

# 贝莱德欣悦丰利债券型证券投资基金

## 2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：贝莱德基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2024 年 8 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 8 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 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示 .....	2
1.2 目录 .....	3
<b>§ 2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
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 .....	6
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>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	7
3.2 基金净值表现 .....	7
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	12
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 .....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	14
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 .....	14
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	15
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 .....	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见 .....	15
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>16</b>
6.1 资产负债表 .....	16
6.2 利润表 .....	17
6.3 净资产变动表 .....	18
6.4 报表附注 .....	19
<b>§ 7 投资组合报告</b> .....	<b>43</b>
7.1 期末基金资产组合情况 .....	43
7.2 期末按行业分类的股票投资组合 .....	43
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 .....	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	48
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 .....	48
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 .....	48
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 .....	48
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 .....	48
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	48
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	49
7.12 投资组合报告附注 .....	49

<b>§ 8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>51</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	51
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	51
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 .....	51
<b>§ 9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>52</b>
<b>§ 10 重大事件揭示</b> .....	<b>53</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	53
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 .....	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	53
10.4 基金投资策略的改变 .....	53
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	53
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 .....	53
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	54
10.8 其他重大事件 .....	54
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>56</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.....	56
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	56
<b>§ 12 备查文件目录</b> .....	<b>57</b>
12.1 备查文件目录 .....	57
12.2 存放地点 .....	57
12.3 查阅方式 .....	57

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	贝莱德欣悦丰利债券型证券投资基金	
基金简称	贝莱德欣悦丰利债券	
基金主代码	016711	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023 年 2 月 28 日	
基金管理人	贝莱德基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	111,010,507.65 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	贝莱德欣悦丰利债券 A	贝莱德欣悦丰利债券 C
下属分级基金的交易代码	016711	016712
报告期末下属分级基金的份额总额	83,465,478.22 份	27,545,029.43 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在控制风险的前提下，通过积极主动的投资管理，力争实现组合资产长期稳健的增值。
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>本基金将采用“自上而下”的分析方法，综合分析和持续跟踪基本面、政策面、市场面等多方面因素，结合全球宏观经济形势，研判国内外经济的发展趋势，并在严格控制投资组合风险的前提下，对组合中债券、股票、基金、金融衍生品、货币市场工具和法律法规或中国证监会允许基金投资的其他品种的投资比例进行战略配置和动态调整，以规避或分散市场风险，力争实现基金资产的中长期稳健增值。</p> <p>2、债券投资策略</p> <p>3、股票投资策略</p> <p>4、金融衍生品投资策略</p> <p>5、基金投资策略</p>
业绩比较基准	中债综合财富（总值）指数收益率×85%+沪深 300 指数收益率×10%+一年期定期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	<p>本基金为债券型基金，在通常情况下其预期风险和收益低于股票型基金和混合型基金，高于货币市场基金。</p> <p>本基金如果投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。</p>

### 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		贝莱德基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈剑	王小飞
	联系电话	021-80225188	021-60637103
	电子邮箱	Compliance_FMC@blackrock.com.cn	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		400-002-6655	021-60637228
传真		021-80225288	021-60635778
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1233 号汇亚大厦 7 楼 702 室	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1233 号汇亚大厦 7 楼 702 室	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		200120	100033
法定代表人		陈剑	张金良

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.blackrock.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地址

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国建设银行股份有限公司	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

### § 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 6 月 30 日)	
	贝莱德欣悦丰利债券 A	贝莱德欣悦丰利债券 C
本期已实现收益	1,660,247.61	511,713.74
本期利润	2,703,931.08	1,142,175.11
加权平均基金份额本期利润	0.0226	0.0244
本期加权平均净值利润率	2.25%	2.44%
本期基金份额净值增长率	2.03%	1.84%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)	
	贝莱德欣悦丰利债券 A	贝莱德欣悦丰利债券 C
期末可供分配利润	435,708.57	-4,448.07
期末可供分配基金份额利润	0.0052	-0.0002
期末基金资产净值	84,652,591.67	27,787,263.41
期末基金份额净值	1.0142	1.0088
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)	
	贝莱德欣悦丰利债券 A	贝莱德欣悦丰利债券 C
基金份额累计净值增长率	1.42%	0.88%

注：1、上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，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（为期末余额，不是当期发生数）。

4、表中的“期末”指报告期最后一日，即 2024 年 6 月 30 日；“本期”指 2024 年 01 月 01 日-2024 年 6 月 30 日。

#### 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

贝莱德欣悦丰利债券 A

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	-0.36%	0.13%	0.41%	0.05%	-0.77%	0.08%
过去三个月	0.34%	0.15%	1.29%	0.08%	-0.95%	0.07%
过去六个月	2.03%	0.19%	3.37%	0.09%	-1.34%	0.10%

过去一年	1.33%	0.18%	4.10%	0.09%	-2.77%	0.09%
自基金合同生效起至今	1.42%	0.16%	5.57%	0.09%	-4.15%	0.07%

贝莱德欣悦丰利债券 C

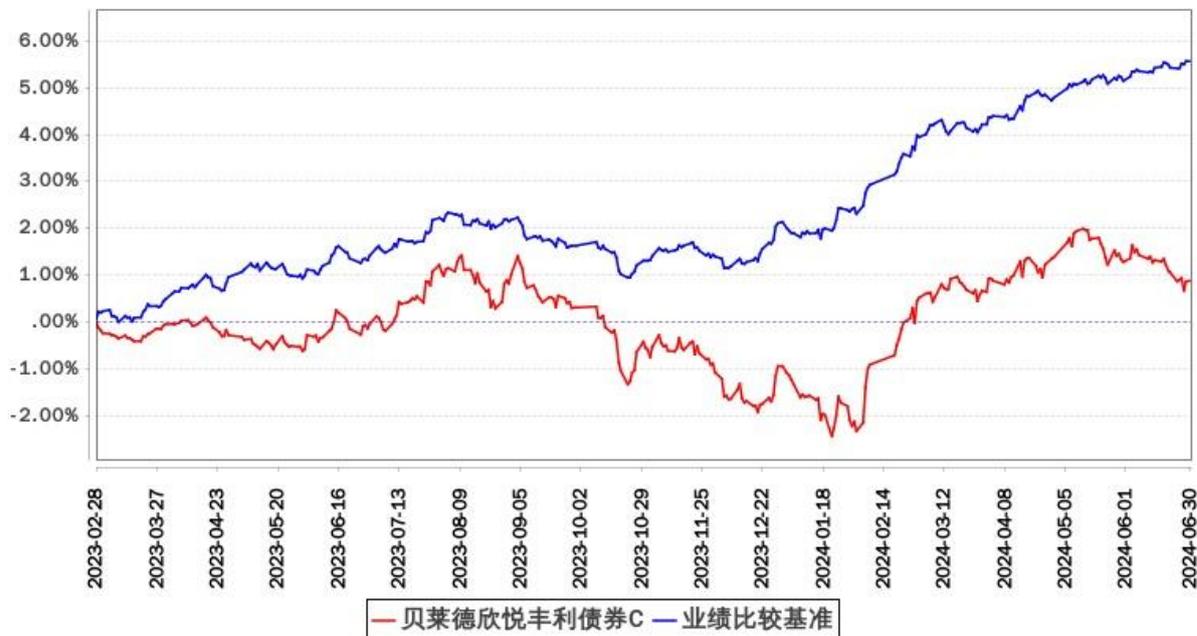
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-0.39%	0.13%	0.41%	0.05%	-0.80%	0.08%
过去三个月	0.24%	0.15%	1.29%	0.08%	-1.05%	0.07%
过去六个月	1.84%	0.19%	3.37%	0.09%	-1.53%	0.10%
过去一年	0.92%	0.18%	4.10%	0.09%	-3.18%	0.09%
自基金合同生效起至今	0.88%	0.16%	5.57%	0.09%	-4.69%	0.07%

### 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

贝莱德欣悦丰利债券A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



贝莱德欣悦丰利债券C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金的基金合同于 2023 年 2 月 28 日生效，本基金自基金合同生效日起 6 个月内为建仓期，本基金建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

## § 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

贝莱德基金管理有限公司成立于 2020 年 9 月 10 日，是国内首家外资全资控股的公募基金管理人公司。公司经中国证券监督管理委员会《关于核准设立贝莱德基金管理有限公司的批复》（证监许可[2020]1917 号）批准，由贝莱德金融管理公司（BlackRock Financial Management, Inc.）出资成立。截至报告期末，公司旗下发行并管理了 8 只公开募集证券投资基金：贝莱德中国新视野混合型证券投资基金、贝莱德港股通远景视野混合型证券投资基金、贝莱德先进制造一年持有期混合型证券投资基金、贝莱德浦悦丰利一年持有期混合型证券投资基金、贝莱德欣悦丰利债券型证券投资基金、贝莱德行业优选混合型证券投资基金、贝莱德安睿 30 天持有期债券型证券投资基金、贝莱德卓越远航混合型证券投资基金。

#### 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		
李倩	本基金的基金经理	2023 年 2 月 28 日	-	14	李倩女士，固定收益投资部基金经理。曾于泓德基金管理有限公司担任基金经理，中国农业银行担任投资经理，中信建投证券担任债券交易及投资经理助理。李倩女士拥有四川大学金融硕士学位以及金融学学士学位。
LIU XIN/ 刘鑫	本基金的基金经理、固定收益投资总监	2023 年 3 月 13 日	-	19	LIU XIN/刘鑫先生，固定收益投资总监。曾于贝莱德新加坡固定收益部担任负责人及基金经理职务，并曾任安本资产管理公司基金经理，三菱日联金融集团投资经理，新加坡科技资产管理公司基金经理等职务。LIU XIN/刘鑫先生是特许金融分析师

					(CFA)、金融风险管理师 (FRM) 持证人, 并拥有欧洲工商管理学院工商管理硕士学位、南洋理工大学电子工程学士学位。
WANG YANG/ 王洋	本基金的基金经理	2023 年 12 月 20 日	-	15	WANG YANG/王洋先生, 固定收益投资部基金经理。历任贝莱德伦敦基金经理, 贝莱德新加坡指数研究员以及利率/外汇交易员, 美国资管公司股票研究员。王洋/WANG YANG 是金融风险管理师 (FRM) 持证人, 拥有美国伊利诺伊大学厄巴纳-香槟分校金融硕士学位、新加坡国立大学电子工程学士学位。
丁浩航	本基金的基金经理助理	2024 年 1 月 5 日	-	8	丁浩航先生, 固定收益投资部基金经理助理。曾先后于贝莱德日本投资组合分析部担任分析员职务, 贝莱德新加坡风险量化分析部担任经理职务。丁浩航先生是特许金融分析师 (CFA) 持证人, 拥有新加坡南洋理工大学计算机工程和商学学士学位、新加坡国立大学计算机科学硕士学位。

注: 1、此处的任职日期和离任日期均指公司决定生效之日, 首任基金经理, 任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》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

注: 截至本报告期末, 本基金的基金经理不存在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

本基金管理人在本报告期内遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、

证监会规定和本基金基金合同的约定，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，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金无重大违法、违规行为，本基金投资运作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

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有投资组合，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》和公司内部相关公平交易制度等规定。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，未出现涉及本基金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 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

在经济方面，2024 年第一季度 GDP 同比增长 5.3%，第二季度在这个基础上延续恢复的态势。我们看到出口和制造业继续表现强劲。3-5 月份，制造业投资同比增长保持在 9.3%之上。5 月出口同比增速 7.6%，出口价格指数也在二季度维持上升趋势。社会消费零售总额在 5 月受益于五一假期天数增加和 618 提前开卖录得 3.7%的同比增加。房地产在二季度延续回落的态势，2024 年 4 月和 5 月的房地产投资均为同比-10%前后，显示房地产需求持续转弱。价格方面，CPI 同比增长为正，4 月和 5 月均为 0.3%，居民消费需求有限，低通胀格局持续。PPI 同比降幅持续收窄的态势，4 月和 5 月分别为同比-2.5%和-1.4%，预计大宗商品价格和工业品价格提升将继续对 PPI 形成支撑。由于实体部门信贷需求偏弱，政府部门融资滞后，同时央行对资金空转、手工补息等操作的治理，4 月新增社融首次出现负增长，即-658 亿，不过 5 月转正。6 月制造业 PMI 为 49.5%，与 5 月持平，4 月为 50.4%，制造业活动近期落于荣枯线之下。非制造业 PMI 6 月为 50.5%，低于 5 月的 51.1%，虽然滑落但还在扩张区间。总体来看，2024 年第二季度经济动能虽有提振，但内需不足的问题对经济造成持续拖累，是否可以延续恢复有待观察。

央行在货币政策上继续维持宽松政策，公开市场投放均衡。1 月有 5 千亿的 PSL 投放，2 月 5

日降准 50 个基点，2 月 20 日下调 5 年 LPR 25 个基点。银行间发行的 1 年期 AAA 同业存单利率收益率从去年 12 月底的 2.40% 下行到 6 月底的 1.96%。

今年上半年债市表现强劲。第一季度央行超预期的降准和降息，叠加银行理财等机构的配置需求强劲奠定了利率下行的基础。随着多地陆续优化房地产政策和央行对长端债券风险的提示，利率市场在 4 月下旬经历了短暂的调整。之后随着超长国债发行节奏明朗化，政府债券发行滞后，叠加较为超预期的金融数据，利率曲线总体下行，利率曲线走陡，短端表现亮眼，十年国债收益率从去年 12 月底的 2.56% 下行到 6 月底的 2.21%，同时看到 30 年国债向下突破 2.50% 关键点位。

“资产荒”下理财等机构配置继续，对信用债的需求尤为强劲，我们看到各个等级的信用利差和期限利差都持续压缩。AAA 中短期票据 1-5 年期收益率下行约 50-70 个基点不等。

2024 年上半年 A 股市场出现较大的波动，年初市场对经济的担忧叠加上市公司业绩的下滑，A 股市场持续震荡下跌。接近 1 月底随着雪球敲入，负反馈效应放大，微盘股出现恐慌性大跌，沪深 300 也在 2 月初下探至上半年底部位置。在波动中，5 月中下旬沪深 300 达到 2 季度顶点 3703 点，之后由于 5 月公布的金融和经济数据表现低于预期，A 股市场持续回调，截止 6 月底沪深 300 为 3462 点，小盘股表现弱于大盘股。

从配置思路来讲，本基金维持较高杠杆，且债券方面优选高等级高流动性的信用债券，均衡配置于城投及产业债，适当拉长信用久期。股票配置维持中等仓位，重点关注：高股息红利股，供需格局改善的出口企业，有政策长期推动的新兴科技，新质生产力相关个股，有望迎来估值修复行情的周期、金融、石油石化，建筑建材等低估值板块。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金 A 类份额净值 1.0142 元，本报告期内净值增长率 2.03%，同期业绩比较基准收益率 3.37%；截至本报告期末，本基金 C 类份额净值 1.0088 元，本报告期内净值增长率 1.84%，同期业绩比较基准收益率 3.37%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们判断 2024 年下半年经济继续恢复的态势，考虑政策面的支持和央行持续宽货币的基调，房地产有望企稳，财政可超预期发力，居民消费意愿有望提升，全年经济增速还是大概率可以达到 5% 的目标。

利率方面目前看整体仍在持续下行通道中，总体偏乐观。受制于美联储降息节奏和短期汇率压力，央行在降息操作上尽管持保守谨慎态度，但下半年降息仍为大概率事件。债市在这个基础

上，叠加配置压力，信用债预期将会有较好的表现。市场需要关注的风险点包括特殊政府性债券的超量发行，央行对长端收益率及利率曲线的看法以及理财产品出现超预期赎回的风险。

我们预期权益市场将在持续震荡的行情中演绎。内需不足的问题需要时间修复，下半年海外经济放缓可能致使出口链条承压，权益市场或有一些偏主题性的投资机会显现。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，本基金管理人严格按照《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，委托基金服务机构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。基金管理人及委托的基金服务机构严格执行基金估值控制流程，定期评估估值技术的合理性，基金份额净值经基金托管人复核无误后由基金管理人对外披露。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规、本基金基金合同的约定以及基金的实际运作情况，本报告期内本基金未进行收益分配。本基金将严格按照法律法规及基金合同约定进行收益分配。

#### 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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

## § 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：贝莱德欣悦丰利债券型证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	436,647.17	22,598.78
结算备付金		1,086,827.87	1,216,048.89
存出保证金		67,106.40	-
交易性金融资产	6.4.7.2	132,370,055.77	300,831,011.23
其中：股票投资		20,573,091.70	45,089,803.04
基金投资		-	-
债券投资		111,796,964.07	255,741,208.19
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	-	7,279,030.29
应收清算款		-	615,581.93
应收股利		21,712.00	-
应收申购款		69.99	10,000.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		133,982,419.20	309,974,271.12
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024 年 6 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		20,582,300.86	61,560,148.70
应付清算款		426,607.01	7,894.37
应付赎回款		364,044.15	197,174.81
应付管理人报酬		48,646.43	106,032.53
应付托管费		14,593.91	31,809.75
应付销售服务费		9,649.81	24,570.86
应付投资顾问费		-	-
应交税费		6,647.27	25,576.84

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	90,074.68	67,146.60
负债合计		21,542,564.12	62,020,354.46
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	111,010,507.65	249,704,513.70
未分配利润	6.4.7.8	1,429,347.43	-1,750,597.04
净资产合计		112,439,855.08	247,953,916.66
负债和净资产总计		133,982,419.20	309,974,271.12

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，基金份额总额 111,010,507.65 份，其中 A 类基金份额净值 1.0142 元，基金份额 83,465,478.22 份；C 类基金份额净值 1.0088 元，基金份额 27,545,029.43 份。

## 6.2 利润表

会计主体：贝莱德欣悦丰利债券型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 2 月 28 日(基金 合同生效日)至 2023 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		5,076,503.10	2,605,185.76
1. 利息收入		37,752.39	1,100,096.31
其中：存款利息收入	6.4.7.9	30,366.88	447,317.63
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		7,385.51	652,778.68
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		3,364,569.85	5,316,852.82
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-1,146,415.97	-1,061,416.27
基金投资收益	6.4.7.11	-1,996.75	-
债券投资收益	6.4.7.12	4,219,439.31	5,336,633.70
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	10,837.05	-
股利收益	6.4.7.14	282,706.21	1,041,635.39
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	1,674,144.84	-3,811,864.54
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. 16	36. 02	101. 17
<b>减: 二、营业总支出</b>		1, 230, 396. 91	2, 567, 649. 66
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	418, 058. 49	1, 104, 549. 78
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	125, 417. 50	331, 364. 92
3. 销售服务费		94, 144. 38	386, 872. 12
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		475, 167. 09	623, 873. 11
其中: 卖出回购金融资产支出		475, 167. 09	623, 873. 11
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		10, 569. 02	36, 633. 70
8. 其他费用	6. 4. 7. 17	107, 040. 43	84, 356. 03
<b>三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)</b>		3, 846, 106. 19	37, 536. 10
减: 所得税费用		-	-
<b>四、净利润 (净亏损以“-”号填列)</b>		3, 846, 106. 19	37, 536. 10
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		3, 846, 106. 19	37, 536. 10

### 6.3 净资产变动表

会计主体: 贝莱德欣悦丰利债券型证券投资基金

本报告期: 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	249, 704, 513. 70	-1, 750, 597. 04	247, 953, 916. 66
加: 会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
二、本期期初净资产	249, 704, 513. 70	-1, 750, 597. 04	247, 953, 916. 66
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-138, 694, 006. 05	3, 179, 944. 47	-135, 514, 061. 58
(一)、综合收益总额	-	3, 846, 106. 19	3, 846, 106. 19
(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)	-138, 694, 006. 05	-666, 161. 72	-139, 360, 167. 77
其中: 1. 基金申购款	1, 293, 451. 87	13, 076. 36	1, 306, 528. 23

2. 基金赎回款	-139,987,457.92	-679,238.08	-140,666,696.00
(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)	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-
四、本期期末净资产	111,010,507.65	1,429,347.43	112,439,855.08
项目	上年度可比期间 2023年2月28日(基金合同生效日)至2023年6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	803,542,546.27	-	803,542,546.27
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
二、本期期初净资产	803,542,546.27	-	803,542,546.27
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-321,009,642.17	222,075.12	-320,787,567.05
(一)、综合收益总额	-	37,536.1	37,536.1
(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)	-321,009,642.17	184,539.02	-320,825,103.15
其中：1. 基金申购款	130,001.51	-25.58	129,975.93
2. 基金赎回款	-321,139,643.68	184,564.60	-320,955,079.08
(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)	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-
四、本期期末净资产	482,532,904.10	222,075.12	482,754,979.22

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：

陈剑

杨怡

杨怡

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

贝莱德欣悦丰利债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2022]1953 号《关于准予贝莱德欣悦丰利债券型证券投资基金注册的批复》准予注册,由贝莱德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《贝莱德欣悦丰利债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,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 803,250,730.06 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2023)第 0063 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《贝莱德欣悦丰利债券型证券投资基金基金合同》于 2023 年 2 月 28 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 803,542,546.27 份基金份额,其中认购资金利息折合 291,816.21 份基金份额。本基金的基金管理人为贝莱德基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行银行股份有限公司。

根据《贝莱德欣悦丰利债券型证券投资基金基金合同》和《贝莱德欣悦丰利债券型证券投资基金招募说明书》,本基金根据认购/申购费用、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。其中:在投资者认购、申购时收取认购、申购费用,在赎回时根据持有期限收取赎回费用,但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为 A 类基金份额;从本类别基金资产中计提销售服务费而不收取认购/申购费用,在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额,称为 C 类基金份额。本基金 A 类和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同,本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值,计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《贝莱德欣悦丰利债券型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括主板、创业板及其他中国证监会允许上市的股票、存托凭证)、港股通标的股票、债券(国债、金融债、企业债、公司债、政府支持债券、政府支持机构债券、可转换债券(含可分离交易可转换债券)、可交换债券、次级债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等)、资产支持证券、金融衍生品(包括国债期货、信用衍生品等)、经中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金(仅包括全市场的境内股票型 ETF 和本基金基金管理人旗下的权益类基金,不包括 QDII 基金、香港互认基金、基金中基金、其他可投资公募基金的非基金中基金、货币市场基金)、债券回购、银行存款(包括定期存款、协议存款、通知存款等)、同业存单、现金等货币市场工具,以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金的投资组合比例为:本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的 80%,本基金对股票(含存托

凭证)、权益类基金、可转换债券及可交换债券的投资比例合计不超过基金资产的 20%，港股通标的股票的投资比例为股票资产的 0%-50%；本基金持有其他基金，其市值不超过基金资产净值的 10%；每个交易日日终在扣除国债期货合约所需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。前述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：中债综合财富(总值)指数收益率 $\times$ 85%+沪深 300 指数收益率 $\times$ 10%+一年期定期存款利率(税后) $\times$ 5%。

本财务报表由本基金的基金管理人贝莱德基金管理有限公司于 2024 年 08 月 30 日批准报出。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、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>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《贝莱德欣悦丰利债券型证券投资基金基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2024 年上半年度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 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及 2024 年上半年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《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]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对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，股票的股息、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。

(3) 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。对基金从上市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。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20%的税率代扣个人所得税。

(4) 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。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

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

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	6,377.91
等于：本金	6,350.96
加：应计利息	26.95
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
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	430,269.26
等于：本金	430,248.36
加：应计利息	20.9
合计	436,647.17

注：其他存款为存放在证券经纪商的证券交易结算资金。

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	20,147,639.20	-	20,573,091.70	425,452.50

贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	42,992,966.70	660,147.84	43,565,937.84	-87,176.70
	银行间市场	65,720,328.92	1,379,026.23	68,231,026.23	1,131,671.08
	合计	108,713,295.62	2,039,174.07	111,796,964.07	1,044,494.38
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		128,860,934.82	2,039,174.07	132,370,055.77	1,469,946.88

### 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

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-4,185,700.00	-	-	-
其中：国债期货	-4,185,700.00	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-4,185,700.00	-	-	-

#### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
T2409	T2409	-2.00	-2,107,200.00	-1,400.00
TF2409	TF2409	-2.00	-2,080,200.00	-300.00
合计	-	-	-	-1,700.00
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	-1,700.00
净额	-	-	-	-

### 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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

#### 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从买断式逆回购交易中取得的债券。

### 6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	3,053.20
其中：交易所市场	-
银行间市场	3,053.20
应付利息	-
预提费用	-
信息披露费	59,672.34
审计费用	27,349.14
其他	-
合计	90,074.68

### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

贝莱德欣悦丰利债券 A		
项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	176,505,776.20	176,505,776.20
本期申购	445,906.86	445,906.86
本期赎回（以“-”号填列）	-93,486,204.84	-93,486,204.84
本期末	83,465,478.22	83,465,478.22

金额单位：人民币元

贝莱德欣悦丰利债券 C		
项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	73,198,737.50	73,198,737.50
本期申购	847,545.01	847,545.01
本期赎回（以“-”号填列）	-46,501,253.08	-46,501,253.08
本期末	27,545,029.43	27,545,029.43

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

贝莱德欣悦丰利债券 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-1,965,723.73	899,921.71	-1,065,802.02
本期期初	-1,965,723.73	899,921.71	-1,065,802.02
本期利润	1,660,247.61	1,043,683.47	2,703,931.08
本期基金份额交易产生的变动数	741,184.69	-1,192,200.30	-451,015.61
其中：基金申购款	781.82	7,439.74	8,221.56
基金赎回款	740,402.87	-1,199,640.04	-459,237.17
本期已分配利润	-	-	-
本期末	435,708.57	751,404.88	1,187,113.45

单位：人民币元

贝莱德欣悦丰利债券 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-1,055,604.26	370,809.24	-684,795.02
本期期初	-1,055,604.26	370,809.24	-684,795.02
本期利润	511,713.74	630,461.37	1,142,175.11
本期基金份额交易产生的变动数	539,442.45	-754,588.56	-215,146.11
其中：基金申购款	-8,788.90	13,643.70	4,854.80
基金赎回款	548,231.35	-768,232.26	-220,000.91
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-4,448.07	246,682.05	242,233.98

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	1,098.66
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	378.56
结算备付金利息收入	28,889.66
其他	-
合计	30,366.88

注：其他存款利息收入为存放在证券经纪商的证券交易结算资金的利息收入。

**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**

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	58,912,182.25
减：卖出股票成本总额	59,949,826.85
减：交易费用	108,771.37
买卖股票差价收入	-1,146,415.97

**6.4.7.11 基金投资收益**

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
卖出/赎回基金成交总额	660,000.00
减：卖出/赎回基金成本总额	660,940.00
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	-
减：交易费用	1,056.75
基金投资收益	-1,996.75

**6.4.7.12 债券投资收益****6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	3,235,102.19
债券投资收益——买卖债券(债转股及债券到期兑付)差价收入	984,337.12
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	4,219,439.31

**6.4.7.12.2 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 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
卖出债券(债转股及债券到期兑付)成交总额	211,344,878.67
减：卖出债券(债转股及债券到期兑付)成本总额	206,165,835.20
减：应计利息总额	4,176,020.43

减：交易费用	18,685.92
买卖债券差价收入	984,337.12

#### 6.4.7.12.3 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。

#### 6.4.7.12.4 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。

#### 6.4.7.13 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
黄金延期合约投资收益	-
外汇远期投资收益	-
股指期货投资收益	-
国债期货投资收益	10,837.05

#### 6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	282,706.21
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	282,706.21

#### 6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
1. 交易性金融资产	1,675,844.84
——股票投资	1,708,824.60
——债券投资	-32,979.76
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-1,700.00
——权证投资	-

——国债期货	-1,700.00
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	1,674,144.84

#### 6.4.7.16 其他收入

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
赎回费收入	21.81
转换费收入	14.21
合计	36.02

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 50% 归入基金资产。

#### 6.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
审计费用	27,349.14
信息披露费	59,672.34
律师费	-
账户维护费	18,600.00
持有人大会费用	-
汇划手续费	1,344.07
开户费	-
证券出借违约金	-
证券组合费	74.88
合计	107,040.43

### 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，本基金并无须作披露的或有事项。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并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
贝莱德基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人、基金代销机构、注册登记机构

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 本报告期的关联方交易

### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行交易。

### 6.4.10.2 关联方报酬

#### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年 6月30日	上年度可比期间 2023年2月28日(基金合同生 效日)至2023年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	418,058.49	1,104,549.78
其中：应支付销售机构的客户维护费	208,838.69	539,623.21
应支付基金管理人的净管理费	209,219.80	564,926.57

注：支付基金管理人贝莱德基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.50%/当年天数。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6 月30日	上年度可比期间 2023年2月28日(基金合同生 效日)至2023年6月30日
当期发生的基金应支付的 托管费	125,417.50	331,364.92

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.15 %的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值×0.15 %/当年天数。

**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名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	贝莱德欣悦丰利债券 A	贝莱德欣悦丰利债券 C	合计
中国建设银行	-	92,677.09	92,677.09
合计	-	92,677.09	92,677.09
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2023 年 2 月 28 日(基金合同生效日)至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	贝莱德欣悦丰利债券 A	贝莱德欣悦丰利债券 C	合计
中国建设银行	-	384,493.01	384,493.01
合计	-	384,493.01	384,493.01

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.40% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日销售服务费 = 前一日 C 类基金份额的基金资产净值 × 0.40% / 当年天数。

**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**

本基金本报告期及上年度可比期间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**

本基金本报告期及上年度可比期间未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**

本基金本报告期及上年度可比期间未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**

本基金管理人在本报告期内及上年度可比期间未运用固有资金投资本基金。

**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**

本基金本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

**6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 2 月 28 日(基金合同生效日)至 2023 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	6,377.91	1,098.66	4,685.67	22,605.23

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

**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无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

**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其他关联交易事项。

**6.4.11 利润分配情况**

本基金本报告期内未进行利润分配。

**6.4.12 期末（2024 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券****6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券的流通受限证券。

**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 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 10,003,914.50 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值 单价	数量（张）	期末估值总额
102281773	22 首钢 MTN005	2024 年 7 月 2 日	104.27	12,000	1,251,199.48
102382976	23 无锡建投 MTN003	2024 年 7 月 2 日	103.59	100,000	10,358,836.07

合计				112,000	11,610,035.55
----	--	--	--	---------	---------------

#### 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，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 10,578,386.36 元，于 2024 年 07 月 01 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

本基金本报告期末无参与转融通出借业务的证券。

### 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，在通常情况下其预期风险和收益低于股票型基金和混合型基金，高于货币市场基金。本基金如果投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。本基金主要投资于依法发行上市的股票、港股通标的股票、债券等金融工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金在日常投资管理中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建立，建立了由董事会、公司管理层、风险管理部门和业务职能部门构成的四级风险管理组织架构，并明确了相应的风险管理职能。董事会对风险管理的责任包括制定业务战略和风险管理目标、审阅重大事件和决策的风险评估等；管理层负责风险管理政策、风险控制措施的制定和落实，确保有效管理所有重大风险，下设风险管理委员会，根据董事会和管理层的授权开展风险管理工作；风险管理部门负责风险评估、报告、监控和管理，主要职责包括制定公司风险管理制度和程序、实施定量和定性的风险评估等；业务职能部门从经营管理的各业务环节上贯彻落实风险管理措施。在业务操作层面，各部门积极配合风险管理部门完成运作风险管理，其他中后台部门包括但不限于财务、合规稽核和运营等部门在各自职能范围内支持或监督公司风险管理。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要通过定性和定量相结合的分析方法去评估各种相关风险可能造成的影响。从定性分析的角度触发，判断风险的种类、风险损失的严重

程度和出现同类风险损失的频度。从定量分析的角度触发，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、模型和日常风险报告等，确定基金资产的风险状态及其是否符合基金的风险特征，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、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。本基金的银行存款存放在本基金的托管人建设银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

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

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
A-1	-	10,391,131.15
A-1 以下	-	-
未评级	5,201,252.46	25,564,513.66
合计	5,201,252.46	35,955,644.81

注：本报告期末，未评级债券主要包括其他企业短期融资债。

##### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末无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

注：本基金本报告期末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

##### 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	上年度末
--------	-----	------

	2024 年 6 月 30 日	2023 年 12 月 31 日
AAA	78,363,098.92	76,347,817.58
AAA 以下	-	10,347,536.99
未评级	20,854,278.69	117,924,107.11
合计	99,217,377.61	204,619,461.68

注：本报告期末，未评级债券主要包括中期票据。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末无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

注：本基金本报告期末无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在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

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

于 2024 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额中有 20,582,300.86 元将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额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》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 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发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上

上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制）。

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，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例符合法律法规的相关要求。

本基金的基金管理人每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。于 2024 年 6 月 30 日，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

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

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量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固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以 上	不计息	合计
资产					
货币资金	436,647.17	-	-	-	436,647.17
结算备付金	1,086,827.87	-	-	-	1,086,827.87
存出保证金	67,106.40	-	-	-	67,106.40
交易性金融 资产	27,927,102.90	83,869,861.17	-	20,573,091.70	132,370,055.77
买入返售金 融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	21,712.00	21,712.00
应收申购款	-	-	-	69.99	69.99
其他资产	-	-	-	-	-
<b>资产总计</b>	<b>29,517,684.34</b>	<b>83,869,861.17</b>	<b>-</b>	<b>20,594,873.69</b>	<b>133,982,419.20</b>
负债					
交易性金融 负债	-	-	-	-	-
卖出回购金 融资产款	20,582,300.86	-	-	-	20,582,300.86
应付清算款	-	-	-	426,607.01	426,607.01
应付赎回款	-	-	-	364,044.15	364,044.15
应付管理人 报酬	-	-	-	48,646.43	48,646.43
应付托管费	-	-	-	14,593.91	14,593.91
应付销售服 务费	-	-	-	9,649.81	9,649.81
应交税费	-	-	-	6,647.27	6,647.27
其他负债	-	-	-	90,074.68	90,074.68
<b>负债合计</b>	<b>20,582,300.86</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>960,263.26</b>	<b>21,542,564.12</b>
利率敏感度 缺口	8,935,383.48	83,869,861.17	-	19,634,610.43	112,439,855.08
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以 上	不计息	合计
资产					
货币资金	22,598.78	-	-	-	22,598.78
结算备付金	1,216,048.89	-	-	-	1,216,048.89
存出保证金	-	-	-	-	-

交易性金融资产	92,049,686.59	163,691,521.60	-	45,089,803.04	300,831,011.23
买入返售金融资产	7,279,030.29	-	-	-	7,279,030.29
应收清算款	-	-	-	615,581.93	615,581.93
应收申购款	-	-	-	10,000.00	10,000.00
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	100,567,364.55	163,691,521.60	-	45,715,384.97	309,974,271.12
负债					
卖出回购金融资产款	61,560,148.70	-	-	-	61,560,148.70
应付清算款	-	-	-	7,894.37	7,894.37
应付赎回款	-	-	-	197,174.81	197,174.81
应付管理人报酬	-	-	-	106,032.53	106,032.53
应付托管费	-	-	-	31,809.75	31,809.75
应付销售服务费	-	-	-	24,570.86	24,570.86
应交税费	-	-	-	25,576.84	25,576.84
其他负债	-	-	-	67,146.60	67,146.60
负债总计	61,560,148.70	-	-	460,205.76	62,020,354.46
利率敏感度缺口	39,007,215.85	163,691,521.60	-	45,255,179.21	247,953,916.66

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约定的到期日予以分类。

#### 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6月30日	上年度末 2023年12月31日
	市场利率上升25个基点	-452,470.04	-671,977.85
	市场利率下降25个基点	456,290.66	676,072.55

#### 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。本基金持有不以记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	3,912,065.92	-	3,912,065.92
应收股利	-	-	-	-
资产合计	-	3,912,065.92	-	3,912,065.92
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	3,912,065.92	-	3,912,065.92
项目	上年度末 2023 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	3,384,436.28	-	3,384,436.28
资产合计	-	3,384,436.28	-	3,384,436.28
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	3,384,436.28	-	3,384,436.28

### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇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 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
	所有外币相对人民币升值 5%	195,603.30	169,221.81
	所有外币相对人民币贬值 5%	-195,603.30	-169,221.81

### 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汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在注重严格风险控制的基础上，动态调整资产配置，使风险和预期目标相匹配，并选择符合基金合同约定范围内的投资品种进行投资。同时，本基金充分发挥基金管理人的研究优势，通过对经济发展、社会结构、宏观政策、产业政策和科学技术的跟踪研究，将定性分析和定量模型相结合，根据投资策略或市场环境的变化构建和管理投资组合，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金对股票(含存托凭证)、权益类基金、可转换债券及可交换债券的投资比例合计不超过基金资产的 20%，港股通标的股票的投资比例为股票资产的 0%-50%；本基金持有其他基金，其市值不超过基金资产净值的 10%；每个交易日日终在扣除国债期货合约所需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。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，以识别和测算本基金面临的潜在价格风险，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

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 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	20,573,091.70	18.30	45,089,803.04	18.18
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
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	20,573,091.70	18.30	45,089,803.04	18.18

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准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 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	7,586,718.88	-
	业绩比较基准下降 5%	-7,586,718.88	-

注：于 2023 年 12 月 31 日，本基金成立尚未满一年，无足够历史经验数据计算其他价格风险对基金资产净值的影响。

#### 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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	20,573,091.70	45,089,803.04
第二层次	111,796,964.07	255,741,208.19
第三层次	-	-
合计	132,370,055.77	300,831,011.23

###### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

###### 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 6 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资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

#### **6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**

截止资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	20,573,091.70	15.36
	其中：股票	20,573,091.70	15.36
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	111,796,964.07	83.44
	其中：债券	111,796,964.07	83.44
	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	1,523,475.04	1.14
8	其他资产	88,888.39	0.07
9	合计	133,982,419.20	100.00

注：1、本基金通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 3,912,065.92 元，占资产净值比例为 3.48%。

2、本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

3、本基金本报告期末未持有全国中小企业股份转让系统挂牌股票。

### 7.2 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

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	187,480.00	0.17
B	采矿业	1,422,425.00	1.27
C	制造业	12,783,891.98	11.37
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	216,239.00	0.19
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	176,760.00	0.16
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	756,071.80	0.67

J	金融业	1,118,158.00	0.99
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	16,661,025.78	14.82

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
主要消费	-	-
金融	1,695,604.28	1.51
原材料	-	-
通信服务	785,415.90	0.70
信息技术	-	-
能源	1,100,874.62	0.98
公用事业	-	-
房地产	-	-
工业	330,171.12	0.29
医药卫生	-	-
可选消费	-	-
合计	3,912,065.92	3.48

注：以上分类采用中证行业分类标准。

### 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600160	巨化股份	39,004	941,166.52	0.84
2	00857	中国石油股份	130,000	937,322.36	0.83
3	601899	紫金矿业	48,700	855,659.00	0.76
4	300750	宁德时代	4,100	738,123.00	0.66

5	603195	公牛集团	9,051	698,013.12	0.62
6	00941	中国移动	9,500	667,625.42	0.59
7	600522	中天科技	37,500	594,375.00	0.53
8	605117	德业股份	7,800	579,852.00	0.52
9	600737	中粮糖业	59,700	572,523.00	0.51
10	600547	山东黄金	20,700	566,766.00	0.50
11	000338	潍柴动力	34,700	563,528.00	0.50
12	603606	东方电缆	11,500	561,315.00	0.50
13	601100	恒立液压	12,000	558,960.00	0.50
14	00998	中信银行	112,000	512,123.00	0.46
15	01398	工商银行	114,000	482,771.21	0.43
16	03988	中国银行	117,000	411,116.71	0.37
17	601600	中国铝业	52,400	399,812.00	0.36
18	603486	科沃斯	8,400	396,312.00	0.35
19	600406	国电南瑞	15,580	388,876.80	0.35
20	002371	北方华创	1,200	383,868.00	0.34
21	002318	久立特材	16,300	380,279.00	0.34
22	600801	华新水泥	27,600	379,500.00	0.34
23	600422	昆药集团	21,200	377,996.00	0.34
24	600585	海螺水泥	16,000	377,440.00	0.34
25	002003	伟星股份	30,000	376,500.00	0.33
26	002372	伟星新材	24,400	376,248.00	0.33
27	600036	招商银行	11,000	376,090.00	0.33
28	002126	银轮股份	21,600	376,056.00	0.33
29	603379	三美股份	9,600	375,744.00	0.33
30	002966	苏州银行	50,000	375,000.00	0.33
31	300580	贝斯特	25,462	374,291.40	0.33
32	600845	宝信软件	11,500	367,195.00	0.33
33	601881	中国银河	33,800	367,068.00	0.33
34	300856	科思股份	11,300	361,713.00	0.32
35	600519	贵州茅台	200	293,478.00	0.26
36	01288	农业银行	95,000	289,593.36	0.26
37	002756	永兴材料	6,500	232,570.00	0.21
38	600795	国电电力	36,100	216,239.00	0.19
39	002475	立讯精密	5,300	208,343.00	0.19
40	000999	华润三九	4,520	192,461.60	0.17
41	600809	山西汾酒	900	189,792.00	0.17
42	002714	牧原股份	4,300	187,480.00	0.17
43	000657	中钨高新	20,500	187,370.00	0.17

44	300705	九典制药	7,000	187,180.00	0.17
45	002484	江海股份	14,100	186,825.00	0.17
46	600276	恒瑞医药	4,800	184,608.00	0.16
47	688036	传音控股	2,321	177,649.34	0.16
48	603939	益丰药房	7,200	176,760.00	0.16
49	00883	中国海洋石油	8,000	163,552.26	0.15
50	00762	中国联通	18,000	117,790.48	0.10
51	03969	中国通号	37,000	113,464.38	0.10
52	00257	光大环境	31,000	110,908.87	0.10
53	01766	中国中车	23,000	105,797.87	0.09

## 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	600941	中国移动	1,055,029.00	0.43
2	300750	宁德时代	986,268.00	0.40
3	002466	天齐锂业	968,331.00	0.39
4	603486	科沃斯	946,737.00	0.38
5	601398	工商银行	902,180.00	0.36
6	600522	中天科技	862,038.00	0.35
7	000725	京东方 A	833,040.00	0.34
8	002756	永兴材料	713,717.00	0.29
9	000333	美的集团	690,966.00	0.28
10	000951	中国重汽	689,628.00	0.28
11	000100	TCL 科技	686,070.00	0.28
12	600933	爱柯迪	674,881.00	0.27
13	600547	山东黄金	659,885.00	0.27
14	00941	中国移动	655,262.94	0.26
15	002484	江海股份	636,160.00	0.26
16	600737	中粮糖业	629,890.00	0.25
17	603379	三美股份	618,900.00	0.25
18	600563	法拉电子	599,962.00	0.24
19	600795	国电电力	596,750.00	0.24

20	002318	久立特材	580,046.00	0.23
----	--------	------	------------	------

注：“买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例（%）
1	601398	工商银行	2,499,310.00	1.01
2	600809	山西汾酒	1,987,241.00	0.80
3	00857	中国石油股份	1,952,252.41	0.79
4	603195	公牛集团	1,941,788.00	0.78
5	600160	巨化股份	1,763,721.50	0.71
6	600519	贵州茅台	1,521,169.00	0.61
7	600426	华鲁恒升	1,408,391.00	0.57
8	603379	三美股份	1,272,082.00	0.51
9	002050	三花智控	1,261,688.00	0.51
10	600795	国电电力	1,197,538.00	0.48
11	600941	中国移动	1,109,188.00	0.45
12	601899	紫金矿业	1,078,140.00	0.43
13	601988	中国银行	1,030,798.00	0.42
14	603129	春风动力	1,017,981.00	0.41
15	601100	恒立液压	973,599.00	0.39
16	688169	石头科技	964,676.00	0.39
17	600378	昊华科技	961,827.00	0.39
18	000338	潍柴动力	942,113.00	0.38
19	600422	昆药集团	922,330.00	0.37
20	000408	藏格矿业	904,982.00	0.36

注：“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	33,724,290.91
卖出股票收入（成交）总额	58,912,182.25

注：“买入股票成本（成交）总额”和“卖出股票收入（成交）总额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

**7.5 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	7,378,334.00	6.56
2	央行票据	-	-
3	金融债券	21,277,734.42	18.92
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	36,187,603.84	32.18
5	企业短期融资券	5,201,252.46	4.63
6	中期票据	41,752,039.35	37.13
7	可转债	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	111,796,964.07	99.43

**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**

序号	债券代码	债券名称	数量	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	242380019	23 邮储永续债 01	100,000	10,714,865.57	9.53
2	092280086	22 农行永续债 02	100,000	10,562,868.85	9.39
3	102382279	23 鄂交投 MTN002	100,000	10,495,442.62	9.33
4	102282555	22 成都高新 MTN002	100,000	10,471,098.36	9.31
5	102281773	22 首钢 MTN005	100,000	10,426,662.30	9.27

**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**

注：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**

注：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**

注：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**

根据本基金的基金合同约定，本基金的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

本基金投资国债期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场定性和定量的分析，对国债期货和现货基差、国债期货的流动性、波动水平等指标进行跟踪监控。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金在上半年利率快速下行、偏离长期公允价值的情况下进行了国债期货套期保值交易，适当适时降低基金久期风险，并且在利率回归公允价值时结束套期保值交易。本报告期内，本基金投资国债期货符合既定的投资政策和投资目的。

## 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未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

### 7.12.2

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

### 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（元）
1	存出保证金	67,106.40
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	21,712.00
4	应收利息	-
5	应收申购款	69.99
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	88,888.39

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：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

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 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，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
贝莱德欣悦丰利债券 A	712	117,226.80	99,450.25	0.12%	83,366,027.97	99.88%
贝莱德欣悦丰利债券 C	222	124,076.71	0.00	0.00%	27,545,029.43	100.00%
合计	934	118,854.93	99,450.25	0.09%	110,911,057.40	99.91%

注：分级基金机构/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，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 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	贝莱德欣悦丰利债券 A	15,156.69	0.0182%
	贝莱德欣悦丰利债券 C	50,038.89	0.1817%
	合计	65,195.58	0.0587%

注：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，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 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的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	贝莱德欣悦丰利债券 A	0
	贝莱德欣悦丰利债券 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	贝莱德欣悦丰利债券 A	0
	贝莱德欣悦丰利债券 C	0

	合计	0
--	----	---

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	贝莱德欣悦丰利债券 A	贝莱德欣悦丰利债券 C
基金合同生效日（2023 年 2 月 28 日） 基金份额总额	432,215,451.18	371,327,095.09
本报告期期初基金份额总额	176,505,776.20	73,198,737.50
本报告期基金总申购份额	445,906.86	847,545.01
减：本报告期基金总赎回份额	93,486,204.84	46,501,253.08
本报告期基金拆分变动份额（份额减少 以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	83,465,478.22	27,545,029.43

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内，基金管理人的重大人事变动如下：

- 1、2024 年 2 月 1 日起，范华女士担任公司董事长，张弛先生不再代为履行董事长职务；
- 2、2024 年 2 月 23 日起，张弛先生不再担任公司总经理，陈剑先生代为履行公司总经理职务；
- 3、2024 年 3 月 5 日起，陈剑先生担任公司总经理，不再担任公司督察长，并代为履行督察长职务。

本基金管理人已在规定信息披露媒介登载了高级管理人员变更公告。上述变更事项已按有关规定向监管机构报备。

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事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，为本基金进行审计的机构未发生变化，为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）。

### 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

注：本报告期内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

注：本报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

## 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	
		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
中信证券（山东）有限责任公司	2	92,636,473.16	100.00	90,628.58	100.00

注：1、此处的佣金指通过单一券商的交易单元进行股票、债券、债券回购、权证等交易（如有）而合计支付该券商的佣金合计，不单指股票交易佣金。

2、根据《关于新设公募基金管理人证券交易模式转换有关事项的通知》（证监办发[2019]14号）的有关规定，基金产品管理人可选择一家或多家证券公司开展证券交易，并可免于执行《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》第二条“一家基金管理公司通过一家证券公司的交易席位买卖证券的年交易佣金，不得超过其当年所有基金买卖证券交易佣金的 30%”的分仓规定。

3、本基金管理人选择财务状况良好、经营行为规范、研究实力较强、能满足公募基金采用券商交易模式进行证券交易和结算需要的证券公司作为本基金的证券经纪商。

4、本基金管理人与选择的证券经纪商、本基金的托管人签订证券经纪服务协议，对账户管理、资金存管、交易执行、交易管理、佣金收取、清算交收、违约责任等作出约定。

### 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
中信证券（山东）有限责任公司	94,481,838.99	100.00	597,624,000.00	100.00	0.00	0.00	1,320,940.00	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	关于聘任贝莱德欣悦丰利债券型证券投资基金基金经理助理的公告	中国证监会规定媒介	2024-1-5

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
2	贝莱德欣悦丰利债券型证券投资基金(A类份额)基金产品资料概要更新(2024年第1号)	中国证监会规定媒介	2024-1-20
3	贝莱德欣悦丰利债券型证券投资基金(C类份额)基金产品资料概要更新(2024年第1号)	中国证监会规定媒介	2024-1-20
4	贝莱德欣悦丰利债券型证券投资基金招募说明书更新(2024年第1号)	中国证监会规定媒介	2024-1-20
5	贝莱德欣悦丰利债券型证券投资基金2023年第4季度报告	中国证监会规定媒介	2024-1-22
6	贝莱德基金管理有限公司关于董事长任职的公告	中国证监会规定媒介	2024-2-1
7	贝莱德基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会规定媒介	2024-2-24
8	贝莱德基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会规定媒介	2024-3-6
9	贝莱德欣悦丰利债券型证券投资基金2023年年度报告	中国证监会规定媒介	2024-3-30
10	贝莱德欣悦丰利债券型证券投资基金2024年第1季度报告	中国证监会规定媒介	2024-4-22
11	贝莱德欣悦丰利债券型证券投资基金招募说明书更新(2024年第2号)	中国证监会规定媒介	2024-6-29
12	贝莱德欣悦丰利债券型证券投资基金(A类份额)基金产品资料概要更新(2024年第2号)	中国证监会规定媒介	2024-6-29
13	贝莱德欣悦丰利债券型证券投资基金(C类份额)基金产品资料概要更新(2024年第2号)	中国证监会规定媒介	2024-6-29

## § 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

注：本基金本报告期内未发生单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

### 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、本基金的中国证监会批准募集文件
- 2、本基金的基金合同
- 3、本基金的招募说明书
- 4、本基金的托管协议
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、本基金的公告
- 7、中国证监会要求的其他文件

### 12.2 存放地点

基金管理人的办公场所：中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路 1233 号汇亚大厦 7 楼 702 室。

### 12.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人网站（[www.blackrock.com.cn](http://www.blackrock.com.cn)）查阅，或在营业时间内至基金管理人办公场所免费查阅。

贝莱德基金管理有限公司

2024 年 8 月 31 日