

淳厚安心 87 个月定期开放债券型证券投资基金

2021 年中期报告

2021 年 06 月 30 日

基金管理人:淳厚基金管理有限公司

基金托管人:兴业银行股份有限公司

送出日期:2021 年 08 月 30 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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年8月27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。

本报告财务资料未经审计。

本报告期自2021年01月01日起至2021年06月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
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	11
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	12
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
§5 托管人报告	12
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	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§6 中期财务会计报告(未经审计)	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 所有者权益(基金净值)变动表	16
6.4 报表附注	17
§7 投资组合报告	40
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	41
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	42
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	43
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	43
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	43
7.12 投资组合报告附注	43
§8 基金份额持有人信息	44
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.....	44
§9 开放式基金份额变动.....	44
§10 重大事件揭示.....	45
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.....	45
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	45
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.....	45
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	45
10.8 其他重大事件.....	46
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	47
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.....	47
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	47
§12 备查文件目录.....	47
12.1 备查文件目录.....	47
12.2 存放地点.....	48
12.3 查阅方式.....	48

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	淳厚安心87个月定期开放债券型证券投资基金
基金简称	淳厚安心87个月定开债
基金主代码	010627
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020年11月26日
基金管理人	淳厚基金管理有限公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	7,749,998,074.56份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金封闭期内采取买入持有到期投资策略，投资于剩余期限（或回售期限）不超过基金剩余封闭期的固定收益类工具，力求基金资产的稳健增值。
投资策略	1、封闭期投资策略；2、开放期投资策略
业绩比较基准	该封闭期起始日公布的三年期定期存款利率（税后）+0.75%
风险收益特征	本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，但低于混合型基金、股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	淳厚基金管理有限公司	兴业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	谢芳
	联系电话	021-60607066
	电子邮箱	xiefang@purekindfund.com
客户服务电话	4000009738	95561
传真	021-60607060	021-62159217
注册地址	上海市虹口区临潼路170号60	福州市湖东路154号

	7室	
办公地址	上海市浦东新区丁香路778号 丁香国际大厦西塔7F	上海市银城路167号兴业大厦 4楼
邮政编码	200135	200120
法定代表人	邢媛	吕家进

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.purekindfund.com/
基金中期报告备置地点	上海市浦东新区丁香路778号丁香国际大厦西塔7F

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	淳厚基金管理有限公司	上海市浦东新区丁香路778号丁香国际大厦西塔7F

§ 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 (2021年01月01日- 2021年06月30日)
	本期已实现收益
本期利润	151,861,984.57
加权平均基金份额本期利润	0.0196
本期加权平均净值利润率	1.95%
本期基金份额净值增长率	1.97%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2021年06月30日)

期末可供分配利润	31,168,489.01
期末可供分配基金份额利润	0.0040
期末基金资产净值	7,781,166,563.57
期末基金份额净值	1.0040
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2021年06月30日)
基金份额累计净值增长率	2.21%

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

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，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、本基金基金合同生效日为2020年11月26日，合同生效当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

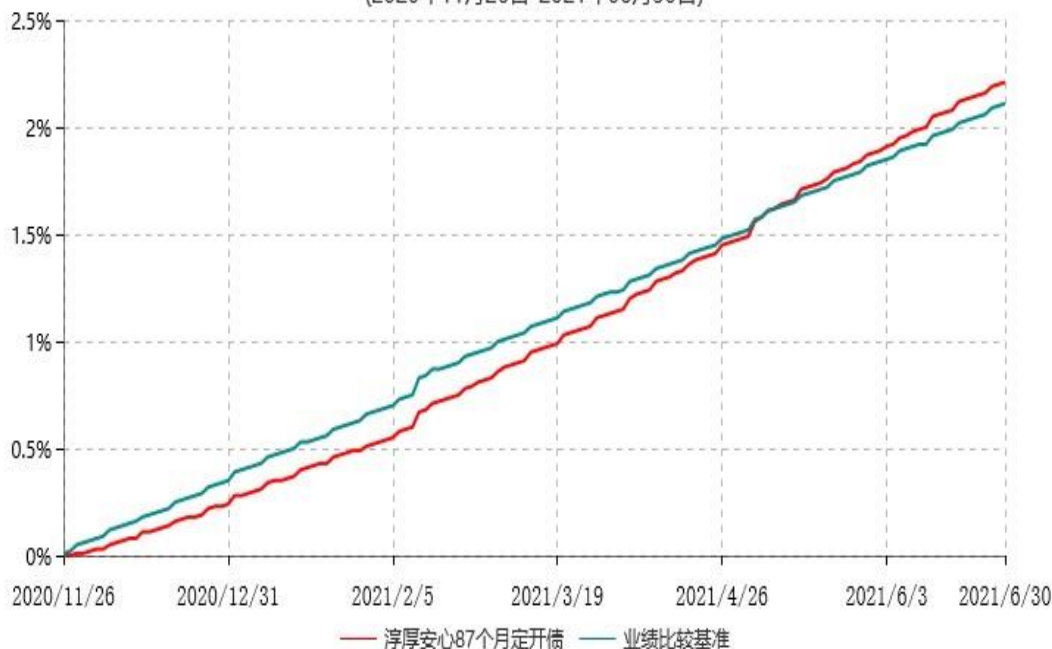
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.34%	0.01%	0.29%	0.01%	0.05%	0.00%
过去三个月	1.07%	0.01%	0.87%	0.01%	0.20%	0.00%
过去六个月	1.97%	0.01%	1.75%	0.01%	0.22%	0.00%
自基金合同生效起至今	2.21%	0.01%	2.11%	0.01%	0.10%	0.00%

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

淳厚安心87个月定期开放债券型证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2020年11月26日-2021年06月30日)



注：1) 本基金合同于2020年11月26日生效，至报告期末未满1年。
2) 按照本基金的基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。截至本报告期末本基金已完成建仓，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

§ 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

淳厚基金管理有限公司经中国证监会证监许可【2018】1618号文批准，于2018年11月3日成立，是由六位资深专业人士发起设立的公募基金管理公司。公司注册地上海，注册资本为1亿元人民币。公司于2019年2月1日取得中国证券监督管理委员会核发的《经营证券期货业务许可证》。

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		
祁洁萍	基金经理	2020-11-26	-	13年	东华大学理学硕士。曾任永

					<p>赢基金管理有限公司固定收益部固定收益总监，光大证券股份有限公司证券投资总部投资顾问、执行董事，平安证券有限责任公司研究所债券研究员。2018年加入淳厚基金，现任淳厚基金管理有限公司固定收益部总监、淳厚中短债债券型证券投资基金基金经理、淳厚稳鑫债券型证券投资基金基金经理、淳厚安裕87个月定期开放债券型证券投资基金、淳厚安心87个月定期开放债券型证券投资基金基金经理、淳厚稳嘉债券型证券投资基金基金经理、淳厚益加增强债券型证券投资基金基金经理、淳厚稳悦债券型证券投资基金基金经理。</p>
江文军	基金经理	2020-12-24	-	6年	<p>上海财经大学经济学硕士。曾任永赢基金管理有限公司专户投资经理。2018年加入淳厚基金，现任淳厚基金管理有限公司淳厚稳惠债券型证券投资基金基金经理、淳厚中短债债券型证券投资基金基金经理、淳厚稳鑫债券型证券投资基金基金经理、淳厚安裕87个月定期开放债券型证券投资基金基金经理、淳厚安心87个月定期开放债券型证券投资基金基金经理、淳厚稳嘉</p>

					债券型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	----------------

注：1、本基金首任基金经理的任职日期为本基金合同生效日，后任基金经理的任职日期以及历任基金经理的离任日期为公司相关会议作出决定的公告（生效）日期；
2、证券从业年限计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》中关于证券从业人员范围的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、本基金《基金合同》等法律文件和其他相关法律法规的规定，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，力争为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定，无损害基金份额持有人利益的行为。

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

基金管理人制定了严格的投资控制制度和公平交易监控制度来保证旗下基金运作的公平，旗下所管理的所有资产组合，包括证券投资基金和私募资产管理计划均严格遵循制度进行公平交易。

公司建立资源共享的投资研究信息平台，确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。公司在交易执行环节实行集中交易制度，建立公平的交易分配制度。对于交易所公开竞价交易，遵循“时间优先、价格优先、比例分配”的原则，全部通过交易系统进行比例分配；对于非集中竞价交易、以公司名义进行的场外交易，遵循“价格优先、比例分配”的原则按事前独立确定的投资方案对交易结果进行分配。

公司交易部和监察稽核部进行日常投资交易行为监控，监察稽核部负责对各账户公平交易进行事后分析，于每季度和每年度分别对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异以及不同时间窗口同向交易的交易价差进行分析，通过分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

报告期内本公司严格执行公平交易制度，公平对待旗下各投资组合，未发现任何违反公平交易的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合未发生参与交易所公开竞价同日反向交易且成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情形，未发现异常交易行为。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

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

一季度，资金面波动较大，债券市场对于流动性的敏感度显著上升，1月15日并未全额续作MLF和TMLF。下旬税期期间以及跨春节投放较为谨慎，银行机构普遍在SLF顶格利率融入资金，且非银一度出现10%以上的高成本融资，打破了市场对于11月以来资金面的一致预期。2月之后资金面维持宽松，地方政府债供给低于市场预期，央行引导货币市场利率围绕短期政策利率波动运行，资金面波动性逐步降低，流动性维持宽松。二季度，地方政府债供给低于市场预期，叠加央行引导货币市场利率围绕短期政策利率波动运行，资金面波动性较一季度显著降低，DR007均值较一季度有所降低。10年期国开较一季度末下行8BP，信用利差整体先下后上。其中4、5月份受资金面宽松影响，信用利差逐步收缩，3年期AAA评级信用债与3年期国开债利差由35BP下行至23BP；6月受到季末时点因素影响，资金面较为谨慎，信用利差走扩至37BP。分评级看，中低评级债券表现要好于高评级债券。主要因为收益率低位环境下，投资者追求绝对收益，对中评级债券信用挖掘较为充分。

本基金在报告期内采用稳健积极的投资策略，主要以配置政策金融债为主，组合杠杆维持平稳。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末淳厚安心87个月定开债基金份额净值为1.0040元，本报告期内，基金份额净值增长率为1.97%，同期业绩比较基准收益率为1.75%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年供需错配导致的通胀上行并未对货币政策形成掣肘，反而是物价快速上升对下游中小企业需求形成抑制，货币政策维持宽松，呵护下游需求。

展望后期，全球经济逐步从疫情中恢复至常态，预期下半年美联储缩减购债预期逐步落地，国内货币政策维持稳健，同时加强防范外部冲击。若出现债券收益率阶段性上升，可进入积极配置区间。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证券监督管理委员会颁布的《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等相关规定和基金合同的约定。对于特定品种或者投资品种相同，但具有不同特征的，若协会有特定调整估值方法的通知的，例如《证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）》，应参照协会通知执行。

报告期内，本基金管理人制定了健全、有效的估值政策和程序，经公司管理层批准后实行，并成立了估值委员会，估值委员会主任委员由分管运营的副总担任，常务副主任委员由运营保障部负责人担任，专业委员若干名，由投资部、研究部、监察稽核部、财富管理部部门负责人或其指定人员组成。

估值委员会成员均为公司各部门人员，均具有基金从业资格、专业胜任能力和相关工作经验，且之间不存在任何重大利益冲突。基金经理可列席公司估值委员会，不介入基金日常估值业务，但可参加估值小组会议，可以提议测算某一投资品种的估值调整影响，但不能参与表决，从而将其影响程度进行适当限制，保证基金估值的公平、合理，保持估值政策和程序的一贯性。

日常估值由本基金管理人同本基金托管人一同进行，基金份额净值由本基金管理人完成估值后，经本基金托管人复核无误后由本基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账务的核对同时进行。

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，本基金收益分配方式仅有现金分红；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。

根据上述分配原则以及基金的实际运作情况，本报告期内进行了两次收益分配。于2021年3月25日，每10份基金份额派发红利 0.08 元，于2021年6月23日，每10份基金份额派发红利 0.10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，本基金未发生连续二十个工作日出现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

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，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

本托管人认真复核了中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 中期财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：淳厚安心87个月定期开放债券型证券投资基金

报告截止日：2021年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	2,477,137.47	5,141,999.44
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	13,936,505,234.71	4,565,593,532.15
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		13,936,505,234.71	4,565,593,532.15
资产支持证券投资		-	-

贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	3,014,924,794.06
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	224,242,482.61	184,632,138.63
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		14,163,224,854.79	7,770,292,464.28
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		6,377,127,994.28	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		965,003.69	985,772.88
应付托管费		321,667.90	328,590.97
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	290,235.75	23,555.16
应交税费		-	-
应付利息		3,266,609.15	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	86,780.45	150,000.00
负债合计		6,382,058,291.22	1,487,919.01
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	7,749,998,074.56	7,749,998,074.56

未分配利润	6.4.7.10	31,168,489.01	18,806,470.71
所有者权益合计		7,781,166,563.57	7,768,804,545.27
负债和所有者权益总计		14,163,224,854.79	7,770,292,464.28

注：报告截止日2020年6月30日，基金份额总额7,749,998,074.56份，基金份额净值为人民币1.0040元。

6.2 利润表

会计主体：淳厚安心87个月定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
一、收入		214,882,747.18
1. 利息收入		214,882,747.18
其中：存款利息收入	6.4.7.11	99,369.65
债券利息收入		211,582,407.90
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		3,200,969.63
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.3	-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.14	-
股利收益	6.4.7.15	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-

4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-
减：二、费用		63,020,762.61
1. 管理人报酬		5,804,826.00
2. 托管费		1,934,942.01
3. 销售服务费		-
4. 交易费用		-
5. 利息支出		55,166,320.43
其中：卖出回购金融资产支出		55,166,320.43
6. 税金及附加		-
7. 其他费用	6.4.7.18	114,674.17
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		151,861,984.57
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		151,861,984.57

注：本基金合同生效日为2020年11月26日，故无上年度可比区间数据，下同。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：淳厚安心87个月定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	7,749,998,074.56	18,806,470.71	7,768,804,545.27
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	151,861,984.57	151,861,984.57
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以	-	-	-

“-”号填列)			
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-139,499,966.27	-139,499,966.27
五、期末所有者权益（基金净值）	7,749,998,074.56	31,168,489.01	7,781,166,563.57

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：

邢媛

董卫军

董卫军

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

淳厚安心87个月定期开放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[2020]2830号《关于准予淳厚安心87个月定期开放债券型证券投资基金注册的批复》核准,由基金发起人淳厚基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《淳厚安心87个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》(“基金合同”)发起,于2020年11月26日募集成立。本基金的基金管理人为淳厚基金管理有限公司,基金托管人为兴业银行股份有限公司。本基金募集期为自2020年11月16日至2020年11月25日,本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,本基金共募集有效净认购资金,7,749,998,073.83元,折合7,749,998,073.83份淳厚安心基金份额。有效认购资金在募集期间产生的利息为人民币0.73元,折合0.73份淳厚安心基金份额,以上收到的实收基金共计人民币7,749,998,074.56元,折合7,749,998,074.56份淳厚安心基金份额,有效认购户数为440户。按照基金合同的有关约定计入基金份额持有人的基金账户。本基金募集资金经上会会计师事务所(特殊普通合伙)验资。

根据《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》和基金合同等有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括债券(国债、金融债、地方政府债、政府支持机构债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、

短期融资券、超短期融资券、次级债、可分离交易可转债的纯债部分等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款、通知存款和其他银行存款）、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相关规定。本基金不投资股票，也不投资于可转换债券（可分离交易可转债的纯债部分除外）、可交换债券。

本基金业绩比较标准为：在每个封闭期，本基金的业绩比较基准为该封闭期起始日公布的三年期定期存款利率（税后）+0.75%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则-基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号〈年度报告和半年度报告〉》、其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金2020年6月30日的财务状况以及2021年上半年的经营成果和基金净值变动情况等相关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计期间，即每年自1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间系2021年1月1日至2021年6月30日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和贷款及应收款项。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产包括股票投资、债券投资和衍生工具投资（主要为权证投资）等，其中股票投资和债券投资在资产负债表中作为交易性金融资产列报，衍生工具投资在资产负债表中作为衍生金融资产列报。

本基金持有的各类应收款项、买入返售金融资产等在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产分类为贷款及应收款项。

（2）金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。

本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

本基金的金融资产在初始确认时以公允价值计量。本基金对所持有的债券投资以摊余成本法进行后续计量。本会计期间内，本基金持有的债券投资的摊余成本接近其公允价值。

本基金的金融负债于初始确认时以公允价值计量，并以摊余成本进行后续计量。

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认，即从本基金账户和资产负债表内予以转销。

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，终止确认该金融负债或其一部分。

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产。本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

（1）债券投资

买入银行间同业市场交易的债券于成交日确认为债券投资。债券投资按实际支付的全部价款入账，其中所包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，作为应收利息单独核算，不构成债券投资成本，对于贴息债券，该等利息应作为债券投资成本；卖出银行间同业市场交易的债券于成交日确认债券投资收益。出售债券的成本按移动加权平均法结转。

(2) 回购协议

本基金持有的回购协议(封闭式回购)以成本列示,按实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时,也可以使用合同利率)在实际持有期间内逐日计提利息。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中,出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。以公允价值计量或披露的资产和负债,根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值,确定所属的公允价值层次: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。

本基金估值采用摊余成本法,其相当于公允价值。估值对象以买入成本列示,按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余存续期内按实际利率法摊销,每日计提收益或损失。

本基金不采用市场利率和上市交易的债券和票据的市价计算基金资产净值;

本基金金融工具的估值方法具体如下:

(1) 银行存款

本基金持有的银行存款以本金列示,按银行实际协议利率逐日计提利息;

(2) 债券投资

本基金持有的付息债券、贴现券购买时采用实际支付价款(包含交易费用)确定初始成本,每日按摊余成本和实际利率计算确定利息收入;

(3) 回购协议

① 本基金持有的回购协议(封闭式回购),以成本列示,按实际利率在实际持有期间内逐日计提利息;

② 本基金持有的买断式回购以协议成本列示,所产生的利息在实际持有期间内逐日计提。回购期间对涉及的金融资产根据其资产的性质进行相应的估值。回购期满时,若双方都能履约,则按协议进行交割。若融资业务到期无法履约,则继续持有现金资产;若融券业务到期无法履约,则继续持有债券资产,实际持有的相关资产按其性质进行估值;

(4) 其他

① 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映金融资产公允价值的,基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后,按最能反映公允价值的方法估值;

② 为了避免采用摊余成本法计算的基金资产净值与按其他可参考公允价值指标计算的基金资产净值发生重大偏离,从而对基金份额持有人的利益产生稀释和不公平的结果,基金管理人于每一估值日,采用其他可参考公允价值指标,对基金持有的估值对象

进行重新评估，即“影子定价”。当基金资产净值与影子价格产生重大偏离，基金管理人应根据相关法律法规采取相应措施，使基金资产净值更能公允地反映基金资产价值；

③ 如有新增事项，按国家最新规定估值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。申购、赎回、转换及红利再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金指申购、赎回、转入、转出及红利再投资等事项导致基金份额变动时，相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配(未分配利润)已实现与未实现部分各自占基金净值的比例，损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入利润分配(未分配利润)。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

(1) 利息收入

① 存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

② 除贴息债外的债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认债券利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含利率后，逐日确认债券利息收入。

③ 买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提，若合同利率与实际利率差异较小，则采用合同利率计算确定利息收入。

(2) 投资收益

① 股票投资收益于交易日按卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本的差额确认。

② 债券投资收益于交易日按卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本与应收利息(若有)后的差额确认。

③ 衍生工具投资收益于交易日按交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本后的差额确认。

④ 股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

(3) 公允价值变动收益

公允价值变动收益于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产/负债的公允价值变动形成的利得或损失确认，并于相关金融资产/负债卖出或到期时转出计入投资收益。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的基金管理人报酬按《基金合同》约定的方法进行计提。

本基金的基金托管费按《基金合同》约定的方法进行计提。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的交易费用发生时按照确定的金额计入交易费用。

卖出回购金融资产支出按卖出回购金融资产款的摊余成本在回购期内以实际利率法逐日计提，若合同利率与实际利率差异较小，则采用合同利率计算确定利息支出。

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；

(2) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利按除权后的基金份额净值自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(3) 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；

(4) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在符合法律法规及基金合同约定，并对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可对基金收益分配原则和支付方式进行调整，不需召开基金份额持有人大会。

6.4.4.12 分部报告

根据本基金的内部组织机构、管理要求及内部报告制度，本基金整体为一个报告分部，且向管理层报告时采用的会计政策及计量基础与编制财务报表时的会计政策及计量基础一致。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下股票投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券、可分离债券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券、可分离债券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中央国债登记结算有限责任公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

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

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

6.4.6.1 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自2016年5月1日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自2018年1月1日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

6.4.6.2 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

6.4.6.3 企业所得税

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

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

6.4.6.4 个人所得税

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末	
	2021年06月30日	
活期存款	1,856,044.70	
定期存款	-	
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	621,092.77	
合计	2,477,137.47	

其他存款本期末余额为存放在证券经纪商基金专用证券账户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			
	2021年06月30日			
	成本	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	-	-	
	银行间市场	13,936,505,234.71	13,936,505,234.71	-
	合计	13,936,505,234.71	13,936,505,234.71	-

资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	13,936,505,234.71	13,936,505,234.71	-

本基金采用摊余成本法估值。上表列示交易性金融资产债券成本以及公允价值金额均为本基金持有至到期的债券投资期末余额，无减值准备。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

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买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
应收活期存款利息	1,106.26
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	138.00
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	224,241,238.35
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	-

合计	224,242,482.61
----	----------------

注：应收其他存款利息为应收券商保证金利息。

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	290,235.75
合计	290,235.75

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
预提费用-审计费	27,273.08
预提费用-信息披露费	59,507.37
合计	86,780.45

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	7,749,998,074.56	7,749,998,074.56
本期申购	-	-

本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	7,749,998,074.56	7,749,998,074.56

注：（1）本基金募集期为2020年11月16日至2020年11月25日。“淳厚安心87个月定开债”已收到首次募集的有效净认购金额为人民币7,749,998,073.83元，折合7,749,998,073.83份“淳厚安心87个月定开债”基金份额；有效认购资金在募集期间产生的利息为人民币0.73元，折合0.73份“淳厚安心87个月定开债”基金份额。以上“淳厚安心87个月定开债”收到的实收基金共计人民币7,749,998,074.56元，折合7,749,998,074.56份“淳厚安心87个月定开债”基金份额。

（2）申购含红利再投、转换入份额及金额，赎回含转换出份额及金额。

（3）本基金合同生效日为2020年11月26日。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	18,806,470.71	-	18,806,470.71
本期利润	151,861,984.57	-	151,861,984.57
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-139,499,966.27	-	-139,499,966.27
本期末	31,168,489.01	-	31,168,489.01

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
活期存款利息收入	14,997.21
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	84,372.44
结算备付金利息收入	-
其他	-

合计	99,369.65
----	-----------

注：其他存款利息收入为券商保证金利息收入。

6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金本报告期无股票投资收益。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期无债券买卖差价收入投资收益。

6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

本基金本报告期无股利收益。

6.4.7.16 公允价值变动收益

本基金本报告期无公允价值变动收益。

6.4.7.17 其他收入

本基金本报告期无其他收入。

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
审计费用	27,273.08
信息披露费	59,507.37

证券出借违约金	-
汇划手续费	17,093.72
账户维护费	10,500.00
银行结算费用	300.00
合计	114,674.17

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期，存在控制关系或其他重大利害关系的关联方没有发生变化。

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
兴业银行股份有限公司	基金托管人
淳厚基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
邢媛	基金管理人股东
李雄厚	基金管理人股东
董卫军	基金管理人股东

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期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

本基金本报告期未无应支付的关联方佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	5,804,826.00
其中：支付销售机构的客户维护费	-

1、本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.15%年费率计提。管理费的计算方法如下：

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

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付，由基金管理人与基金托管人核对一致后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式根据基金管理人指令于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等，支付日期顺延。

2、本基金合同于2020年11月26日生效，故无上年度可比期间数据。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,934,942.01

1、本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.05%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计提，按月支付，由基金管理人与基金托管人核对一致后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式根据基金管理人指令于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等，支付日期顺延。

2、本基金合同于2020年11月26日生效，故无上年度可比期间数据。

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

单位：人民币元

本期 2021年01月01日至2021年06月30日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
兴业银行股份有限公司	-	-	-	-	2,700,114,135.89	1,000,785.25

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内，本基金的基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.4.2 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2021年06月30日		上年度末 2020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
兴业银行股份有限公司资金营运中心	2,899,999,000.00	37.42%	2,899,999,000.00	37.42%

李雄厚	0.99	0.00%	0.99	0.00%
邢媛	0.99	0.00%	0.99	0.00%
董卫军	994.26	0.00%	994.26	0.00%

注：

- 1、上述展示系四舍五入的结果。
- 2、本报告期及上年度可比期间，除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的适用费率符合基金合同、招募说明书及相关公告的规定。

6.4.10.5 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 2021年01月01日至2021年06月30日	
	期末余额	当期利息收入
兴业银行股份有限公司	1,856,044.70	14,997.21

- 注：1、本基金的银行存款由基金托管人保管，按银行同业利率计息。
2、本基金合同于2020年11月26日生效，故无上年度可比期间数据。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期未发生在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况——按摊余成本法核算的货币市场基金之外的基金

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
1	2021-03	2021-03	0.080	61,999,98	-	61,999,98	-

	-25	-25		5.51		5.51	
2	2021-06 -23	2021-06 -23	0.100	77,499,98 0.76	-	77,499,98 0.76	-
合计			0.180	139,499,9 66.27	-	139,499,9 66.27	-

6.4.12 期末（2021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

本基金无因认购新发/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2021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6,377,127,994.28元，是以如下债券作为抵押：

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
092018002	20农发清发02	2021-07-06	96.83	6,500,000	629,395,816.34
092018002	20农发清发02	2021-07-07	96.83	2,120,000	205,279,866.25
092118001	21农发清发01	2021-07-01	99.59	5,150,000	512,901,009.85
170215	17国开15	2021-07-05	104.32	4,160,000	433,980,048.65
180205	18国开05	2021-07-01	108.00	6,330,000	683,623,924.98
180205	18国开05	2021-07-02	108.00	6,300,000	680,384,001.16
210204	21国开04	2021-07-01	99.66	2,090,000	208,294,646.86
210204	21国开04	2021-07-02	99.66	11,540,000	1,150,105,370.68
210204	21国开04	2021-07-06	99.66	2,090,000	208,294,646.86
210204	21国开04	2021-07-13	99.66	4,160,000	414,596,043.50
210307	21进出07	2021-07-01	99.75	6,200,000	618,462,452.33
210307	21进出07	2021-07-06	99.75	3,100,000	309,231,226.17

210307	21进出07	2021-07-07	99.75	7,220,000	720,209,500.94
合计				66,960,000	6,774,758,554.57

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2021年6月30日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

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

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。本基金管理人建立了董事会、经营管理层、风险管理部门、各职能部门四级风险管理组织架构，并明确了相应的风险管理职能。

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，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家上市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管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的10%。

本基金的银行存款均存放于信用良好的托管行，申购交易均通过具有基金销售资格的金融机构进行。另外，在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

按信用评级列示的债券、资产支持证券和同业存单的投资情况如下表所示，如无表格，则本基金于本期末未持有除国债、地方政府债、政策性金融债、央行票据以外的债券。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本期末本基金未持有短期信用评级的债券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本期末本基金未持有短期信用评级的资产支持证券。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本期末本基金未持有短期信用评级的同业存单。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本期末本基金未持有长期信用评级债券。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本期末本基金未持有长期信用评级的资产支持证券。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本期末本基金未持有长期信用评级的同业存单。

6.4.13.3 流动性风险

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

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》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度流动性受限资产比例、基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。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。

本基金资产投资于到期日（或回售期限）在封闭期结束之前的债券、债券回购和银行存款等金融资产，确保基金资产在开放前完全变现，能满足开放期流动性的需求。于封闭期，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资产的公允价值。除附注6.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在一个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负

债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

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因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关于未来现金流的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年0 6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	2,477,137.47	-	-	-	2,477,137.47
交易性金融资产	-	-	13,936,505,234.71	-	13,936,505,234.71
应收利息	-	-	-	224,242,482.61	224,242,482.61
资产总计	2,477,137.47	-	13,936,505,234.71	224,242,482.61	14,163,224,854.79
负债					
卖出回购金融资产款	6,377,127,994.28	-	-	-	6,377,127,994.28
应付管理人报酬	-	-	-	965,003.69	965,003.69
应付托管费	-	-	-	321,667.90	321,667.90
应付交易费用	-	-	-	290,235.75	290,235.75
应付利息	-	-	-	3,266,609.15	3,266,609.15
其他负债	-	-	-	86,780.45	86,780.45
负债总计	6,377,127,994.28	-	-	4,930,296.94	6,382,058,291.22
利率敏感度缺口	-6,374,650,856.81	-	13,936,505,234.71	219,312,185.67	7,781,166,563.57
上年度	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计

末 2020年1 2月31日					
资产					
银行存款	5,141,999.44	-	-	-	5,141,999.44
交易性金融 资产	-	-	4,565,593,532.15	-	4,565,593,532.15
买入返售 金融资产	3,014,924,794.06	-	-	-	3,014,924,794.06
应收利息	-	-	-	184,632,138.63	184,632,138.63
资产总计	3,020,066,793.50	-	4,565,593,532.15	184,632,138.63	7,770,292,464.28
负债					
应付管理 人报酬	-	-	-	985,772.88	985,772.88
应付托管 费	-	-	-	328,590.97	328,590.97
应付交易 费用	-	-	-	23,555.16	23,555.16
其他负债	-	-	-	150,000.00	150,000.00
负债总计	-	-	-	1,487,919.01	1,487,919.01
利率敏感 度缺口	3,020,066,793.50	-	4,565,593,532.15	183,144,219.62	7,768,804,545.27

注：本基金用摊余成本法估值。上表列示可交易性金融资产金额为本基金持有至到期的债券投资余额，无减值准备。

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 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
	市场利率下降25个基点	195,860,283.85	66,652,597.76
	市场利率上升25个基点	-192,468,169.77	-65,418,609.14

注：利率风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的情况下，利率发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值可参考的公允价值产生的影响。

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，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场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。本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种且以摊余成本进行后续计量，因此无重大其他价格风险。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

1. 公允价值

1.1 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括银行存款、结算备付金、存出保证金、应收款项、卖出回购金融资产款以及其他金融负债，除持有至到期金融资产外的其他金融资产因其剩余期限不长，因此公允价值与账面价值相若。

以下是本基金除账面价值与公允价值差异很小的金融工具之外的各类别金融工具的账面价值与公允价值的比较：

单位：人民币元

项目		本期末 2021年6月30日		
		摊余成本	公允价值	公允价值变动
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	13,936,505,234.71	13,973,219,000.00	36,713,765.29
	合计	13,936,505,234.71	13,973,219,000.00	36,713,765.29
资产支持证券		-	-	-
合计		13,936,505,234.71	13,973,219,000.00	36,713,765.29
项目		上年度末 2020年12月31日		
		摊余成本	公允价值	公允价值变动
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	4,565,593,532.15	4,586,374,000.00	20,780,467.85
	合计	4,565,593,532.15	4,586,374,000.00	20,780,467.85

资产支持证券	-	-	-
合计	4,565,593,532.15	4,586,374,000.00	20,780,467.85

1.2 以公允价值计量的金融工具

1.2.1 各层次金融工具公允价值

于2021年06月30日，本基金未持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期持有的交易性金融资产的公允价值所属层次未发生重大变动。

1.2.3 第三层次公允价值余额和本期变动金额

本基金持有的交易性金融资产第三层次公允价值本期未发生变动。

2. 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大承诺事项。

3. 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的其他重要事项。

§ 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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	13,936,505,234.71	98.40
	其中：债券	13,936,505,234.71	98.40
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金	-	-

	融资产		
7	银行存款和结算备付金合计	2,477,137.47	0.02
8	其他各项资产	224,242,482.61	1.58
9	合计	14,163,224,854.79	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金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买入股票。

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卖出股票。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内无买入及卖出股票的情况。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	13,936,505,234.71	179.11
	其中：政策性金融债	13,936,505,234.71	179.11

4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	13,936,505,234.71	179.11

注：本基金用摊余成本法估值，上表列示公允价值为债券摊余成本。

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	180205	18国开05	62,400,000	6,739,041,535.33	86.61
2	210307	21进出07	23,400,000	2,334,196,997.51	30.00
3	210204	21国开04	21,300,000	2,122,811,472.75	27.28
4	092018002	20农发清发02	13,800,000	1,336,255,733.15	17.17
5	092118001	21农发清发01	9,700,000	966,046,562.24	12.42

注：本基金用摊余成本法估值，上表列示公允价值为债券摊余成本。

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股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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收到公开谴责、处罚的情形

本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

7.12.2 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

本基金本报告期末未持有股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	224,242,482.61
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	224,242,482.61

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本报告中因四舍五入原因，投资组合报告中市值占总资产或净资产比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§ 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

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
440	17,613,631.99	7,749,994.00 0.00	100.00%	4,074.56	0.00%

注：上表展示的比例系四舍五入后的结果。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	1,036.87	0.00%

注：上表展示的比例系四舍五入后的结果。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2020年11月26日)基金份额总额	7,749,998,074.56
本报告期期初基金份额总额	7,749,998,074.56
本报告期基金总申购份额	-
减：本报告期基金总赎回份额	-
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	7,749,998,074.56

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

本基金本报告期内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

1、基金管理人的重大人事变动：本报告期内基金管理人未发生重大人事变动。

2、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动：本次报告期内基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，未发生影响公司经营或基金运营业务的诉讼。本报告期内，无涉及本基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

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，为本基金审计的会计事务所为上会会计师事务所（特殊普通合伙），未有改聘情况发生。

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

本报告期内未发生基金管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情形。本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关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	
中信证券	2	-	-	26,575.00	100.00%	-

注：1. 根据中国证监会的有关规定，我司在综合考量证券经营机构的财务状况、经营状况、研究能力的基础上，选择基金专用交易席位。

2. 本报告期内，本基金无新增或减少租用证券公司交易席位的情况。

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
中信证券	-	-	3,083,500,000.00	100.00%	-	-	-	-

注：1. 根据中国证监会的有关规定，我司在综合考量证券经营机构的财务状况、经营状况、研究能力的基础上，选择基金专用交易席位。

2. 本报告期内，本基金无新增或减少租用证券公司交易席位的情况。

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	淳厚安心87个月定期开放债券型证券投资基金分红公告	《证券时报》、公司官网	2021-03-25
2	淳厚安心87个月定期开放债券型证券投资基金2021年第一季度报告	公司官网	2021-04-21
3	淳厚基金管理有限公司旗下基金2021年1季度报告提示	《证券时报》	2021-04-21

	性公告		
4	淳厚安心87个月定期开放债券型证券投资基金分红公告	《证券时报》、公司官网	2021-06-23

§ 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	2021年1月1日-6月30日	2,899,999,000.00	0.00	0.00	2,899,999,000.00	37.42%
产品特有风险							
<p>本报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过 20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：</p> <p>1、当基金份额持有人占比过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人巨额赎回而引发基金净值剧烈波动的风险；</p> <p>2、若某单一基金份额持有人巨额赎回有可能引发基金的流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额；</p> <p>3、当基金份额持有人巨额赎回时，可能会导致基金资产净值出现连续六十个工作日低于5000万元的风险，届时基金将根据基金合同进入清算程序并终止；</p> <p>4、当某单一基金份额持有人所持有的基金份额已经达到或超过本基金规模的50%或者接受某笔或者某些申购或转换转入申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过50%时，本基金管理人可拒绝该持有人对本基金基金份额提出的申购及转换转入申请；</p> <p>5、其他可能的风险。</p>							

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、中国证券监督管理委员会批准设立淳厚基金管理有限公司的文件；
- 2、中国证券监督管理委员会批准淳厚安心87个月定期开放债券型证券投资基金设立的文件；
- 3、《淳厚安心87个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》；
- 4、《淳厚安心87个月定期开放债券型证券投资基金托管协议》；

- 5、《淳厚安心87个月定期开放债券型证券投资基金招募说明书》；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照。

12.2 存放地点

淳厚基金管理有限公司

地址：上海市浦东新区丁香路778号丁香国际西塔7楼

12.3 查阅方式

上述文件可在淳厚基金管理有限公司互联网站上查阅，或者在营业时间内到淳厚基金管理有限公司查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人淳厚基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-000-9738

网址：<http://www.purekindfund.com/>

淳厚基金管理有限公司
二〇二一年八月三十日