

国新国证雄安建设发展三年定期开放债券型证券投资基金

2023 年中期报告

2023 年 06 月 30 日

基金管理人:国新国证基金管理有限公司

基金托管人:中国工商银行股份有限公司

报告送出日期:2023 年 08 月 31 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2023年08月15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2023年01月01日起至2023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 | 5 |
| 2.4 信息披露方式 | 6 |
| 2.5 其他相关资料 | 6 |
| § 3 主要财务指标和基金净值表现 | 6 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标 | 6 |
| 3.2 基金净值表现 | 7 |
| § 4 管理人报告 | 8 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况 | 8 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 | 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 | 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 | 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 | 13 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 | 13 |
| 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 | 13 |
| 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) | 14 |
| 6.1 资产负债表 | 14 |
| 6.2 利润表 | 15 |
| 6.3 净资产(基金净值)变动表 | 16 |
| 6.4 报表附注 | 18 |
| § 7 投资组合报告 | 36 |
| 7.1 期末基金资产组合情况 | 36 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 | 37 |
| 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 | 37 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 | 37 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 | 37 |
| 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 | 38 |
| 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 | 38 |
| 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 | 38 |
| 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 | 38 |
| 7.10 本基金投资股指期货的投资政策 | 38 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 | 38 |

| | |
|---|-----------|
| 7.12 投资组合报告附注..... | 38 |
| § 8 基金份额持有人信息..... | 39 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构..... | 39 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况..... | 39 |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况..... | 40 |
| § 9 开放式基金份额变动..... | 40 |
| § 10 重大事件揭示..... | 40 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议..... | 40 |
| 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动..... | 40 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼..... | 40 |
| 10.4 基金投资策略的改变..... | 40 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况..... | 40 |
| 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况..... | 41 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况..... | 41 |
| 10.8 其他重大事件..... | 42 |
| § 11 影响投资者决策的其他重要信息..... | 43 |
| 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况..... | 43 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息..... | 44 |
| § 12 备查文件目录..... | 44 |
| 12.1 备查文件目录..... | 44 |
| 12.2 存放地点..... | 44 |
| 12.3 查阅方式..... | 44 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|---------------------------|
| 基金名称 | 国新国证雄安建设发展三年定期开放债券型证券投资基金 |
| 基金简称 | 国新国证雄安建设发展三年定开 |
| 基金主代码 | 009399 |
| 基金运作方式 | 契约型定期开放式 |
| 基金合同生效日 | 2020 年 07 月 01 日 |
| 基金管理人 | 国新国证基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国工商银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 726,707,462.06 份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|--|
| 投资目标 | 本基金在严格控制投资组合风险的前提下，重点投资涉雄安概念债券，追求基金资产的长期稳健增值，力争获得超越业绩比较基准的投资回报。 |
| 投资策略 | 本基金秉持“自上而下”与“自下而上”相结合的主动管理投资理念，采用价值分析方法，在分析和判断财政、货币、利率、通货膨胀等宏观经济运行指标的基础上，自上而下确定和动态调整各类资产比例和组合的目标久期、类属配置及期限结构配置；同时，本基金债券投资以涉雄安概念债券为主，雄安新区已进入大规模实质建设阶段，一方面，雄安新区地方政府债持续发行、期限丰富。中国雄安集团有限公司作为雄安新区开发建设主要载体和运作平台，预期也将公开市场发行债券；另一方面，中央企业通过设立分子公司等方式，参与雄安新区的建设发展，存续债券和计划发行债券种类丰富。本基金将重点关注以上两个方面的债券投资机会，在研究分析信用风险、流动性风险、供求关系、收益率水平、税收水平等因素基础上，自下而上的精选个券。本基金以封闭期为周期进行投资运作。本基金在封闭期与开放期采取不同的投资策略。在谨慎投资的基础上，力争实现组合的稳健增值。 |
| 业绩比较基准 | 中债综合财富（总值）指数收益率 |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，其长期平均风险和预期收益率理论上低于股票型基金、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 | | 国新国证基金管理有限公司 | 中国工商银行股份有限公司 |
| 信息披露负 | 姓名 | 谢超 | 郭明 |

| | | | |
|--------|------|--|---------------------|
| 责人 | 联系电话 | 010-59315649 | 010-66105799 |
| | 电子邮箱 | xiechao@crsfund.com.cn | custody@icbc.com.cn |
| 客户服务电话 | | 400-819-0789 | 95588 |
| 传真 | | 010-59315600 | 010-66105798 |
| 注册地址 | | 中国（河北）自由贸易试验区雄安片区容城县雄安市民服务中心企业办公区A栋一层108单元 | 北京市西城区复兴门内大街 55 号 |
| 办公地址 | | 北京市朝阳区朝阳门北大街 18 号中国人保寿险大厦 11 层 | 北京市西城区复兴门内大街 55 号 |
| 邮政编码 | | 100020 | 100140 |
| 法定代表人 | | 杨铭海 | 陈四清 |

2.4 信息披露方式

| | |
|---------------------|--------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 中国证券报 |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | www.crsfund.com.cn |
| 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 | 国新国证基金管理有限公司 | 北京市朝阳区朝阳门北大街 18 号中国人保寿险大厦 11 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（2023 年 01 月 01 日-2023 年 06 月 30 日） |
|---------------|--|
| 本期已实现收益 | 11,745,209.24 |
| 本期利润 | 12,045,482.88 |
| 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 | 1.55% |
| 本期基金份额净值增长率 | 1.58% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末（2023 年 06 月 30 日） |
| 期末可供分配利润 | 33,523,041.85 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0461 |
| 期末基金资产净值 | 760,230,503.91 |
| 期末基金份额净值 | 1.0461 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末（2023 年 06 月 30 日） |

| | |
|-------------|--------|
| 基金份额累计净值增长率 | 10.06% |
|-------------|--------|

注：（1）所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

（2）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。

（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

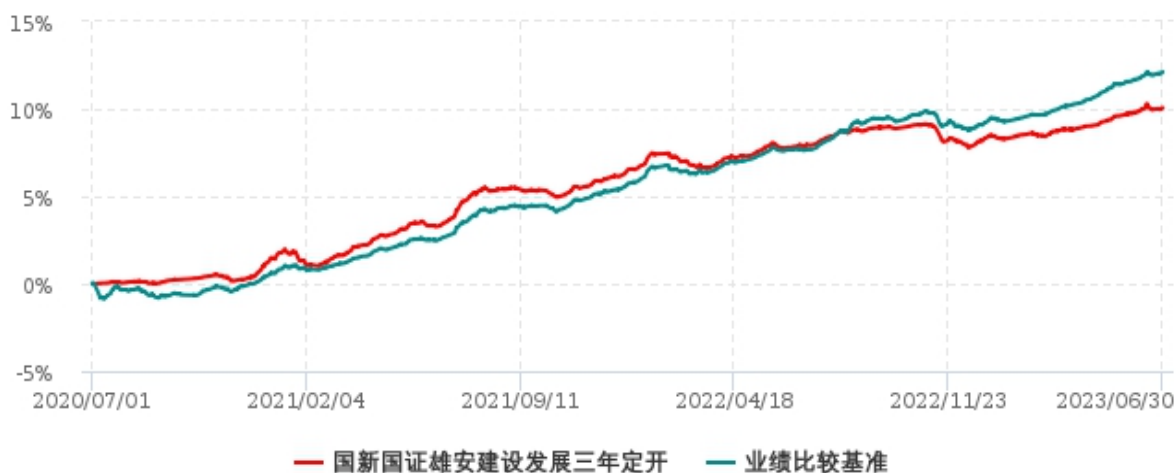
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 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 | 0.25% | 0.07% | 0.42% | 0.05% | -0.17% | 0.02% |
| 过去三个月 | 1.12% | 0.04% | 1.67% | 0.04% | -0.55% | 0.00% |
| 过去六个月 | 1.58% | 0.04% | 2.65% | 0.04% | -1.07% | 0.00% |
| 过去一年 | 1.98% | 0.04% | 4.12% | 0.05% | -2.14% | -0.01% |
| 过去三年 | 10.06% | 0.05% | 12.12% | 0.05% | -2.06% | 0.00% |
| 自基金合同生效起至今 | 10.06% | 0.05% | 12.12% | 0.05% | -2.06% | 0.00% |

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

国新国证雄安建设发展三年定期开放债券型证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2020年07月01日-2023年06月30日)



注：本基金合同于 2020 年 7 月 1 日生效。根据基金合同规定，自本基金合同生效日起 6 个月内基金的投资比例需符合基金合同要求。本基金在建仓期结束时，各项资产配置比例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

国新国证基金管理有限公司（原华融基金管理有限公司，以下简称“国新国证基金”）成立于 2019 年 3 月 1 日，是经中国证监会批准设立的首家及目前唯一一家落户雄安新区的公募基金管理及全国性证券类法人机构。国新国证基金股东为国新证券股份有限公司（原华融证券股份有限公司），持股比例 100%。国新国证基金注册资本人民币 2 亿元。自成立以来，国新国证基金秉承“诚信、尽责、专业、奋进”的企业精神，积极创新产品设计开发，创设国内首只雄安主题的公募基金，引导社会资源参与雄安新区运营建设，助力创新科技和京津冀协同发展。融入国新后，国新国证基金秉承国新“国之脉、传承责任之脉，新致远、坚持创新发展”核心价值理念，积极融入国家战略和国有资本运营全局，以“服务央企、服务国家战略”为己任，通过开展央企资本市场深度研究与投资，创设央企主题等创新产品，打造“央企投资特色资管机构”，努力为投资者提供长期稳健的投资回报，共享央企改革增长的红利。

截至报告期末，国新国证基金旗下管理 11 只公募基金产品，为国新国证现金增利货币市场基金、国新国证新锐灵活配置混合型证券投资基金、国新国证新利灵活配置混合型证券投资基金、国新国证雄安建设发展三年定期开放债券型证券投资基金、国新国证荣赢 63 个月定期开放债券型证券投资基金，国新国证融泽 6 个月定期开放灵活配置混合型证券投资基金，国新国证融兴 6 个月定期开放灵活配置混合型证券投资基金，国新国证优选配置 6 个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF），国新国证鑫颐中短债债券型证券投资基金，国新国证鑫裕央企债六个月定期开放债券型证券投资基金、国新国证鑫泰三个月定期开放债券型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理（助理）期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|-----|---------------------|-----------------|------|--------|--|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 黄诺楠 | 本基金的基金经理、固定收益投资部负责人 | 2020-07-01 | - | 10 年 | 黄诺楠，清华大学应用经济学专业博士，10 年证券从业经验。2020 年 1 月加入国新国证基金管理有限公司（原华融基金管理有限公司），现任固定收益投资部负责人。2020 年 7 月 1 日起担任国新国证雄安建设发展三年定期开放债券型证券投资基金的基金经理，2020 年 |

| | | | | |
|----|----------|------------|---|---|
| | | | | <p>12 月 30 日起担任国新国证荣赢 63 个月定期开放债券型证券投资基金的基金经理，2021 年 8 月 17 日起担任国新国证融泽 6 个月定期开放灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2021 年 12 月 15 日起担任国新国证融兴 6 个月定期开放灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2022 年 12 月 23 日起担任国新国证鑫裕央企债六个月定期开放债券型证券投资基金的基金经理，2023 年 5 月 18 日起担任国新国证鑫泰三个月定期开放债券型证券投资基金的基金经理。历任东方基金管理有限责任公司研究部研究员，固定收益部研究员、投资经理，东方双债添利债券型证券投资基金的基金经理、东方臻馨债券型证券投资基金的基金经理、东方强化收益债券型证券投资基金的基金经理、东方利群混合型发起式证券投资基金的基金经理、东方臻享纯债债券型证券投资基金的基金经理、东方多策略灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、东方臻宝纯债债券型证券投资基金的基金经理。</p> |
| 苏莹 | 本基金的基金经理 | 2022-08-04 | - | <p>6 年</p> <p>苏莹，对外经济贸易大学国民经济学硕士，6 年证券从业经验。2020 年 4 月加入国新国证基金管理有限公司（原华融基金管理有限公司），2022 年 8 月 4 日起担任国新国证雄安建设发展三年定期开放债券型证券投资基金、国新国证融泽 6 个月定期开放灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2021 年 12 月 22 日起担任国新国证融兴 6 个月定期开放灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理。曾任联合信</p> |

| | | | | | |
|-----|------------|------------|---|-----|---|
| | | | | | 用评级有限公司分析师、北信瑞丰基金管理有限公司信评研究员、国新国证基金管理有限公司研究部信用研究员。 |
| 张蕊 | 本基金的基金经理助理 | 2022-07-29 | - | 12年 | 张蕊，天津大学管理科学与工程博士，12年证券从业经验。2022年7月加入国新国证基金管理有限公司（原华融基金管理有限公司），2022年7月29日起任国新国证现金增利货币市场基金、国新国证雄安建设发展三年定期开放债券型证券投资基金、国新国证融泽6个月定期开放灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理。2022年12月29日起任国新国证鑫裕央企债六个月定期开放债券型证券投资基金的基金经理助理。2023年5月23日起担任国新国证鑫泰三个月定期开放债券型证券投资基金的基金经理助理。曾就职于中信建投证券股份有限公司，曾任渤海证券股份有限公司债券销售交易总部业务创新主管、创新业务组组长、投资经理。 |
| 桑劲乔 | 本基金的基金经理助理 | 2020-07-02 | - | 10 | 桑劲乔，澳大利亚麦考瑞大学金融学硕士，金融风险管理师(FRM)，10年证券从业经验。2012年11月加入国新证券股份有限公司（原华融证券股份有限公司，下同），2020年3月加入国新国证基金管理有限公司（原华融基金管理有限公司）。2016年12月6日起担任国新国证现金增利货币市场基金的基金经理，2022年6月13日起担任国新国证荣赢63个月定期开放债券型证券投资基金的基金经理，2022年12月7日起担任国新国证鑫颐中短债债券型证券投资基金的基金经理。2023年5月18日起担任国新国证鑫泰三个月定期开放 |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|---|
| | | | | | 债券型证券投资基金的基金经理。2020 年 7 月 2 日起担任国新国证雄安建设发展三年定期开放债券型证券投资基金的基金经理助理。历任国新证券股份有限公司固定收益投资部交易员、投资经理，基金业务部基金经理。 |
|--|--|--|--|--|---|

注:1.对基金的首任基金经理,其“任职日期”为基金合同生效日,“离任日期”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》及行业协会关于证券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

截止本报告期末,本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《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》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司开展投资、研究活动防控内幕交易指导意见》等法律法规规定及《国新国证雄安建设发展三年定期开放债券型证券投资基金基金合同》约定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

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

本基金管理人根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,建立了健全有效的公平交易执行体系,保证公平对待旗下的每一个投资组合。

在投资决策环节,本基金管理人构建了统一的研究平台,为旗下所有投资组合公平地提供研究支持。同时,在投资决策过程中,各基金经理严格遵守本基金管理人的各项投资管理制度和投资授权制度,保证各投资组合的独立投资决策机制。

在交易执行环节,本基金管理人实行集中交易制度,按照“时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡”的原则,确保各投资组合享有公平的交易执行机会。

在事后监控环节,本基金管理人定期对证券交易情况进行分析,并出具公平交易执行情况分析报告;另外,本基金管理人还对公平交易制度的遵守和相关业务流程的执行情况进行定期和不定期的检查,并对发现的问题进行及时报告。

综上所述,本基金管理人在本报告期内严格执行了公平交易制度的相关规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未发现存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

本报告期内基金管理人管理的所有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均未超过该证券当日成交量的 5%。

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

今年上半年，国内经济数据受疫情防控放开后需求集中释放，国内经济数据在一季度冲高后回落，二季度内需和外需均有所下降，经济复苏力度偏弱。具体而言，通胀 CPI 和 PPI 同比增速均持续下行，呈现低通胀特张，PPI 同比连续多月处于负值区间。生产端方面，受到低基数影响，工业增加值在 2 月冲高后逐步落入 5% 以下，PMI 数据显示企业仍在主动去库，工业企业利润累计同比增速持续下滑，仅高端制造业利润增速保持韧性。需求端方面，外需仍强于市场预期、内需恢复力度偏弱：上半年出口数据走势呈现倒 U 型，二季度进入负增长，高新技术产品和集成电路产品成为主要拖累项，贸易顺差高位小幅回落；内需方面，上半年固定资产投资增速放缓，其中房地产投资处于下行阶段，制造业投资增速也呈现前高后低，基建投资继续托底，但支持力度有限，而受去年低基数影响，社会消费品零售高速增长，特别是餐饮收入项，二季度增速回落。货币信用方面，上半年央行实行降准降息政策，3 月底全面下调存款准备金率 25bp，6 月中旬下调 1 年 MLF、7 天逆回购、SLF 利率、1 年和 5 年 LPR 利率均 10bp，整体资金价格中枢下行，货币市场资金面合理充裕，社融和企业信贷数据冲高后回落。

上半年债券市场先抑后扬，二季度大幅上涨，中短端利率中枢下行幅度较大，利率曲线先平坦化后陡峭化，中短久期信用债配置价值优于利率债，信用利差压缩至低位。

本基金今年上半年整体上保持了一定的久期和杠杆，在二季度加大了利率债波动操作频率，并为下半年初的开放进行了适度调仓，净值有一定幅度增长。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末国新国证雄安建设发展三年定开基金份额净值为 1.0461 元，本报告期内，基金份额净值增长率为 1.58%，同期业绩比较基准收益率为 2.65%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，在新旧经济切换阶段，高端制造业带动经济总量的增长较难托起房地产周期下行的经济疲弱，预计下半年国内经济基本面将继续探底，四季度可能底部回升，全年经济数据呈现 U 型走势，货币市场资金面仍会保持合理宽松，稳增长政策逐步加码，政策刺激力度温和。三季度地方债发行加速，但供需整体均衡。因此，下半年债券收益率可能会阶段性冲高，但上行幅度有限，本基金将择机进行杠杆和久期的灵活调整。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人同基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

本基金管理人设立估值委员会（主任委员由分管基金运营部的公司领导担任，副主任由公司主管基金运营部的部门领导担任，委员由投资、研究、风控、运营等部门负责人或业务骨干组成），负责研究、指导基金估值业务。估值委员会委员和负责基金日常估值业务的基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经验。基金经理不介入基金日常估值业务；估值委员会决议之前会与涉及基金的基金经理进行充分沟通。基金运营部负责执行估值委员会制定的估值政策及决议。

参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司和中证指数有限公司分别签署服务协议，其中中债金融估值中心有限公司按约定提供固定收益品种信用减值数据和在银行间同业市场交易的固定收益品种估值数据，中证指数有限公司提供在交易所市场交易的固定收益品种估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内实施了一次利润分配，于 2023 年 4 月 25 日每 10 份基金份额分红 0.540 元，现金形式发放总额为 36,379,535.61 元，再投资形式发放总额为 2,720,978.25 元，本期利润分配合计为 39,100,513.86 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

报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本基金的管理人——国新国证基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对国新国证基金管理有限公司编制和披露的本基金 2023 年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：国新国证雄安建设发展三年定期开放债券型证券投资基金

报告截止日：2023 年 06 月 30 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2023 年 06 月 30 日 | 上年度末 2022 年 12 月 31 日 |
|------------|---------|----------------------|-----------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 1,515,366.05 | 83,678,309.95 |
| 结算备付金 | | 26,992,539.41 | 5,938,480.20 |
| 存出保证金 | | 21,902.37 | 5,895.28 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 690,329,898.12 | 1,218,741,236.30 |
| 其中：股票投资 | | - | - |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 690,329,898.12 | 1,218,741,236.30 |
| 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 | 120,012,662.10 | - |
| 债权投资 | | - | - |
| 其中：债券投资 | | - | - |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 其他投资 | | - | - |
| 其他债权投资 | | - | - |
| 其他权益工具投资 | | - | - |
| 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 | 6.4.7.5 | - | - |
| 资产总计 | | 838,872,368.05 | 1,308,363,921.73 |

| 负债和净资产 | 附注号 | 本期末 2023 年 06 月 30 日 | 上年度末 2022 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 | | 77,971,501.05 | 523,010,243.30 |
| 应付清算款 | | 42,748.42 | 83,083.84 |
| 应付赎回款 | | - | - |
| 应付管理人报酬 | | 374,654.05 | 398,700.10 |
| 应付托管费 | | 93,663.50 | 99,675.02 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付投资顾问费 | | - | - |
| 应交税费 | | 74,033.91 | 46,878.68 |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.6 | 85,263.21 | 160,784.15 |
| 负债合计 | | 78,641,864.14 | 523,799,365.09 |
| 净资产： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.7 | 726,707,462.06 | 724,083,568.38 |
| 其他综合收益 | | - | - |
| 未分配利润 | 6.4.7.8 | 33,523,041.85 | 60,480,988.26 |
| 净资产合计 | | 760,230,503.91 | 784,564,556.64 |
| 负债和净资产总计 | | 838,872,368.05 | 1,308,363,921.73 |

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.0461 元，基金份额总额 726,707,462.06 份。

6.2 利润表

会计主体：国新国证雄安建设发展三年定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目 | 附注号 | 本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日 | 上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日 |
|-----------------|---------|---------------------------------------|--|
| 一、营业总收入 | | 19,487,394.30 | 16,075,383.83 |
| 1. 利息收入 | | 332,443.04 | 242,580.64 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.9 | 187,643.73 | 227,047.12 |
| 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 | | 144,799.31 | 15,533.52 |
| 证券出借利息收入 | | - | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2. 投资收益（损失以“-”填 | | 18,854,677.62 | 19,410,771.88 |

| | | | |
|----------------------------|------------|---------------|---------------|
| 列) | | | |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.10 | - | - |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.11 | 18,854,677.62 | 19,410,771.88 |
| 资产支持证券投资收益 | 6.4.7.12 | - | - |
| 贵金属投资收益 | 6.4.7.13 | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.14 | - | - |
| 股利收益 | 6.4.7.15 | - | - |
| 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） | 6.4.7.16 | 300,273.64 | -3,577,968.69 |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - | - |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17 | - | - |
| 减：二、营业总支出 | | 7,441,911.42 | 6,153,712.56 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 2,309,189.88 | 2,310,958.63 |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 577,297.48 | 577,739.67 |
| 3. 销售服务费 | 6.4.10.2.3 | - | - |
| 4. 投资顾问费 | | - | - |
| 5. 利息支出 | | 4,425,727.06 | 3,099,288.19 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 4,425,727.06 | 3,099,288.19 |
| 6. 信用减值损失 | 6.4.7.18 | - | - |
| 7. 税金及附加 | | 35,313.00 | 35,522.06 |
| 8. 其他费用 | 6.4.7.19 | 94,384.00 | 130,204.01 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 12,045,482.88 | 9,921,671.27 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 12,045,482.88 | 9,921,671.27 |
| 五、其他综合收益的税后净额 | | - | - |
| 六、综合收益总额 | | 12,045,482.88 | 9,921,671.27 |

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：国新国证雄安建设发展三年定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 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（基金净值） | 724,083,568.38 | - | 60,480,988.26 | 784,564,556.64 |
| 加：会计政策变更 | - | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 二、本期期初净资产（基金净值） | 724,083,568.38 | - | 60,480,988.26 | 784,564,556.64 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | 2,623,893.68 | - | -26,957,946.41 | -24,334,052.73 |
| （一）、综合收益总额 | - | - | 12,045,482.88 | 12,045,482.88 |
| （二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列） | 2,623,893.68 | - | 97,084.57 | 2,720,978.25 |
| 其中：1. 基金申购款 | 2,623,893.68 | - | 97,084.57 | 2,720,978.25 |
| 2. 基金赎回款 | - | - | - | - |
| （三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | - | - | -39,100,513.86 | -39,100,513.86 |
| （四）、其他综合收益结转留存收益 | - | - | - | - |
| 四、本期期末净资产（基金净值） | 726,707,462.06 | - | 33,523,041.85 | 760,230,503.91 |
| | 上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日 | | | |
| 项目 | 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（基金净值） | 724,083,568.38 | - | 47,417,308.97 | 771,500,877.35 |
| 加：会计政策变更 | - | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 二、本期期初净资产（基金净值） | 724,083,568.38 | - | 47,417,308.97 | 771,500,877.35 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | - | - | 9,921,671.27 | 9,921,671.27 |
| （一）、综合收益总额 | - | - | 9,921,671.27 | 9,921,671.27 |
| （二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列） | - | - | - | - |
| 其中：1. 基金申购款 | - | - | - | - |
| 2. 基金赎回款 | - | - | - | - |
| （三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金 | - | - | - | - |

| | | | | |
|-------------------|----------------|---|---------------|----------------|
| 净值变动（净值减少以“-”号填列） | | | | |
| （四）、其他综合收益结转留存收益 | - | - | - | - |
| 四、本期期末净资产（基金净值） | 724,083,568.38 | - | 57,338,980.24 | 781,422,548.62 |

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：

| | | |
|----------|-----------|---------|
| 丁卓 | 赵天智 | 单国巍 |
| ----- | ----- | ----- |
| 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

国新国证雄安建设发展三年定期开放债券型证券投资基金（原华融雄安建设发展三年定期开放债券型证券投资基金，以下简称“本基金”），系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[2020]669 号文）核准，由国新国证基金管理有限公司（原华融基金管理有限公司）依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《国新国证雄安建设发展三年定期开放债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）安永华明（2020）验字第 61560047_A01 号验资报告予以验证后，向中国证监会备案。基金合同于 2020 年 7 月 1 日正式生效，设立时募集扣除认购费后的有效净认购金额为人民币 724,036,258.25 元，折合 724,036,258.25 份基金份额；有效认购款项在募集期间产生的利息为人民币 47,310.13 元，折合 47,310.13 份基金份额；以上收到的实收基金共计人民币 724,083,568.38 元，折合 724,083,568.38 份基金份额。本基金为契约型、定期开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为国新国证基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。本基金管理人于 2022 年 12 月 7 日发布基金名称变更公告，本基金名称由华融雄安建设发展三年定期开放债券型证券投资基金变更为国新国证雄安建设发展三年定期开放债券型证券投资基金。

本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括国债、央行票据、政策性金融债、涉雄安概念债券（雄安新区地方政府、中国雄安集团有限公司和“落户雄安”的主体评级 AAA 级及以上中央企业发行的债券，包括地方政府债券、企业债券、公司债券、金融债券、短期融资券、超短期融资券、中期票据、可分离交易可转换债券的纯债部分及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包含协议存款、定期存款等）、货币市场工具、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证券监督管理委员会相关规定）。本基金对中央企业定义为：由国务院国资委或财政部（包括委托中央汇金投资有限责任公司）代表国务院履行实际控制人职责的企业。本基金对“落户雄安”的定义为：注册地或运营总部在雄安新区，或在雄安新区设立了分公司或控股子公司。本基金仅投资信用评级在 AAA 级及以上的信用债券。本基金投资的地方政府债券、企业债券、公司债券、金融债券、中期票据、可分

离交易可转换债券的纯债部分等信用债券的信用评级依照评级机构出具的债券信用评级；本基金投资的短期融资券、超短期融资券等短期信用债的信用评级依照评级机构出具的主体信用评级。本基金仅投资中国雄安集团有限公司和“落户雄安”的主体评级 AAA 级及以上中央企业作为原始权益人发行的信用级别评级为 AAA 以上（含 AAA）的资产支持证券。本基金不投资于股票等权益类资产，也不投资于可转换债券（可分离交易可转换债券的纯债部分除外）、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。本基金投资组合资产配置比例：债券资产占基金资产的比例不低于 80%，其中投资于涉雄安概念债券的比例不低于非现金基金资产的 80%（每个开放期开始日前 3 个月至开放期结束后 3 个月内不受此比例限制），投资于一家公司发行的证券的比例不超过基金资产净值的 5%。在开放期内，每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者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，但每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金。其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金参与国债期货交易，应符合法律法规规定和基金合同约定的投资限制并遵守相关期货交易所的业务规则。如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准为：中债综合财富（总值）指数收益率。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2023 年 06 月 30 日的财务状况以及自 2023 年 01 月 01 日起至 2023 年 06 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

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

本基金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

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

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

6.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

6.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，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（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。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。

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部

分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，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；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、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股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、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；

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按规定的比例缴纳。

6.4.6.3 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

6.4.6.4 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[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》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金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，暂减按 25% 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；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《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》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2023 年 06 月 30 日 |
|--------|----------------------|
| 活期存款 | 1,515,366.05 |
| 等于：本金 | 1,512,258.83 |
| 加：应计利息 | 3,107.22 |
| 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 | 1,515,366.05 |

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2023 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 | 459,349,630.06 | 6,484,616.09 | 465,964,072.39 | 129,826.24 |
| | 银行间市场 | 222,284,647.37 | 2,785,825.73 | 224,365,825.73 | -704,647.37 |
| | 合计 | 681,634,277.43 | 9,270,441.82 | 690,329,898.12 | -574,821.13 |
| 资产支持证券 | - | - | - | - | |
| 基金 | - | - | - | - | |
| 其他 | - | - | - | - | |
| 合计 | 681,634,277.43 | 9,270,441.82 | 690,329,898.12 | -574,821.13 | |

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2023 年 06 月 30 日 | |
|-------|----------------------|-----------|
| | 账面余额 | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | - | - |
| 银行间市场 | 120,012,662.10 | - |
| 合计 | 120,012,662.10 | - |

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金在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 2023 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 | 15,838.85 |
| 其中：交易所市场 | - |
| 银行间市场 | 15,838.85 |
| 应付利息 | - |
| 预提费用 | 69,424.36 |
| 合计 | 85,263.21 |

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日 | |
|---------------|---------------------------------------|----------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 724,083,568.38 | 724,083,568.38 |
| 本期申购 | 2,623,893.68 | 2,623,893.68 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | - | - |
| 本期末 | 726,707,462.06 | 726,707,462.06 |

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|----------------|-------------|----------------|
| 本期期初 | 61,356,083.03 | -875,094.77 | 60,480,988.26 |
| 本期利润 | 11,745,209.24 | 300,273.64 | 12,045,482.88 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 100,418.13 | -3,333.56 | 97,084.57 |
| 其中：基金申购款 | 100,418.13 | -3,333.56 | 97,084.57 |
| 基金赎回款 | - | - | - |
| 本期已分配利润 | -39,100,513.86 | - | -39,100,513.86 |
| 本期末 | 34,101,196.54 | -578,154.69 | 33,523,041.85 |

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 活期存款利息收入 | 13,909.39 |
| 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 | 173,616.49 |
| 其他 | 117.85 |
| 合计 | 187,643.73 |

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金投资范围不包括股票投资。

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日 |
|------------------------------|---------------------------------------|
| 债券投资收益——利息收入 | 17,363,715.56 |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | 1,490,962.06 |
| 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 | 18,854,677.62 |

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日 |
|------------------------|---------------------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额 | 2,051,168,603.06 |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 2,027,253,623.77 |
| 减：应计利息总额 | 22,407,917.23 |
| 减：交易费用 | 16,100.00 |
| 买卖债券差价收入 | 1,490,962.06 |

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期内未投资资产支持证券。

6.4.7.13 贵金属投资收益

6.4.7.13.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期内未投资贵金属。

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期内无衍生工具收益——其他投资收益。

6.4.7.15 股利收益

本基金投资范围不包括股票投资。

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日 |
|------------------------|---------------------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | 300,273.64 |
| ——股票投资 | - |
| ——债券投资 | 300,273.64 |
| ——资产支持证券投资 | - |
| ——基金投资 | - |
| ——贵金属投资 | - |
| ——其他 | - |
| 2. 衍生工具 | - |
| ——权证投资 | - |
| 3. 其他 | - |
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税 | - |
| 合计 | 300,273.64 |

6.4.7.17 其他收入

本基金本报告期无其他收入。

6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日 |
|------|---------------------------------------|
| 审计费用 | 9,916.99 |

| | |
|---------|-----------|
| 信息披露费 | 59,507.37 |
| 证券出借违约金 | - |
| 其他费用 | 600.00 |
| 账户维护费 | 18,000.00 |
| 银行汇划费 | 6,359.64 |
| 合计 | 94,384.00 |

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|--------------|---------------------|
| 国新国证基金管理有限公司 | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |
| 中国工商银行股份有限公司 | 基金托管人、基金销售机构 |
| 国新证券股份有限公司 | 基金管理人的股东、基金销售机构 |

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金报告期及上年度可比期间，未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金报告期及上年度可比期间，未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2023年01月01日至2023年06月30日 | | 上年度可比期间 2022年01月01日至 2022年06月30日 | |
|-------|-------------------------------|-----------|-------------------------------------|-----------|
| | 成交金额 | 占当期债券买卖成交 | 成交金额 | 占当期债券买卖成交 |

| | | 总额的比例 | | 总额的比例 |
|------------|----------------|---------|----------------|---------|
| 国新证券股份有限公司 | 500,189,313.69 | 100.00% | 301,696,672.03 | 100.00% |

6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日 | | 上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日 | |
|------------|---------------------------------------|----------------|--|----------------|
| | 成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例 |
| 国新证券股份有限公司 | 26,660,584,000.00 | 100.00% | 26,092,592,000.00 | 100.00% |

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金报告期及上年度可比期间，无应支付的关联方佣金。

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 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日 | 上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日 |
|-----------------|---------------------------------------|--|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 2,309,189.88 | 2,310,958.63 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 576,426.41 | 576,143.73 |

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.6% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.6\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付；基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 5 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 5 个工作日内支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日 | 上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日 |
|----------------|---------------------------------------|--|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 577,297.48 | 577,739.67 |

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.15% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付；由基金托管人于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 5 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 5 个工作日内支付。

6.4.10.2.3 销售服务费

本报告期及上年度可比期间，本基金未产生销售服务费。

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

本报告期及上年度可比期间，本基金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

本报告期及上年度可比期间，本基金未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。

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

本报告期及上年度可比期间，本基金未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

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自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

| 项目 | 本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日 | 上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日 |
|----------------------------------|---------------------------------------|--|
| 基金合同生效日（2020 年 07 月 01 日）持有的基金份额 | - | - |
| 报告期初持有的基金份额 | 20,003,277.78 | 20,003,277.78 |
| 报告期间申购/买入总份额 | - | - |
| 报告期间因拆分变动份额 | - | - |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额 | - | - |
| 报告期末持有的基金份额 | 20,003,277.78 | 20,003,277.78 |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 2.7526% | 2.7626% |

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末除管理人之外的其他关联方未投资本基金。

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 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日 | | 上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 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 |
| 中国工商银行股份有限公司 | 1,515,366.05 | 13,909.39 | 1,021,951.82 | 14,998.07 |

注：本基金的上述银行存款由基金托管人中国工商银行股份有限公司保管，按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券交易。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本报告期及上年度可比期间，本基金无其他关联方交易事项。

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

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 | 2023-04-25 | - | 2023-04-25 (场外) | 0.540 | 36,379,535.61 | 2,720,978.25 | 39,100,513.86 | - |
| 合计 | | | | 0.540 | 36,379,535.61 | 2,720,978.25 | 39,100,513.86 | - |

6.4.12 期末（2023 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本报告期末，本基金没有因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。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 6 月 30 日止，本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 77,971,501.05 元，于 2023 年 7 月 3 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末未参与转融通证券出借业务。

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

本基金一贯的风险管理政策是使基金投资风险可测、可控、可承担。本基金管理人秉承全面风险管理的理念，将风险管理融入业务中，建立了以合规与风险控制委员会为核心，由合规与风险控制委员会、督察长、风险管理部、法律合规/监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金管理人配备的风险管理人员对投资风险进行独立的监控并及时向管理层汇报。本基金管理人主要通过定性分析和定量分析的方法，估测各种金融工具风险可能产生的损失。本基金管理人从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重性；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的金融工具特征，通过特定的风险量化指标、模型和报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时对各种风险进行监督、检查和评估，并制定相应决策，将风险控制在预期可承受的范围内。

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导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的投资范围及投资比例符合法律法规的要求、监管机构的相关规定及本基金的合同要求。本基金管理人通过建立和完善内部信用评级体系，对发行人及债券进行内部评级，控制可能出现的信用风险。本基金的活期银行存款存放在托管行。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。本基金在银行间同业市场仅与达到本基金管理人既定信用政策标准的交易对手进行交易，并设定交易额度，以控制相应的信用风险。

本基金管理人还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 5%，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，不超过该证券的 10%。

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 2023 年 06 月 30 日 | 上年度末 2022 年 12 月 31 日 |
|--------|----------------------|-----------------------|
| A-1 | - | - |
| A-1 以下 | - | - |
| 未评级 | - | 10,127,333.70 |
| 合计 | - | 10,127,333.70 |

注：以上按短期信用评级的债券投资中不包含国债、政策性金融债及央行票据等。

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 2023 年 06 月 30 日 | 上年度末 2022 年 12 月 31 日 |
|--------|----------------------|-----------------------|
| AAA | 537,482,188.31 | 517,512,015.23 |
| AAA 以下 | - | - |
| 未评级 | 111,574,005.02 | 131,826,475.63 |
| 合计 | 649,056,193.33 | 649,338,490.86 |

注：以上按长期信用评级的债券投资中不包含国债、政策性金融债及央行票据等。

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

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末 2023 年 06 月 30 日 | 上年度末 2022 年 12 月 31 日 |
|--------|----------------------|-----------------------|
| AAA | - | - |
| AAA 以下 | 19,877,288.76 | 19,576,879.71 |
| 未评级 | - | - |
| 合计 | 19,877,288.76 | 19,576,879.71 |

注：以上同业存单评级使用发行人主体评级。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可在开放期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。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人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，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。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 5%，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%。本基金仅可投资信用评级在 AAA 级及以上的信用债券，均能以合理价格适时变现。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投资的公允价值。

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岗位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时间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 5%，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。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。开放期内，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个开放日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每个开放日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日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办法：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；在开展逆回购交易时，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。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

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。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金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 2023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 | | | | | | | |
| 银行存款 | 1,515,366.05 | - | - | - | - | - | 1,515,366.05 |
| 结算备付金 | 26,992,539.41 | - | - | - | - | - | 26,992,539.41 |
| 存出保证金 | 21,902,377 | - | - | - | - | - | 21,902,377 |
| 交易性金融资产 | - | 127,823,393.69 | 335,142,237.91 | 227,364,266.52 | - | - | 690,329,898.12 |
| 买入返售金融资产 | 120,012,662.10 | - | - | - | - | - | 120,012,662.10 |
| 资产总计 | 148,542,469.93 | 127,823,393.69 | 335,142,237.91 | 227,364,266.52 | - | - | 838,872,368.05 |
| 负债 | | | | | | | |
| 卖出回购金融资产款 | 77,971,501.05 | - | - | - | - | - | 77,971,501.05 |
| 应付清算款 | - | - | - | - | - | 42,748.42 | 42,748.42 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | 374,654.05 | 374,654.05 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 93,663.50 | 93,663.50 |
| 应交税费 | - | - | - | - | - | 74,033.91 | 74,033.91 |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 85,263.21 | 85,263.21 |
| 负债总计 | 77,971,501.05 | - | - | - | - | 670,363.09 | 78,641,864.14 |
| 利率敏感度缺口 | 70,570,968.88 | 127,823,393.69 | 335,142,237.91 | 227,364,266.52 | - | -670,363.09 | 760,230,503.91 |

| 上年度末 2022 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 | | | | | | | |
| 银行存款 | 83,678,309.95 | - | - | - | - | - | 83,678,309.95 |
| 结算备付金 | 5,938,480.20 | - | - | - | - | - | 5,938,480.20 |
| 存出保证金 | 5,895.28 | - | - | - | - | - | 5,895.28 |
| 交易性金融资产 | 8,161,676.71 | 276,513,332.57 | 366,048,967.30 | 449,653,768.01 | 118,363,491.71 | - | 1,218,741,236.30 |
| 资产总计 | 97,784,362.14 | 276,513,332.57 | 366,048,967.30 | 449,653,768.01 | 118,363,491.71 | - | 1,308,363,921.73 |
| 负债 | | | | | | | |
| 卖出回购金融资产款 | 523,010,243.30 | - | - | - | - | - | 523,010,243.30 |
| 应付清算款 | - | - | - | - | - | 83,083.84 | 83,083.84 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | 398,700.10 | 398,700.10 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 99,675.02 | 99,675.02 |
| 应交税费 | - | - | - | - | - | 46,878.68 | 46,878.68 |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 160,784.15 | 160,784.15 |
| 负债总计 | 523,010,243.30 | - | - | - | - | 789,121.79 | 523,799,365.09 |
| 利率敏感度缺口 | -425,225,881.16 | 276,513,332.57 | 366,048,967.30 | 449,653,768.01 | 118,363,491.71 | -789,121.79 | 784,564,556.64 |

注：上表统计了本基金交易的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| 假设 | 假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他市场变量均不发生变化。 | | |
|----|--|-----------------------------|-----------------------|
| 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 2023 年 06 月 30 日 | 上年度末 2022 年 12 月 31 日 |
| | 利率下降 25 个基点 | 1,748,778.21 | 4,851,694.60 |
| | 利率上升 25 个基点 | -1,737,387.77 | -4,776,361.16 |

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险为除市场利率和外汇汇率以外的市场因素发生变动时产生的价格波动风险。

本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的债券，所面临的最大市场价格风险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市场价格风险，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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2023 年 06 月 30 日 | | 上年度末 2022 年 12 月 31 日 | |
|---------------|----------------------|---------------|-----------------------|---------------|
| | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) |
| 交易性金融资产—股票投资 | - | - | - | - |
| 交易性金融资产—基金投资 | - | - | - | - |
| 交易性金融资产—债券投资 | 690,329,898.12 | 90.81 | 1,218,741,236.30 | 155.34 |
| 交易性金融资产—贵金属投资 | - | - | - | - |
| 衍生金融资产—权证投资 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 合计 | 690,329,898.12 | 90.81 | 1,218,741,236.30 | 155.34 |

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

本基金本报告期末主要投资于债券，因此除市场利率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响。

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的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

| 公允价值计量结果所属的层次 | 本期末 2023 年 06 月 30 日 | 上年度末 2022 年 12 月 31 日 |
|---------------|----------------------|-----------------------|
| 第一层次 | - | - |
| 第二层次 | 690,329,898.12 | 1,218,741,236.30 |
| 第三层次 | - | - |
| 合计 | 690,329,898.12 | 1,218,741,236.30 |

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券、基金等投资，若出现交易不活跃（包括重大事项停牌、境内股票涨跌停等导致的交易不活跃）和非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的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，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。本基金政策以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期末无有助于理解和分析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 | 690,329,898.12 | 82.29 |
| | 其中：债券 | 690,329,898.12 | 82.29 |
| | 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 | 120,012,662.10 | 14.31 |
| | 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 | 28,507,905.46 | 3.40 |
| 8 | 其他各项资产 | 21,902.37 | 0.00 |
| 9 | 合计 | 838,872,368.05 | 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

本基金投资范围不包括股票投资。

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金投资范围不包括股票投资。

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

本基金投资范围不包括股票投资。

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

本基金投资范围不包括股票投资。

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

本基金投资范围不包括股票投资。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金投资范围不包括股票投资。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种 | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|----------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 21,396,416.03 | 2.81 |
| | 其中：政策性金融债 | 21,396,416.03 | 2.81 |
| 4 | 企业债券 | 444,567,656.36 | 58.48 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | 204,488,536.97 | 26.90 |
| 7 | 可转债(可交换债) | - | - |

| | | | |
|----|------|----------------|-------|
| 8 | 同业存单 | 19,877,288.76 | 2.61 |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 690,329,898.12 | 90.81 |

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 | 155626 | 19 新际 03 | 300,000 | 31,226,038.36 | 4.11 |
| 2 | 101801232 | 18 中国航材 MTN001 | 300,000 | 31,087,231.23 | 4.09 |
| 3 | 175625 | 21 航集 01 | 305,000 | 31,051,030.55 | 4.08 |
| 4 | 175096 | 20 核电 Y2 | 300,000 | 30,916,609.31 | 4.07 |
| 5 | 102001568 | 20 汇金 MTN009A | 300,000 | 30,862,898.63 | 4.06 |

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金投资范围不包括贵金属投资。

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

本基金投资范围不包括股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到监管部门立案调查或报告编制日前一年内受

到公开谴责、处罚的情形说明

本基金投资前十名证券的发行主体未发生上述情况。

7.12.2 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

本基金投资范围不包括股票投资。

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 | 21,902.37 |
| 2 | 应收清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 21,902.37 |

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

本基金投资范围不包括股票投资。

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，本报告分项之和与合计项之间可能有尾差。

§ 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 |
| 5,357 | 135,655.68 | 350,172,787.00 | 48.1862% | 376,534,675.06 | 51.8138% |

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 | 305,196.55 | 0.0420% |

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

| 项目 | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|-----------------------------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究人员持有本开放式基金 | 10~50 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 0~10 |

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|----------------------------|----------------|
| 基金合同生效日（2020年07月01日）基金份额总额 | 724,083,568.38 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 724,083,568.38 |
| 本报告期基金总申购份额 | 2,623,893.68 |
| 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） | - |
| 本报告期末基金份额总额 | 726,707,462.06 |

注：报告期期间基金总申购份额含红利再投。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

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、基金托管人的专门基金托管部门均未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金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

本基金本报告期内所聘用的会计师事务所未发生变化。

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，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到稽查或处罚等情况。

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 | |
| 国新证券股份有限公司 | 2 | - | - | - | - | - |

注：1、租用证券公司交易单元的选择标准：

- (1) 资质雄厚，信誉良好，注册资本不少于 10 亿元人民币；
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (3) 经营行为规范，最近两年未因重大违规行为而受到中国证券监督管理委员会和中国人民银行处罚；
- (4) 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；
- (5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的需要，并能为基金提供全面的信息服务；
- (6) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时为基金提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场投资策略、个股分析报告及其他专门报告，并能根据基金投资的特定要求提供专门研究报告；
- (7) 收取的佣金率符合市场平均水平。

2、交易单元选择程序：我司根据以上标准对不同券商进行综合评价，然后根据评价选择券商，与其签订协议租用交易单元。

3、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

- (1) 本基金报告期内新增租用交易单元情况：无。
- (2) 本基金报告期内停止租用交易单元情况：无。

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 |
| 国新证券股份有限公司 | 500,189,313.69 | 100.00% | 26,660,584,000.00 | 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 | 国新国证基金管理有限公司关于旗下基金改聘会计师事务所的公告 | 中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2023-01-11 |
| 2 | 国新国证雄安建设发展三年定期开放债券型证券投资基金 2022 年第四季度报告 | 基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2023-01-19 |
| 3 | 国新国证基金管理有限公司旗下基金 2022 年 4 季度报告提示性公告 | 中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报 | 2023-01-19 |
| 4 | 国新国证基金管理有限公司关于暂停网上直销汇款交易的公告 | 中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2023-02-04 |
| 5 | 国新国证基金管理有限公司关于恢复网上直销汇款交易的公告 | 中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2023-02-07 |
| 6 | 国新国证基金管理有限公司关于变更直销汇款账户的公告 | 中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、基金管理 | 2023-02-07 |

| | | | |
|----|--|---|------------|
| | | 人网站、中国证监会基金电子披露网站 | |
| 7 | 国新国证基金管理有限公司关于变更公司官网、网上交易域名及公司服务邮箱的公告 | 中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2023-03-22 |
| 8 | 国新国证雄安建设发展三年定期开放债券型证券投资基金 2022 年年度报告 | 基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2023-03-31 |
| 9 | 国新国证雄安建设发展三年定期开放债券型证券投资基金 2023 年第一季度报告 | 基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2023-04-22 |
| 10 | 国新国证基金管理有限公司旗下基金 2023 年 1 季度报告提示性公告 | 中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报 | 2023-04-22 |
| 11 | 国新国证雄安建设发展三年定期开放债券型证券投资基金分红公告 | 中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2023-04-22 |
| 12 | 国新国证雄安建设发展三年定期开放债券型证券投资基金招募说明书（更新） | 基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2023-04-27 |
| 13 | 国新国证雄安建设发展三年定期开放债券型证券投资基金基金产品资料概要（更新） | 基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2023-04-27 |
| 14 | 国新国证雄安建设发展三年定期开放债券型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换业务的公告 | 中国证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2023-06-30 |

§ 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 | 2023.01.01~2023.06.30 | 300,001,916.67 | - | - | 300,001,916.67 | 41.28% |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| 本基金存在持有基金份额超过 20%的基金份额持有人，在持有人大额赎回时易构成本基金发生巨额赎回，存在流动性风险，且在特定市场条件下，若基金管理人及时变现基金资产，存在基 | | | | | | | |

金净值波动风险。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内未发生影响投资者决策的其他重要信息。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予基金注册的文件
- 2、《国新国证雄安建设发展三年定期开放债券型证券投资基金招募说明书》
- 3、《国新国证雄安建设发展三年定期开放债券型证券投资基金基金合同》
- 4、《国新国证雄安建设发展三年定期开放债券型证券投资基金托管协议》
- 5、本基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、本基金托管人业务资格批件、营业执照
- 7、报告期内本基金管理人在指定媒体上披露的各项公告

12.2 存放地点

上述备查文件存放在本基金管理人或基金托管人的办公场所。

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得上述文件的复印件或复印件。相关公开披露的法律文件，投资者还可在本基金管理人网站（www.crsfund.com.cn）查阅。

国新国证基金管理有限公司
二〇二三年八月三十一日