

国元元赢30天持有期债券型集合资产管理计划

2024年第2季度报告

2024年06月30日

基金管理人:国元证券股份有限公司

基金托管人:招商银行股份有限公司

报告送出日期:2024年07月19日

§1 重要提示

管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

托管人招商银行股份有限公司根据本集合计划合同规定，于2024年7月19日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用集合计划资产，但不保证集合计划一定盈利。

集合计划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集合计划的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2024年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

| | |
|------------|---|
| 基金简称 | 国元元赢30天持有期债券 |
| 基金主代码 | 970140 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2022年03月30日 |
| 报告期末基金份额总额 | 536,286,124.12份 |
| 投资目标 | 在追求资产安全性的基础上，力争获取长期稳定的投资收益。 |
| 投资策略 | <p>本集合计划债券资产的投资比例不低于集合计划资产的80%，本集合计划保持持有的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于集合计划资产净值的5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。</p> <p>本集合计划不参与新股申购或增发新股，也不直接买入股票等权益类资产，可转债仅投资可分离交易可转债的纯债部分。</p> <p>集合计划的投资策略包括资产配置策略、久期策略、收益率曲线策略、杠杆策略、利率债投资策略、信用债投资策略、资产支持证券投资策略、个券选择策略等，在有效管理风险的基础上，达成投资目标。</p> |

| | | |
|-----------------|--|-----------------|
| 业绩比较基准 | 中债-综合全价(1-3年)指数(CBA00223.CS)收益率*85%+一年期定期存款利率*15%。 | |
| 基金管理人 | 国元证券股份有限公司 | |
| 基金托管人 | 招商银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 国元元赢30天持有期债券A | 国元元赢30天持有期债券C |
| 下属分级基金的交易代码 | 970140 | 970141 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 343,579,624.54份 | 192,706,499.58份 |

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期(2024年04月01日 - 2024年06月30日) | |
|----------------|--------------------------------|----------------|
| | 国元元赢30天持有期债券A | 国元元赢30天持有期债券C |
| 1.本期已实现收益 | 2,545,139.41 | 1,294,290.73 |
| 2.本期利润 | 2,868,532.32 | 1,484,922.49 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0086 | 0.0079 |
| 4.期末基金资产净值 | 372,937,380.01 | 207,964,755.34 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.0854 | 1.0792 |

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

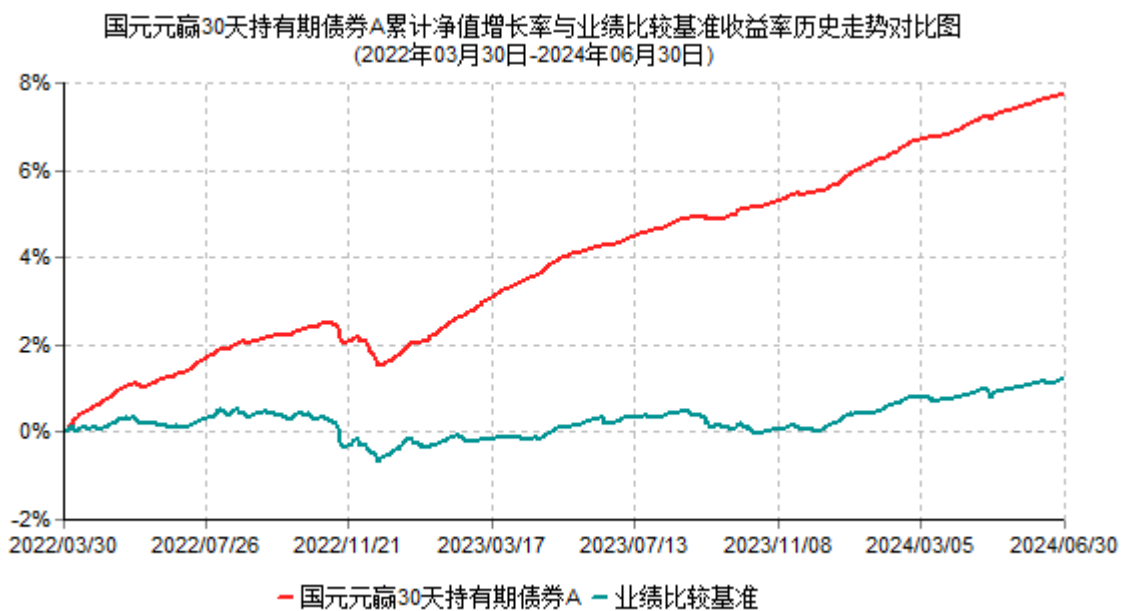
国元元赢30天持有期债券A净值表现

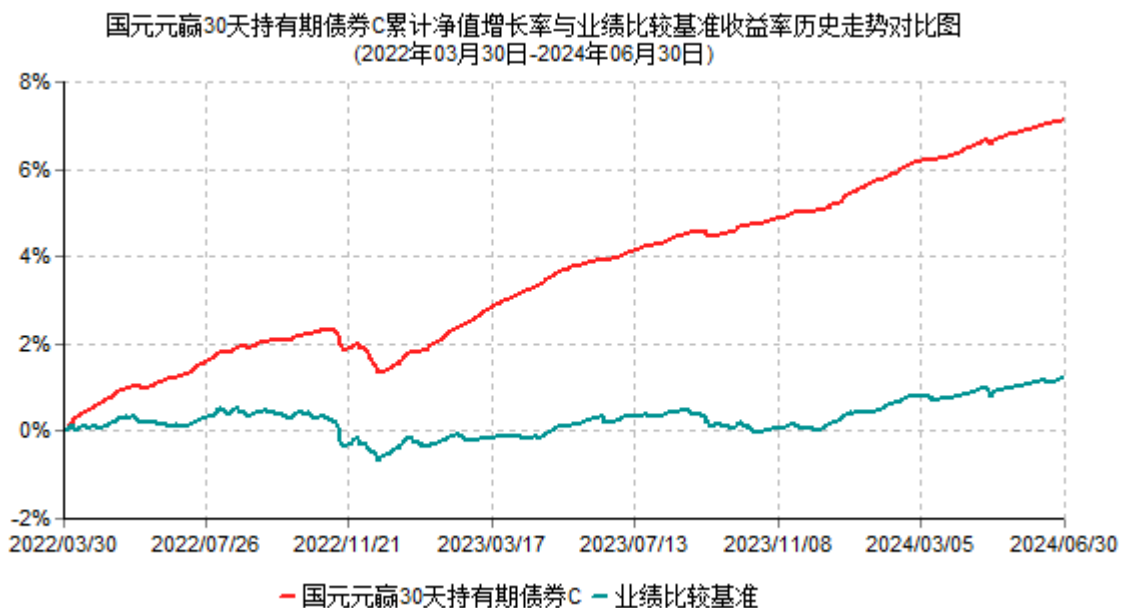
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|-------|--------|
| 过去三个月 | 0.79% | 0.01% | 0.42% | 0.02% | 0.37% | -0.01% |
| 过去六个月 | 1.75% | 0.01% | 0.79% | 0.02% | 0.96% | -0.01% |
| 过去一年 | 3.28% | 0.01% | 0.95% | 0.02% | 2.33% | -0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | 7.76% | 0.02% | 1.22% | 0.03% | 6.54% | -0.01% |

国元元赢30天持有期债券C净值表现

| 阶段 | 净值增长率① | 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 |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|-------|--------|
| 过去三个月 | 0.73% | 0.01% | 0.42% | 0.02% | 0.31% | -0.01% |
| 过去六个月 | 1.63% | 0.01% | 0.79% | 0.02% | 0.84% | -0.01% |
| 过去一年 | 3.04% | 0.01% | 0.95% | 0.02% | 2.09% | -0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | 7.15% | 0.02% | 1.22% | 0.03% | 5.93% | -0.01% |

3.2.2 自基金合同生效以来基金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





§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|-----|-----------|-------------|------|--------|--|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 李雅婷 | 大集合产品投资经理 | 2019-11-18 | - | 14 | 南开大学金融学硕士。曾任职于中国工商银行安徽省分行营业部，2012年8月加入国元证券资管总部，历任投资助理，现任国元元赢30天持有期债、国元元赢四个月定开债、国元元增利货币投资经理。 |
| 柯贤发 | 大集合产品投资经理 | 2021-02-03 | - | 13 | 金融学硕士，先后任职于南方基金管理有限公司、平安基金管理有限公司，2017年加入国元证券客户资产管理总部，历任项目经理、投资经理助理，现任国元元赢30天持有期债、国元元增利货币、国元元赢六个月定开 |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|--------|
| | | | | | 债投资经理。 |
|--|--|--|--|--|--------|

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

管理人声明：本报告期内，本管理人严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券公司大集合资产管理业务适用关于规范金融机构资产管理业务的指导意见操作指引》等有关法律法规及集合计划合同、招募说明书等有关基金法律文件的规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用集合计划资产，在控制风险的基础上，为集合计划份额持有人谋求最大利益，无损害集合计划份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本管理人一贯公平对待旗下管理的所有组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《国元证券客户资产管理业务公平交易管理暂行办法》的规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本集合计划于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内管理人管理的所有大集合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%的交易次数为0次。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

债市回顾：1季度GDP同比增长5.3%，略超预期。2季度经济延续复苏但幅度减弱。1-5月投资增速同比增长4%，5月环比下降0.04%。1-5月地产同比下降10.1%。1-5月消费同比增长4.1%，5月消费同比增长3.7%。1-5月规上工业增加值同比增长6.2%，5月同比实际增长5.6%。综上，5月投资、消费、工业增加值均低于预期，且较1-4月有所下行。出口方面，以美元计价，5月出口同比增长7.6%，高于预期，进口同比增1.8%，低于预期，外需强于内需格局维持。

2季度，央行整体缩量平价续作MLF，LPR和OMO利率均按兵不动，OMO维持小量净投放，资金面整体平稳，DR007季度均值1.8747%，与1季度基本持平但高于OMO 7天逆回购利率，符合央行既防空转又促发展的目的。4月底受监管机构喊话影响，长债出现了一波调整，但“资产荒”情况未缓解，收益率继续下行，久期行情继续演绎。2季度，1年国有行存单大幅下行27.2BP至1.9597%，10年国债收益率下行8.43BP至2.2058%，30年国债收益率下行3.12BP至2.4282%。

组合操作：2季度我们继续严格遵照产品合同的相关约定，优化资产配置结构，提高组合收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末国元元赢30天持有期债券A基金份额净值为1.0854元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.79%，同期业绩比较基准收益率为0.42%；截至报告期末国元元赢30天持有期债券C基金份额净值为1.0792元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.73%，同期业绩比较基准收益率为0.42%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本集合计划本报告期内未出现连续20个工作日集合计划份额持有人数低于200、资产净值低于5000万元的情形。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 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 | 588,637,469.21 | 99.01 |
| | 其中：债券 | 588,637,469.21 | 99.01 |
| | 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 | 2,650,678.06 | 0.45 |
| 8 | 其他资产 | 3,211,734.45 | 0.54 |
| 9 | 合计 | 594,499,881.72 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本集合计划本报告期末未持有股票资产。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本集合计划本报告期末未持有股票资产。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本集合计划本报告期末未持有股票资产。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|----------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 30,548,327.87 | 5.26 |
| | 其中：政策性金融债 | 30,548,327.87 | 5.26 |
| 4 | 企业债券 | 279,774,373.16 | 48.16 |
| 5 | 企业短期融资券 | 91,572,513.16 | 15.76 |
| 6 | 中期票据 | 167,090,809.54 | 28.76 |
| 7 | 可转债（可交换债） | - | - |
| 8 | 同业存单 | 19,651,445.48 | 3.38 |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 588,637,469.21 | 101.33 |

5.5 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债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|--------------|---------|---------------|--------------|
| 1 | 102282137 | 22雅安发展MTN001 | 300,000 | 31,829,852.46 | 5.48 |
| 2 | 149653 | 21仁寿03 | 300,000 | 31,443,287.67 | 5.41 |
| 3 | 102100557 | 21宝城投MTN001 | 300,000 | 31,186,524.59 | 5.37 |
| 4 | 138618 | 22国联G3 | 300,000 | 30,998,416.44 | 5.34 |
| 5 | 230421 | 23农发21 | 300,000 | 30,548,327.87 | 5.26 |

5.6 报告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明细

本集合计划本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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

本集合计划本报告期末未持有贵金属。

5.8 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权证投资明细

本集合计划本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本集合计划不参与股指期货投资。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本集合计划不参与国债期货投资。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 根据管理人现有舆情系统监控，未发现本集合计划投资的前十名证券的发行主体中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。

5.11.2 本集合计划本报告期末未持有股票资产。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|----|---------|--------------|
| 1 | 存出保证金 | 7,227.35 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 3,204,507.10 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 3,211,734.45 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本集合计划不参与可转换债券投资。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本集合计划本报告期末未持有股票资产。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

| | 国元元赢30天持有期债券A | 国元元赢30天持有期债券C |
|-------------|----------------|----------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 349,493,568.85 | 196,442,545.40 |

| | | |
|-------------------------------|----------------|----------------|
| 报告期期间基金总申购份额 | 113,838,301.06 | 115,085,751.85 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 119,752,245.37 | 118,821,797.67 |
| 报告期期间基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列) | - | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 343,579,624.54 | 192,706,499.58 |

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

本集合计划本报告期无集合计划管理人运用固有资金投资本集合计划的情况。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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
无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会同意合同变更的文件；
- 2、国元元赢30天持有期债券型集合资产管理计划资产管理合同；
- 3、国元元赢30天持有期债券型集合资产管理计划托管协议；
- 4、国元元赢30天持有期债券型集合资产管理计划招募说明书；
- 5、管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、报告期内披露的各项公告。

9.2 存放地点

安徽省合肥市梅山路18号安徽国际金融中心A座

9.3 查阅方式

上述文件可在国元证券网站上查阅，或者在营业时间内到国元证券查阅。
投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人国元证券股份有限公司。

客户服务中心电话：95578

网址：www.gyzq.com.cn

国元证券股份有限公司

2024年07月19日