

# 国联益诚30天持有期债券型发起式证券投资基金

2024年第3季度报告

2024年09月30日

基金管理人：国联基金管理有限公司

基金托管人：中国邮政储蓄银行股份有限公司

报告送出日期：2024年10月25日

## §1 重要提示

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

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年10月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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7月1日起至2024年9月30日止。

## §2 基金产品概况

|             |   |                 |
|-------------|---|-----------------|
| 基金简称        | 国联益诚30天持有债券发起式  |                 |
| 基金主代码       | 020935  |                 |
| 基金运作方式      | 契约型开放式  |                 |
| 基金合同生效日     | 2024年06月04日   |                 |
| 报告期末基金份额总额  | 1,022,586,558.63份   |                 |
| 投资目标        | 本基金在有效控制风险的基础上，力争长期内实现超越业绩比较基准的投资回报。                        |                 |
| 投资策略        | 1、大类资产配置策略；2、债券投资策略；3、证券公司短期公司债券投资策略；4、国债期货投资策略；5、信用衍生品投资策略 |                 |
| 业绩比较基准      | 中债综合财富（1年以下）指数收益率×90%+一年期定期存款基准利率（税后）×10%                   |                 |
| 风险收益特征      | 本基金为债券型基金，其预期风险和预期收益低于股票型及混合型基金，高于货币市场基金。                   |                 |
| 基金管理人       | 国联基金管理有限公司  |                 |
| 基金托管人       | 中国邮政储蓄银行股份有限公司  |                 |
| 下属分级基金的基金简称 | 国联益诚30天持有债券发起式A   | 国联益诚30天持有债券发起式C |
| 下属分级基金的交易代码 | 020935  | 020936          |

|                 |                   |               |
|-----------------|-------------------|---------------|
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 1,012,675,582.59份 | 9,910,976.04份 |
|-----------------|-------------------|---------------|

### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标         | 报告期(2024年07月01日 - 2024年09月30日) |                 |
|----------------|--------------------------------|-----------------|
|                | 国联益诚30天持有债券发起式A                | 国联益诚30天持有债券发起式C |
| 1.本期已实现收益      | 10,444,421.98                  | 41,038.51       |
| 2.本期利润         | 7,208,675.51                   | 13,805.86       |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0035                         | 0.0016          |
| 4.期末基金资产净值     | 1,016,420,134.34               | 9,941,164.37    |
| 5.期末基金份额净值     | 1.0037                         | 1.0030          |

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、上述本基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，例如：基金的申购、赎回费等，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

国联益诚30天持有债券发起式A净值表现

| 阶段         | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③    | ②-④   |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月      | 0.27%  | 0.03%     | 0.43%      | 0.01%         | -0.16% | 0.02% |
| 自基金合同生效起至今 | 0.37%  | 0.02%     | 0.59%      | 0.01%         | -0.22% | 0.01% |

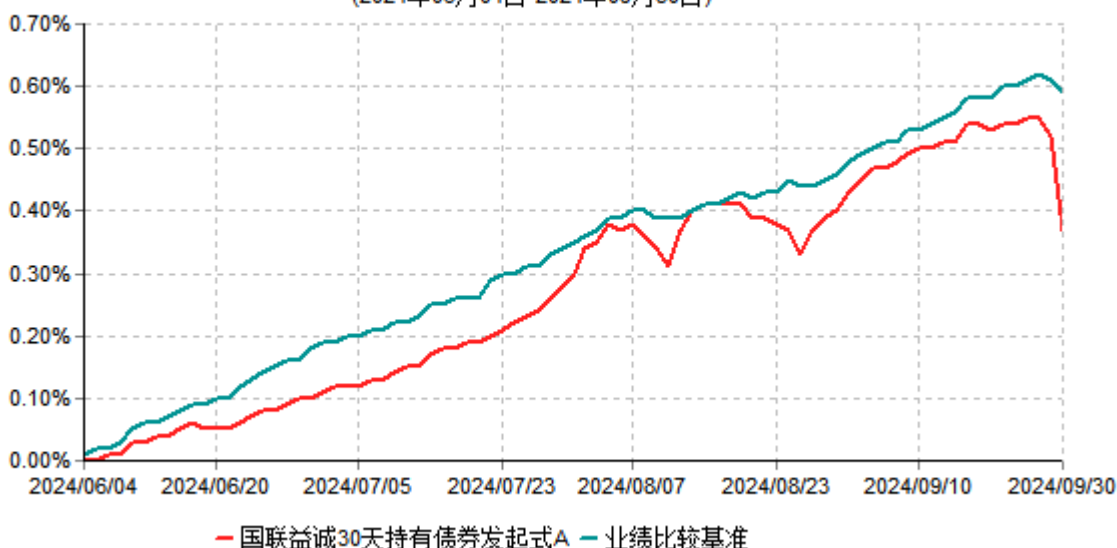
国联益诚30天持有债券发起式C净值表现

| 阶段         | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③    | ②-④   |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月      | 0.27%  | 0.03%     | 0.43%      | 0.01%         | -0.16% | 0.02% |
| 自基金合同生效起至今 | 0.37%  | 0.02%     | 0.59%      | 0.01%         | -0.22% | 0.01% |

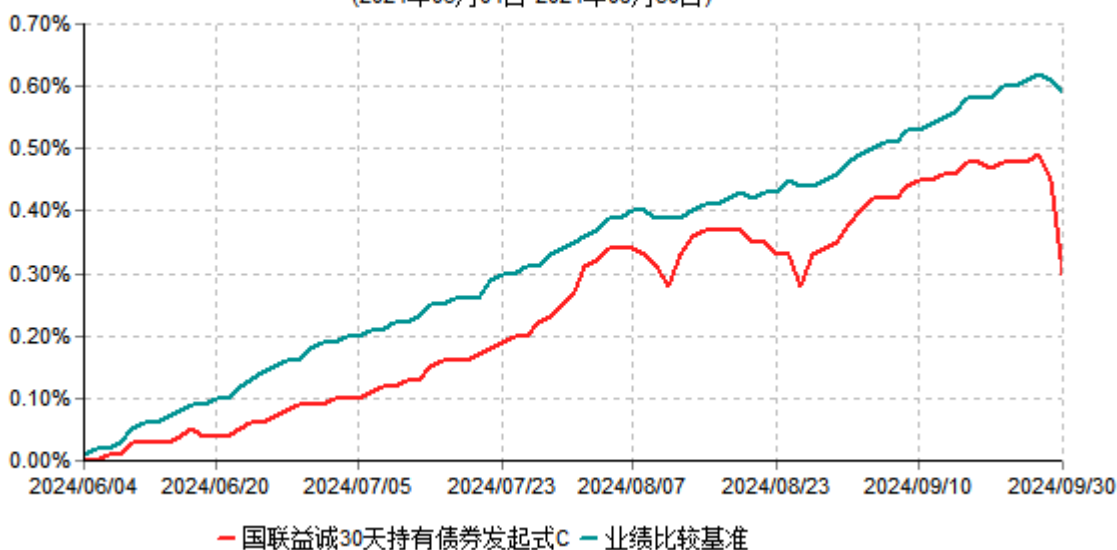
|            |       |       |       |       |        |       |
|------------|-------|-------|-------|-------|--------|-------|
|            |       |       |       | ④     |        |       |
| 过去三个月      | 0.21% | 0.03% | 0.43% | 0.01% | -0.22% | 0.02% |
| 自基金合同生效起至今 | 0.30% | 0.02% | 0.59% | 0.01% | -0.29% | 0.01% |

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

国联益诚30天持有债券发起式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  
(2024年06月04日-2024年09月30日)



国联益诚30天持有债券发起式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  
(2024年06月04日-2024年09月30日)



注：按照基金合同和招募说明书的约定，本基金自合同生效日起6个月内为建仓期，截至本报告期末仍在建仓期内。基金合同生效日起至本报告期末不满一年。

## 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名  | 职务   | 任本基金的基金经理期限 |      | 证券从业年限 | 说明  |
|-----|--|-------------|------|--------|---|
|     |  | 任职日期        | 离任日期 |        |   |
| 韩正宇 | 国联日日盈交易型货币市场基金、国联恒惠纯债债券型证券投资基金、国联盈泽中短债债券型证券投资基金、国联益海30天滚动持有短债债券型证券投资基金、国联睿享86个月定期开放债券型证券投资基金、国联融慧双欣一年定期开放债券型证券投资基金、国联景泓一年持有期混合型证券投资基金、国联益诚30天持有期债券型发起式证券投资基金的基金经理。 | 2024-06-04  | -    | 7      | 韩正宇先生，中国国籍，毕业于美国罗格斯新泽西州立大学金融分析专业，研究生、硕士学位，具有基金从业资格，证券从业年限7年。2015年7月至2017年5月曾任中国光大银行资产负债管理部流动性管理处流动性管理岗；2017年5月至2020年5月曾任中国人保资产管理有限公司公募基金事业部固定收益交易员、基金经理助理。2020年5月加入公司，现任固收投资二部基金经理。 |
| 杨宇俊 | 国联泓安3个月定期开放债券型证券投资基金、国联中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金、国联恒润纯债债券型证券投资基金、国联益诚30天持有期债券型发起式证券投资基金、国联恒鑫纯债债券型证券投资基金的基金经   | 2024-06-14  | -    | 11     | 杨宇俊先生,中国国籍,毕业于对外经济贸易大学金融学专业,研究生、博士学位,具有基金从业资格,证券从业年限11年。2013年5月至2022年6月历任中加基金管理有限公司专户投资经理、固定收益部基金经理、部门主管。2022年6月加入公司,现任固收投资三部总经理。   |

|  |                 |  |  |  |  |
|--|-----------------|--|--|--|--|
|  | 理及固收投资三部<br>总经理 |  |  |  |  |
|--|-----------------|--|--|--|--|

注：（1）上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写；基金合同生效日起即任职，则任职日期为基金合同生效日。

（2）证券基金从业的含义遵从《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》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

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》及其各项配套法规、基金合同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，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定，无损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 公平交易专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，本公司制定了《公平交易管理办法》并严格执行。公司通过建立科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，在研究、决策、交易执行各环节，通过制度、流程、技术手段等各方面措施确保了公平对待所管理的投资组合，保证公平交易原则的实现。

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好，不同的投资组合受到了公平对待，未发生不公平的交易事项。

##### 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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2024年三季度，债券市场收益率先下后上，宽幅震荡。具体来看，7月央行降息，大幅超出市场预期，债券收益率迅速下行。10年国债收益率由7月初2.25%下行至8月初2.12%。此后，随着央行指导大行入场卖券收益率又快速反弹至2.25%，全部抹去降息涨幅。接着，在8月经济数据环比下滑，金融数据走弱、通胀下行的影响下，十年国债收益率再次震荡下行至季度最低点2.04%。临近月末，央行再次降准降息，市场走出利好落地逻辑。同时，政治局会议召开，扭转风险偏好，股市迎来暴涨，导致债市几天内出现大幅回调，十年国债收益率又再次回到2.25%水平。此外，信用债市场在赎回负反馈的影响下，流动性大幅减弱，信用利差快速大幅走阔。

展望四季度，债市扰动因素增多，波动加大。一是政策开始不断释放刺激经济信号，经济预期好转下风险偏好提升，导致股市债市波动加大。二是从政策预期到政策落地再到政策效果验证，都存在较大的不确定性，导致市场波动加大；三是财政政策可能发力，国债和地方债供给逐步增加，再加上房地产贷款政策边际放松，稳信用政策效果待观察；四是央行仍执行支持性的货币政策，广谱利率下降仍支撑整体债市。

报告期内，通过对经济基本面、资金面、政策面、市场情绪等的密切跟踪和预判，积极调整组合杠杆和久期水平，规避信用市场风险。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末国联益诚30天持有债券发起式A基金份额净值为1.0037元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.27%，同期业绩比较基准收益率为0.43%；截至报告期末国联益诚30天持有债券发起式C基金份额净值为1.0030元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.21%，同期业绩比较基准收益率为0.43%。

### §5 投资组合报告

#### 5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目                | 金额(元)            | 占基金总资产的比例<br>(%) |
|----|-------------------|------------------|------------------|
| 1  | 权益投资              | -                | -                |
|    | 其中：股票             | -                | -                |
| 2  | 基金投资              | -                | -                |
| 3  | 固定收益投资            | 1,265,254,893.18 | 95.93            |
|    | 其中：债券             | 1,265,254,893.18 | 95.93            |
|    | 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          | 40,002,130.10    | 3.03             |
|    | 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      | 13,636,169.29    | 1.03             |
| 8  | 其他资产              | 109,363.40       | 0.01             |
| 9  | 合计                | 1,319,002,555.97 | 100.00           |

#### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

**5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合**

注：本基金本报告期末未持有境内股票。

**5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合**

注：本基金本报告期末未持有港股股票。

**5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细**

注：本基金本报告期末未持有股票。

**5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合**

| 序号 | 债券品种      | 公允价值(元)          | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|------------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | -                | -            |
| 2  | 央行票据      | -                | -            |
| 3  | 金融债券      | 60,048,369.86    | 5.85         |
|    | 其中：政策性金融债 | 60,048,369.86    | 5.85         |
| 4  | 企业债券      | 117,822,147.40   | 11.48        |
| 5  | 企业短期融资券   | 371,194,504.12   | 36.17        |
| 6  | 中期票据      | 716,189,871.80   | 69.78        |
| 7  | 可转债（可交换债） | -                | -            |
| 8  | 同业存单      | -                | -            |
| 9  | 其他        | -                | -            |
| 10 | 合计        | 1,265,254,893.18 | 123.28       |

**5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细**

| 序号 | 债券代码      | 债券名称         | 数量（张）     | 公允价值(元)        | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|--------------|-----------|----------------|--------------|
| 1  | 012482019 | 24湖南建设SCP001 | 1,000,000 | 100,213,041.10 | 9.76         |
| 2  | 042480360 | 24静海城投CP001  | 1,000,000 | 100,067,912.33 | 9.75         |
| 3  | 102383345 | 23云投MTN005   | 900,000   | 92,922,934.43  | 9.05         |
| 4  | 102000471 | 20中国铜业MTN001 | 800,000   | 82,356,361.64  | 8.02         |
| 5  | 102382900 | 23豫航空港MTN015 | 600,000   | 62,763,147.54  | 6.12         |



**5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细**

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

**5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细**

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

**5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细**

注：本基金本报告期末未持有权证。

**5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**

**5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

**5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策**

无。

**5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

**5.10.1 本期国债期货投资政策**

利用国债期货，进行套保交易，对基金总体风险可控，符合既定的投资政策和投资目标。

**5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

| 代码                | 名称 | 持仓量<br>(买/卖) | 合约市<br>值(元) | 公允价值变<br>动(元) | 风险指标说明     |
|-------------------|----|--------------|-------------|---------------|------------|
| -                 | -  | -            | -           | -             | -          |
| 公允价值变动总额合计(元)     |    |              |             |               | -          |
| 国债期货投资本期收益(元)     |    |              |             |               | 166,418.19 |
| 国债期货投资本期公允价值变动(元) |    |              |             |               | -          |

**5.10.3 本期国债期货投资评价**

对基金总体风险可控，符合既定的投资政策和投资目标。

**5.11 投资组合报告附注**

**5.11.1 报告期内基金投资的前十名证券除新疆生产建设兵团国有资产经营有限责任公司外其他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。**

乌鲁木齐市天山区消防救援大队2024年05月12日对新疆生产建设兵团国有资产经营有限责任公司进行处罚(乌天消行罚决字[2024]第0074号)。

本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。除上述主体外,本基金投资的其他前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

**5.11.2 基金投资的前十名股票未超过基金合同规定的备选股票库。**

### 5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额(元)      |
|----|---------|------------|
| 1  | 存出保证金   | 94,512.80  |
| 2  | 应收证券清算款 | -          |
| 3  | 应收股利    | -          |
| 4  | 应收利息    | -          |
| 5  | 应收申购款   | 14,850.60  |
| 6  | 其他应收款   | -          |
| 7  | 其他      | -          |
| 8  | 合计      | 109,363.40 |

### 5.11.4 报告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。

### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末未持有股票。

### 5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,各比例的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## §6 开放式基金份额变动

单位:份

|                | 国联益诚30天持有债券<br>发起式A | 国联益诚30天持有债券<br>发起式C |
|----------------|---------------------|---------------------|
| 报告期期初基金份额总额    | 4,377,955,855.93    | 13,178,326.69       |
| 报告期期间基金总申购份额   | 5,739,390.85        | 5,614,805.51        |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 3,371,019,664.19    | 8,882,156.16        |
| 报告期期间基金拆分变动份额  | -                   | -                   |

|              |                  |              |
|--------------|------------------|--------------|
| (份额减少以“-”填列) |                  |              |
| 报告期期末基金份额总额  | 1,012,675,582.59 | 9,910,976.04 |

注：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。

### §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

单位：份

|                          | 国联益诚30天持有债券发起式A | 国联益诚30天持有债券发起式C |
|--------------------------|-----------------|-----------------|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额         | 10,001,333.46   | -               |
| 报告期期间买入/申购总份额            | -               | -               |
| 报告期期间卖出/赎回总份额            | -               | -               |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额         | 10,001,333.46   | -               |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%） | 0.99            | -               |

### §8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

| 项目          | 持有份额总数        | 持有份额占基金总份额比例 | 发起份额总数        | 发起份额占基金总份额比例 | 发起份额承诺持有期限 |
|-------------|---------------|--------------|---------------|--------------|------------|
| 基金管理人固有资金   | 10,001,333.46 | 0.98%        | 10,001,333.46 | 0.98%        | 三年         |
| 基金管理人高级管理人员 | 0.00          | 0.00%        | 0.00          | 0.00%        | -          |
| 基金经理等人员     | 0.00          | 0.00%        | 0.00          | 0.00%        | -          |
| 基金管理人股东     | 0.00          | 0.00%        | 0.00          | 0.00%        | -          |
| 其他          | 0.00          | 0.00%        | 0.00          | 0.00%        | -          |
| 合计          | 10,001,333.46 | 0.98%        | 10,001,333.46 | 0.98%        | -          |

### §9 影响投资者决策的其他重要信息

#### 9.1 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：本基金本报告期间无单一投资者持有基金份额达到或超过20%的情况。

## 9.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期无影响投资者决策的其他重要信息。

## §10 备查文件目录

### 10.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会准予国联益诚30天持有期债券型发起式证券投资基金注册的批复文件
- (2) 《国联益诚30天持有期债券型发起式证券投资基金基金合同》
- (3) 《国联益诚30天持有期债券型发起式证券投资基金托管协议》
- (4) 关于申请募集国联益诚30天持有期债券型发起式证券投资基金之法律意见
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照
- (6) 基金托管人业务资格批件、营业执照
- (7) 中国证监会要求的其他文件

### 10.2 存放地点

基金管理人或基金托管人的住所。

### 10.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可在支付工本费后，在合理时间取得上述文件的复印件。

咨询电话：国联基金管理有限公司客户服务电话400-160-6000，(010) 56517299。

网址：<http://www.glfund.com>

国联基金管理有限公司

2024年10月25日