

B219

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	固定收益投资	14,039,203,586.41	63.70
	其中:债券	13,338,877,586.41	60.52
	资产支持证券	700,326,000.00	3.18
2	买入返售金融资产	1,958,305,897.45	8.89
3	银行存款和结算备付金合计	5,918,256,689.22	26.85
4	其他各项资产	124,815,666.36	0.57
5	合计	22,040,581,839.44	100.00

3.2 债券回购融资情况

		金额单位:人民币元
序号	项目	占基金资产净值的比例 (%)
1	报告期内债券回购融资余额	4.93

序号	项目	金额	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	1,196,320,005.51	5.74

注：报告期末债券回购融资余额占基金资产净值的比例与报告期内各交易日历结束日基金资产净值比例均按期末平均值。

8.3 报告期内基金资产组合及公允价值变动的说明

8.3.1 报告期末本基金资产公允价值变动总额及其来源

8.3.2 报告期内基金资产组合公允价值变动的说明

8.3.3 基金投资组合平均持仓期限

8.3.4 投资组合平均持仓期限及基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均持仓期限	114
报告期内投资组合平均持仓期限	114

报告期内投资组合平均剩余期限最低值		56	
报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明 注：本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余期限未超过120天。			
3.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例			
序号	平均剩余期限	各期限资产净值占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	20.96	5.74
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	-
2	30天(含)——60天	9.29	0.00
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	-

3	60天(含)-90天	23.45	0.00
	其中,剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	-
4	90天(含)-120天	16.58	0.00
	其中,剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	-
5	120天(含)-397天(含)	34.94	0.00
	其中,剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	-
	合计	105.22	5.74

4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

8.5 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	摊余成本	占基金资产净值比例 (%)
3	金融债券	1,033,488,093.54	4.96
	其中:政策性金融债	1,033,488,093.54	4.96
4	企业债券	6,085,010.90	0.03
5	企业短期融资券	2,243,305,534.04	10.77
6	中期票据	120,809,239.48	0.58
7	同业存单	9,934,656,798.45	47.70
8	合计	13,338,827,586.43	64.04

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	11809421	18浦发银行CD241	4,000,000	396,866,064.48	1.91
2	111895798	18贵阳银行CD076	4,000,000	396,042,596.77	1.90
3	118886417	18长沙银行CD191	3,700,000	359,893,826.95	1.73
4	118848623	18广州银行CD070	3,500,000	347,841,253.38	1.67

5	180407	18农发 207	3,200,000	321,244,138.15	1.54
6	11188379	18农发 3377	3,000,000	298,333,603.09	1.43
7	11188584	18农发 3706	3,000,000	297,709,234.72	1.43
8	111821390	18南商 银行 C0360	3,000,000	297,570,702.48	1.43
9	111882140	18晋融 晋山 银行 C0129	3,000,000	293,865,851.08	1.41
10	111888661	18晋金 银行 C0390	3,000,000	291,427,205.95	1.41

8/ “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值偏离

报告期内权益的公允价值	美元	美元	0.22(0%)
报告期内权益的公允价值	欧元	欧元	-0.02(0.28%)
报告期内权益的公允价值	英镑	英镑	0.05(0.6%)

报告期内权益的公允价值比2015年2月26日情况说明

注：本基金本报告期内未发生权益的公允价值达到0.25%的情况。

报告期内权益的公允价值比2015年2月26日情况说明

注：本基金本报告期内未发生权益的公允价值达到0.5%的情况。

3.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资说明

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	149814	普明 57A1	2,500,000	250,000,000	1.20
2	149920	18 华明 6A	1,500,000	150,000,000	0.72
3	156681	18 旭花 3A	1,100,000	110,000,000	0.53
4	149984	18 晋景 5A	950,000	95,000,000	0.46
5	156192	18 晋景 6A	400,000	40,000,000	0.19
6	156601	二 绿 01 比	300,000	30,000,000	0.14
7	149980	18 旭花 4A	1,800,000	25,326,000	0.12

B.9 投资组合报告附注

B.9.1 基金计价方法说明

本基金采用固定份额净值,基金账面份额净值始终保持为人民币1.00元。

本基金估值采用摊余成本法,即估值时以买入成本列示,按照票面利率或协议

8.9.2 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
本报告日前一年内,本基金投资前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查,无
严重处罚、处罚。

8.9.3 期末其他各项资产构成

序号	名称	金额
3	应收利息	74,924,337.18
4	应收申购款	49,891,329.18
8	合计	124,815,666.36

8.9.4 投资组合各报告附注的其他文字描述部分

无

§9 基金持有人持有信息

9.1 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)	持有本公 司的基金 份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额 比例	占总份额 比例	持有份额 比例	占总份额比例
2,672,007	7,795.32	3,310,217,639.12	15.89%	17,518,922,116.31	84.11%

4	银行类机构	302,777,107.85	1.45%
5	券商类机构	301,450,057.47	1.45%
6	其他机构	268,254,576.72	1.29%
7	银行类机构	260,821,814.28	1.25%
8	银行类机构	201,939,001.14	0.97%
9	券商类机构	201,437,633.33	0.97%
10	券商类机构	200,999,694.53	0.96%
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况			
项目		持有份额总额(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有		3,709,335.21	0.0178%

9.4 期末基金持有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、基金投资和研究人员/部门负责人持有本开放式基金	10-50
本基金基金经理持有本开放式基金	0-10

§ 10 开放式基金份额变动

基金合同生效日(2015年6月25日)基金份额总额	200,256,960.70
报告期期初基金份额总额	21,514,463,962.70
报告期期间基金总申购份额	135,562,470,998.69
本报告期间基金总赎回份额	136,247,795,205.35

单位:份

注：总份额扣除基金份额总额

基金份额持有人姓名(名称)	2024.9.19/75.43
---------------	-----------------

注：总应回份额含红利再投，再投入份额，总赎回份额含转出应回份额。

11.1 基金份额持有人大会决议

11.1.1 基金份额持有人大会决议

本报告期间内无基金份额持有人大会决议。

11.2 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

本报告期间，本基金管理人无发生重大人事变动。根据国金基金管理有限公司第三届董事会审议通过，自2024年8月12日至8月15日发生变动，聘任杨振宇女士为公司副总经理。上述人事变动均按照有关规定披露，公告。

本报告期间，本基金管理人无基金托管部门无发生重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金资产、基金托管业务的诉讼

本报告期间，无涉及基金管理人、基金资产、基金托管业务的诉讼。

11.4 涉及基金托管业务的诉讼

本基金在报告期内投资策略未发生重大改变。

11.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本期聘任安永会计师事务所(特殊普通合伙)的报酬为100,000元人民币。截至本报告期末,本基金支付给会计师事务所报酬占基金净资产比例如下:

11.6.1 审计人、支付人及其报酬的支付人

本基金支付给会计师事务所报酬的支付人为基金管理人。

本报告期,基金管理人、基金管理人及其高级管理人员不存在受处罚或处分等情况。

11.7 基金租用证券公司交易席位的情况的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易席位用于股票投资和债券回购情况

金额单位:人民币元

券商名称	股票交易			债券回购券商的佣金			备注
	交易席位数量	成交金额	占当期股票成交金额的比例	佣金	占当期佣金的比例	占当期佣金的比例	
招商证券	1	1,000,000.00	100.00%	1,000.00	100.00%	100.00%	

基金名称	I	比例		
华安宏利	-	-	-	-

注:1.本基金根据中国证券监督管理委员会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》(证监基金字[2007]140号)的有关规定,本基金管理人比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、资产水平后,向券商租用了基金专用交易席位。

基金专用交易席位的选择标准如下:

- ① 经营行为规范,在近年内未出现重大违规行为;
- ② 财务状况良好,各项财务指标显示公司经营状况稳定;
- ③ 具有强大的研究实力,能够及时、全面地提供高质量的宏观、策略、行业、上市公司

(1) 本基金管理人根据下述标准选择代理销售机构：
① 基金销售机构应具备中国证监会规定的基金销售业务资格；
② 基金销售机构应具备健全、有效的内部控制制度；
③ 基金销售机构应具备完善、合理的基金销售网络和系统；
④ 基金销售机构应具备较强的市场推广能力；
⑤ 基金销售机构应具备较强的客户服务能力；
⑥ 基金销售机构应具备较强的风险控制能力；
⑦ 基金销售机构应具备较强的合规管理能力；
⑧ 基金销售机构应具备较强的信息技术支持能力；
⑨ 基金销售机构应具备较强的品牌影响力；
⑩ 基金销售机构应具备较强的综合实力。

(2) 基金专用交易席位的选择程序如下：
① 本基金管理人根据上述标准选择代理销售机构；
② 本基金管理人和被选中的基金销售机构签订席位使用协议；
③ 本基金管理人新增基金交易单元。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	占当期债券 成交金额比例	成交金额	占当期债券 回购成交 金额比例	成交金额	占当期权 证成交 比例	成交金额
券商名称						

申赎费率	202.650/0.77%	100.00%	--	--	--
------	---------------	---------	----	----	----

11.8 偏离度绝对值超过0.5%的情况
注：本基金本报告期内不存在偏离度绝对值超过0.5%的情况。

12 影响投资者决策的其他重要信息
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到20%的情况
注：本基金在本报告期内不存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息
c 国金基金管理有限公司
2019年3月30日