，在严格控制风险的情况下，通过信用研究和流动性管理，选择经风险调整后相对价值较高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。

6、回购套利策略

| | |
|--------|---|
| | 本基金将在考虑债券投资的风险收益情况以及回购成本等因素的情况下，在风险可控及法律法规允许的范围内，通过债券回购融入和滚动短期资金，投资于收益率高于融资成本的债券等其他金融工具，获得杠杆放大收益。 |
| 业绩比较基准 | 中国债券综合全价指数的收益率 |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，预期风险和预期收益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 | | 长安基金管理有限公司 | 中国农业银行股份有限公司 |
| 信息披露 负责人 | 姓名 | 李永波 | 任航 |
| | 联系电话 | 021-20329700 | 010-66060069 |
| | 电子邮箱 | service@changanfunds.com | tgxxpl@abchina.com |
| 客户服务电话 | | 400-820-9688 | 95599 |
| 传真 | | 021-50598018 | 010-68121816 |
| 注册地址 | | 上海市虹口区丰镇路806号3幢371室 | 北京市东城区建国门内大街69号 |
| 办公地址 | | 上海市浦东新区芳甸路1088号紫竹国际大厦16层 | 北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座F9 |
| 邮政编码 | | 201204 | 100031 |
| 法定代表人 | | 崔晓健 | 谷澍 |

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 | http://www.changanfunds.com |
| 基金中期报告备置地点 | 上海市浦东新区芳甸路1088号紫竹国际大厦16层 |

2.5 其他相关资料

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|--------|------------|-------------------|
| 注册登记机构 | 长安基金管理有限公司 | 上海市浦东新区芳甸路1088号紫竹 |

| | |
|--|---------|
| | 国际大厦16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) | |
|---------------|----------------------------------|----------------|
| | 长安泓源纯债债券 A | 长安泓源纯债债券 C |
| 本期已实现收益 | 22,106,154.43 | 4,809,837.33 |
| 本期利润 | 41,661,662.96 | 9,540,205.04 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0422 | 0.0379 |
| 本期加权平均净值利润率 | 3.96% | 3.53% |
| 本期基金份额净值增长率 | 4.05% | 3.97% |
| 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 | 39,665,634.12 | 14,478,076.87 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0371 | 0.0405 |
| 期末基金资产净值 | 1,108,698,559.65 | 372,198,891.42 |
| 期末基金份额净值 | 1.0371 | 1.0405 |
| 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 | 30.10% | 29.21% |

- 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、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、对期末可供分配利润，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。
- 4、本报告期自2024年01月01日至06月30日止。

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

长安泓源纯债债券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 | 0.62% | 0.01% | 0.65% | 0.03% | -0.03% | -0.02% |
| 过去三个月 | 1.92% | 0.03% | 1.06% | 0.07% | 0.86% | -0.04% |
| 过去六个月 | 4.05% | 0.04% | 2.42% | 0.07% | 1.63% | -0.03% |
| 过去一年 | 5.03% | 0.04% | 3.27% | 0.06% | 1.76% | -0.02% |
| 过去三年 | 12.92% | 0.03% | 6.58% | 0.05% | 6.34% | -0.02% |
| 自基金合同生效起至今 | 30.10% | 0.11% | 8.81% | 0.06% | 21.29% | 0.05% |

本基金整体业绩比较基准构成为：中国债券综合全价指数的收益率。

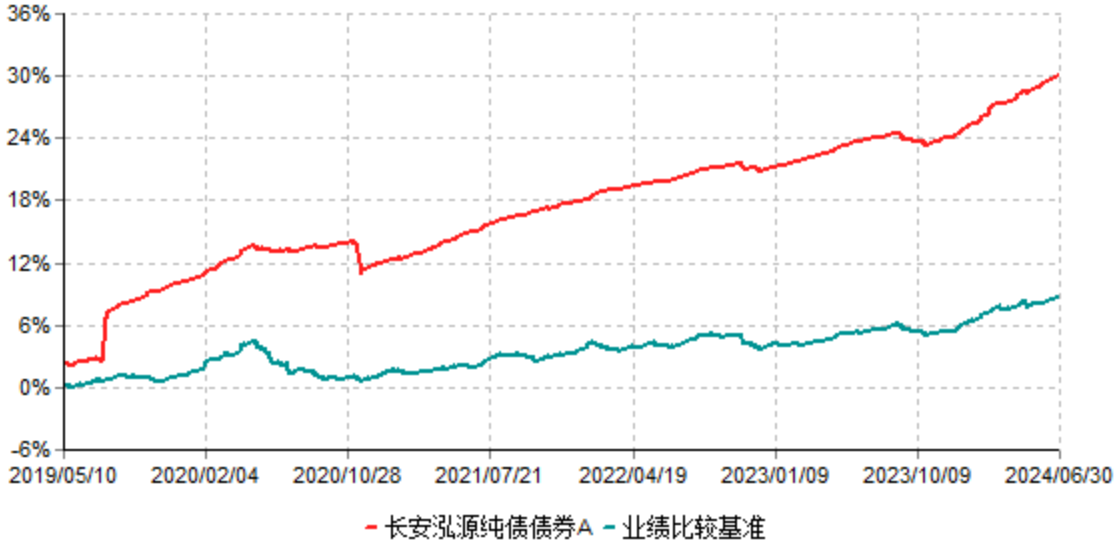
长安泓源纯债债券C

| 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 | 0.61% | 0.01% | 0.65% | 0.03% | -0.04% | -0.02% |
| 过去三个月 | 1.89% | 0.03% | 1.06% | 0.07% | 0.83% | -0.04% |
| 过去六个月 | 3.97% | 0.04% | 2.42% | 0.07% | 1.55% | -0.03% |
| 过去一年 | 4.87% | 0.04% | 3.27% | 0.06% | 1.60% | -0.02% |
| 过去三年 | 12.45% | 0.03% | 6.58% | 0.05% | 5.87% | -0.02% |
| 自基金合同生效起至今 | 29.21% | 0.11% | 8.81% | 0.06% | 20.40% | 0.05% |

本基金整体业绩比较基准构成为：中国债券综合全价指数的收益率。

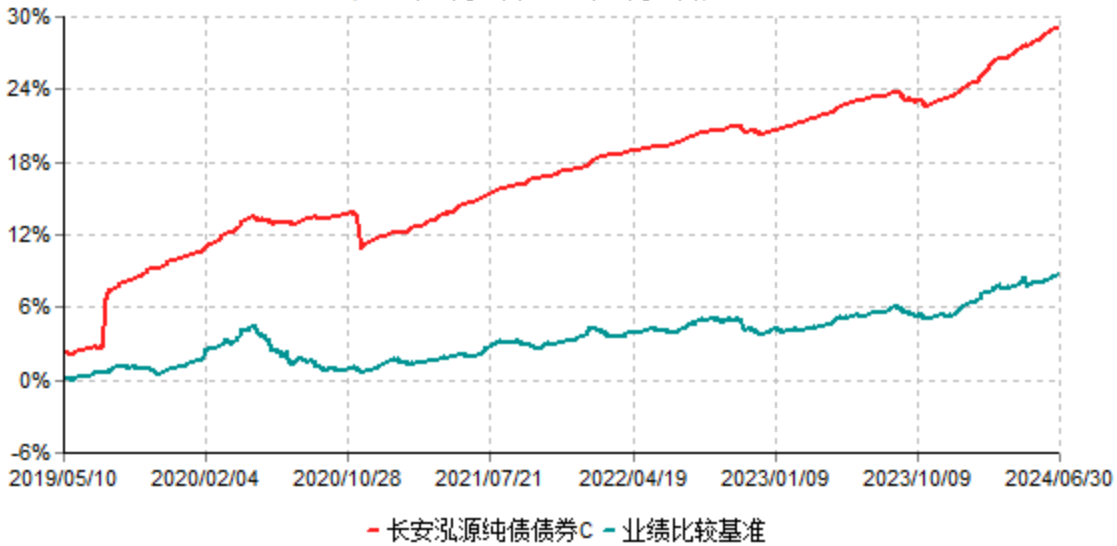
3.2.2 自基金转型以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

长安泓源纯债债券A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2019年05月10日-2024年06月30日)



- 1、本基金从2019年05月10日转型为长安泓源纯债债券型证券投资基金。图示日期为2019年05月10日至2024年06月30日止。
- 2、本基金建仓期为自基金合同生效日起的六个月。本基金在建仓期结束后，各项资产配置比例已符合基金合同有关投资比例的约定。

长安泓源纯债债券C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2019年05月10日-2024年06月30日)



- 1、本基金从2019年05月10日转型为长安泓源纯债债券型证券投资基金。图示日期为2019年05月10日至2024年06月30日止。
- 2、本基金建仓期为自基金合同生效日起的六个月。本基金在建仓期结束后，各项资产配置比例已符合基金合同有关投资比例的约定。

§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

长安基金管理有限公司成立于2011年9月5日，公司的股东分别为：长安国际信托股份有限公司、杭州景林景淳企业管理合伙企业（有限合伙）、上海恒嘉美联发展有限公司、五星控股集团有限公司、兵器装备集团财务有限责任公司。截至2024年6月30日，本基金管理人共管理长安宏观策略混合型证券投资基金、长安沪深300非周期行业指数证券投资基金、长安货币市场证券投资基金、长安产业精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、长安鑫利优选灵活配置混合型证券投资基金、长安鑫益增强混合型证券投资基金、长安鑫富领先灵活配置混合型证券投资基金、长安泓源纯债债券型证券投资基金、长安泓沚中短债债券型证券投资基金、长安鑫旺价值灵活配置混合型证券投资基金、长安鑫兴灵活配置混合型证券投资基金、长安裕盛灵活配置混合型证券投资基金、长安裕泰灵活配置混合型证券投资基金、长安鑫禧灵活配置混合型证券投资基金、长安裕腾灵活配置混合型证券投资基金、长安泓润纯债债券型证券投资基金、长安裕隆灵活配置混合型证券投资基金、长安鑫盈灵活配置混合型证券投资基金、长安鑫悦消费驱动混合型证券投资基金、长安鑫瑞科技先锋6个月定期开放混合型证券投资基金、长安成长优选混合型证券投资基金、长安先进制造混合型证券投资基金、长安优势行业混合型证券投资基金、长安行业成长混合型证券投资基金等24只证券投资基金。

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 | | |
| 孟楠 | 本基金的基金经理 | 2019-07-08 | - | 11年 | 法律硕士。曾任东证融汇证券资产管理有限公司（原东北证券股份有限公司上海分公司）投研助理、投资经理助理及投资主办等职。现任长安基金管理有限公司固定收益部基金经理。 |

- 1、任职日期和离任日期均指公司做出决定后正式对外公告之日；
- 2、证券从业的含义遵从行业协会关于从业人员资格管理办法的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

截至本报告期末，本基金的基金经理不存在兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人树立价值投资理念，设置合理的组织架构和科学的投资决策体系，确保投资、研究、交易各个环节的独立性。同时，建立健全公司适用的投资对象备选库和交易对手备选库，共享研究成果，在确保投资组合间的信息隔离与保密的情况下，保证建立信息公开、资源共享的公平投资管理环境。

公司建立了专门的公平交易制度，并在交易系统中采用公平交易模块，保证公平交易的严格执行。对异常交易的监控包括事前、事中和事后三个环节，并经过严格的报告和审批程序，防范和控制异常交易。

报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《长安基金管理有限公司公平交易制度》的规定。

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。

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年上半年债市走牛，收益率大幅下行，“资产荒”是驱动利率不断下行的主线逻辑。2024年经济增长目标、财政政策以及货币政策均未超出市场预期。一季度市场对于经济增长预期较为悲观，再加上年初降准降息落地、资金面宽松等因素，机构欠配叠加政府债供给低于去年同期，债市需求强于供给，10年期国债收益率一度下行至2.23%低点。4月下旬起央行多次提示长端利率风险，地产政策工具频出，债市转为阶段性调

整行情，随后低位窄幅震荡。6月半年末资金面平稳，二季度经济数据有所走弱，在非银资金较为充裕、部分银行再次下调存款利率叠加市场对于央行提示长债风险逐渐钝化情形下，债市收益率进一步缓慢下行，10年期国债收益率再度向下运行突破前期低点至2.21%，30年国债收益率向下突破2.5%关键点位。

信用债方面，上半年违约风险较2023年下降，违约债券仍然集中在房地产债。随着经济数据走弱，信用债“资产荒”格局延续，收益率整体震荡下行，期间未有明显回调。一方面实体经济延续弱复苏，化债背景下城投债供给减少，净融资萎缩；另一方面，理财规模企稳回升，低利率环境中对信用债需求旺盛。从收益率来看，上半年各期限各等级信用债收益率均大幅下行，表现强于利率债，尤其长久期及弱资质信用利差收窄压缩幅度更大，期限利差和信用等级利差均有所收窄，各类具备超额收益的品种利差被不断抹平，下沉行情逐步从弱资质城投蔓延至隐含评级AA-的产业债。

整体来看，基于此前对市场的判断，本产品在上半年以增配中长久期信用债为主，辅以5-10年利率债波段操作，根据市场趋势以及资金面的波动，调整资产结构和久期，以投资者利益为先，提高组合的收益，整体收益表现尚可。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末长安泓源纯债债券A基金份额净值为1.0371元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为4.05%，同期业绩比较基准收益率为2.42%；截至报告期末长安泓源纯债债券C基金份额净值为1.0405元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为3.97%，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

下半年经济预计延续偏缓改善趋势，有效需求不足是主要制约因素，叠加高温洪涝灾害影响，生产边际放缓。国际大宗商品价格回落，国内旅游出行、农产品价格上行，海外经济数据边际走弱，掣肘出口和物价，国内消费复苏偏缓，投资主要靠制造业支撑，政策诉求增强，从基本面视角来看，高质量发展的基调下，各政策的落地效果需要观察期，波动较小。内生性需求较弱的局面无法带动融资需求的大幅回暖，这是债市中期维持向好的支撑。而随着海外降息周期临近，汇率压力减轻，在“加大金融对实体经济支持力度”背景下，货币政策仍有进一步宽松的空间，预计债券牛市延续，但利率历史绝对低位下波动可能加剧。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人制订了健全、有效的估值政策和程序，清算登记部按照管理层批准后的估值政策进行估值。对于在交易所上市的证券(除固定收益品种外)，采用交易所发布的行情信息来估值。对本基金所持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所和银行间

上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外）采用第三方估值机构提供的价格进行估值。除了投资总监外，其他基金经理不参与估值政策的决策。但是对于非活跃投资品种，基金经理可以提供估值建议。上述参与估值流程各方之间无任何重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金于2024年06月24日进行了利润分配，长安泓源纯债债券A类每10份基金份额分配0.4870元，其中以现金形式发放总额为51,520,118.85元，以再投资形式发放总额为476,942.60元，共计51,997,061.45元；长安泓源纯债债券C类每10份基金份额分配0.4870元，其中以现金形式发放总额为11,841,443.34元，以再投资形式发放总额为4,927,035.92元，共计16,768,479.26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

本基金无连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元情形。

§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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业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》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人-长安基金管理有限公司 2024年01月01日至2024年06月30日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，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遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，长安基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金

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：长安泓源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 |
|---------------|------------|--------------------|---------------------|
| 资产： | | | |
| 货币资金 | 6.4.7.1 | 6,183,952.94 | 1,513,675.38 |
| 结算备付金 | | 345,961.57 | 645,558.77 |
| 存出保证金 | | 18,505.59 | 8,598.07 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 1,670,588,326.13 | 1,237,231,202.69 |
| 其中：股票投资 | | - | - |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 1,561,313,883.12 | 1,095,983,609.54 |
| 资产支持证券投资 | | 109,274,443.01 | 141,247,593.15 |
| 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 | | 20,000,000.00 | 3,092,886.32 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 2,945,395.95 | 1,461,654.72 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.5 | - | - |
| 资产总计 | | 1,700,082,142.18 | 1,243,953,575.95 |
| 负债和净资产 | 附注号 | 本期末 | 上年度末 |

| | | 2024年06月30日 | 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 | | 198,049,602.19 | 200,168,738.82 |
| 应付清算款 | | 19,015,810.49 | - |
| 应付赎回款 | | 1,379,307.52 | 68,783.50 |
| 应付管理人报酬 | | 369,296.81 | 262,566.82 |
| 应付托管费 | | 123,098.93 | 87,522.27 |
| 应付销售服务费 | | 43,929.50 | 4,901.76 |
| 应付投资顾问费 | | - | - |
| 应交税费 | | 93,853.61 | 60,099.04 |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.6 | 109,792.06 | 185,915.00 |
| 负债合计 | | 219,184,691.11 | 200,838,527.21 |
| 净资产： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.7 | 1,426,753,740.08 | 999,375,817.62 |
| 未分配利润 | 6.4.7.8 | 54,143,710.99 | 43,739,231.12 |
| 净资产合计 | | 1,480,897,451.07 | 1,043,115,048.74 |
| 负债和净资产总计 | | 1,700,082,142.18 | 1,243,953,575.95 |

报告截止日2024年06月30日，长安泓源纯债债券A净值1.0371元，基金份额总额1,069,032,925.53份，长安泓源纯债债券C净值1.0405元，基金份额总额357,720,814.55份，总份额合计1,426,753,740.08份。

6.2 利润表

会计主体：长安泓源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 | 上年度可比期间 |
|----|-----|----|---------|
|----|-----|----|---------|

| | | 2024年01月01日至 2024年06月30日 | 2023年01月01日至202 3年06月30日 |
|---------------------------|------------|-----------------------------|-----------------------------|
| 一、营业总收入 | | 55,316,229.95 | 28,828,699.23 |
| 1.利息收入 | | 243,660.36 | 856,167.85 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.9 | 29,243.02 | 79,019.90 |
| 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 | | 214,417.34 | 777,147.95 |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-” 填列） | | 30,701,583.93 | 17,913,718.76 |
| 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 | 29,288,135.75 | 16,677,664.00 |
| 资产支持证券投资 收益 | 6.4.7.13 | 1,413,448.18 | 1,236,054.76 |
| 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 | 24,285,876.24 | 10,034,198.73 |
| 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 | 85,109.42 | 24,613.89 |
| 减：二、营业总支出 | | 4,114,361.95 | 3,605,074.01 |
| 1.管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 1,959,717.66 | 2,144,641.66 |
| 2.托管费 | 6.4.10.2.2 | 653,239.18 | 590,428.82 |
| 3.销售服务费 | 6.4.10.2.3 | 196,857.26 | 77,826.21 |

| | | | |
|---------------------|----------|---------------|---------------|
| 4.投资顾问费 | | - | - |
| 5.利息支出 | | 1,123,087.84 | 610,205.78 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 1,123,087.84 | 610,205.78 |
| 6.信用减值损失 | 6.4.7.19 | - | - |
| 7.税金及附加 | | 60,768.70 | 62,289.70 |
| 8.其他费用 | 6.4.7.20 | 120,691.31 | 119,681.84 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 51,201,868.00 | 25,223,625.22 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 51,201,868.00 | 25,223,625.22 |
| 五、其他综合收益的税后净额 | | - | - |
| 六、综合收益总额 | | 51,201,868.00 | 25,223,625.22 |

6.3 净资产变动表

会计主体：长安泓源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 | 999,375,817.62 | 43,739,231.12 | 1,043,115,048.74 |
| 二、本期期初净资产 | 999,375,817.62 | 43,739,231.12 | 1,043,115,048.74 |
| 三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列) | 427,377,922.46 | 10,404,479.87 | 437,782,402.33 |
| (一)、综合收益总额 | - | 51,201,868.00 | 51,201,868.00 |
| (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) | 427,377,922.46 | 27,968,152.58 | 455,346,075.04 |

| | | | |
|--|------------------------------------|----------------|-------------------|
| 其中：1.基金申购款 | 670,846,263.30 | 45,211,321.69 | 716,057,584.99 |
| 2.基金赎回款 | -243,468,340.84 | -17,243,169.11 | -260,711,509.95 |
| (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) | - | -68,765,540.71 | -68,765,540.71 |
| 四、本期期末净资产 | 1,426,753,740.08 | 54,143,710.99 | 1,480,897,451.07 |
| 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 | 874,367,925.25 | 53,332,896.07 | 927,700,821.32 |
| 二、本期期初净资产 | 874,367,925.25 | 53,332,896.07 | 927,700,821.32 |
| 三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列) | 235,926,424.65 | -15,253,355.37 | 220,673,069.28 |
| (一)、综合收益总额 | - | 25,223,625.22 | 25,223,625.22 |
| (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) | 235,926,424.65 | 14,584,145.13 | 250,510,569.78 |
| 其中：1.基金申购款 | 1,182,274,968.71 | 75,148,544.68 | 1,257,423,513.39 |
| 2.基金赎回款 | -946,348,544.06 | -60,564,399.55 | -1,006,912,943.61 |
| (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) | - | -55,061,125.72 | -55,061,125.72 |
| 四、本期期末净资产 | 1,110,294,349.90 | 38,079,540.70 | 1,148,373,890.60 |

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：

孙晔伟

闫世新

欧鹏

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

长安泓源纯债债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）由长安鑫恒回报混合型证券投资基金转型而来。根据基金管理人于2019年5月9日发布的《关于长安鑫恒回报混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，基金份额持有人大会于2019年5月8日表决通过了《关于长安鑫恒回报混合型证券投资基金转型有关事项的议案》。自2019年5月10日起，长安鑫恒回报混合型证券投资基金正式转型并更名为长安泓源纯债债券型证券投资基金，自同日起，《长安泓源纯债债券型证券投资基金基金合同》生效。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定期。本基金的基金管理人为长安基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据自2019年9月1日起施行的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》，本基金新增集中信息披露指定网站，建立基金产品资料概要制度，调整招募说明书定期更新时点，新增部分重大事项临时公告要求等。根据自2020年8月1日起施行的《公开募集证券投资基金侧袋机制指引（试行）》，本基金在基金合同中基金份额的申购与赎回、基金份额持有人大会、基金的投资、基金的估值、基金费用与税收、基金的信息披露等部分增加侧袋机制相关内容，并在招募说明书中增加相关风险揭示内容。根据《长安基金管理有限公司关于长安泓源纯债债券型证券投资基金下调基金管理费率并修改基金合同、托管协议的公告》，自2023年2月21日起本基金管理费率由0.5%/年下调为0.3%/年。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《长安泓源纯债债券型证券投资基金基金合同》和《长安泓源纯债债券型证券投资基金招募说明书》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，包括债券（含国债、央行票据、地方政府债券、金融债券、企业债券、公司债券、短期融资券、超短期融资券、中期票据、次级债、可分离交易可转债的纯债部分）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具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）。本基金不投资于股票、权证等资产，也不投资于可转换债券（可分离交易可转债的纯债部分除外）、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。

本基金的投资组合比例为：债券资产的比例不低于基金资产的80%；持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。如法律法规或中国证监会变更投资品种的比例限制的，基金管理人可依据相关规定履行适当程序后调整本基金的投资比例规定。

本基金的业绩比较基准为：中国债券综合全价指数的收益率。

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。本基金财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》(以下合称“企业会计准则”)的要求,同时亦按照中国证监会颁布的《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>》以及中国证券投资基金业协会于2012年11月16日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注6.4.2中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求,真实、完整地反映了本基金2024年6月30日的财务状况、自2024年1月1日至2024年6月30日止期间的经营成果和净资产变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历1月1日至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为自2024年1月1日至2024年6月30日止。

6.4.4.2 记账本位币

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

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(a) 金融资产的分类

本基金的金融工具包括债券投资、资产支持证券投资、买入返售金融资产等。

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

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

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

- 本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标;
- 该金融资产的合同条款规定,在特定日期产生的现金流量,仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。

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

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

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

(b) 金融负债的分类

本基金将金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及以摊余成本计量的金融负债。

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

该类金融负债包括交易性金融负债（含属于金融负债的衍生工具）和指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

- 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

本基金现无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

(a) 金融工具的初始确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

(b) 后续计量

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产以公允价值进行后续计量，产生的利得或损失（包括利息和股利收入）计入当期损益，除非该金融资产属于套期关系的一部分。

- 以摊余成本计量的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产采用实际利率法以摊余成本计量。以摊余成本计量且不属于任何套期关系的一部分的金融资产所产生的利得或损失，在终止确认、重分类、按照实际利率法摊销或确认减值时，计入当期损益。

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

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

- 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

(c) 金融工具的终止确认

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；

- 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；

- 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

- 所转移金融资产在终止确认日的账面价值；

- 因转移金融资产而收到的对价。

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

(d) 金融工具的减值

本基金以预期信用损失为基础，对下列项目进行减值会计处理并确认损失准备：

- 以摊余成本计量的金融资产

本基金持有的其他以公允价值计量的金融资产不适用预期信用损失模型。

预期信用损失的计量

预期信用损失，是指以发生违约的风险为权重的金融工具信用损失的加权平均值。信用损失，是指本基金按照原实际利率折现的、根据合同应收的所有合同现金流量与预期收取的所有现金流量之间的差额，即全部现金短缺的现值。

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

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

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

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

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

预期信用损失准备的列报

为反映金融工具的信用风险自初始确认后的变化，本基金在每个资产负债表日重新计量预期信用损失，由此形成的损失准备的增加或转回金额，应当作为减值损失或利得计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融资产，损失准备抵减该金融资产在资产负债表中列示的账面价值。

核销

如果本基金不再合理预期金融资产合同现金流量能够全部或部分收回，则直接减记该金融资产的账面余额。这种减记构成相关金融资产的终止确认。这种情况通常发生在本基金确定债务人没有资产或收入来源可产生足够的现金流量以偿还将被减记的金额。但是，被减记的金融资产仍可能受到本基金催收到期款项相关执行活动的影响。

已减记的金融资产以后又收回的，作为减值损失的转回计入收回当期的损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

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

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，根据企业会计准则的规定采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术。

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

对不存在活跃市场的金融工具，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整并确定公允价值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

- 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；
- 本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量，并于会计期末全额转入未分配利润。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

利息收入

存款利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认为利息收入。

投资收益

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

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

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

公允价值变动收益

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

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算

6.4.4.11 基金的收益分配政策

根据《长安泓源纯债债券型证券投资基金基金合同》的规定，由于基金费用的不同，不同类别的基金份额在收益分配数额方面可能有所不同，基金管理人可对各类基金份额分别制定收益分配方案，同一类别内的每一基金份额享有同等分配权；在符合有关基金分红条件的前提下，基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若基金份额持有人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。

6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

编制财务报表时，本基金需要运用估计和假设，这些估计和假设会对会计政策的应用及资产、负债、收入和支出的金额产生影响。实际情况可能与这些估计不同。本基金

对估计涉及的关键假设和不确定因素的判断进行持续评估，会计估计变更的影响在变更当期和未来期间予以确认。

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

对于在发行时明确一定期限限售期的股票，根据中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》，在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值日流通受限股票的价值。

根据《关于固定收益品种的估值处理标准》在银行间债券市场、上海证券交易所、深圳证券交易所、北京证券交易所及中国证券监督管理委员会认可的其他交易场所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值基准服务机构提供的价格数据进行估值。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号文《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》、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[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税

[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

a) 资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

b) 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。

对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

c) 对基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息红利所得，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。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

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

d) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2024年06月30日 |
|------|--------------------|
| 活期存款 | 6,183,952.94 |

| | |
|--------------|--------------|
| 等于：本金 | 6,183,387.33 |
| 加：应计利息 | 565.61 |
| 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 | 6,183,952.94 |

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 | 250,229,959.10 | 2,256,194.77 | 256,102,154.77 | 3,616,000.90 |
| | 银行间市场 | 1,274,731,436.43 | 11,939,128.35 | 1,305,211,728.35 | 18,541,163.57 |
| | 合计 | 1,524,961,395.53 | 14,195,323.12 | 1,561,313,883.12 | 22,157,164.47 |
| 资产支持证券 | 107,111,075.06 | 550,343.01 | 109,274,443.01 | 1,613,024.94 | |
| 基金 | - | - | - | - | |
| 其他 | - | - | - | - | |
| 合计 | 1,632,072,470.59 | 14,745,666.13 | 1,670,588,326.13 | 23,770,189.41 | |

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于本报告期末无衍生金融资产/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

本基金于本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金于本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金于本报告期末无其他资产。

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 | 15,956.70 |
| 其中：交易所市场 | - |
| 银行间市场 | 15,956.70 |
| 应付利息 | - |
| 预提费用-审计费 | 24,863.02 |
| 预提费用-信息披露费 | 59,672.34 |
| 预提费用-账户维护费 | 9,300.00 |
| 合计 | 109,792.06 |

6.4.7.7 实收基金

6.4.7.7.1 长安泓源纯债债券A

金额单位：人民币元

| 项目 (长安泓源纯债债券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 | 956,050,785.94 | 956,050,785.94 |
| 本期申购 | 123,289,179.20 | 123,289,179.20 |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -10,307,039.61 | -10,307,039.61 |
| 本期末 | 1,069,032,925.53 | 1,069,032,925.53 |

6.4.7.7.2 长安泓源纯债债券C

金额单位：人民币元

| 项目 (长安泓源纯债债券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 | 43,325,031.68 | 43,325,031.68 |
| 本期申购 | 547,557,084.10 | 547,557,084.10 |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -233,161,301.23 | -233,161,301.23 |
| 本期末 | 357,720,814.55 | 357,720,814.55 |

申购含红利再投资、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 长安泓源纯债债券A

单位：人民币元

| 项目 (长安泓源纯债债券A) | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|-------------------|----------------|-----------------|----------------|
| 上年度末 | 378,465,453.56 | -336,791,467.30 | 41,673,986.26 |
| 本期期初 | 378,465,453.56 | -336,791,467.30 | 41,673,986.26 |
| 本期利润 | 22,106,154.43 | 19,555,508.53 | 41,661,662.96 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 46,675,189.07 | -38,348,142.72 | 8,327,046.35 |
| 其中：基金申购款 | 50,895,749.84 | -41,878,894.19 | 9,016,855.65 |
| 基金赎回款 | -4,220,560.77 | 3,530,751.47 | -689,809.30 |
| 本期已分配利润 | -51,997,061.45 | - | -51,997,061.45 |

| | | | |
|-----|----------------|-----------------|---------------|
| 本期末 | 395,249,735.61 | -355,584,101.49 | 39,665,634.12 |
|-----|----------------|-----------------|---------------|

6.4.7.8.2 长安泓源纯债债券C

单位：人民币元

| 项目 (长安泓源纯债债券C) | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|-------------------|----------------|-----------------|----------------|
| 上年度末 | 17,330,145.92 | -15,264,901.06 | 2,065,244.86 |
| 本期期初 | 17,330,145.92 | -15,264,901.06 | 2,065,244.86 |
| 本期利润 | 4,809,837.33 | 4,730,367.71 | 9,540,205.04 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 128,094,017.74 | -108,452,911.51 | 19,641,106.23 |
| 其中：基金申购款 | 224,518,417.14 | -188,323,951.10 | 36,194,466.04 |
| 基金赎回款 | -96,424,399.40 | 79,871,039.59 | -16,553,359.81 |
| 本期已分配利润 | -16,768,479.26 | - | -16,768,479.26 |
| 本期末 | 133,465,521.73 | -118,987,444.86 | 14,478,076.87 |

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 | 23,567.55 |
| 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 | 5,600.67 |
| 其他 | 74.80 |
| 合计 | 29,243.02 |

其他包括保证金利息收入和应收申购款利息收入。

6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金在本报告期内无股票投资收益买卖股票差价收入。

6.4.7.11 基金投资收益

本基金在本报告期内无基金投资收益。

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 | 19,906,456.67 |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | 9,381,679.08 |
| 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 | 29,288,135.75 |

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 | 1,395,001,935.74 |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 1,365,256,336.46 |
| 减：应计利息总额 | 20,340,614.20 |
| 减：交易费用 | 23,306.00 |
| 买卖债券差价收入 | 9,381,679.08 |

6.4.7.12.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金在本报告期内无债券投资收益赎回差价收入。

6.4.7.12.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金在本报告期内无债券投资收益申购差价收入。

6.4.7.13 资产支持证券投资收益

6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024年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 | 1,351,097.48 |
| 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券 差价收入 | 62,350.70 |
| 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 | 1,413,448.18 |

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 | 85,746,953.43 |
| 减：卖出资产支持证券成本总额 | 85,151,999.99 |
| 减：应计利息总额 | 532,602.74 |
| 减：交易费用 | - |
| 资产支持证券投资收益 | 62,350.70 |

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金在本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益**6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金在本报告期内无衍生工具收益买卖权证差价收入。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金在本报告期内无衍生工具收益其他投资收益。

6.4.7.16 股利收益

本基金在本报告期内无股利收益。

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 |
|------------------------|-------------------------|
| | 2024年01月01日至2024年06月30日 |
| 1.交易性金融资产 | 24,285,876.24 |
| ——股票投资 | - |
| ——债券投资 | 23,056,356.79 |
| ——资产支持证券投资 | 1,229,519.45 |
| ——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 | 24,285,876.24 |

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 | 85,047.26 |
| 转换费收入 | 62.16 |
| 合计 | 85,109.42 |

6.4.7.19 信用减值损失

本基金在本报告期内无信用减值损失。

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 | 24,863.02 |
| 信息披露费 | 59,672.34 |
| 证券出借违约金 | - |
| 汇划手续费 | 17,555.95 |
| 帐户维护费 | 18,600.00 |
| 合计 | 120,691.31 |

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

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

6.4.9 关联方关系

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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|----------------------|-----------------------|
| 长安基金管理有限公司 | 基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构 |
| 中国农业银行股份有限公司 | 基金托管人 |
| 长安国际信托股份有限公司 | 基金管理人的股东 |
| 杭州景林景淳企业管理合伙企业（有限合伙） | 基金管理人的股东 |
| 上海恒嘉美联发展有限公司 | 基金管理人的股东 |
| 五星控股集团有限公司 | 基金管理人的股东 |
| 兵器装备集团财务有限责任公司 | 基金管理人的股东 |
| 长安财富资产管理有限公司 | 基金管理人的子公司 |

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.10 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

本基金在本报告期内及上年度可比期间均没有通过关联方的交易单元进行过股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金在本报告期内及上年度可比期间均没有通过关联方的交易单元进行过权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金在本报告期内及上年度可比期间均没有通过关联方的交易单元进行过债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金在本报告期内及上年度可比期间均没有通过关联方的交易单元进行过回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金在本报告期内及上年度可比期间均没有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 | 1,959,717.66 | 2,144,641.66 |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 646,392.28 | 592,787.42 |
| 应支付基金管理人的净管理费 | 1,313,325.38 | 1,551,854.24 |

支付基金管理人长安基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值0.30%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值×0.30%/当年天数

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024年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 | 653,239.18 | 590,428.82 |

支付基金托管人中国农业银行股份有限公司的基金托管费按前一日基金资产净值0.1%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.1%/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 | | |
| | 长安泓源纯债债券A | 长安泓源纯债债券C | 合计 |
| 长安基金管理有限公司 | 0.00 | 127.34 | 127.34 |
| 中国农业银行股份有限公司 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| 合计 | 0.00 | 127.34 | 127.34 |
| 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 | | |
| | 长安泓源纯债债券A | 长安泓源纯债债券C | 合计 |
| 长安基金管理有限公司 | 0.00 | 84.33 | 84.33 |
| 中国农业银行股份有限公司 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| 合计 | 0.00 | 84.33 | 84.33 |

长安泓源纯债债券A不计算基金销售服务费。

长安泓源纯债债券C支付销售机构的基金销售服务费按前一日C类基金资产净值0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

长安泓源纯债债券C日基金销售服务费=前一日C类基金资产净值×0.15%/当年天数

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金在本报告期内及上年度可比期间均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

本基金在本报告期内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

本基金在本报告期内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

本基金的管理人在本报告期内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

除基金管理人之外的其他关联方在本报告期末及上年度末均未持有本基金。

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 |
| 中国农业银行股份有限公司 | 6,183,952.94 | 23,567.55 | 1,525,501.50 | 66,929.16 |

本基金通过“农业银行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的结算备付金，于2024年06月30日的相关余额为人民币345,961.57元。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期内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

本基金在本报告期内及上年度可比期间均无其他关联交易事项。

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

长安泓源纯债债券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 | 2024-06-24 | 2024-06-24 | 0.4870 | 51,520,118.85 | 476,942.60 | 51,997,061.45 | - |
| 合计 | | | 0.4870 | 51,520,118.85 | 476,942.60 | 51,997,061.45 | - |

长安泓源纯债债券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 | 2024-06-24 | 2024-06-24 | 0.4870 | 11,841,443.34 | 4,927,035.92 | 16,768,479.26 | - |
| 合计 | | | 0.4870 | 11,841,443.34 | 4,927,035.92 | 16,768,479.26 | - |

6.4.12 期末（2024年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

根据中国证监会相关规定，证券投资基金参与网下配售，可与发行人、承销商自主约定网下配售股票的持有期限并公开披露。持有期自公开发行的股票上市之日起计算。在持有期内的股票为流动受限制而不能自由转让的资产。证券投资基金获配的科创板股票及创业板股票需要锁定的，锁定期根据相关法规及交易所相关规定执行。证券投资基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起在法规规定的限售期内不得转让。证券投资基金对上述非公开发行股票的减持还需根据交易所相关规定执行。

于2024年06月30日，本基金未持有因认购新发或增发证券而受上述规定约束的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

于2024年06月30日，本基金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

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 |
|--------|--------|------------|--------|-----------|----------------|
| 230202 | 23国开02 | 2024-07-01 | 102.43 | 800,000 | 81,941,726.78 |
| 240203 | 24国开03 | 2024-07-04 | 102.08 | 211,000 | 21,538,234.32 |
| 合计 | | | | 1,011,000 | 103,479,961.10 |

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人民币96,029,119.29元，是以如上债券作为质押。

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，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额102,020,482.90元，于2024年07月01日、2024年07月02日先后到期。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

于2024年06月30日，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
- 市场风险

本基金管理人按照“健全、合理、制衡、独立”的原则，建立了合规与风险管理委员会(董事会层面)、督察长、法律合规部、监察稽核部、风险管理部和相关部门构成的全方位、多层次的合规风险管理架构。本基金管理人秉承全面风险管理的理念，将风险管理贯穿日常经营活动的整个过程，渗透到各个业务环节，覆盖所有部门和岗位，建立了集风险识别、风险测量、风险控制、风险评价、风险报告为一体的风险管理机制，全面、及时识别、分析和评估各类风险，有效防范日常经营和基金运作过程中可能面临的各种风险，最大限度地保护基金份额持有人的合法权益。

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行农业银行，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

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 | 207,671,591.57 | 164,910,008.23 |
| 合计 | 207,671,591.57 | 164,910,008.23 |

未评级债券为国债、政策性金融债及短期融资券等无信用评级的债券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有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06月30日 | 上年度末 2023年12月31日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| A-1 | - | - |
| A-1以下 | - | - |
| 未评级 | 108,544,986.89 | 197,271,269.12 |
| 合计 | 108,544,986.89 | 197,271,269.12 |

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 | 150,073,371.70 | 251,725,966.60 |
| AAA以下 | 36,413,244.38 | 48,299,113.62 |
| 未评级 | 1,058,610,688.58 | 433,777,251.97 |
| 合计 | 1,245,097,304.66 | 733,802,332.19 |

未评级债券为政策性金融债、中期票据等无信用评级的债券。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

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 | 109,274,443.01 | 141,247,593.15 |
| AAA以下 | - | - |
| 未评级 | - | - |
| 合计 | 109,274,443.01 | 141,247,593.15 |

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有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在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险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，另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。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金管理人对流通受限证券的投资交易进行限制和控制，对缺乏流动性的证券投资比率事先确定最高上限，控制基金的流动性结构；加强对投资组合变现周期和冲击成本的定量分析，定期揭示基金的流动性风险；通过分散投资降低基金财产的非系统性风险，保持基金组合良好的流动性。本基金所持证券均可在证券交易所或银行间同业市场交易，除本报告期末本基金持有的流通受限证券章节中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，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。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金管理人根据申购赎回变动情况，制定现金头寸预测表，及时采取措施满足流动性需要；分析基金持有人结构，加强与主要持有机构的沟通，及时揭示可能的赎回需求；按照有关法律法规规定应对固定赎回，并进行适当报告和披露；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。

于本期末，除卖出回购金融资产款余额(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

报告期内，本基金主要投资于在交易所、银行间市场正常交易的债券等。基金组合资产中的主要标的属于《公开募集证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“流动性新规”）中定义的7个工作日可变现资产的范围，基金管理人每日对基金组合资产中的7个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估和测算，保证本基金每日净赎回申请不超过基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值。本基金主动投资于流动性新规中定义的流动性受限资产的市值不超过基金的资产净值的15%。本基金根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》和流动性新规的要求严格执行开放式基金资金头寸管理的相关规定，每日保持不低于5%的现金和到期日在一年以内的政府债券（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等），以备支付基金份额持有人的赎回款。报告期内本基金组合资产的流动性和变现能力较强，流动性风险较小。

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。本基金管理人每日对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过对所持投资品种修正久期等参数的监控进行利率风险管理。

下表统计了本基金面临的利率风险敞口，表中所示为本基金资产及负债的公允价值，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：

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2024年 06月30 日 | 1个月以内 | 1-3个月 | 3个月-1年 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |
|----------------------------|----------------|---------------|----------------|------------------|------|---------------|------------------|
| 资产 | | | | | | | |
| 货币资金 | 6,183,952.94 | - | - | - | - | - | 6,183,952.94 |
| 结算备付金 | 345,961.57 | - | - | - | - | - | 345,961.57 |
| 存出保证金 | 18,505.59 | - | - | - | - | - | 18,505.59 |
| 交易性金融资产 | 1,139,936.57 | 10,258,857.92 | 380,095,960.27 | 1,279,093,571.37 | - | - | 1,670,588,326.13 |
| 应收清算款 | - | - | - | - | - | 20,000,000.00 | 20,000,000.00 |
| 应收申购款 | - | - | - | - | - | 2,945,395.95 | 2,945,395.95 |
| 资产总计 | 7,688,356.67 | 10,258,857.92 | 380,095,960.27 | 1,279,093,571.37 | - | 22,945,395.95 | 1,700,082,142.18 |
| 负债 | | | | | | | |
| 卖出回购金融资产款 | 198,049,602.19 | - | - | - | - | - | 198,049,602.19 |
| 应付清 | - | - | - | - | - | 19,015,810.49 | 19,015,810.49 |

| | | | | | | | |
|-----------------------------|-----------------|---------------|----------------|------------------|---------------|---------------|------------------|
| 算款 | | | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | - | 1,379,307.52 | 1,379,307.52 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | 369,296.81 | 369,296.81 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 123,098.93 | 123,098.93 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | - | 43,929.50 | 43,929.50 |
| 应交税费 | - | - | - | - | - | 93,853.61 | 93,853.61 |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 109,792.06 | 109,792.06 |
| 负债总计 | 198,049,602.19 | - | - | - | - | 21,135,088.92 | 219,184,691.11 |
| 利率敏感度缺口 | -190,361,245.52 | 10,258,857.92 | 380,095,960.27 | 1,279,093,571.37 | - | 1,810,307.03 | 1,480,897,451.07 |
| 上年度末 2023年 12月31 日 | 1个月以内 | 1-3个月 | 3个月-1年 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |
| 资产 | | | | | | | |
| 货币资金 | 1,513,675.38 | - | - | - | - | - | 1,513,675.38 |
| 结算备付金 | 645,558.77 | - | - | - | - | - | 645,558.77 |
| 存出保证金 | 8,598.07 | - | - | - | - | - | 8,598.07 |
| 交易性金融资产 | 120,553,411.51 | - | 264,647,848.16 | 771,428,172.53 | 80,601,770.49 | - | 1,237,231,202.69 |
| 应收清算款 | - | - | - | - | - | 3,092,886.32 | 3,092,886.32 |
| 应收申购款 | - | - | - | - | - | 1,461,654.72 | 1,461,654.72 |
| 资产总计 | 122,721,243.73 | - | 264,647,848.16 | 771,428,172.53 | 80,601,770.49 | 4,554,541.04 | 1,243,953,575.95 |
| 负债 | | | | | | | |

| | | | | | | | |
|-----------|----------------|---|----------------|----------------|---------------|--------------|------------------|
| 卖出回购金融资产款 | 200,168,738.82 | - | - | - | - | - | 200,168,738.82 |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | - | 68,783.50 | 68,783.50 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | 262,566.82 | 262,566.82 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 87,522.27 | 87,522.27 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | - | 4,901.76 | 4,901.76 |
| 应交税费 | - | - | - | - | - | 60,099.04 | 60,099.04 |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 185,915.00 | 185,915.00 |
| 负债总计 | 200,168,738.82 | - | - | - | - | 669,788.39 | 200,838,527.21 |
| 利率敏感度缺口 | -77,447,495.09 | - | 264,647,848.16 | 771,428,172.53 | 80,601,770.49 | 3,884,752.65 | 1,043,115,048.74 |

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06月30日 | 上年度末 2023年12月31日 |
| | 利率下降25个基点 | 8,590,343.75 | 5,597,258.63 |
| | 利率上升25个基点 | -8,550,704.23 | -5,564,519.83 |

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

本基金承受的其他价格风险，主要是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。本基金的其他价

格风险，主要受到证券交易所上市的股票整体涨跌趋势的影响，由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，通过组合估值、行业配置分析等进行市场价格风险管理。

本基金本期末未持有对其他价格风险敏感的金融资产与金融负债。因此，证券交易所上市的股票整体涨跌趋势的变动对本基金资产的净值无重大影响。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属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 | - | - |
| 第二层次 | 1,670,588,326.13 | 1,237,231,202.69 |
| 第三层次 | - | - |
| 合计 | 1,670,588,326.13 | 1,237,231,202.69 |

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

于本报告期间，本基金无公允价值所属层次间的重大变动。

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(2023年12月31日：无)。

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以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债，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 | - | - |
| | 其中：股票 | - | - |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 1,670,588,326.13 | 98.27 |
| | 其中：债券 | 1,561,313,883.12 | 91.84 |
| | 资产支持证券 | 109,274,443.01 | 6.43 |
| 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 | 6,529,914.51 | 0.38 |
| 8 | 其他各项资产 | 22,963,901.54 | 1.35 |
| 9 | 合计 | 1,700,082,142.18 | 100.00 |

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合**7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合**

本基金本报告期末未持有股票。

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期末未持有股票。

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 | 80,858,454.79 | 5.46 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 244,929,355.19 | 16.54 |
| | 其中：政策性金融债 | 244,929,355.19 | 16.54 |
| 4 | 企业债券 | 196,716,576.69 | 13.28 |
| 5 | 企业短期融资券 | 45,487,060.28 | 3.07 |
| 6 | 中期票据 | 884,777,449.28 | 59.75 |
| 7 | 可转债(可交换债) | - | - |
| 8 | 同业存单 | 108,544,986.89 | 7.33 |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 1,561,313,883.12 | 105.43 |

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 | 112418169 | 24华夏银行CD169 | 1,000,000 | 98,614,520.15 | 6.66 |
| 2 | 230202 | 23国开02 | 800,000 | 81,941,726.78 | 5.53 |
| 3 | 240203 | 24国开03 | 800,000 | 81,661,551.91 | 5.51 |
| 4 | 092218005 | 22农发清发05 | 800,000 | 81,326,076.50 | 5.49 |
| 5 | 019733 | 24国债02 | 800,000 | 80,858,454.79 | 5.46 |

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 | 261923 | 华保障1A | 500,000 | 50,242,013.70 | 3.39 |
| 2 | 260454 | 远志03A2 | 420,000 | 43,684,153.97 | 2.95 |
| 3 | 143922 | 山高02优 | 150,000 | 15,348,275.34 | 1.04 |

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

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

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 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

7.12.2 报告期内本基金投资前十名股票中不存在超出合同规定备选股票库之外的情况。

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 | 18,505.59 |
| 2 | 应收清算款 | 20,000,000.00 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 2,945,395.95 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 22,963,901.54 |

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，本报告中涉及比例计算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 |
| 长安 | 8,587 | 124,494.34 | 1,035,043,269.75 | 96.82% | 33,989,655.78 | 3.18% |

| | | | | | | |
|-----------|--------|-----------|------------------|--------|----------------|---------|
| 泓源纯债债券A | | | | | | |
| 长安泓源纯债债券C | 63,947 | 5,594.02 | 6,174.69 | 0.00% | 357,714,639.86 | 100.00% |
| 合计 | 72,534 | 19,670.14 | 1,035,049,444.44 | 72.55% | 391,704,295.64 | 27.45% |

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 | 长安泓源纯债债券A | 4,517.00 | 0.00% |
| | 长安泓源纯债债券C | 101,442.98 | 0.03% |
| | 合计 | 105,959.98 | 0.01% |

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 | 份额级别 | 持有基金份额总量的数量区间 (万份) |
|------------------------------------|-----------|-----------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金 | 长安泓源纯债债券A | 0 |
| | 长安泓源纯债债券C | 0 |
| | 合计 | 0 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 长安泓源纯债债券A | 0 |
| | 长安泓源纯债债券C | 0~10 |
| | 合计 | 0~10 |

§9 开放式基金份额变动

单位：份

| | | |
|--|-----------|-----------|
| | 长安泓源纯债债券A | 长安泓源纯债债券C |
|--|-----------|-----------|

| | | |
|----------------------------|------------------|----------------|
| 基金合同生效日(2019年05月10日)基金份额总额 | 939,506.38 | 1,067,598.83 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 956,050,785.94 | 43,325,031.68 |
| 本报告期基金总申购份额 | 123,289,179.20 | 547,557,084.10 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 10,307,039.61 | 233,161,301.23 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 1,069,032,925.53 | 357,720,814.55 |

总申购份额包含红利再投资、转换入份额，总赎回份额包含转换出份额。

§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、基金管理人于2024年4月19日披露《长安基金管理有限公司财务负责人任职公告》，王娟于2024年4月17日起担任公司财务负责人职务。

2、基金管理人于2024年4月19日披露《长安基金管理有限公司副总经理离任公告》，王健于2024年4月17日起不再担任公司副总经理职务。

3、基金管理人于2024年5月17日披露《长安基金管理有限公司总经理助理任职公告》，周密于2024年5月15日起担任公司总经理助理职务。

4、本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本基金本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

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

毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)(原"毕马威华振会计师事务所")自本基金基金合同生效日起为本基金提供审计服务。

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

本基金本报告期内无基金管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金本报告期内无基金托管人及其高级管理人员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 | |
| 东吴证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 广州证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国信证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国金证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 国泰君安证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 西藏东方财富证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 兴业证券 | 2 | - | - | - | - | - |

1、基金租用席位的选择标准是：

- (1) 资力雄厚，信誉良好，财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (2) 经营行为规范，在最近一年内无重大违规经营行为；
- (3) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；

(4)公司具有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供具有相当质量的关于宏观经济面分析、行业发展趋势及证券市场走向、个股分析的研究报告以及丰富全面的信息服务；能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告。

选择程序是：根据对各券商提供的各项投资、研究服务情况的考评结果，符合席位券商标准的，由公司研究部提出席位券商的调整意见（调整名单及调整原因），并经公司批准。

2、在上述租用的券商交易单元中，本报告期无新增及退租交易单元。

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 | | 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 |
| 东吴证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 广州证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 国信证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 国金证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 国泰君安证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 西藏东方财富证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 兴业证券 | 477,128,427.51 | 100.00% | 627,000,000.00 | 100.00% | - | - | - | - |

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 | 004897_长安泓源纯债债券型证券投资基金2023年第4季度报告 | 公司官网 | 2024-01-20 |
| 2 | 长安泓源纯债债券型证券投资基金暂停大额申购、定期定额投资以及转换转入业务的公告 | 证券时报、公司官网 | 2024-02-26 |
| 3 | 关于新增福克斯（北京）基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构并参与费率优惠活动的公告 | 证券时报、公司官网 | 2024-02-29 |
| 4 | 关于新增海通期货股份有限公司为 | 证券时报、公司官网 | 2024-03-06 |

| | | | |
|----|--|-----------|------------|
| | 旗下部分基金销售机构并参与费率优惠活动的公告 | | |
| 5 | 关于增加北京创金启富基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告 | 证券时报、公司官网 | 2024-03-27 |
| 6 | 004897_长安泓源纯债债券型证券投资基金2023年年度报告 | 公司官网 | 2024-03-30 |
| 7 | 长安泓源纯债债券型证券投资基金暂停大额申购、定期定额投资以及转换转入业务的公告 | 证券时报、公司官网 | 2024-04-16 |
| 8 | 长安基金管理有限公司财务负责人任职公告 | 证券时报、公司官网 | 2024-04-19 |
| 9 | 长安基金管理有限公司副总经理离任公告 | 证券时报、公司官网 | 2024-04-19 |
| 10 | 004897_长安泓源纯债债券型证券投资基金2024年第1季度报告 | 公司官网 | 2024-04-20 |
| 11 | 长安基金管理有限公司总经理助理任职公告 | 证券时报、公司官网 | 2024-05-17 |
| 12 | 关于增加上海云湾基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告 | 证券时报、公司官网 | 2024-05-24 |
| 13 | 关于新增华泰证券股份有限公司为长安泓源纯债债券型证券投资基金销售机构并参与费率优惠活动的公告 | 证券时报、公司官网 | 2024-05-27 |
| 14 | 关于增加中国邮政储蓄银行股份有限公司邮你同赢平台为旗下部分基金销售机构的公告 | 证券时报、公司官网 | 2024-05-31 |
| 15 | 长安泓源纯债债券型证券投资基金分红公告 | 证券时报、公司官网 | 2024-06-21 |
| 16 | 004897_长安泓源纯债债券型证券投资基金基金产品资料概要更新 | 公司官网 | 2024-06-27 |
| 17 | 长安基金管理有限公司关于提醒投资者更新、完善身份信息的公告 | 证券时报、公司官网 | 2024-06-28 |

| | | | |
|----|------------------------------------|------|------------|
| 18 | 关于旗下基金2024年6月30日基金份额净值及基金份额累计净值的公告 | 公司官网 | 2024-06-30 |
|----|------------------------------------|------|------------|

§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 | 2024/01/01 - 2024/06/30 | 942,175,680.34 | 0.00 | 0.00 | 942,175,680.34 | 66.04% |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| <p>本基金由于存在上述单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况，存在以下特有风险：</p> <p>(1) 当基金份额集中度较高时，少数基金份额持有人所持有的基金份额占比较高，其在召开持有人大会并对重大事项进行投票表决时可能拥有较大话语权；</p> <p>(2) 在极端情况下，当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致在其赎回后本基金资产规模长期低于5000万元，进而可能导致本基金终止或与其他基金合并或转型为另外的基金，其他基金份额持有人丧失继续投资本基金的机会；</p> <p>(3) 当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，更容易触发巨额赎回条款，基金份额持有人将无法及时赎回所持有的全部基金份额；</p> <p>(4) 当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，基金为支付赎回款项而卖出所持有的证券，可能造成证券价格波动，导致本基金的收益水平发生波动。同时，巨额赎回、份额净值小数保留位数是采用四舍五入、管理费及托管费等费用是按前一日资产计提，会导致基金份额净值出现大幅波动；</p> <p>(5) 当某一基金份额持有人所持有的基金份额达到或超过本基金规模的50%时，本基金管理人将不再接受该持有人对本基金基金份额提出的申购及转换转入申请。在其他基金份额持有人赎回基金份额导致某一基金份额持有人所持有的基金份额达到或超过本基金规模50%的情况下，该基金份额持有人将面临所提出的对本基金基金份额的申购及转换转入申请被拒绝的风险。如果投资人某笔申购或转换转入申请导致其持有本基金基金份额达到或超过本基金规模的50%，该笔申购或转换转入申请可能被确认失败。</p> | | | | | | | |

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、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、《长安泓源纯债债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《长安泓源纯债债券型证券投资基金托管协议》；
- 4、《长安泓源纯债债券型证券投资基金招募说明书》；
- 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、报告期内披露的各项公告。

12.2 存放地点

上海市浦东芳甸路1088号紫竹大厦16楼

12.3 查阅方式

投资者可到基金管理人、基金托管人的办公场所或基金管理人网站免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

投资者对本报告如有疑问，可咨询本管理人。

咨询电话：400-820-9688

公司网址：www.changanfunds.com。

长安基金管理有限公司
二〇二四年八月三十日