

新沃安鑫 87 个月定期开放债券型证券投资
基金
2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：新沃基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

送出日期：二〇二四年八月二十九日

§ 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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，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 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 | 6 |
| 2.1 基金基本情况..... | 6 |
| 2.2 基金产品说明..... | 6 |
| 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 | 10 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况..... | 10 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明..... | 11 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明..... | 11 |
| 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..... | 11 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望..... | 12 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明..... | 12 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明..... | 13 |
| 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..... | 13 |
| §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..... | 17 |

| | |
|--|-----------|
| 6.4 报表附注..... | 19 |
| §7 投资组合报告..... | 39 |
| 7.1 期末基金资产组合情况..... | 39 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合..... | 39 |
| 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..... | 39 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动..... | 39 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合..... | 40 |
| 7.6 期末按实际利率计算账面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..... | 40 |
| 7.7 期末按实际利率计算账面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..... | 40 |
| 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..... | 40 |
| 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..... | 40 |
| 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明..... | 41 |
| 7.11 投资组合报告附注..... | 41 |
| §8 基金份额持有人信息..... | 42 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构..... | 42 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况..... | 42 |
| 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的情况..... | 42 |
| §9 开放式基金份额变动..... | 43 |
| §10 重大事件揭示..... | 44 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议..... | 44 |
| 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..... | 44 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼..... | 44 |
| 10.4 基金投资策略的改变..... | 44 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况..... | 44 |
| 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..... | 44 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况..... | 44 |
| 10.8 其他重大事件..... | 44 |
| §11 影响投资者决策的其他重要信息..... | 46 |
| 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..... | 46 |

| | |
|--------------------------|-----------|
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息..... | 46 |
| §12 备查文件目录..... | 47 |
| 12.1 备查文件目录..... | 47 |
| 12.2 存放地点..... | 47 |
| 12.3 查阅方式..... | 47 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|-------------------------|
| 基金名称 | 新沃安鑫 87 个月定期开放债券型证券投资基金 |
| 基金简称 | 新沃安鑫 87 个月定开债 |
| 基金主代码 | 010607 |
| 基金运作方式 | 契约型定期开放式 |
| 基金合同生效日 | 2021 年 7 月 27 日 |
| 基金管理人 | 新沃基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 兴业银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 5,050,222,364.33 份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|---|
| 投资目标 | 本基金采取买入持有到期投资策略，投资于剩余期限（或回售期限）不超过基金剩余封闭期的固定收益类金融工具，力求基金资产的稳健增值。 |
| 投资策略 | <p>本基金的主要投资策略包含</p> <p>（一）封闭期投资策略</p> <p>本基金以封闭期为周期进行投资运作。为力争基金资产在开放前可完全变现，本基金在封闭期内采用买入并持有到期投资策略，所投金融资产以收取合同现金流量为目的并持有到期，所投资资产到期日（或回售日）不得晚于封闭运作期到期日。具体投资策略含：</p> <ol style="list-style-type: none"> 1、债券类属配置策略 2、久期管理策略 3、收益率曲线策略 4、杠杆投资策略 5、现金管理策略 <p>（二）开放期投资策略</p> <p>开放期内，为了保证组合具有较高的流动性，方便投资人安排投资，本基金将在遵守有关投资限制与投资比例的前提下，主要投资于具有较高流动性的投资品种，通过合理配置组合期限结构等方式，积极防范流动性风险，在满足组合流动性需求的同时，尽量减小基金净值的波动。</p> |
| 业绩比较基准 | 在每个封闭期，本基金的业绩比较基准为该封闭期起始日公布的三年期定期存款利率（税后）+0.5% |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，理论上其预期风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。 |

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 | | 新沃基金管理有限公司 | 兴业银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 王靖飞 | 龚小武 |
| | 联系电话 | 400-698-9988 | 021-52629999-212056 |
| | 电子邮箱 | service@sinvofund.com | gongxiaowu@cib.com.cn |
| 客户服务电话 | | 400-698-9988 | 95561 |
| 传真 | | 010-58290555 | 021-62159217 |
| 注册地址 | | 山东省青岛市崂山区苗岭路 15 号青岛金融中心大厦 702 室 | 福建省福州市台江区江滨中大道 398 号兴业银行大厦 |
| 办公地址 | | 北京市朝阳区安贞西里五区 1 号楼新华金融大厦 5 层 519 室 | 上海市浦东新区银城路 167 号 4 楼 |
| 邮政编码 | | 100029 | 200120 |
| 法定代表人 | | 朱灿 | 吕家进 |

2.4 信息披露方式

| | |
|---------------------|-------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 《上海证券报》 |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | www.sinvofund.com |
| 基金中期报告备置地点 | 基金管理人和基金托管人的办公场所 |

2.5 其他相关资料

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|--------|------------|-----------------------------------|
| 注册登记机构 | 新沃基金管理有限公司 | 北京市朝阳区安贞西里五区 1 号楼新华金融大厦 5 层 519 室 |

§ 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 | 83,878,407.17 |
| 本期利润 | 83,878,407.17 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0166 |
| 本期加权平均净值利润率 | 1.63% |
| 本期基金份额净值增长率 | 1.65% |
| 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 | 26,451,579.09 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0052 |
| 期末基金资产净值 | 5,076,673,943.42 |
| 期末基金份额净值 | 1.0052 |
| 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 | 9.85% |

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，由于本基金采用摊余成本法核算，所以公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

2、本报告所列示的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、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

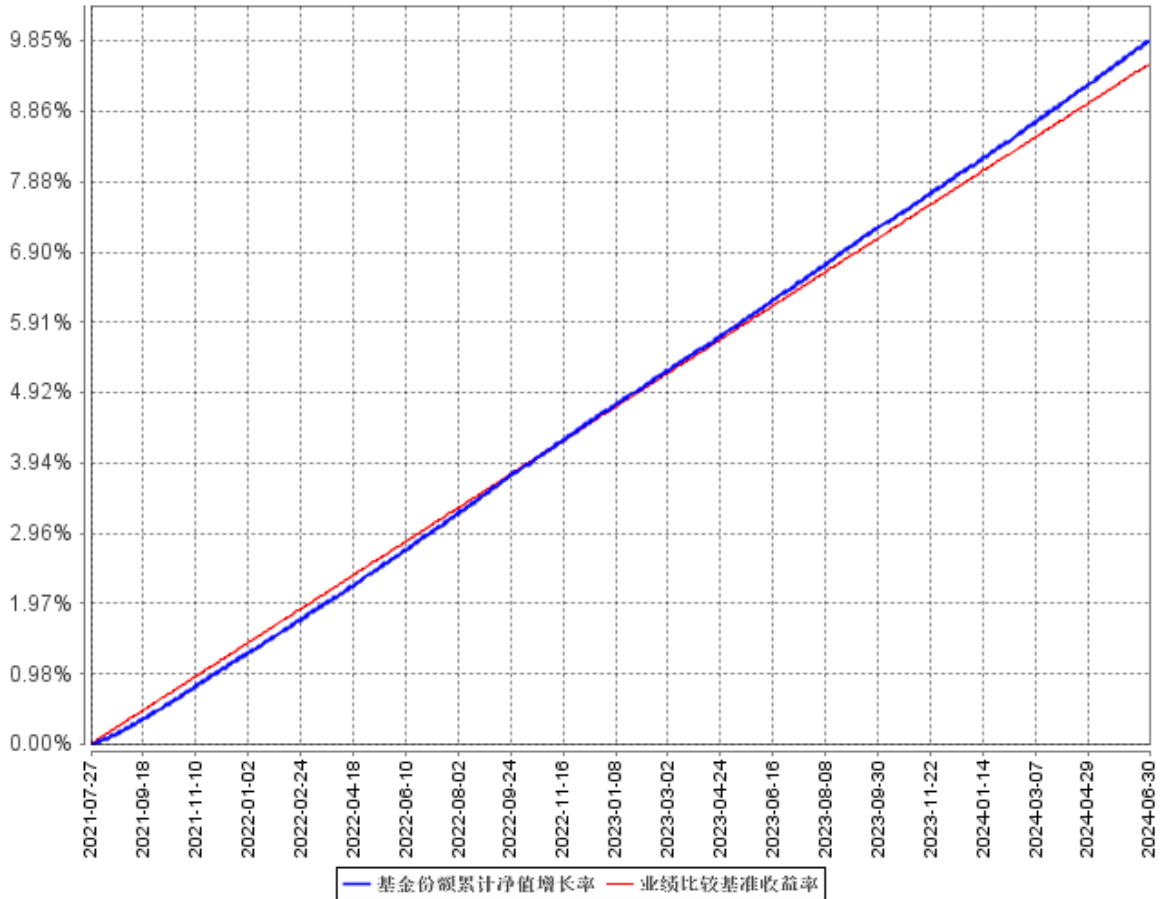
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 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 | 0.27% | 0.01% | 0.24% | 0.01% | 0.03% | 0.00% |
| 过去三个月 | 0.83% | 0.01% | 0.75% | 0.01% | 0.08% | 0.00% |
| 过去六个月 | 1.65% | 0.01% | 1.50% | 0.01% | 0.15% | 0.00% |
| 过去一年 | 3.29% | 0.01% | 3.07% | 0.01% | 0.22% | 0.00% |
| 自基金合同生效起至今 | 9.85% | 0.01% | 9.53% | 0.01% | 0.32% | 0.00% |

注：本着公允性原则、可复制性原则和再平衡等原则，本基金在每个封闭期，选取“该封闭期起始日公布的三年期定期存款利率（税后）+0.5%”作为本基金的比较基准。

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

基金份额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



§ 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

新沃基金管理有限公司成立于 2015 年 8 月，是一家经中国证监会核准设立的全国性基金管理公司，经营范围包括公募基金管理业务、证券投资基金销售服务和中国证监会许可的其他业务。截至 2024 年 6 月 30 日，公司共管理 6 只公募基金，分别是新沃通宝货币市场基金、新沃通盈灵活配置混合型证券投资基金、新沃通利纯债债券型证券投资基金、新沃创新领航混合型证券投资基金、新沃内需增长混合型证券投资基金、新沃安鑫 87 个月定期开放债券型证券投资基金。

未来，公司将继续秉承“专业创造机会，合作实现价值”的发展理念，坚持“以人为本”的发展战略，坚守“诚信、专业、合作、超越”的价值准则，致力于经过长期努力跻身国内一流基金管理公司行列，力求为广大投资者提供稳定的投资回报。

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 | | |
| 庄磊 | 本基金的基金经理、公司固定收益部总经理 | 2021 年 10 月 28 日 | - | 13 年 | 中央财经大学金融学博士，中国籍。2001 年 7 月起先后在北京银行股份有限公司资金交易部、资产管理部担任理财业务主管；贵阳银行股份有限公司理财投资部兼北京投行与同业中心担任副总经理；华泰汽车金融有限公司担任总裁助理；四川天府银行股份有限公司资产管理事业部担任副总裁；2020 年 9 月加入新沃基金管理有限公司，现担任固定收益部总经理兼基金经理。 |

注：1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”按基金合同生效日填写，“离职日期”为根据公司决定确定的解聘日期，对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2、证券从业年限计算标准遵从中国证监会《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业

人员监督管理办法》中关于证券投资基金从业人员范围的相关规定。

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

本报告期末基金经理无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》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、基金合同和其他有关法律法规，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。

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

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《新沃基金管理有限公司公平交易管理办法》，在授权管理、研究分析、投资决策、交易执行、行为监控等方面对公平交易制度予以落实，确保各组合享有同等信息知情权、均等交易机会，并保持各组合的独立投资决策权。

本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

公司制定了《异常交易监控管理办法》对各类异常交易的情形进行了界定，并制定相应的监控方法与识别、报告、处理程序。

本报告期内，公司对各投资组合的交易行为进行监控和分析，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

本报告期内，未发生投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情形。

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，宏观经济依旧低迷。一季度 GDP 同比增长 5.3%，略超市场预期。一季度 3 个月制造业 PMI 逐月走高。社会消费品零售总额同比增速低于预期，出口同比增速超预期。固定资产投资增速出现回升。CPI、PPI 同比增速低于预期。A 股一季度走势较差，股债跷跷板效应下，债市持续走高。二季度宏观经济仍然表现不佳。二季度 GDP 同比增长 4.7%，低于预期。月度制造业 PMI 重回荣枯线以下。非制造业 PMI 则逐月走低。固定资产投资增速回落。社会消费品

零售总额增速也低于预期。出口增速依然强于预期。2024 年上半年金融数据表现较差。4 月社融增量罕见负增长，M1 出现负增长，M2 增速持续走低。较弱的经济基本面对债市形成了一定支撑。

货币市场方面，2024 年上半年整体资金面较为宽松。上半年，央行降准降息，为货币市场营造了宽松氛围。央行 2 月先后调低存款准备金率和 LPR 利率。短期回购利率较往年偏低。除一季度末、二季度末回购利率短暂高企外，其他时间回购利率均较低。

2024 年上半年，债市收益率呈波段下行走势。年初至 3 月初，债券收益率一路下行。3 月中旬长期债券交易拥挤，收益率过低，引发市场调整。但调整很快结束，收益率重回下行通道。4 月份债券收益率继续下行，但 4 月最后一周，央行强调“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”，叠加 A 股走强，债市出现大幅调整。受益于偏弱的经济基本面，一级债券供给不及预期，债券收益率继续下行。

本基金在报告期内采用稳健积极的投资策略，主要配置到期日贴近下一开放日的政策金融债，并采用持有至到期的策略。本基金通过精细化融资管理，实现净值的合理增长，为投资者提供了较好的业绩回报。由于近 3 年债券收益率大幅下行，故本产品暂缓配置利率债，等待利率的反弹再行配置。报告期内，本基金组合杠杆维持平稳，同时积极扩展交易对手控制杠杆融资成本，并主要通过短期回购来降低融资成本，最大限度提升套息交易收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.0052 元；本报告期基金份额净值增长率为 1.65%，业绩比较基准收益率为 1.50%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年我国宏观经济呈现弱复苏态势，下半年政策有望加码。但受国内需求不足等因素制约，下半年经济大幅回升的概率较低，仍可能维持弱复苏态势。偏宽松的货币政策依然值得期待。2024 年 7 月 22 日以来，央行先后调低公开市场逆回购利率、1 年期和 5 年期 LPR 利率、MLF 利率，央行呵护市场流动性的意图明显。下半年央行仍有降准的可能性。央行降息后，国有银行的存款挂牌利率也快速下调。受美国失业率高企、通胀数据持续改善因素影响，美联储下半年大概率降息，也为我国债市提供了较好的外围环境。较弱的国内经济基本面和降息的外部环境，导致了我国债市收益率难以大幅上行，收益率有望震荡走低。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1、有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历的描述

根据证监会的相关规定，为建立健全有效的估值政策和程序，公司成立估值委员会，明确参与估值流程各方的人员分工和职责，由投资研究部、监察稽核部、基金事务部相关人员担任委员

会委员。估值委员会委员具备应有的经验、专业胜任能力和独立性，分工明确，在上市公司研究和估值、基金投资、投资品种所属行业的专业研究、估值政策、估值流程和程序、基金的风险控制与绩效评估、会计政策与基金核算以及相关事项的合法合规性审核和监督等各个方面具备专业能力和丰富经验。估值委员会严格按照工作流程诚实守信、勤勉尽责地讨论和决策估值事项。日常估值项目由基金事务部严格按照新会计准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定执行。当经济环境和证券市场发生重大变化时，针对特殊估值工作，按照以下工作流程进行：由公司估值委员会依据行业协会提供的估值模型和行业做法选定与当时市场经济环境相适应的估值方法并征求托管行、会计师事务所的相关意见，由基金事务部做出提示，对其潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响是否在 0.25% 以上进行测算，并对确认产生影响的品种根据前述估值模型、估值流程计算提供相关投资品种的公允价值以进行估值处理，待清算人员复核后，将估值结果反馈基金经理，并提交公司估值委员会。其他特殊情形，可由基金经理主动做出提示，并由研究员提供研究报告，交估值委员会审议，同时按流程对外公布。

2、基金经理参与或决定估值的程度

基金经理参与对估值问题的讨论，对估值结果提出反馈意见，但不介入基金日常估值业务。

3、本公司参与估值流程各方之间没有存在任何重大利益冲突。

4、定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《新沃安鑫 87 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》及其他法律法规的规定，本报告期内，本基金实施利润分配 1 次，分配方案为 0.2000 元/10 份基金份额，其中以现金形式发放的总额为 101,004,447.20 元，以再投资形式发放的总额为 0.02 元，共分配 101,004,447.22 元，具体参见本报告“6.4.11 利润分配情况”。本基金的利润分配符合相关法律法规的规定及基金合同的相关约定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金未出现连续 20 个工作日基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本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

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《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

本托管人认真复核了本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、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 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：新沃安鑫 87 个月定期开放债券型证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2024 年 6 月 30 日 | 上年度末 2023 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| 资产： | | | |
| 货币资金 | 6.4.7.1 | 986,860.62 | 302,126.16 |
| 结算备付金 | | - | - |
| 存出保证金 | | - | - |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | - | - |
| 其中：股票投资 | | - | - |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | - | - |
| 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 | 7,089,319,586.69 | 6,980,106,676.45 |
| 其中：债券投资 | | 7,089,319,586.69 | 6,980,106,676.45 |
| 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 | | 7,090,306,447.31 | 6,980,408,802.61 |
| 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 | | 2,012,654,915.71 | 1,885,522,303.93 |
| 应付清算款 | | - | - |
| 应付赎回款 | | - | - |
| 应付管理人报酬 | | 633,235.36 | 649,124.80 |
| 应付托管费 | | 211,078.46 | 216,374.93 |
| 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 | 133,274.36 | 221,015.50 |
| 负债合计 | | 2,013,632,503.89 | 1,886,608,819.16 |
| 净资产： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.10 | 5,050,222,364.33 | 5,050,222,364.31 |
| 其他综合收益 | 6.4.7.11 | - | - |
| 未分配利润 | 6.4.7.12 | 26,451,579.09 | 43,577,619.14 |
| 净资产合计 | | 5,076,673,943.42 | 5,093,799,983.45 |
| 负债和净资产总计 | | 7,090,306,447.31 | 6,980,408,802.61 |

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0052 元，基金份额总额 5,050,222,364.33 份。

6.2 利润表

会计主体：新沃安鑫 87 个月定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
|------------------|----------|--|---|
| 一、营业总收入 | | 109,220,836.35 | 108,623,006.69 |
| 1.利息收入 | | 109,220,836.35 | 108,623,006.69 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.13 | 7,926.11 | 2,273.94 |
| 债券利息收入 | | 109,212,910.24 | 108,620,732.75 |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | - | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | - | - |
| 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 | - | - |
| 资产支持证券投资收益 | 6.4.7.16 | - | - |
| 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 | - | - |
| 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 | | 25,342,429.18 | 27,973,120.17 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 3,827,806.65 | 3,808,958.08 |
| 其中：暂估管理人报酬（若有） | | - | - |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 1,275,935.57 | 1,269,652.69 |
| 3. 销售服务费 | 6.4.10.2.3 | - | - |
| 4. 投资顾问费 | | - | - |
| 5. 利息支出 | | 20,134,401.60 | 22,790,370.48 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 20,134,401.60 | 22,790,370.48 |
| 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 | 104,285.36 | 104,138.92 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 83,878,407.17 | 80,649,886.52 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 83,878,407.17 | 80,649,886.52 |
| 五、其他综合收益的税后净额 | | - | - |
| 六、综合收益总额 | | 83,878,407.17 | 80,649,886.52 |

6.3 净资产变动表

会计主体：新沃安鑫 87 个月定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 | | | |
|-----------|---------------------------------------|--------|---------------|------------------|
| | 实收基金 | 其他综合收益 | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净资产 | 5,050,222,364.31 | - | 43,577,619.14 | 5,093,799,983.45 |
| 加：会计政策变更 | - | - | - | - |

| | | | | |
|--|--|--------|-----------------|------------------|
| 前期差错更正 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 二、本期期初净资产 | 5,050,222,364.31 | - | 43,577,619.14 | 5,093,799,983.45 |
| 三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列) | 0.02 | - | -17,126,040.05 | -17,126,040.03 |
| (一)、综合收益总额 | - | - | 83,878,407.17 | 83,878,407.17 |
| (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) | 0.02 | - | - | 0.02 |
| 其中：1.基金申购款 | 0.02 | - | - | 0.02 |
| 2.基金赎回款 | - | - | - | - |
| (三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列) | - | - | -101,004,447.22 | -101,004,447.22 |
| (四)、其他综合收益结转留存收益 | - | - | - | - |
| 四、本期期末净资产 | 5,050,222,364.33 | - | 26,451,579.09 | 5,076,673,943.42 |
| 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 | 5,050,222,364.28 | - | 32,463,790.30 | 5,082,686,154.58 |
| 加：会计政策变更 | - | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |

| | | | | |
|--|------------------|---|-----------------|------------------|
| 二、本期期初净资产 | 5,050,222,364.28 | - | 32,463,790.30 | 5,082,686,154.58 |
| 三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列) | 0.02 | - | -20,354,560.70 | -20,354,560.68 |
| (一)、综合收益总额 | - | - | 80,649,886.52 | 80,649,886.52 |
| (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) | 0.02 | - | - | 0.02 |
| 其中: 1.基金申购款 | 0.02 | - | - | 0.02 |
| 2.基金赎回款 | - | - | - | - |
| (三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列) | - | - | -101,004,447.22 | -101,004,447.22 |
| (四)、其他综合收益结转留存收益 | - | - | - | - |
| 四、本期期末净资产 | 5,050,222,364.30 | - | 12,109,229.60 | 5,062,331,593.90 |

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>李钧</u> | <u>李钧</u> | <u>孙娟</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

新沃安鑫 87 个月定期开放债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可第[2020]2788号《关于准予新沃安鑫 87 个月定期开放债券型证券投资基金注册的批复》核准,由新沃基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券

投资基金法》和《新沃安鑫 87 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型定期开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 5,050,004,025.80 元，业经上会会计师事务所（特殊普通合伙）上会师报字（2021）第 8357 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《新沃安鑫 87 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》于 2021 年 7 月 27 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 5,050,222,362.09 份基金份额，其中认购资金利息折合 218,336.29 份基金份额。本基金的基金管理人为新沃基金管理有限公司（以下简称“新沃基金”），基金托管人为兴业银行股份有限公司（以下简称“兴业银行”）。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和基金合同等有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的国债、央行票据、政策性银行金融债、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。本基金不直接投资股票等权益类资产，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，其投资比例遵循届时有效法律法规或相关规定。本基金投资于债券比例不低于基金资产的 80%（每次开放期开始前 3 个月、开放期及开放期结束后 3 个月的期间内，基金投资不受此比例限制）。开放期内，在每个交易日日终，应当保持不低于基金资产净值的 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券；在封闭期内，本基金不受上述 5% 的限制。其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金的业绩比较基准为：在每个封闭期，本基金的业绩比较基准为该封闭期起始日公布的三年期定期存款利率（税后）+0.5%。

本基金的财务报表于 2024 年 8 月 28 日已经本基金的基金管理人批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期间无重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局国家税务总局财税[1998]55 号《关于证券投资基金税收问题的通知》、财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》、财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、国发[1985]19 号发布和国务院令[2011]第 588 号修订的《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例》、国务院令[2005]第 448 号《国务院关于修改〈征收教育费附加的暂行规定〉的决定》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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

2、对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不缴纳企业所得税。

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

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

5、基金卖出股票缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2024 年 6 月 30 日 |
|--------|------------------------|
| 活期存款 | 986,860.62 |
| 等于：本金 | 985,796.96 |
| 加：应计利息 | 1,063.66 |
| 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 | 986,860.62 |

6.4.7.2 交易性金融资产

无。

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

无。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

单位：人民币元

| 项目 | | 本期末 2024 年 6 月 30 日 | | | | |
|--------|-------|------------------------|--------------|----------------|--------|------------------|
| | | 初始成本 | 利息调整 | 应计利息 | 减：减值准备 | 账面价值 |
| 债券 | 交易所市场 | - | - | - | - | - |
| | 银行间市场 | 6,890,000,000.00 | 2,610,958.27 | 196,708,628.42 | - | 7,089,319,586.69 |
| | - | - | - | - | - | - |
| | 小计 | 6,890,000,000.00 | 2,610,958.27 | 196,708,628.42 | - | 7,089,319,586.69 |
| 资产支持证券 | | - | - | - | - | - |
| 其他 | | - | - | - | - | - |
| 合计 | | 6,890,000,000.00 | 2,610,958.27 | 196,708,628.42 | - | 7,089,319,586.69 |

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

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

无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.8 其他资产

无。

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 | 39,439.00 |
| 其中：交易所市场 | - |
| 银行间市场 | 39,439.00 |
| 应付利息 | - |
| 预提费用 | 93,835.36 |
| 合计 | 133,274.36 |

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 | 5,050,222,364.31 | 5,050,222,364.31 |
| 本期申购 | 0.02 | 0.02 |
| 本期赎回(以“-”号填列) | - | - |
| - 基金拆分/份额折算前 | - | - |
| 基金拆分/份额折算变动份额 | - | - |
| 本期申购 | - | - |
| 本期赎回(以“-”号填列) | - | - |
| 本期末 | 5,050,222,364.33 | 5,050,222,364.33 |

注：申购含红利再投、转换入份额及金额，赎回含转换出份额及金额。

6.4.7.11 其他综合收益

无。

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 | 43,577,619.14 | - | 43,577,619.14 |
| 加：会计政策变更 (若有) | - | - | - |
| 前期差错更正 (若有) | - | - | - |

| | | | |
|----------------|-----------------|---|-----------------|
| 其他（若有） | - | - | - |
| 本期期初 | 43,577,619.14 | - | 43,577,619.14 |
| 本期利润 | 83,878,407.17 | - | 83,878,407.17 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | - | - | - |
| 其中：基金申购款 | - | - | - |
| 基金赎回款 | - | - | - |
| 本期已分配利润 | -101,004,447.22 | - | -101,004,447.22 |
| 本期末 | 26,451,579.09 | - | 26,451,579.09 |

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 | 7,926.11 |
| 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 | 7,926.11 |

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

无。

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

无。

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

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

无。

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

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

无。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

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

无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

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

无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.19 股利收益

无。

6.4.7.20 公允价值变动收益

无。

6.4.7.21 其他收入

无。

6.4.7.22 信用减值损失

无。

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 | - |
| 其他 | 600.00 |
| 账户服务费 | 18,000.00 |
| 银行费用 | 1,150.00 |
| 银行间回购交易手续费 | - |
| 银行间债券交易手续费 | - |
| 合计 | 104,285.36 |

注：“其他”为上交所查询服务费。

6.4.7.24 分部报告

无。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

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

2024 年 5 月 13 日，本基金管理人发布《新沃基金管理有限公司关于新增注册资本及股东的公告》，根据公司股东会决议，公司进行增资扩股。公司注册资本由人民币 14,000.00 万元增加至人民币 15,596.5342 万元，新增股东青岛金家岭控股集团有限公司、青岛海诺投资发展有限公司分别认缴公司新增注册资本人民币 778.2671 万元。本次股权变更后，公司的股权结构如下：

新沃控股集团有限公司 63.0140%；新沃联合资产管理有限公司 27.0060%；青岛金家岭控股集团有限公司 4.9900%；青岛海诺投资发展有限公司 4.9900%。本次股权变更工商变更登记手续已办理完毕。

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 |
|------------|---------------------|
| 新沃基金管理有限公司 | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |
| 兴业银行股份有限公司 | 基金托管人 |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 权证交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024年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 | 3,827,806.65 | 3,808,958.08 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 1.82 | 1.81 |
| 应支付基金管理人的净管理费 | 3,827,804.84 | 3,808,956.27 |

注：①支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.15%/当年天数；

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024年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托管费 | 1,275,935.57 | 1,269,652.69 |

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.05%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值×0.05%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

无。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

| 本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 | | | | | | |
|--|--------|------|----------|----------|-------------------|--------------|
| 银行间市场 交易的 各关联方名 称 | 债券交易金额 | | 基金逆回购 | | 基金正回购 | |
| | 基金买入 | 基金卖出 | 交易金 额 | 利息收 入 | 交易金额 | 利息支出 |
| 兴业银行股 份有限公司 | - | - | - | - | 23,291,000,000.00 | 9,708,263.29 |
| 上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 | | | | | | |
| 银行间市场 交易的 各关联方名 称 | 债券交易金额 | | 基金逆回购 | | 基金正回购 | |
| | 基金买入 | 基金卖出 | 交易金 额 | 利息收 入 | 交易金额 | 利息支出 |
| 兴业银行股 份有限公司 | - | - | - | - | 14,579,000,000.00 | 5,720,843.20 |

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

无。

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

无。

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

无。

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

无。

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 |
| 兴业银行股份有限公司 | 986,860.62 | 7,926.11 | 520,361.82 | 2,273.94 |

注：本基金的银行存款由基金托管人兴业银行股份有限公司保管，按约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

金额单位：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 6 月 24 日 | - | 2024 年 6 月 24 日 | 0.2000 | 101,004,447.20 | 0.02 | 101,004,447.22 | |
| 合计 | - | - | | 0.2000 | 101,004,447.20 | 0.02 | 101,004,447.22 | |

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

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 06 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回

购证券款余额是 2,012,654,915.71 元，是以如下债券作为抵押：

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 |
|-----------|------------|----------------|--------|------------|------------------|
| 210209 | 21 国开 09 | 2024 年 7 月 2 日 | 102.60 | 7,154,000 | 734,006,868.02 |
| 092118004 | 21 农发清发 04 | 2024 年 7 月 3 日 | 102.77 | 7,390,000 | 759,442,589.84 |
| 092118004 | 21 农发清发 04 | 2024 年 7 月 4 日 | 102.77 | 6,430,000 | 660,786,989.54 |
| 合计 | | | | 20,974,000 | 2,154,236,447.40 |

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为债券型基金，具有中等预期风险、中等预期收益的特征，其预期风险和预期收益低于混合型基金和股票型基金、高于货币市场基金。本基金投资的金融工具主要为债券投资。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金在追求本金安全、保持资产流动性以及严格控制风险的基础上，通过主要配置国债、政策性金融债等固定收益类金融工具，追求资产的长期稳定增值，力争为基金份额持有人提供超越业绩比较基准的当期收益以及长期稳定的投资回报。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以监察及风险控制委员会为核心的、由督察长、风险管理委员会、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立监察及风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险管理委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；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以及进行投资风险分析与绩效评估。监察稽核部对公司总经理负责，并由督察长分管。

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

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行兴业银行股份有限公司，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末 2024 年 6 月 30 日 | 上年度末 2023 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| AAA | - | - |
| AAA 以下 | - | - |
| 未评级 | 7,089,319,586.69 | 6,980,106,676.45 |

| | | |
|----|------------------|------------------|
| 合计 | 7,089,319,586.69 | 6,980,106,676.45 |
|----|------------------|------------------|

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级；

2、未评级债券为期限大于一年的政策性金融债。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

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基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于 2024 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约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，因此账面余额即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

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《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》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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的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%。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。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投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日内可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日内可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时关于未来现金流的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2024 年 6 月 30 日 | 1 年以内 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
|------------------------|------------------|------------------|-------|-----|------------------|
| 资产 | | | | | |
| 货币资金 | 986,860.62 | - | - | - | 986,860.62 |
| 债权投资 | - | 7,089,319,586.69 | - | - | 7,089,319,586.69 |
| 其他资产 | - | - | - | - | - |
| 资产总计 | 986,860.62 | 7,089,319,586.69 | - | - | 7,090,306,447.31 |
| 负债 | | | | | |
| 卖出回购金融资产款 | 2,012,654,915.71 | - | - | - | 2,012,654,915.71 |

| | | | | | |
|--------------------------|-------------------|------------------|-------|---------------|------------------|
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 633,235.36 | 633,235.36 |
| 应付托管费 | - | - | - | 211,078.46 | 211,078.46 |
| 其他负债 | - | - | - | 133,274.36 | 133,274.36 |
| 负债总计 | 2,012,654,915.71 | - | - | 977,588.18 | 2,013,632,503.89 |
| 利率敏感度缺口 | -2,011,668,055.09 | 7,089,319,586.69 | - | -977,588.18 | 5,076,673,943.42 |
| 上年度末 2023 年 12 月 31 日 | 1 年以内 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
| 资产 | | | | | |
| 货币资金 | 302,126.16 | - | - | - | 302,126.16 |
| 债权投资 | - | 6,980,106,676.45 | - | - | 6,980,106,676.45 |
| 其他资产 | - | - | - | - | - |
| 资产总计 | 302,126.16 | 6,980,106,676.45 | - | - | 6,980,408,802.61 |
| 负债 | | | | | |
| 卖出回购金融资产款 | 1,885,522,303.93 | - | - | - | 1,885,522,303.93 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 649,124.80 | 649,124.80 |
| 应付托管费 | - | - | - | 216,374.93 | 216,374.93 |
| 其他负债 | - | - | - | 221,015.50 | 221,015.50 |
| 负债总计 | 1,885,522,303.93 | - | - | 1,086,515.23 | 1,886,608,819.16 |
| 利率敏感度缺口 | -1,885,220,177.77 | 6,980,106,676.45 | - | -1,086,515.23 | 5,093,799,983.45 |

注：本基金采用摊余成本法估值。上表列示持有至到期投资金额为本基金持有至到期的债券投资余额，无减值准备。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本期末生息资产为银行存款及其他资产。其中，银行存款以活期存款利率或相对固定的利率计息，其他资产-持有至到期投资为固定利率持有至到期投资，利息收益在交易时已确定，不受利率变化影响。本基金本期末生息负债仅为卖出回购金融资产，卖出回购金融资产的利息支出在交易时已确定，不受利率变化影响。因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种且以摊余成本进行后续计量，因此无重大其他价格风险。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，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。

本基金未持有以公允价值计量的金融工具。

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

不适用。

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

无。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

不适用。

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资产和负债主要包括应收款项、债权投资和其他金融负债等。

除债权投资以外，其他不以公允价值计量的金融资产和金融负债的账面价值与公允价值差异很小。

于本基金本报告期末，本基金持有的债权投资的账面价值为 7,089,319,586.69 元，公允价值为 7,392,949,628.42 元，属于第二层次。（上年度末：本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，除持有至到期投资（债权投资）外，其余金融工具因其剩余期限较短，因此账面价值与公允价值相若。于上年度末，本基金持有的持有至到期投资（债权投资）的账面价值为 6,980,106,676.45 元，公允价值为 7,167,601,732.24 元，属于第二层次。）

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

除公允价值外，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 | 7,089,319,586.69 | 99.99 |
| | 其中：债券 | 7,089,319,586.69 | 99.99 |
| | 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 | 986,860.62 | 0.01 |
| 8 | 其他各项资产 | | |
| 9 | 合计 | 7,090,306,447.31 | 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 | 按实际利率计算账面价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|------------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 7,089,319,586.69 | 139.64 |
| | 其中：政策性金融债 | 7,089,319,586.69 | 139.64 |
| 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 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 7,089,319,586.69 | 139.64 |

7.6 期末按实际利率计算账面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） | 按实际利率计算账面价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|------------|------------|------------------|--------------|
| 1 | 092118004 | 21 农发清发 04 | 36,900,000 | 3,792,074,636.70 | 74.70 |
| 2 | 210209 | 21 国开 09 | 28,600,000 | 2,934,385,857.60 | 57.80 |
| 3 | 180210 | 18 国开 10 | 3,400,000 | 362,859,092.39 | 7.15 |

7.7 期末按实际利率计算账面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持有国债期货。

7.10.2 本期国债期货投资评价

无。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

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

7.11.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金未持有股票，不存在投资的前十名股票超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

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各项资产。

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持有股票，期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于计算中四舍五入的原因，本报告分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数(户) | 户均持有的基金份额 | 持有人结构 | | | |
|----------|---------------|------------------|---------|----------|--------|
| | | 机构投资者 | | 个人投资者 | |
| | | 持有份额 | 占总份额比例 | 持有份额 | 占总份额比例 |
| 301 | 16,778,147.39 | 5,050,214,333.34 | 100.00% | 8,030.99 | 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 | 230.22 | 0.0000% |

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的情况

| 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 | 0~10 |

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|--------------------------------|------------------|
| 基金合同生效日（2021 年 7 月 27 日）基金份额总额 | 5,050,222,362.09 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 5,050,222,364.31 |
| 本报告期基金总申购份额 | 0.02 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | - |
| 本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 5,050,222,364.33 |

§ 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

本报告期内，本基金管理人股东会决议，选举朱晓亮先生、肖书强先生、孙娟女士担任公司董事。详情请参阅本基金管理人发布的相关公告。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、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

本报告期内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

本基金会计师事务所为上会会计师事务所（特殊普通合伙）自基金成立起为本基金提供审计服务至今。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人及其高级管理人员无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

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

本报告期内本基金未租用证券公司交易单元进行股票投资。

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

本报告期内本基金未租用证券公司交易单元进行其他证券投资。

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 | 新沃安鑫 87 个月定期开放债券型证券投资基金 2023 年第 4 季度报告 | 指定报刊和/或管理人网站 | 2024 年 1 月 19 日 |
| 2 | 新沃基金管理有限公司关于旗下基金新增平安银行股份有限公司为基金销售机构的公告 | 指定报刊和/或管理人网站 | 2024 年 2 月 8 日 |

| | | | |
|----|---|--------------|-----------------|
| 3 | 新沃基金管理有限公司关于更新旗下公募基金风险等级的公告 | 指定报刊和/或管理人网站 | 2024 年 2 月 8 日 |
| 4 | 新沃安鑫 87 个月定期开放债券型证券投资基金 2023 年年度报告 | 指定报刊和/或管理人网站 | 2024 年 3 月 28 日 |
| 5 | 新沃基金管理有限公司关于提醒投资者防范金融诈骗的风险提示公告 | 指定报刊和/或管理人网站 | 2024 年 4 月 4 日 |
| 6 | 新沃基金管理有限公司关于旗下部分基金新增和讯信息科技有限公司为基金销售机构的公告 | 指定报刊和/或管理人网站 | 2024 年 4 月 12 日 |
| 7 | 新沃安鑫 87 个月定期开放债券型证券投资基金招募说明书(更新)(2024 年第 1 号) | 指定报刊和/或管理人网站 | 2024 年 4 月 19 日 |
| 8 | 新沃安鑫 87 个月定期开放债券型证券投资基金基金产品资料概要(更新) | 指定报刊和/或管理人网站 | 2024 年 4 月 19 日 |
| 9 | 新沃基金管理有限公司关于董事变更情况的公告 | 指定报刊和/或管理人网站 | 2024 年 4 月 20 日 |
| 10 | 新沃安鑫 87 个月定期开放债券型证券投资基金 2024 年第 1 季度报告 | 指定报刊和/或管理人网站 | 2024 年 4 月 20 日 |
| 11 | 新沃基金管理有限公司关于新增注册资本及股东的公告 | 指定报刊和/或管理人网站 | 2024 年 5 月 13 日 |
| 12 | 新沃基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海国信嘉利基金销售有限公司为基金销售机构的公告 | 指定报刊和/或管理人网站 | 2024 年 5 月 17 日 |
| 13 | 新沃基金管理有限公司关于增加基金直销账户的公告 | 指定报刊和/或管理人网站 | 2024 年 6 月 19 日 |
| 14 | 新沃安鑫 87 个月定期开放债券型证券投资基金分红公告 | 指定报刊和/或管理人网站 | 2024 年 6 月 20 日 |
| 15 | 新沃安鑫 87 个月定期开放债券型证券投资基金基金产品资料概要(更新) | 指定报刊和/或管理人网站 | 2024 年 6 月 20 日 |

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 | | | | | 报告期末持有基金情况 | |
|---|----------------|-------------------------|------------------|------|------|------------------|--------|
| | 序号 | 持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额 | 份额占比 |
| 机构 | 1 | 20240101-20240630 | 2,000,065,666.67 | - | - | 2,000,065,666.67 | 39.60% |
| | 2 | 20240101-20240630 | 2,050,067,333.33 | - | - | 2,050,067,333.33 | 40.59% |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| <p>报告期内本基金出现单一投资者持有基金份额比例超过 20%的情况。在单一投资者持有基金份额比例较高的情况下，如该投资者集中赎回，可能会增加基金的流动性风险。此外，由于基金在遇到大额赎回的时候可能需要变现部分资产，可能对持有资产的价格形成冲击，增加基金的市场风险。基金管理人将专业审慎、勤勉尽责地运作基金资产，加强防范流动性风险、市场风险，保护持有人利益。</p> | | | | | | | |

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

当持有基金份额比例达到或超过 20%的投资人较大比例赎回且基金的现金头寸不足时，基金管理人可能需要较高比例融入资金或较高比例变现资产，由此可能导致资金融入成本较高或较大冲击成本，造成基金财产损失、影响基金收益水平。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会准予新沃安鑫 87 个月定期开放债券型证券投资基金募集注册的文件
- (二) 《新沃安鑫 87 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》
- (三) 《新沃安鑫 87 个月定期开放债券型证券投资基金托管协议》
- (四) 《关于申请募集注册新沃安鑫 87 个月定期开放债券型证券投资基金之法律意见书》
- (五) 基金管理人业务资格批件、营业执照
- (六) 基金托管人业务资格批件、营业执照
- (七) 中国证监会规定的其他备查文件

12.2 存放地点

基金管理人和/或基金托管人的办公场所。

12.3 查阅方式

投资者可以在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

新沃基金管理有限公司

2024 年 8 月 29 日