

# 金信民达纯债债券型发起式证券投资基金

## 2024 年中期报告

2024 年 06 月 30 日

基金管理人:金信基金管理有限公司

基金托管人:中国工商银行股份有限公司

报告送出日期:2024 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2024年08月30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01月01日起至2024年06月30日止。

## 1.2 目录

|   |           |
|---|-----------|
| <b>§ 1 重要提示及目录</b>                      | <b>1</b>  |
| 1.1 重要提示                                | 1         |
| 1.2 目录                                  | 2         |
| <b>§ 2 基金简介</b>                         | <b>4</b>  |
| 2.1 基金基本情况                              | 4         |
| 2.2 基金产品说明                              | 4         |
| 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         |
| <b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>                | <b>6</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 6         |
| 3.2 基金净值表现                              | 7         |
| <b>§ 4 管理人报告</b>                        | <b>8</b>  |
| 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              | 9         |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 10        |
| 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             | 10        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 11        |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 11        |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 11        |
| 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       | 12        |
| <b>§ 5 托管人报告</b>                        | <b>12</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 12        |
| 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 | 12        |
| 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       | 12        |
| <b>§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)</b>              | <b>12</b> |
| 6.1 资产负债表                               | 12        |
| 6.2 利润表                                 | 14        |
| 6.3 净资产变动表                              | 15        |
| 6.4 报表附注                                | 16        |
| <b>§ 7 投资组合报告</b>                       | <b>40</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况                          | 40        |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合                    | 40        |
| 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       | 41        |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动                     | 41        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 41        |
| 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      | 41        |
| 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   | 42        |
| 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   | 42        |
| 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      | 42        |
| 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明               | 42        |
| 7.11 投资组合报告附注                           | 42        |
| <b>§ 8 基金份额持有人信息</b>                    | <b>44</b> |

|  |           |
|--|-----------|
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....              | 44        |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....           | 44        |
| 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 .....   | 45        |
| 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况 .....                | 45        |
| <b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>               | <b>45</b> |
| <b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>                 | <b>45</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 .....                   | 45        |
| 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 .....   | 45        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....        | 45        |
| 10.4 基金投资策略的改变 .....                     | 46        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....              | 46        |
| 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 .....      | 46        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....             | 46        |
| 10.8 其他重大事件 .....                        | 47        |
| <b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>         | <b>48</b> |
| 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 ..... | 48        |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....                | 49        |
| <b>§ 12 备查文件目录 .....</b>                 | <b>49</b> |
| 12.1 备查文件目录 .....                        | 49        |
| 12.2 存放地点 .....                          | 49        |
| 12.3 查阅方式 .....                          | 49        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                     |                    |                 |
|---------------------|--------------------|-----------------|
| 基金名称                | 金信民达纯债债券型发起式证券投资基金 |                 |
| 基金简称                | 金信民达纯债             |                 |
| 基金主代码               | 008571             |                 |
| 基金运作方式              | 契约型开放式             |                 |
| 基金合同生效日             | 2020 年 06 月 11 日   |                 |
| 基金管理人               | 金信基金管理有限公司         |                 |
| 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          | 169,590,037.80 份   |                 |
| 基金合同存续期             | 不定期                |                 |
| 下属分级基金的基金简称         | 金信民达纯债 A           | 金信民达纯债 C        |
| 下属分级基金的交易代码         | 008571             | 008572          |
| 报告期末下属分级基金的份<br>额总额 | 132,231,032.23 份   | 37,359,005.57 份 |

### 2.2 基金产品说明

|      |   |
|------|---|
| 投资目标 | 本基金通过债券主动投资管理，在严格控制组合风险并保持良好流动性的前提下，力争为基金持有人获取长期持续稳定的投资回报。  |
| 投资策略 | <p>1、资产配置策略</p> <p>本基金通过对宏观经济指标、货币政策与财政政策、商业银行信贷扩张、国际资本流动和其他影响短期资金供求状况等因素的分析，预判对未来利率市场变化情况。根据对未来利率市场变化的预判情况，分析不同类别资产的收益率水平、流动性特征和风险水平特征，确定资产在非信用类固定收益类证券（国家债券、中央银行票据等）和信用类固定收益类证券之间的配置比例。</p> <p>2、债券投资策略</p> <p>债券投资组合策略：本基金在综合分析宏观经济、货币政策的基础上，采用久期管理和信用风险管理相结合的投资策略。在债券组合的具体构造和调整上，本基金综合运用久期调整、收益率曲线形变预测、信用利差和信用风险管理、回购套利等组合管理手段进行日常管理。</p> <p>个券选择策略：在个券选择上，本基金综合运用利率预期、收益率曲线估值、信用风险分析、隐含期权价值评估、流动性分析等方法来评估个券的投资价值。</p> <p>转换债券投资策略：可转换债券兼具权益类证券与固定收益类证券的特性，具有抵御下行风险、分享股票价格上涨收益的特点。本基金将选择公司基本素质优良、其对</p> |

|        |  |
|--------|--|
|        | <p>应的基础证券有着较高上涨潜力的可转换债券进行投资，并采用期权定价模型等数量化估值工具评定其投资价值，以合理价格买入并持有。</p> <p>3、资产支持证券等品种投资策略</p> <p>本基金投资资产支持证券将采取自上而下和自下而上相结合的投资策略。自上而下投资策略指本公司在平均久期配置策略与期限结构配置策略基础上，运用数量化或定性分析方法对资产支持证券的利率风险、提前偿付风险、流动性风险溢价、税收溢价等因素进行分析，对收益率走势及其收益和风险进行判断。自下而上投资策略指本公司运用数量化或定性分析方法对资产池信用风险进行分析和度量，选择风险与收益相匹配的更优品种进行配置。</p> <p>4、国债期货投资策略</p> <p>国债期货作为利率衍生品的一种，有助于管理债券组合的久期、流动性和风险水平。基金管理人将按照相关法律法规的规定，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析。构建量化分析体系，对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，在最大限度保证基金资产安全的基础上，力求实现基金资产的长期稳定增值。</p> |
| 业绩比较基准 | 中债综合财富(总值)指数收益率*80%+银行 1 年期定期存款利率(税 后)*20%   |
| 风险收益特征 | 本基金是债券型证券投资基金，其预期收益和风险水平高于货币市场基金，低于股票型和混合型基金，属于较低风险、较低收益的基金产品。   |

### 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      |      | 金信基金管理有限公司   | 中国工商银行股份有限公司        |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 王几高  | 郭明                  |
|         | 联系电话 | 0755-82510502  | 010-66105799        |
|         | 电子邮箱 | jubao@jxfunds.com.cn   | custody@icbc.com.cn |
| 客户服务电话  |      | 400-900-8336   | 95588               |
| 传真      |      | 0755-82510305  | 010-66105798        |
| 注册地址    |      | 深圳市前海深港合作区兴海大道 3040 号前海世茂大厦 2603                                       | 北京市西城区复兴门内大街 55 号   |
| 办公地址    |      | 深圳市前海深港合作区兴海大道 3040 号前海世茂大厦 2603<br>深圳市福田区益田路 6001 号<br>太平 金融大厦 1502 室 | 北京市西城区复兴门内大街 55 号   |
| 邮政编码    |      | 518038   | 100140              |
| 法定代表人   |      | 殷克胜  | 廖林                  |

## 2.4 信息披露方式

|                     |   |
|---------------------|---|
| 本基金选定的信息披露报纸名称      | 证券时报  |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | http://www.jxfunds.com.cn   |
| 基金中期报告备置地点          | 深圳市福田区益田路 6001 号太平金融大厦 1502 室<br>深圳市前海深港合作区兴海大道 3040 号前海世茂大厦 2603 |

## 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称                  | 办公地址  |
|--------|---------------------|---|
| 注册登记机构 | 金信基金管理有限公司          | 深圳市福田区益田路 6001 号太平金融大厦 1502 室<br>深圳市前海深港合作区兴海大道 3040 号前海世茂大厦 2603 |
| 会计师事务所 | 毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙） | 中国北京东长安街 1 号东方广场毕马威大厦 8 层   |

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期（2024 年 01 月 01 日-2024 年 06 月 30 日） |               |
|---------------|--|---------------|
|               | 金信民达纯债 A                               | 金信民达纯债 C      |
| 本期已实现收益       | 1,470,919.97                           | 734,465.01    |
| 本期利润          | 712,914.70                             | 630,186.75    |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0054                                 | 0.0097        |
| 本期加权平均净值利润率   | 0.51%                                  | 0.83%         |
| 本期基金份额净值增长率   | 0.49%                                  | 0.41%         |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末（2024 年 06 月 30 日）                 |               |
| 期末可供分配利润      | 3,078,852.97                           | 6,319,774.10  |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.0233                                 | 0.1692        |
| 期末基金资产净值      | 136,214,697.52                         | 43,891,022.89 |
| 期末基金份额净值      | 1.0301                                 | 1.1748        |
| 3.1.3 累计期末指标  | 报告期末（2024 年 06 月 30 日）                 |               |
| 基金份额累计净值增长率   | 18.41%                                 | 17.48%        |

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）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

2、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数；

3、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。

## 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

#### 金信民达纯债 A 净值表现

| 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      | -0.99%   | 0.31%       | 0.72%      | 0.02%         | -1.71% | 0.29% |
| 过去三个月      | -0.01%   | 0.21%       | 1.47%      | 0.05%         | -1.48% | 0.16% |
| 过去六个月      | 0.49%    | 0.16%       | 3.15%      | 0.05%         | -2.66% | 0.11% |
| 过去一年       | 1.09%    | 0.13%       | 5.03%      | 0.04%         | -3.94% | 0.09% |
| 过去三年       | 12.18%   | 0.12%       | 13.29%     | 0.04%         | -1.11% | 0.08% |
| 自基金合同生效起至今 | 18.41%   | 0.13%       | 16.26%     | 0.04%         | 2.15%  | 0.09% |

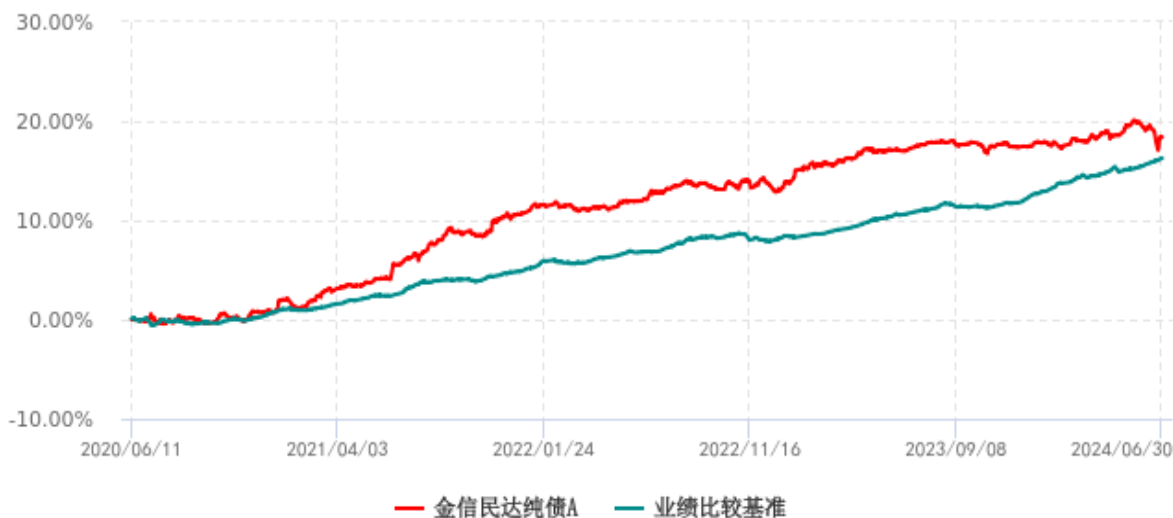
#### 金信民达纯债 C 净值表现

| 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      | -1.00%   | 0.31%       | 0.72%      | 0.02%         | -1.72% | 0.29% |
| 过去三个月      | -0.05%   | 0.21%       | 1.47%      | 0.05%         | -1.52% | 0.16% |
| 过去六个月      | 0.41%    | 0.16%       | 3.15%      | 0.05%         | -2.74% | 0.11% |
| 过去一年       | 0.90%    | 0.12%       | 5.03%      | 0.04%         | -4.13% | 0.08% |
| 过去三年       | 11.52%   | 0.12%       | 13.29%     | 0.04%         | -1.77% | 0.08% |
| 自基金合同生效起至今 | 17.48%   | 0.13%       | 16.26%     | 0.04%         | 1.22%  | 0.09% |

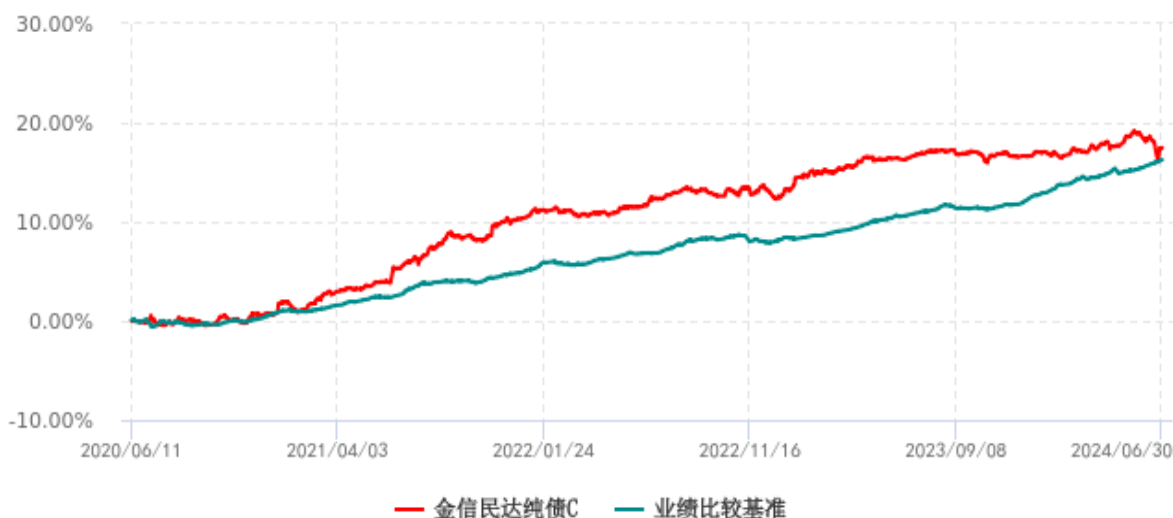
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



金信民达纯债A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2020年06月11日-2024年06月30日)



金信民达纯债C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2020年06月11日-2024年06月30日)



## § 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

金信基金管理有限公司成立于 2015 年 7 月，注册资本 1 亿元人民币，注册地位于深圳前海，是经中国证监会批准设立的公募基金管理公司，业务范围包括基金募集、基金销售、基金管理、特定客户资产管理以及中国证监会许可的其他业务。

金信基金管理有限公司作为国内首家管理团队出任第一大股东的公募基金公司，管理团队持股 35%，是公司第一大股东。此外，公司股东还包括深圳市卓越创业投资有限责任公司及安徽国元信托有限责任公司，两家机构出资比例分别为：34%、31%。

截至报告期末，金信基金管理有限公司旗下管理 20 只开放式证券投资基金和 1 只资产管理计划。

#### 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 |        |  |
| 杨杰  | 本基金的基金经理 | 2020-06-11      | -    | 15 年   | 华中科技大学金融学硕士。2009 年开始先后曾任金元证券股票研究员、固定收益研究员，金信基金固定收益研究员、基金经理助理、专户投资经理。现任金信基金基金经理。    |
| 刘雨卉 | 本基金的基金经理 | 2021-05-11      | -    | 8 年    | 南京大学数学学士，复旦大学金融学硕士。2015 年曾任富安达基金管理有限公司固定收益研究员、基金经理助理，2019 年 11 月加入金信基金，现任金信基金基金经理。 |

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”为根据公司决定的解聘日期，除首任基金经理外，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定的聘任日期和解聘日期；

2、证券从业的含义遵从行业协会的相关规定。

#### 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

本报告期内本基金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》和《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则的规定以及《金信民达纯债债券型发起式证券投资基金基金合同》等基金法律文件的约定，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，为基金持有人谋求最大利益。

本报告期内，基金运作整体合法合规，没有发生损害基金持有人利益的情形。基金的投资范围、投资比例符合有关法律法规及基金合同的规定。

### 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

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。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没有超过该证券当日成交量的 5% 的情况。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2024 年上半年，我国宏观经济保持平稳增长。经济面临有效需求仍然不足，企业经营压力较大。总体来看，我国上半年经济运行中生产强于需求，外需强于内需。官方制造业 PMI 除 3、4 月外，较长时间处于荣枯线下方运行。生产方面，工业增加值同比增速整体强于去年同期水平，但二季度存在逐月下滑。出口总体偏好，对经济产生正向拉动作用。需求总体偏弱，社会消费品零售总额同比增速逐月下降，2024 年 6 月低至 2%。居民消费受收入预期一般、资产下跌带来的负财富效应等负面影响。投资增速处于低位且缓步向下，主要是地产投资的拖累加大，房地产发展新模式的构建仍在推进过程中。价格方面，得益于肉类等价格上涨，CPI 回正。PPI 降幅上半年逐步收窄。

政策方面，房地产支持政策持续释放，消化存量和优化增量相结合，收购存量商品房用于保障房。货币政策总体积极，资金面总体宽松。1 月份央行降准 50BP，2 月份 5 年期 LPR 超预期调降 25BP。为维持正向收益率曲线，央行对长端债券收益率风险持续提示。央行货币政策框架优化，突出 OMO 的作用并收窄利率走廊宽度。7 月份央行超预期降低 OMO 利率 10BP，降低 MLF20BP。为稳定净息差，银行部门持续调降存款利率水平。

债券市场上半年整体上行。货币政策宽松，资金利率稳定。银行存款利率下降导致存款搬家，债市演绎资产荒逻辑。融资需求偏弱，债券资产供给有限。久期策略相对占优。

海外方面，美国围绕经济、通胀和就业前景，博弈降息预期。

转债方面。年初权益延续去年弱势表现，雪球敲入、量化风险陆续显露。2 月 5 日后股市支持政策出台、汇金增持范围扩大，风险偏好回升带动超跌反弹。春节后海外 AI 产业映射表现良好。国九条出台后市场风险偏好下降，年报期冲击过后叠加地产政策优化，市场有所好转。6 月份在退市、违约、评级下调、交易所问询等压力下，转债市场显著下行。上半年中证转债指数微幅下跌，其中转债大盘风格表现明显强于小盘风格。

本基金在报告期内逐步提高组合的杠杆水平。纯债除中短期限的高等级信用债外，增加了部分利率债和商金债，适当拉长久期，同时控制流动性风险和信用风险。可转债仓位较为灵活，适时进行了增减。受小盘风格表现较弱、转债债底支撑弱化等因素影响，基金净值波动有所增大。我们积极调整组合，坚持绝对收益投资的思路，力争在较低波动的前提下获得相对稳定的回报。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末金信民达纯债 A 基金份额净值为 1.0301 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 0.49%，同期业绩比较基准收益率为 3.15%；截至报告期末金信民达纯债 C 基金份额净值为 1.1748 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 0.41%，同期业绩比较基准收益率为 3.15%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，7 月份政治局会议提出宏观政策要持续用力、更加给力，预计宏观经济有望保持相对平稳运行。房地产政策存在继续放松空间，地产融资平台债务风险继续化解。货币政策有望保持支持性、偏宽松的方向。债券市场流动性合理充裕。目前纯债收益率处于偏低位置，未来如有所回调则可把握相应机会。转债经过前期调整后，估值处于历史相对低位，中长期盈利的确定性较高，但短期受权益波动影响较为明显。

未来我们采取稳健平衡的投资策略。转债在控制退市风险和信用风险的基础上，以绝对收益为导向，把握结构性机会，注重安全边际，做好基金净值回撤管理。纯债部分采取更加积极的投资策略，以中高等级信用债为主，配合利率债和商金债，灵活调节组合杠杆和久期。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人由总经理、督察长、运作保障部、基金投资部、监察稽核部、交易部负责人及其他相关人员，负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。该等人员均具备专业胜任能力和相关从业资格，精通各领域的理论知识，熟悉相关政策法规，并具有丰富的实践经验。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本基金本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金合同约定，在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每份基金份额每次基金收益分配比例不得低于基金收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 10%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基

金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。每一基金份额享有同等分配权；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

根据上述分配原则以及基金的实际运作情况，于 2024 年 6 月 20 日实施 2024 年第 1 次收益分配，每 10 份基金 A 份额派发红利 0.4320 元，每 10 份基金 C 份额派发红利 0.0000 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，本基金未出现持有人数或基金资产净值预警的情形。

### § 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，金信民达纯债债券型发起式证券投资基金的管理人——金信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、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，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

本托管人依法对金信基金管理有限公司编制和披露的本基金 2024 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：金信民达纯债债券型发起式证券投资基金

报告截止日：2024 年 06 月 30 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2024 年 06 月 30 日 | 上年度末 2023 年 12 月 31 日 |
|----|-----|----------------------|-----------------------|
|----|-----|----------------------|-----------------------|

|               |            |                             | 日                            |
|---------------|------------|-----------------------------|------------------------------|
| <b>资产：</b>    |            |                             |                              |
| 货币资金          | 6.4.7.1    | 1,386,541.38                | 1,692,517.13                 |
| 结算备付金         |            | 3,857,392.74                | 479,116.15                   |
| 存出保证金         |            | 16,896.26                   | 13,778.33                    |
| 交易性金融资产       | 6.4.7.2    | 212,689,747.71              | 210,409,644.21               |
| 其中：股票投资       |            | -                           | -                            |
| 基金投资          |            | -                           | -                            |
| 债券投资          |            | 212,689,747.71              | 210,409,644.21               |
| 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    | 5,350,000.00                | 42,227,684.56                |
| 应收清算款         |            | 2,403,829.54                | 49,543.38                    |
| 应收股利          |            | -                           | -                            |
| 应收申购款         |            | 12,214.17                   | 8,960.21                     |
| 递延所得税资产       |            | -                           | -                            |
| 其他资产          | 6.4.7.8    | -                           | -                            |
| 资产总计          |            | 225,716,621.80              | 254,881,243.97               |
| <b>负债和净资产</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末 2024 年 06 月 30 日</b> | <b>上年度末 2023 年 12 月 31 日</b> |
| <b>负债：</b>    |            |                             |                              |
| 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     |            | 43,000,000.00               | -                            |
| 应付清算款         |            | 2,417,248.32                | 1,301,763.73                 |
| 应付赎回款         |            | 37,098.02                   | 293,127.94                   |
| 应付管理人报酬       |            | 45,296.58                   | 54,130.81                    |
| 应付托管费         |            | 12,079.08                   | 14,434.89                    |
| 应付销售服务费       |            | 7,356.34                    | 14,181.15                    |
| 应付投资顾问费       |            | -                           | -                            |
| 应交税费          |            | 7,360.79                    | 10,437.58                    |
| 应付利润          |            | -                           | -                            |
| 递延所得税负债       |            | -                           | -                            |
| 其他负债          | 6.4.7.9    | 84,462.26                   | 120,578.28                   |
| 负债合计          |            | 45,610,901.39               | 1,808,654.38                 |
| <b>净资产：</b>   |            |                             |                              |
| 实收基金          | 6.4.7.10   | 169,590,037.80              | 227,864,824.61               |
| 未分配利润         | 6.4.7.12   | 10,515,682.61               | 25,207,764.98                |

|          |  |                |                |
|----------|--|----------------|----------------|
| 净资产合计    |  | 180,105,720.41 | 253,072,589.59 |
| 负债和净资产总计 |  | 225,716,621.80 | 254,881,243.97 |

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额总额 169,590,037.80 份。其中金信民达纯债 A 基金份额净值 1.0301 元，基金份额总额 132,231,032.23 份；金信民达纯债 C 基金份额净值 1.1748 元，基金份额总额 37,359,005.57 份。

## 6.2 利润表

会计主体：金信民达纯债债券型发起式证券投资基金

本报告期：2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                     | 附注号        | 本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日 | 上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日 |
|------------------------|------------|---------------------------------------|--|
| <b>一、营业总收入</b>         |            | 2,201,670.60                          | 2,311,686.42                               |
| 1. 利息收入                |            | 63,505.49                             | 66,404.59                                  |
| 其中：存款利息收入              | 6.4.7.13   | 22,304.13                             | 6,906.19                                   |
| 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             |            | 41,201.36                             | 59,498.40                                  |
| 其他利息收入                 |            | -                                     | -  |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）      |            | 2,981,179.54                          | 1,740,003.07                               |
| 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   | 2,981,179.54                          | 1,740,003.07                               |
| 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   | -                                     | -  |
| 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   | -862,283.53                           | 488,342.02                                 |
| 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   | 19,269.10                             | 16,936.74                                  |
| <b>减：二、营业总支出</b>       |            | 858,569.15                            | 283,114.80                                 |
| 1. 管理人报酬               | 6.4.10.2.1 | 323,596.90                            | 109,983.93                                 |
| 2. 托管费                 | 6.4.10.2.2 | 86,292.55                             | 29,329.04                                  |
| 3. 销售服务费               | 6.4.10.2.3 | 76,035.98                             | 42,207.95                                  |
| 4. 投资顾问费               |            | -                                     | -  |

|                            |          |                     |                     |
|----------------------------|----------|---------------------|---------------------|
| 5. 利息支出                    |          | 260,689.21          | 38,419.75           |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |          | 260,689.21          | 38,419.75           |
| 6. 信用减值损失                  | 6.4.7.22 | -                   | -                   |
| 7. 税金及附加                   |          | 6,861.42            | 2,176.95            |
| 8. 其他费用                    | 6.4.7.23 | 105,093.09          | 60,997.18           |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |          | <b>1,343,101.45</b> | <b>2,028,571.62</b> |
| 减：所得税费用                    |          | -                   | -                   |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |          | <b>1,343,101.45</b> | <b>2,028,571.62</b> |
| <b>五、其他综合收益的税后净额</b>       |          | <b>-</b>            | <b>-</b>            |
| <b>六、综合收益总额</b>            |          | <b>1,343,101.45</b> | <b>2,028,571.62</b> |

### 6.3 净资产变动表

会计主体：金信民达纯债债券型发起式证券投资基金

本报告期：2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                                       | 本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日      |                |                |
|--|--|----------------|----------------|
|  | 实收基金                                       | 未分配利润          | 净资产合计          |
| 一、上期期末净资产                                | 227,864,824.61                             | 25,207,764.98  | 253,072,589.59 |
| 二、本期期初净资产                                | 227,864,824.61                             | 25,207,764.98  | 253,072,589.59 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                     | -58,274,786.81                             | -14,692,082.37 | -72,966,869.18 |
| （一）、综合收益总额                               | -  | 1,343,101.45   | 1,343,101.45   |
| （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）      | -58,274,786.81                             | -10,403,681.08 | -68,678,467.89 |
| 其中：1. 基金申购款                              | 7,328,861.09                               | 784,057.87     | 8,112,918.96   |
| 2. 基金赎回款                                 | -65,603,647.90                             | -11,187,738.95 | -76,791,386.85 |
| （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） | -  | -5,631,502.74  | -5,631,502.74  |
| 四、本期期末净资产                                | 169,590,037.80                             | 10,515,682.61  | 180,105,720.41 |
| 项目                                       | 上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日 |                |                |
|  | 实收基金                                       | 未分配利润          | 净资产合计          |
| 一、上期期末净资产                                | 63,636,492.02                              | 8,134,580.87   | 71,771,072.89  |
| 二、本期期初净资产                                | 63,636,492.02                              | 8,134,580.87   | 71,771,072.89  |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                     | 134,463,535.22                             | 20,031,159.08  | 154,494,694.30 |
| （一）、综合收益总额                               | -  | 2,028,571.62   | 2,028,571.62   |
| （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）      | 134,463,535.22                             | 22,995,769.85  | 157,459,305.07 |



|  |                |               |                |
|--|----------------|---------------|----------------|
| “-”号填列)                                  |                |               |                |
| 其中：1. 基金申购款                              | 184,751,332.24 | 30,579,722.83 | 215,331,055.07 |
| 2. 基金赎回款                                 | -50,287,797.02 | -7,583,952.98 | -57,871,750.00 |
| (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） | -              | -4,993,182.39 | -4,993,182.39  |
| 四、本期期末净资产                                | 198,100,027.24 | 28,165,739.95 | 226,265,767.19 |

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：

|          |           |         |
|----------|-----------|---------|
| 殷克胜      | 朱斌        | 陈瑾      |
| 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

金信民达纯债债券型发起式证券投资基金(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[2019]1784号《关于准予金信民达纯债债券型发起式证券投资基金注册的批复》核准,由金信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《金信民达纯债债券型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,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10,095,573.30元,已经毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)毕马威华振验字第2000475号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《金信民达纯债债券型发起式证券投资基金基金合同》于2020年6月11日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为10,096,212.26份基金份额,其中认购资金利息折合638.96份基金份额。本基金的基金管理人为金信基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《金信民达纯债债券型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定,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、金融债、央行票据、地方政府债、中期票据、企业债、公司债、次级债、短期融资券、超级短期融资券、可转换债券(含可分离交易的可转换债券)、可交换债券、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、国债期货等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的相关规定)。基金债券的投资比例不低于基金资产的80%;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,本基金持有现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为:中债综合财富(总值)指数收益率\*80%+银行1年期定期存款利率(税后)\*20%。

本财务报表由本基金的基金管理人金信基金管理有限公司于2024年8月30日批准报出。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》以及中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》及附注 6.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2024 年 06 月 30 日的财务状况，2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日的经营成果和基金净值变动情况。

#### 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。

#### 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

本基金本报告期无会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财税[2002] 128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004] 78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012] 85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015] 101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008] 1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税 [2016] 36 号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016] 46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016] 70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税 [2016] 140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]

2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017] 56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017] 90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023] 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(a) 资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

(b) 对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(c) 对基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。

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

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

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

| 项目             | 本期末 2024 年 06 月 30 日 |
|----------------|----------------------|
| 活期存款           | 1,386,541.38         |
| 等于：本金          | 1,386,404.48         |
| 加：应计利息         | 136.90               |
| 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     | 1,386,541.38 |

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末 2024 年 06 月 30 日 |                |                |                |               |
|---------------|----------------------|----------------|----------------|----------------|---------------|
|               | 成本                   | 应计利息           | 公允价值           | 公允价值变动         |               |
| 股票            | -                    | -              | -              | -              |               |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | -                    | -              | -              | -              |               |
| 债券            | 交易所市场                | 170,854,755.51 | 1,720,475.62   | 170,669,565.55 | -1,905,665.58 |
|               | 银行间市场                | 41,437,374.83  | 311,182.16     | 42,020,182.16  | 271,625.17    |
|               | 合计                   | 212,292,130.34 | 2,031,657.78   | 212,689,747.71 | -1,634,040.41 |
| 资产支持证券        | -                    | -              | -              | -              |               |
| 基金            | -                    | -              | -              | -              |               |
| 其他            | -                    | -              | -              | -              |               |
| 合计            | 212,292,130.34       | 2,031,657.78   | 212,689,747.71 | -1,634,040.41  |               |

#### 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。

##### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

本基金本报告期末未持有期货合约。

##### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

#### 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 2024 年 06 月 30 日 |           |
|-------|----------------------|-----------|
|       | 账面余额                 | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | 5,350,000.00         | -         |
| 银行间市场 | -                    | -         |
| 合计    | 5,350,000.00         | -         |

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 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

本基金本报告期无债权投资。

##### 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期无债权投资。

#### 6.4.7.6 其他债权投资

##### 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

本基金本报告期无其他债权投资。

##### 6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期无其他债权投资。

#### 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

本基金本报告期无其他权益工具投资。

##### 6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

本基金本报告期无其他权益工具投资。

#### 6.4.7.8 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末 2024 年 06 月 30 日 |
|-------------|----------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                    |
| 应付赎回费       | 18.38                |
| 应付证券出借违约金   | -                    |
| 应付交易费用      | 853.00               |
| 其中：交易所市场    | -                    |
| 银行间市场       | 853.00               |

|      |           |
|------|-----------|
| 应付利息 | -         |
| 预提费用 | 83,590.88 |
| 合计   | 84,462.26 |

## 6.4.7.10 实收基金

## 金信民达纯债 A

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日 |                |
|---------------|---------------------------------------|----------------|
|               | 基金份额（份）                               | 账面金额           |
| 上年度末          | 132,495,296.01                        | 132,495,296.01 |
| 本期申购          | 4,196,021.79                          | 4,196,021.79   |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -4,460,285.57                         | -4,460,285.57  |
| 本期末           | 132,231,032.23                        | 132,231,032.23 |

## 金信民达纯债 C

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日 |                |
|---------------|---------------------------------------|----------------|
|               | 基金份额（份）                               | 账面金额           |
| 上年度末          | 95,369,528.60                         | 95,369,528.60  |
| 本期申购          | 3,132,839.30                          | 3,132,839.30   |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -61,143,362.33                        | -61,143,362.33 |
| 本期末           | 37,359,005.57                         | 37,359,005.57  |

## 6.4.7.11 其他综合收益

本基金本报告期无其他综合收益。

## 6.4.7.12 未分配利润

## 金信民达纯债 A

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           | 7,323,154.86  | 1,667,099.45 | 8,990,254.31 |
| 本期期初           | 7,323,154.86  | 1,667,099.45 | 8,990,254.31 |
| 本期利润           | 1,470,919.97  | -758,005.27  | 712,914.70   |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -83,719.12    | -4,281.86    | -88,000.98   |
| 其中：基金申购款       | 175,392.27    | 45,185.91    | 220,578.18   |
| 基金赎回款          | -259,111.39   | -49,467.77   | -308,579.16  |
| 本期已分配利润        | -5,631,502.74 | -            | -            |
| 本期末            | 3,078,852.97  | 904,812.32   | 3,983,665.29 |

## 金信民达纯债 C

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           | 15,072,739.73  | 1,144,770.94 | 16,217,510.67 |
| 本期期初           | 15,072,739.73  | 1,144,770.94 | 16,217,510.67 |
| 本期利润           | 734,465.01     | -104,278.26  | 630,186.75    |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -9,487,430.64  | -828,249.46  | -             |
|                |                |              | 10,315,680.10 |
| 其中：基金申购款       | 515,731.39     | 47,748.30    | 563,479.69    |
| 基金赎回款          | -10,003,162.03 | -875,997.76  | -             |
|                |                |              | 10,879,159.79 |
| 本期已分配利润        | -              | -            | -             |
| 本期末            | 6,319,774.10   | 212,243.22   | 6,532,017.32  |

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 2,281.80                              |
| 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 | 19,913.26                             |
| 其他        | 109.07                                |
| 合计        | 22,304.13                             |

注：“其他”为结算保证金利息收入。

#### 6.4.7.14 股票投资收益

##### 6.4.7.14.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金本报告期内无股票投资收益——买卖股票差价收入。

##### 6.4.7.14.2 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期内无股票投资收益——证券出借差价收入。

#### 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

单位：人民币元

| 项目                           | 本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日 |
|------------------------------|---------------------------------------|
| 债券投资收益——利息收入                 | 2,979,350.75                          |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | 1,828.79                              |
| 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 | 2,981,179.54 |
|----|--------------|

#### 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                     | 本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日 |
|------------------------|---------------------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额   | 215,418,608.39                        |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 212,822,681.92                        |
| 减：应计利息总额               | 2,586,992.48                          |
| 减：交易费用                 | 7,105.20                              |
| 买卖债券差价收入               | 1,828.79                              |

#### 6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无债券投资收益——赎回差价收入。

#### 6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无债券投资收益——申购差价收入。

#### 6.4.7.16 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.17 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.18 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

#### 6.4.7.19 股利收益

本基金本报告期无股利收益。

#### 6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称       | 本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日 |
|------------|---------------------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | -862,283.53                           |
| ——股票投资     | -                                     |
| ——债券投资     | -862,283.53                           |
| ——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                     | -862,283.53 |

#### 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日 |
|---------|---------------------------------------|
| 基金赎回费收入 | 19,269.10                             |
| 合计      | 19,269.10                             |

#### 6.4.7.22 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

#### 6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

| 项目        | 本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 审计费用      | 14,918.54                             |
| 信息披露费     | 59,672.34                             |
| 证券出借违约金   | -                                     |
| 账户查询费-上清所 | 600.00                                |
| 银行汇划费     | 2,902.21                              |
| 账户维护费     | 27,000.00                             |
| 合计        | 105,093.09                            |

#### 6.4.7.24 分部报告

本基金无分部报告。

#### 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，本基金无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本会计报表批准报出日，本基金无须作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**

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

**6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方**

| 关联方名称                | 与本基金的关系             |
|----------------------|---------------------|
| 金信基金管理有限公司（“金信基金”）   | 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（“工商银行”） | 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**

本基金本报告期内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**

本基金本报告期内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**

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

**6.4.10.1.4 债券回购交易**

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

**6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金**

本基金本报告期内及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

**6.4.10.2 关联方报酬****6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

| 项目               | 本期 2024 年 01 月 01 日至<br>2024 年 06 月 30 日 | 上年度可比期间 2023 年 01 月<br>01 日至 2023 年 06 月 30 日 |
|------------------|--|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费   | 323,596.90                               | 109,983.93                                    |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 37,710.70                                | 27,708.08                                     |
| 应支付基金管理人的净管理费    | 285,886.20                               | 82,275.85                                     |

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.30% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.30\% \div \text{当年天数}$$

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。由基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金资产中一次性支付给管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

本基金管理人按照与基金销售机构签订的基金销售协议约定，依据销售机构销售基金的保有量提取一定比例的客户维护费，用以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，客户维护费从基金管理费中列支。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期 2024 年 01 月 01 日至<br>2024 年 06 月 30 日 | 上年度可比期间 2023 年 01 月<br>01 日至 2023 年 06 月 30 日 |
|----------------|--|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 86,292.55                                | 29,329.04                                     |

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.08% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.08\% \div \text{当年天数}$$

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。由基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金资产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方<br>名称 | 本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日      |           |           |
|--------------------|--|-----------|-----------|
|                    | 当期发生的基金应支付的销售服务费                           |           |           |
|                    | 金信民达纯债 A                                   | 金信民达纯债 C  | 合计        |
| 金信基金               | -  | 22,636.23 | 22,636.23 |
| 合计                 | -  | 22,636.23 | 22,636.23 |
| 获得销售服务费的各关联方<br>名称 | 上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日 |           |           |
|                    | 当期发生的基金应支付的销售服务费                           |           |           |
|                    | 金信民达纯债 A                                   | 金信民达纯债 C  | 合计        |
| 金信基金               | -  | 13,242.37 | 13,242.37 |
| 合计                 | -  | 13,242.37 | 13,242.37 |

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费

本基金 C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.20%。销售服务费计提的计算公式具体如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的基金销售服务费

E 为前一日 C 类基金份额的基金资产净值

基金销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，基金托管人于次月首日起第 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给登记机构，由登记机构代付给销售机构。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延至最近可支付日支付。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间与关联方无银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内与上年度可比期间无与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

##### 6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内与上年度可比期间无与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

###### 金信民达纯债 C

份额单位：份

| 项目                               | 本期 2024 年 01 月 01 日至<br>2024 年 06 月 30 日 | 上年度可比期间 2023 年 01 月<br>01 日至 2023 年 06 月 30 日 |
|----------------------------------|--|---|
| 基金合同生效日（2020 年 06 月 11 日）持有的基金份额 | 5,001,262.55                             | 5,001,262.55                                  |
| 报告期初持有的基金份额                      | 5,001,262.55                             | 5,001,262.55                                  |
| 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<br>额               | -  | -   |
| 报告期末持有的基金份额                      | 5,001,262.55                             | 5,001,262.55                                  |
| 报告期末持有的基金份额占基<br>金总份额比例          | 2.9490%                                  | 2.5246%                                       |

注：本报告期内基金管理人不存在申购、赎回或买卖本基金的情况。

##### 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

## 金信民达纯债 A

份额单位：份

| 关联方名称        | 本期末 2024 年 06 月 30 日 |                  | 上年度末 2023 年 12 月 31 日 |                  |
|--------------|----------------------|------------------|-----------------------|------------------|
|              | 持有的基金份额              | 持有的基金份额占基金总份额的比例 | 持有的基金份额               | 持有的基金份额占基金总份额的比例 |
| 深圳市巨财汇投资有限公司 | 5,000,262.55         | 2.9484%          | 5,000,262.55          | 2.1944%          |

注：深圳市巨财汇投资有限公司投资本基金适用的认（申）购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行。

## 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称        | 本期 2024 年 01 月 01 日至<br>2024 年 06 月 30 日 |          | 上年度可比期间 2023 年 01 月<br>01 日至 2023 年 06 月 30 日 |          |
|--------------|--|----------|---|----------|
|              | 期末余额                                     | 当期利息收入   | 期末余额  | 当期利息收入   |
| 中国工商银行股份有限公司 | 1,386,541.38                             | 2,281.80 | 477,372.97                                    | 3,551.39 |

注：本基金的银行活期存款由基金托管人中国工商银行股份有限公司保管，按适用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

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

## 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

## 6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

## 金信民达纯债 A

单位：人民币元

| 序号 | 权益登记日      | 除息日        | 每 10 份<br>基金份额<br>分红数 | 现金形式发<br>放总额 | 再投资形式<br>发放总额 | 本期利润分<br>配合计 | 备注 |
|----|------------|------------|-----------------------|--------------|---------------|--------------|----|
| 1  | 2024-06-20 | 2024-06-20 | 0.432                 | 3,485,236.29 | 2,146,266.45  | 5,631,502.74 | -  |
| 合计 |            |            | 0.432                 | 3,485,236.29 | 2,146,266.45  | 5,631,502.74 | -  |

## 6.4.12 期末（2024 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

## 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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

截至本报告期末 2024 年 06 月 30 日止，本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 06 月 30 日止，本基金无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期内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

本基金为债券型基金，其理论上预期收益及预期风险水平高于货币市场基金，低于股票型和混合型基金。本基金投资的金融工具主要为债券投资等。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、流动性风险以及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取在严格控制风险的前提下，谋求基金资产的长期稳定增长。

本基金的基金管理人建设全面风险管理体系，建立了以公司董事会风险控制与审计委员会为核心的、由投资决策委员会、督察长、监察稽核部和相关业务部门构成的多级风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险控制与审计委员会，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。在公司管理层下设立投资决策委员会和监察稽核部对公司的风险进行的预防和控制；投资决策委员会在总经理的领导下，研究并制定公司基金资产投资战略和投资策略，对基金的总体投资情况提出指导性意见，从而达到分散投资风险，提高基金资产的安全性的目的；监察稽核部在督察长的领导下，独立于公司各业务部门和各分支机构，对各岗位、各部门、各项业务中的风险控制情况实施监督。在业务部门层面，公司各部门根据经营计划、业务规则及本部门具体情况制定本部门的工作流程及风险控制措施。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理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，将风险控制可在承受的范围之内。

#### 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之发行人出现违约、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。本基金的活期存款存放在本基金的托管行工商银行，与该货币资金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设置投资最低条件来控制证券发行人的信用风险。信用评估包括公司内部信用评级和外部信用评级。内部债券信用评估主要考察发行人的经营风险、财务风险和流动性风险，以及信用产品的条款和担保人的情况等。此外，本基金的基金管理人根据信用产品的评估结果，对单只信用产品投资占基金资产净值的比例及占发行量的比例进行控制，通过分散化投资以分散信用风险。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末 2024 年 06 月 30 日 | 上年度末 2023 年 12 月 31 日 |
|--------|----------------------|-----------------------|
| A-1    | -                    | -                     |
| A-1 以下 | -                    | -                     |
| 未评级    | 10,690,999.32        | 34,483,094.73         |
| 合计     | 10,690,999.32        | 34,483,094.73         |

注：未评级债券为国债、央行票据、政策性金融债及超短期融资券等无信用评级的债券。

##### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

##### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的同业存单。

##### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末 2024 年 06 月 30 日 | 上年度末 2023 年 12 月 31 日 |
|--------|----------------------|-----------------------|
| AAA    | 107,241,336.62       | 96,133,033.06         |
| AAA 以下 | 52,067,958.29        | 45,599,779.43         |
| 未评级    | 42,689,453.48        | 34,193,736.99         |
| 合计     | 201,998,748.39       | 175,926,549.48        |

注：未评级债券为国债、央行票据、政策性金融债及超短期融资券等无信用评级的债券。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。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。

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、组合在短期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 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%。本基金所持证券均在证券交易所或银行间债券市场上市，金融资产均能以合理价格适时变现。

于 2024 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一年以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)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%。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；按照穿透原则对实际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相关制度：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。

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%。于 2024 年 6 月 30 日，本基金未持有流动性受限资产。

#### 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。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的债券投资，因此存在相应的利率风险。

下表统计了本基金面临的利率风险敞口，表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者进行了分类：

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本<br>期<br>末<br>20<br>24<br>年<br>06<br>月<br>30<br>日 | 1 个月以内           | 1-3 个月 | 3 个月-1<br>年 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计               |
|--|------------------|--------|-------------|-------|-------|-----|------------------|
| 资<br>产   |                  |        |             |       |       |     |                  |
| 货<br>币<br>资<br>金                                   | 1,386,541<br>.38 | -      | -           | -     | -     | -   | 1,386,541<br>.38 |
| 结<br>算   | 3,857,392<br>.74 | -      | -           | -     | -     | -   | 3,857,392<br>.74 |

|          |               |              |               |                |               |              |                |
|----------|---------------|--------------|---------------|----------------|---------------|--------------|----------------|
| 备付金      |               |              |               |                |               |              |                |
| 存出保证金    | 16,896.26     | -            | -             | -              | -             | -            | 16,896.26      |
| 交易性金融资产  | 1,948,864.23  | 2,262,710.14 | 94,489,216.29 | 101,042,265.54 | 12,946,691.51 | -            | 212,689,747.71 |
| 买入返售金融资产 | 5,350,000.00  | -            | -             | -              | -             | -            | 5,350,000.00   |
| 应收清算款    | -             | -            | -             | -              | -             | 2,403,829.54 | 2,403,829.54   |
| 应收申购款    | -             | -            | -             | -              | -             | 12,214.17    | 12,214.17      |
| 资产总计     | 12,559,694.61 | 2,262,710.14 | 94,489,216.29 | 101,042,265.54 | 12,946,691.51 | 2,416,043.71 | 225,716,621.80 |
| 负债       |               |              |               |                |               |              |                |
| 卖出回购金    | 43,000,000.00 | -            | -             | -              | -             | -            | 43,000,000.00  |

|         |               |   |   |   |   |              |               |
|---------|---------------|---|---|---|---|--------------|---------------|
| 融资产款    |               |   |   |   |   |              |               |
| 应付清算款   | -             | - | - | - | - | 2,417,248.32 | 2,417,248.32  |
| 应付赎回款   | -             | - | - | - | - | 37,098.02    | 37,098.02     |
| 应付管理人报酬 | -             | - | - | - | - | 45,296.58    | 45,296.58     |
| 应付托管费   | -             | - | - | - | - | 12,079.08    | 12,079.08     |
| 应付销售服务费 | -             | - | - | - | - | 7,356.34     | 7,356.34      |
| 应交税费    | -             | - | - | - | - | 7,360.79     | 7,360.79      |
| 其他负债    | -             | - | - | - | - | 84,462.26    | 84,462.26     |
| 负债总计    | 43,000,000.00 | - | - | - | - | 2,610,901.39 | 45,610,901.39 |

|                             |                        |                   |                    |                    |                   |                     |                    |
|-----------------------------|------------------------|-------------------|--------------------|--------------------|-------------------|---------------------|--------------------|
| 计                           |                        |                   |                    |                    |                   |                     |                    |
| 利率敏感<br>度缺口                 | -<br>30,440,30<br>5.39 | 2,262,710<br>.14  | 94,489,21<br>6.29  | 101,042,2<br>65.54 | 12,946,69<br>1.51 | -<br>194,857.6<br>8 | 180,105,7<br>20.41 |
| 上年度末<br>2023年<br>12月<br>31日 | 1个月以内                  | 1-3个月             | 3个月-1<br>年         | 1-5年               | 5年以上              | 不计息                 | 合计                 |
| 资产                          |                        |                   |                    |                    |                   |                     |                    |
| 货币资金                        | 1,692,517<br>.13       | -                 | -                  | -                  | -                 | -                   | 1,692,517<br>.13   |
| 结算备付金                       | 479,116.1<br>5         | -                 | -                  | -                  | -                 | -                   | 479,116.1<br>5     |
| 存出保证金                       | 13,778.33              | -                 | -                  | -                  | -                 | -                   | 13,778.33          |
| 交易性金融资产                     | 2,258,184<br>.43       | 24,666,13<br>7.95 | 100,836,4<br>67.23 | 82,648,85<br>4.60  | -                 | -                   | 210,409,6<br>44.21 |
| 衍生                          | -                      | -                 | -                  | -                  | -                 | -                   | -                  |

|          |               |               |                |               |   |            |                |
|----------|---------------|---------------|----------------|---------------|---|------------|----------------|
| 金融资产     |               |               |                |               |   |            |                |
| 买入返售金融资产 | 42,227,684.56 | -             | -              | -             | - | -          | 42,227,684.56  |
| 债权投资     | -             | -             | -              | -             | - | -          | -              |
| 应收股利     | -             | -             | -              | -             | - | -          | -              |
| 应收申购款    | -             | -             | -              | -             | - | 8,960.21   | 8,960.21       |
| 应收清算款    | -             | -             | -              | -             | - | 49,543.38  | 49,543.38      |
| 其他资产     | -             | -             | -              | -             | - | -          | -              |
| 资产总计     | 46,671,280.60 | 24,666,137.95 | 100,836,467.23 | 82,648,854.60 | - | 58,503.59  | 254,881,243.97 |
| 负债       |               |               |                |               |   |            |                |
| 应付赎回     | -             | -             | -              | -             | - | 293,127.94 | 293,127.94     |

|           |   |   |   |   |   |              |              |
|-----------|---|---|---|---|---|--------------|--------------|
| 款         |   |   |   |   |   |              |              |
| 应付管理人报酬   | - | - | - | - | - | 54,130.81    | 54,130.81    |
| 应付托管费     | - | - | - | - | - | 14,434.89    | 14,434.89    |
| 应付清算款     | - | - | - | - | - | 1,301,763.73 | 1,301,763.73 |
| 卖出回购金融资产款 | - | - | - | - | - | -            | -            |
| 应付销售服务费   | - | - | - | - | - | 14,181.15    | 14,181.15    |
| 应付投资顾问费   | - | - | - | - | - | -            | -            |
| 应付利息      | - | - | - | - | - | -            | -            |

|         |               |               |                |               |   |              |                |
|---------|---------------|---------------|----------------|---------------|---|--------------|----------------|
| 润       |               |               |                |               |   |              |                |
| 应交税费    | -             | -             | -              | -             | - | 10,437.58    | 10,437.58      |
| 其他负债    | -             | -             | -              | -             | - | 120,578.28   | 120,578.28     |
| 负债总计    | -             | -             | -              | -             | - | 1,808,654.38 | 1,808,654.38   |
| 利率敏感度缺口 | 46,671,280.60 | 24,666,137.95 | 100,836,467.23 | 82,648,854.60 | - | 1,750,150.79 | 253,072,589.59 |

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| 假设 | 除市场利率以外的其他市场变量保持不变 |                             |                       |
|----|--------------------|-----------------------------|-----------------------|
| 分析 | 相关风险变量的变动          | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） |                       |
|    |                    | 本期末 2024 年 06 月 30 日        | 上年度末 2023 年 12 月 31 日 |
|    | 1. 市场利率下降 25 个基点   | 1,460,606.42                | 601,741.11            |
|    | 2. 市场利率上升 25 个基点   | -1,444,105.05               | -596,931.99           |

#### 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币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及交易所债券，因此无重大其他

价格风险。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于债券资产比例不低于基金资产的 80%。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，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

本基金于本报告期末及上年度末无股票投资、权证投资等权益性投资。

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2024 年 6 月 30 日，本基金未持有股票投资（2023 年 12 月 31 日，同），因此沪深 300 指数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层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

#### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

##### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

| 公允价值计量结果所属的层次 | 本期末 2024 年 06 月 30 日 | 上年度末 2023 年 12 月 31 日 |
|---------------|----------------------|-----------------------|
| 第一层次          | 66,630,407.59        | 69,886,575.90         |
| 第二层次          | 146,059,340.12       | 140,523,068.31        |
| 第三层次          | -                    | -                     |
| 合计            | 212,689,747.71       | 210,409,644.21        |

##### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

于本报告期间，本基金无公允价值所属层次间的重大变动。



**6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明**

于 2024 年 06 月 30 日，本基金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**

不以公允价值计量的金融工具主要包括以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

**6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**

于 2024 年 06 月 30 日，本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

**§ 7 投资组合报告****7.1 期末基金资产组合情况**

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目                | 金额            | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|---------------|---------------|
| 1  | 权益投资              | -             | -             |
|    | 其中：股票             | -             | -             |
| 2  | 基金投资              | -             | -             |
| 3  | 固定收益投资            | 212,689,747.7 | 94.23         |
|    |                   | 1             |               |
|    | 其中：债券             | 212,689,747.7 | 94.23         |
|    |                   | 1             |               |
|    | 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          | 5,350,000.00  | 2.37          |
|    | 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      | 5,243,934.12  | 2.32          |
| 8  | 其他各项资产            | 2,432,939.97  | 1.08          |
| 9  | 合计                | 225,716,621.8 | 100.00        |
|    |                   | 0             |               |

**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

本基金本报告期内未持有股票。

#### 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

本基金本报告期内未持有股票。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内未持有股票。

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种      | 公允价值           | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|-----------|----------------|---------------|
| 1  | 国家债券      | 53,380,452.80  | 29.64         |
| 2  | 央行票据      | -              | -             |
| 3  | 金融债券      | 21,543,953.55  | 11.96         |
|    | 其中：政策性金融债 | -              | -             |
| 4  | 企业债券      | 46,506,652.52  | 25.82         |
| 5  | 企业短期融资券   | -              | -             |
| 6  | 中期票据      | 10,182,070.14  | 5.65          |
| 7  | 可转债(可交换债) | 66,630,407.59  | 37.00         |
| 8  | 同业存单      | -              | -             |
| 9  | 其他        | 14,446,211.11  | 8.02          |
| 10 | 合计        | 212,689,747.71 | 118.09        |

### 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  | 019724 | 23 国债 21 | 286,000 | 29,742,761.97 | 16.51         |
| 2  | 231601 | 24 湖南 01 | 140,920 | 14,446,211.11 | 8.02          |

|   |         |                  |         |               |      |
|---|---------|------------------|---------|---------------|------|
| 3 | 128063  | 未来转债             | 124,000 | 14,386,513.97 | 7.99 |
| 4 | 1928008 | 19 农业银行<br>二级 03 | 100,000 | 11,185,198.36 | 6.21 |
| 5 | 019727  | 23 国债 24         | 105,000 | 10,690,999.32 | 5.94 |

### 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

国债期货作为利率衍生品的一种，有助于管理债券组合的久期、流动性和风险水平。基金管理人将按照相关法律法规的规定，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析。构建量化分析体系，对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，在最大限度保证基金资产安全的基础上，力求实现基金资产的长期稳定增值。

#### 7.10.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

### 7.11 投资组合报告附注

#### 7.11.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未有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是否超出基金合同规定的备选股票库

根据合同规定，本基金不投资股票资产。

#### 7.11.3 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 | 16,896.26    |
| 2  | 应收清算款 | 2,403,829.54 |
| 3  | 应收股利  | -            |
| 4  | 应收利息  | -            |
| 5  | 应收申购款 | 12,214.17    |
| 6  | 其他应收款 | -            |
| 7  | 待摊费用  | -            |
| 8  | 其他    | -            |
| 9  | 合计    | 2,432,939.97 |

## 7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码   | 债券名称     | 公允价值          | 占基金资产净值比例<br>(%) |
|----|--------|----------|---------------|------------------|
| 1  | 128063 | 未来转债     | 14,386,513.97 | 7.99             |
| 2  | 113530 | 大丰转债     | 7,729,297.44  | 4.29             |
| 3  | 132020 | 19 蓝星 EB | 7,415,332.70  | 4.12             |
| 4  | 113066 | 平煤转债     | 4,838,701.98  | 2.69             |
| 5  | 127027 | 能化转债     | 2,636,971.79  | 1.46             |
| 6  | 118031 | 天 23 转债  | 2,228,429.59  | 1.24             |
| 7  | 113033 | 利群转债     | 2,199,901.06  | 1.22             |
| 8  | 128138 | 侨银转债     | 2,139,166.13  | 1.19             |
| 9  | 118023 | 广大转债     | 1,985,368.77  | 1.10             |
| 10 | 123107 | 温氏转债     | 1,894,247.61  | 1.05             |
| 11 | 128066 | 亚泰转债     | 1,858,929.43  | 1.03             |
| 12 | 128081 | 海亮转债     | 1,844,599.21  | 1.02             |
| 13 | 128119 | 龙大转债     | 1,763,970.41  | 0.98             |
| 14 | 110077 | 洪城转债     | 1,502,797.33  | 0.83             |
| 15 | 113624 | 正川转债     | 1,463,594.90  | 0.81             |
| 16 | 123190 | 道氏转 02   | 1,385,285.69  | 0.77             |
| 17 | 113542 | 好客转债     | 1,114,520.19  | 0.62             |
| 18 | 113640 | 苏利转债     | 1,108,630.68  | 0.62             |
| 19 | 127060 | 湘佳转债     | 1,068,336.00  | 0.59             |
| 20 | 123146 | 中环转 2    | 887,706.03    | 0.49             |
| 21 | 111017 | 蓝天转债     | 817,590.28    | 0.45             |
| 22 | 127062 | 垒知转债     | 735,144.32    | 0.41             |
| 23 | 110048 | 福能转债     | 642,609.04    | 0.36             |
| 24 | 113632 | 鹤 21 转债  | 590,026.71    | 0.33             |
| 25 | 111009 | 盛泰转债     | 572,751.78    | 0.32             |
| 26 | 127034 | 绿茵转债     | 390,415.34    | 0.22             |

|    |        |          |            |      |
|----|--------|----------|------------|------|
| 27 | 123126 | 瑞丰转债     | 330,599.67 | 0.18 |
| 28 | 113608 | 威派转债     | 300,789.53 | 0.17 |
| 29 | 132026 | G 三峡 EB2 | 258,913.15 | 0.14 |
| 30 | 123132 | 回盛转债     | 199,119.18 | 0.11 |
| 31 | 110094 | 众和转债     | 184,893.82 | 0.10 |
| 32 | 127049 | 希望转 2    | 155,253.86 | 0.09 |

#### 7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期内未持有流通受限股票。

#### 7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

## § 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

| 份额级别     | 持有人户数 (户) | 户均持有的基金份额  | 持有人结构          |          |               |          |
|----------|-----------|------------|----------------|----------|---------------|----------|
|          |           |            | 机构投资者          |          | 个人投资者         |          |
|          |           |            | 持有份额           | 占总份额比例   | 持有份额          | 占总份额比例   |
| 金信民达纯债 A | 1,030     | 128,379.64 | 122,373,815.04 | 92.5455% | 9,857,217.19  | 7.4545%  |
| 金信民达纯债 C | 2,950     | 12,664.07  | 30,759,763.74  | 82.3356% | 6,599,241.83  | 17.6644% |
| 合计       | 3,809     | 44,523.51  | 153,133,578.78 | 90.2963% | 16,456,459.02 | 9.7037%  |

注：1、分类基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分类基金，比例的分母采用各自类别的份额；对合计数，比例的分母采用期末基金份额总额；

2、户均持有的基金份额合计=期末基金份额总额/期末持有人户数总计。

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 份额级别     | 持有份额总数 (份) | 占基金总份额比例 |
|------------------|----------|------------|----------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 金信民达纯债 A | 21,048.82  | 0.0159%  |
|                  | 金信民达纯债 C | 55,108.71  | 0.1475%  |
|                  | 合计       | 76,157.53  | 0.0449%  |

注：分级基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额；对合计数，比例的分母采用期末基金份额总额。

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

| 项目                                     | 份额级别     | 持有基金份额总量的数量区间<br>(万份) |
|--|----------|-----------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和<br>研究部门负责人持有本开<br>放式基金 | 金信民达纯债 A | 0~10                  |
|  | 金信民达纯债 C | 0                     |
|  | 合计       | 0~10                  |
| 本基金基金经理持有本开放<br>式基金                    | 金信民达纯债 A | 0                     |
|  | 金信民达纯债 C | 0~10                  |
|  | 合计       | 0~10                  |

### 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

本基金成立于 2020 年 6 月 11 日，截至本报告期末本基金已成立超过三年。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

|                                     | 金信民达纯债 A       | 金信民达纯债 C      |
|-------------------------------------|----------------|---------------|
| 基金合同生效日（2020 年 06 月 11 日）基金<br>份额总额 | 5,092,021.94   | 5,004,190.32  |
| 本报告期期初基金份额总额                        | 132,495,296.01 | 95,369,528.60 |
| 本报告期基金总申购份额                         | 4,196,021.79   | 3,132,839.30  |
| 减：本报告期基金总赎回份额                       | 4,460,285.57   | 61,143,362.33 |
| 本报告期基金拆分变动份额（份额减少以<br>“-”填列）        | -              | -             |
| 本报告期期末基金份额总额                        | 132,231,032.23 | 37,359,005.57 |

## § 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，基金管理人没有发生重大人事变动。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，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改变。

#### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期为本基金提供审计服务的会计师事务所无变化。

#### 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未受监管部门稽查或处罚。

##### 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

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 |    |
| 申万宏源证券 | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 兴业证券   | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |

注：根据中国证监会《公开募集证券投资基金交易费用管理规定》的有关规定，我公司制定了合作证券公司的选择标准和程序：

##### A：选择标准

- (1) 公司经营行为规范，财务状况和经营状况良好；
- (2) 公司具有较强的研究能力，能及时、全面地为基金提供高质量的宏观经济研究、行业研究及市场走向、个股分析报告和专门研究报告；
- (3) 公司内部管理规范，合规风控能力和交易等服务力能较强，能满足基金操作的保密要求；
- (4) 建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息。

##### B：选择流程

公司投资、研究部门定期对合作证券公司服务质量从以下几方面进行量化评比，并根据评比的结果征求有关人员意见，经公司领导审批后选择合作的证券公司：

- (1) 服务的主动性。主要针对证券公司承接调研课题的态度、协助安排上市公司调研、以及就有关专题提供研究报告和讲座；

(2) 研究报告的质量。主要是指证券公司所提供研究报告是否详实，投资建议是否准确；

(3) 资讯提供的及时性及便利性。主要是指证券公司提供资讯的时效性、及时性以及提供资讯的渠道是否便利、提供的资讯是否充足全面。

### 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 |
| 申万宏源证券 | 360,226,408.13 | 99.88%       | 3,377,322,000.00 | 100.00%        | -    | -            | -    | -            |
| 兴业证券   | 418,800.00     | 0.12%        | -                | -              | -    | -            | -    | -            |

### 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  | 金信民达纯债债券型发起式证券投资基金 2023 年度第 4 季度报告      | 中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站      | 2024-01-20 |
| 2  | 金信基金管理有限公司旗下 18 只基金 2023 年第 4 季度报告提示性公告 | 中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站、规定报刊 | 2024-01-20 |
| 3  | 金信基金管理有限公司关于关闭网上直销交易平台、账户查询平台的公告        | 中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站、规定报刊 | 2024-03-05 |
| 4  | 金信民达纯债债券型发起式证券投资基金 2023 年年度报告           | 中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站      | 2024-03-30 |
| 5  | 金信基金管理有限公司旗下 18 只基金 2023 年年度报告提示性公告     | 中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站、规定报刊 | 2024-03-30 |
| 6  | 金信民达纯债债券型发起式证券投资基金 2024 年度第 1 季度报告      | 中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站      | 2024-04-20 |
| 7  | 金信基金管理有限公司旗下 20 只基金 2024 年第 1 季度报告提示性公告 | 中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站、规定报刊 | 2024-04-20 |
| 8  | 金信民达纯债债券型发起式证券投资基金基金产品资料概要              | 中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站、规定报刊 | 2024-06-18 |



|    |                                      |                            |            |
|----|--------------------------------------|----------------------------|------------|
|    | 更新                                   |                            |            |
| 9  | 金信民达纯债债券型发起式证券投资基金暂停机构投资者大额申购业务的公告   | 中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站、规定报刊 | 2024-06-19 |
| 10 | 金信民达纯债债券型发起式证券投资基金分红公告               | 中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站、规定报刊 | 2024-06-20 |
| 11 | 金信民达纯债债券型发起式证券投资基金基金产品资料概要更新         | 中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站、规定报刊 | 2024-06-21 |
| 12 | 金信民达纯债债券型发起式证券投资基金基金恢复机构投资者大额申购业务的公告 | 中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站、规定报刊 | 2024-06-21 |

## § 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       | 68,357,686.06 | 0.00         | 0.00       | 68,357,686.06 | 40.3076% |
|   | 2              | 20240101-20240630       | 47,000,376.01 | 1,970,895.20 | 0.00       | 48,971,271.21 | 28.8763% |
| 产品特有风险  |                |                         |               |              |            |               |          |
| <p>1、大额赎回风险</p> <p>本基金如果出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金份额总份额的 20%，则面临大额赎回的情况，可能导致：</p> <p>(1) 基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险；如果持有基金份额比例达到或超过基金份额总额的 20% 的单一投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定决定部分延期赎回，如果连续 2 个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响；</p> <p>(2) 基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，则可能使基金资产净值受到不利影响，影响基金的投资运作和收益水平；</p> <p>(3) 因基金净值精度计算问题，或因赎回费收入归基金资产，导致基金净值出现较大波动；</p> <p>(4) 基金资产规模过小，可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略；</p> <p>(5) 大额赎回导致基金资产规模过小，不能满足存续的条件，基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。</p> |                |                         |               |              |            |               |          |

2、大额申购风险

若投资者大额申购，基金所投资的标的资产未及时准备，导致净值涨幅可能会因此降低。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予金信民达纯债债券型发起式证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《金信民达纯债债券型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《金信民达纯债债券型发起式证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件和营业执照。

12.2 存放地点

深圳市福田区益田路 6001 号太平金融大厦 1502 室  
深圳市前海深港合作区兴海大道 3040 号前海世茂大厦 2603

12.3 查阅方式

本基金管理人公司网站，网址：[www.jxfunds.com.cn](http://www.jxfunds.com.cn)。

金信基金管理有限公司  
二〇二四年八月三十一日