# 华泰保兴中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金
# 2026 年中期报告

2026 年 06 月 30 日

基金管理人：华泰保兴基金管理有限公司

基金托管人：平安银行股份有限公司

报告送出日期：2026 年 08 月 29 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。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 08 月 26 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 2026 年 01 月 01 日起至 2026 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 ..... 7
3.1 主要会计数据和财务指标 ..... 7
3.2 基金净值表现 ..... 7
§4 管理人报告 ..... 9
4.1 基金管理人及基金经理情况 ..... 9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 ..... 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 ..... 10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 ..... 12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 ..... 12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 ..... 13
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 ..... 13
§5 托管人报告 ..... 14
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 ..... 14
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 ..... 14
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 ..... 14
§6 半年度财务会计报告（未经审计） ..... 15
6.1 资产负债表 ..... 15
6.2 利润表 ..... 16
6.3 净资产变动表 ..... 17
6.4 报表附注 ..... 18
§7 投资组合报告 ..... 34
7.1 期末基金资产组合情况 ..... 34
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 ..... 34
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 ..... 34
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 ..... 34
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 ..... 34
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 ..... 35
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 ..... 35
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 ..... 35
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 ..... 35
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 ..... 35
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 ..... 35
7.12 投资组合报告附注 ..... 35

§8 基金份额持有人信息 ..... 38
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 ..... 38
8.2 盈利投资者数量占比 ..... 38
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 ..... 38
8.4 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 ..... 38
§9 开放式基金份额变动 ..... 39
§10 重大事件揭示 ..... 40
10.1 基金份额持有人大会决议 ..... 40
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 ..... 40
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 ..... 40
10.4 基金投资策略的改变 ..... 40
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 ..... 40
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 ..... 40
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况 ..... 40
10.8 其他重大事件 ..... 41
§11 影响投资者决策的其他重要信息 ..... 42
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 ..... 42
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 ..... 42
§12 备查文件目录 ..... 43
12.1 备查文件目录 ..... 43
12.2 存放地点 ..... 43
12.3 查阅方式 ..... 43

# §2 基金简介

## 2.1 基金基本情况

| | |
|---|---|
| 基金名称 | 华泰保兴中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金 |
| 基金简称 | 华泰保兴中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期 |
| 基金主代码 | 018723 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2023 年 11 月 07 日 |
| 基金管理人 | 华泰保兴基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 平安银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 4,078,562.80 份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

## 2.2 基金产品说明

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 本基金通过指数化投资，争取在扣除各项费用之前获得与标的指数相似的总回报，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。 |
| 投资策略 | 本基金为指数基金，主要采用抽样复制和动态最优化的方法，投资于标的指数中具有代表性和流动性的成份券和备选成份券，或选择非成份券作为替代，构造与标的指数风险收益特征相似的资产组合，以实现对标的指数的有效跟踪。<br>在正常市场情况下，力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.20%，年跟踪误差不超过 2%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度和跟踪误差进一步扩大。<br>本基金主要投资策略包括：指数投资策略、资产支持证券投资策略、其他投资策略。 |
| 业绩比较基准 | 中证同业存单 AAA 指数收益率*95%+银行人民币一年定期存款利率(税后)*5% |
| 风险收益特征 | 本基金预期风险和预期收益低于股票型基金和偏股混合型基金，高于货币市场基金。同时，本基金为指数基金，主要投资于标的指数成份券及备选成份券，具有与标的指数相似的风险收益特征。 |

## 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 | | 华泰保兴基金管理有限公司 | 平安银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 王相国 | 潘琦 |
| | 联系电话 | 021-80299000 | 0755-22168257 |
| | 电子邮箱 | fund_xxpl@ehuatai.com | PANQI003@pingan.com.cn |
| 客户服务电话 | | 400-632-9090 | 95511-3 |
| 传真 | | 021-60756968 | 0755-82080387 |
| 注册地址 | | 中国（上海）自由贸易试验区 | 广东省深圳市罗湖区深南东路 |

| | | |
|---|---|---|
| | 世纪大道 88 号 3810 室 | 5047 号 |
| 办公地址 | 上海市浦东新区博成路 1101 号华泰金融大厦 9 层 | 广东省深圳市福田区益田路 5023 号平安金融中心 B 座 |
| 邮政编码 | 200126 | 518001 |
| 法定代表人 | 杨平 | 谢永林 |

## 2.4 信息披露方式

| | |
|---|---|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 上海证券报 |
| 登载基金中期报告的管理人互联网网址 | www.ehuataifund.com |
| 基金中期报告置备地点 | 基金管理人办公场所及基金托管人住所 |

## 2.5 其他相关资料

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|---|---|---|
| 注册登记机构 | 华泰保兴基金管理有限公司 | 上海市浦东新区博成路 1101 号华泰金融大厦 9 层 |

# §3 主要财务指标和基金净值表现

## 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期（2026年01月01日至2026年06月30日） |
|---|---|
| 本期已实现收益 | 29,866.99 |
| 本期利润 | 28,970.84 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0029 |
| 本期加权平均净值利润率 | 0.28% |
| 本期基金份额净值增长率 | 0.29% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末（2026年06月30日） |
| 期末可供分配利润 | 80,699.47 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0198 |
| 期末基金资产净值 | 4,165,161.98 |
| 期末基金份额净值 | 1.0212 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末（2026年06月30日） |
| 基金份额累计净值增长率 | 2.12% |

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

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

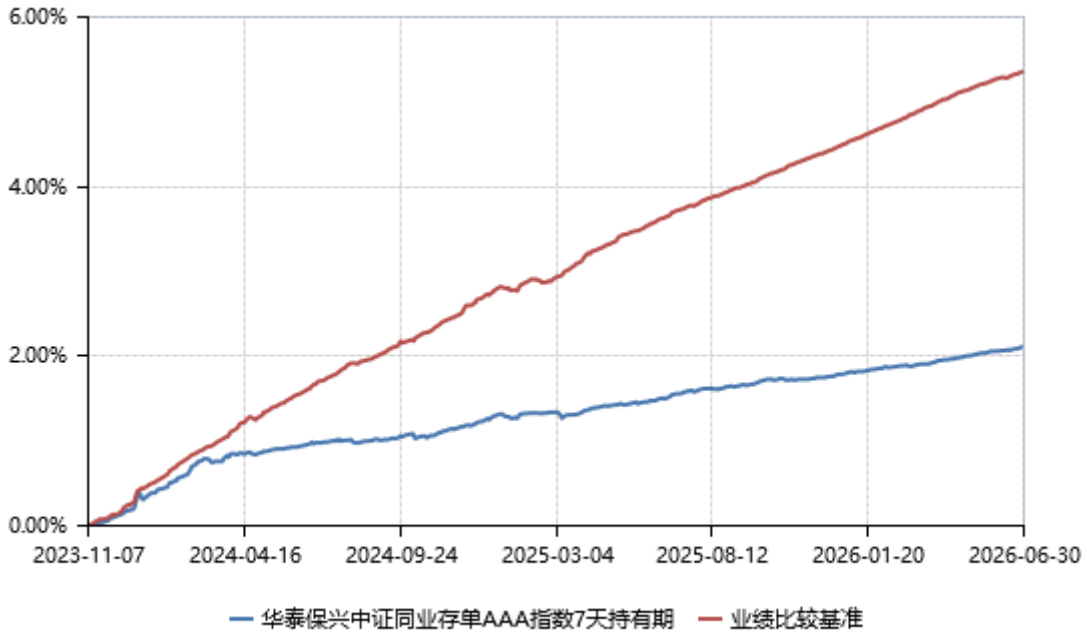
## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | 0.18% | 0.01% | 0.37% | 0.00% | -0.19% | 0.01% |
| 过去六个月 | 0.29% | 0.01% | 0.80% | 0.01% | -0.51% | 0.00% |
| 过去一年 | 0.58% | 0.01% | 1.65% | 0.01% | -1.07% | 0.00% |
| 自基金合同生效起至今 | 2.12% | 0.01% | 5.38% | 0.01% | -3.26% | 0.00% |

注：本基金业绩比较基准为：中证同业存单 AAA 指数收益率*95%+银行人民币一年定期存款利率(税后)*5%。

### 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


6.00%
4.00%
2.00%
0.00%
2023-11-07
2024-04-16
2024-09-24
2025-03-04
2025-08-12
2026-01-20
2026-06-30
华泰保兴中证同业存单AAA指数7天持有期
业绩比较基准

# §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

华泰保兴基金管理有限公司（以下或简称“公司”或“本公司”）经中国证监会证监许可〔2016〕1309 号文核准，于 2016 年 07 月 26 日成立，公司股东分别为华泰保险集团股份有限公司（以下简称“华泰保险集团”）、上海飞恒资产管理中心（有限合伙）（以下简称“飞恒资产”）、上海旷正资产管理中心（有限合伙）（以下简称“旷正资产”）、上海泰颐资产管理中心（有限合伙）（以下简称“泰颐资产”）、上海哲昌资产管理中心（有限合伙）（以下简称“哲昌资产”）、上海志庄资产管理中心（有限合伙）（以下简称“志庄资产”）。公司注册资本人民币 24,000 万元，其中，华泰保险集团持股比例为 85%，飞恒资产、旷正资产、泰颐资产、哲昌资产、志庄资产均为公司高级管理人员及核心业务骨干股权激励持股平台，合计持股比例为 15%。2022 年 03 月 25 日，公司设立北京分公司。2024 年 12 月 27 日，公司设立华南分公司。目前，公司经营范围为基金募集、基金销售、资产管理、特定客户资产管理和中国证监会许可的其他业务。此外，公司还具有保险资金受托管理资格。

截至 2026 年 06 月 30 日，公司共管理 37 只公募基金，公募基金资产管理总规模为 783.98 亿元人民币，包括货币型、债券型、混合型、股票型、指数型等类型。

### 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 | | |
| 王海明 | 基金经理 | 2023 年 11 月 07 日 | - | 10 年 | 上海财经大学经济学硕士。曾任华泰资产管理有限公司固定收益投资部研究员。2016 年 8 月加入华泰保兴基金管理有限公司。 |

注：1、基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，其“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期。

2、基金的非首任基金经理，其“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

3、证券从业的含义遵从《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

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、规范性文件要求和本基金基金合同约定，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，基金运作无违法违规、未履行基金合同或其他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

公司公平交易制度的执行情况主要包括：公平对待不同投资组合，禁止各投资组合之间进行以利益输送为目的的投资交易活动；建立统一的研究报告发布和信息共享平台，使各投资组合得到公平的投资研究服务；在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时，严格执行投资授权制度及授权审批程序；实行集中交易制度和公平交易分配制度，以“时间优先、价格优先”为基本原则，结合投资交易系统中的公平交易模块，尽最大可能保证公平对待各投资组合；建立各投资组合投资信息严格管理及保密制度，保证不同投资组合经理之间的重大非公开投资信息的相互隔离；加强对各投资组合投资交易行为的监察稽核力度，建立有效的异常交易行为日常监控和分析评估体系等。

本报告期内，未发现各投资组合因非公平交易等导致的利益输送行为及其他违反公平交易制度的情况，公平交易制度的整体执行情况良好。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

为规范投资行为，公平对待不同的投资组合，公司制定《异常交易监控与报告管理办法》对涉嫌内幕交易、涉嫌市场操纵、涉嫌利益输送等交易行为异常和交易价格异常的情形进行了界定，并拟定相应的监控、识别、分析与防控措施；公司禁止同一交易日内同一投资组合内部的反向交易以及其他可能导致不公平交易和利益输送的交易行为，严格监控同一交易日内不同投资组合之间的反向交易。

公司对各投资组合的交易行为进行监控和分析，对各投资组合不同时间窗口内的同向交易、反向交易的溢价金额与溢价率进行了 T 检验，未发现违反公平交易制度的异常交易行为。

本报告期内，未发生本公司管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的情形，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

2026 年上半年，国民经济延续总体平稳、向新向优的发展态势，生产供给稳中有升，就业物价总体稳定，外贸韧性持续彰显。6 月，制造业采购经理指数（PMI）录得 50.3%，比上月上升 0.3 个百分点，重返扩张区间；非制造业商务活动指数和综合 PMI 产出指数分别为 50.2%和 50.6%，均比上月上升 0.1 个百分点，我国经济景气水平有所回升。上半年，全国规模以上工业增加值同比增长 5.4%，其中 6 月份，全国规模以上工业增加值增长 5.3%，增速较上月加快 0.8 个百分点，连续两个月加快。上半年，社会消费商品和服务零售总额同比增长 2.7%，其中服务零售额增长 5.3%，增速高于商品零售额 4.2 个百分点。在一系列扩大服务消费政策带动下，服务消费供给丰富优化，消费新场景加速涌现。上半年，通讯信息服务类零售额增速保持较高水平。上半年，高技术产业投资同比增长 4.6%，增速比 1—5 月份加快 0.1 个百分点，拉动全部投资增长 0.5 个百分点。上半年，高技术制造业投资同比增长 3.2%。其中，电子电路制造业投资增长 55.6%，锂离子电池制造业投资增长 24.4%，电子专用材料制造业投资增长 10.0%，集成电路制造业投资增长 8.8%。进出口展现了很强韧性，上半年货物进出口总额达到 25.5 万亿元，其中出口增长 13.4%，进口增长 22.1%；一季度中国外贸占全球份额同比提高约 0.8 个百分点。

就业、居民消费者价格总体稳定，工业生产者出厂价格指数同比上涨。上半年，全国城镇调查失业率平均值为 5.2%，与上年同期持平；其中，二季度失业率均值为 5.1%，比一季度下降 0.2 个百分点。居民消费价格温和上涨，工业生产者价格同比涨幅扩大。6 月份，受季节性因素和国际市场价格波动等因素影响，居民消费价格指数（CPI）环比下降 0.3%，同比上涨 1.0%，扣除食品和能源价格的核心 CPI 同比上涨 1.0%，继续保持温和上涨。PPI 上涨 4.1%，涨幅比上月扩大 0.2 个百分点。

政策方面，今年以来宏观政策更加积极有为，货币政策保持适度宽松，强化逆周期和跨周期调节，综合运用多种货币政策工具，为经济持续向好向优创造适宜的货币金融环境。贷款市场报价利率改革效能持续释放，存款利率市场化调整机制作用有效发挥，货币政策传导效率增强，社会融资成本处于历史较低水平。财政政策方面，上半年政府债发行进度显著滞后。

债券市场方面，上半年债券收益率先下后上。10 年国债最低至 1.70，1 年存单至 1.43。资金方面，存款类机构质押式回购 DR001 利率在 4 月下降至 1.20 附近，5 月在调控下逐步上行。DR007 逐步回升至政策利率附近。短端收益率跟随资金面变动。中国人民银行推出隔夜逆回购，资金价格更加平稳。

报告期内，本基金秉承稳健投资原则谨慎操作，投资于标的指数中具有代表性和流动性的成份券和备选成份券，以实现对标的指数的有效跟踪，上半年组合整体运行状况良好。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末基金份额净值为 1.0212 元，本报告期内基金份额净值增长率为 0.29%，同期业绩比较基准收益率为 0.80%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2026 年下半年，国内经济将会保持稳中向好，高质量发展趋势。同时，当前外部环境更加复杂多变，世界经济增长动能疲弱，地缘冲突和经贸摩擦多发频发，主要经济体经济表现分化，通胀走势和货币政策调整存在不确定性。中国经济运行总体平稳、向新向优，高质量发展取得新成效，但仍面临供强需弱、结构分化、外部冲击等问题和挑战。

货币政策方面，中国人民银行将发挥增量政策和存量政策集成效应，增强政策前瞻性、灵活性和针对性，根据国内外经济金融形势和金融市场运行情况，把握好政策实施的力度、节奏和时机。保持流动性充裕，使社会融资规模、货币供应量增长同经济增长、价格总水平预期目标相匹配。

债券市场方面，在货币政策保持适度宽松的背景下，下半年有望平稳运行。

## 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人为确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定，确保基金资产估值的公平、合理、科学和一致性，保护基金份额持有人的合法权益，成立了估值委员会。估值委员会负责制订、评估和修订公司的估值管理办法，定期评估估值程序和估值技术，对估值技术进行最终决策，指导和监督整个估值流程。估值委员会委员由公司分管运营副总和投研部门、风险管理部、监察稽核部及运营保障部的指定人员担任。估值委员会委员在基金估值研究或运作方面具有丰富经验，熟悉相关法规、估值原则和估值技术，在估值工作中保持判断的专业性和客观性。

投研部门负责对特殊投资品种估值进行分析研究，并就可能影响投资品种公允价值的重大事项进行监控和报告，提出适用的估值模型和参数；负责对第三方估值机构的估值质量进行定期评估。风险管理部负责对特殊投资品种的估值技术和估值模型进行研究，通过实证分析等方法完善估值模型，验证投研部门提供的估值模型和参数并协助提供数据支持文件。监察稽核部检查、督促相关部门严格遵守法规和公司制度的规定，采用适当程序进行基金估值及调整；检查、督促相关部门及时进行信息披露；根据相关规定及估值委员会的决议对估值相关公告进行合规性审核。运营保障部根据相关法规和公司估值管理办法对基金进行估值；根据指定方法监控并汇报基金持有停牌股票的情况，根据公司估值委员会的决议进行估值并与托管人核对，与会计师事务所沟通；根据相关法规规定及时进行信息披露。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

截止报告期末，本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司/中证指数有限公司签署服务协

议，由其按约定提供在银行间同业市场交易的固定收益品种/在证券交易所市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外）的估值数据。

## 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、本基金的基金合同等规定以及基金的实际运作情况，本报告期内本基金未实施利润分配。本基金将严格按照法律法规及基金合同的规定实施利润分配。

## 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

本基金本报告期内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的情形、存在基金资产净值连续六十个工作日低于五千万元的情形，基金管理人已按规定向监管部门报告并提出解决方案。

# §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，平安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损害基金份额持有人利益的行为。

## 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

本报告期，本托管人复核的财务指标、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真实、准确、完整。

# §6 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：华泰保兴中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金
报告截止日：2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

| 资 产 | 附注号 | 本期末<br>2026 年 06 月 30 日 | 上年度末<br>2025 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|---|
| **资 产：** | | | |
| 货币资金 | 6.4.7.1 | 371,871.09 | 1,740,545.12 |
| 结算备付金 | | - | - |
| 存出保证金 | | - | - |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 3,796,563.21 | 18,168,864.58 |
| 其中：股票投资 | | - | - |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 3,796,563.21 | 18,168,864.58 |
| 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 | - | - |
| 应收清算款 | | - | - |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 10.00 | 3,189,622.00 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.5 | - | - |
| 资产总计 | | 4,168,444.30 | 23,099,031.70 |
| **负债和净资产** | **附注号** | **本期末<br>2026 年 06 月 30 日** | **上年度末<br>2025 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 | | - | 3,000,240.22 |
| 应付清算款 | | - | - |
| 应付赎回款 | | - | - |
| 应付管理人报酬 | | 712.06 | 4,231.15 |
| 应付托管费 | | 177.95 | 1,057.76 |
| 应付销售服务费 | | 712.06 | 4,231.15 |
| 应付投资顾问费 | | - | - |
| 应交税费 | | 20.50 | 42.36 |
| 应付利润 | | - | - |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.6 | 1,659.75 | 6,372.16 |
| 负债合计 | | 3,282.32 | 3,016,174.80 |
| **净资产：** | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.7 | 4,078,562.80 | 19,724,043.24 |
| 未分配利润 | 6.4.7.8 | 86,599.18 | 358,813.66 |
| 净资产合计 | | 4,165,161.98 | 20,082,856.90 |
| 负债和净资产总计 | | 4,168,444.30 | 23,099,031.70 |

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.0212 元，基金份额总额 4,078,562.80 份。

## 6.2 利润表

会计主体：华泰保兴中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金
本报告期：2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目 | 附注号 | 本期<br>2026 年 01 月 01 日至<br>2026 年 06 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2025 年 01 月 01 日至<br>2025 年 06 月 30 日 |
|---|---|---|---|
| **一、营业总收入** | | 57,482.48 | 14,857.60 |
| 1.利息收入 | | 4,036.84 | 1,515.95 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.9 | 4,036.84 | 1,515.95 |
| 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 | | - | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | 54,341.79 | 11,129.65 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.10 | - | - |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.11 | 54,341.79 | 11,129.65 |
| 资产支持证券投资收益 | 6.4.7.12 | - | - |
| 贵金属投资收益 | | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.13 | - | - |
| 股利收益 | 6.4.7.14 | - | - |
| 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 | -896.15 | 2,212.00 |
| 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 | - | - |
| **减：二、营业总支出** | | 28,511.64 | 7,710.53 |
| 1.管理人报酬 | | 10,130.04 | 3,229.85 |
| 2.托管费 | | 2,532.43 | 807.55 |
| 3.销售服务费 | | 10,130.04 | 3,229.85 |
| 4.投资顾问费 | | - | - |
| 5.利息支出 | | 5,701.27 | 443.28 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 5,701.27 | 443.28 |
| 6.信用减值损失 | 6.4.7.17 | - | - |
| 7.税金及附加 | | 17.86 | - |
| 8.其他费用 | 6.4.7.18 | - | - |
| **三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）** | | 28,970.84 | 7,147.07 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| **四、净利润（净亏损以“-”号填列）** | | 28,970.84 | 7,147.07 |
| **五、其他综合收益的税后净额** | | - | - |
| **六、综合收益总额** | | 28,970.84 | 7,147.07 |

## 6.3 净资产变动表

会计主体：华泰保兴中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金
本报告期：2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日 | | |
|---|---|---|---|
| | 实收基金 | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净资产 | 19,724,043.24 | 358,813.66 | 20,082,856.90 |
| 二、本期期初净资产 | 19,724,043.24 | 358,813.66 | 20,082,856.90 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | -15,645,480.44 | -272,214.48 | -15,917,694.92 |
| （一）、综合收益总额 | - | 28,970.84 | 28,970.84 |
| （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） | -15,645,480.44 | -301,185.32 | -15,946,665.76 |
| 其中：1.基金申购款 | 104,003,039.15 | 1,921,194.22 | 105,924,233.37 |
| 2.基金赎回款 | -119,648,519.59 | -2,222,379.54 | -121,870,899.13 |
| （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、本期期末净资产 | 4,078,562.80 | 86,599.18 | 4,165,161.98 |
| **项目** | **上期<br>2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日** | | |
| | **实收基金** | **未分配利润** | **净资产合计** |
| 一、上期期末净资产 | 1,983,246.16 | 25,927.67 | 2,009,173.83 |
| 二、本期期初净资产 | 1,983,246.16 | 25,927.67 | 2,009,173.83 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | 81,882.92 | 5,747.47 | 87,630.39 |
| （一）、综合收益总额 | - | 7,147.07 | 7,147.07 |
| （二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“- | 81,882.92 | -1,399.60 | 80,483.32 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 号填列） | | | |
| 其中：1.基金申购款 | 12,766,659.35 | 174,030.86 | 12,940,690.21 |
| 2.基金赎回款 | -12,684,776.43 | -175,430.46 | -12,860,206.89 |
| （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、本期期末净资产 | 2,065,129.08 | 31,675.14 | 2,096,804.22 |

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：

| | | |
|---|---|---|
| 王现成 | 赵俊 | 王云凌 |
| 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

华泰保兴中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金(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〔2023〕1163 号《关于准予华泰保兴中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金注册的批复》准予注册，由华泰保兴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《华泰保兴中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金基金合同》负责公开募集。经向中国证监会备案，《华泰保兴中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金基金合同》于 2023 年 11 月 07 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 263,134,210.34 份基金份额，业经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）予以验证。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定。本基金的基金管理人为华泰保兴基金管理有限公司，基金托管人为平安银行股份有限公司。

### 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《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称“企业会计准则”)、中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，同时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发布的若干基金行业实务操作。

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 2026 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 2026 年 06 月 30 日的财务状况以及 2026 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[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、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]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》、财税[2025]4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》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债券的转让收入免征增值税。对证券投资基金取得的自 2025 年 8 月 8 日之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复缴纳增值税；取得的在 2025 年 8 月 8 日之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分)的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。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，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 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<br>2026 年 06 月 30 日 |
|---|---|
| 活期存款 | 371,871.09 |
| 等于：本金 | 371,835.95 |
| 加：应计利息 | 35.14 |
| 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 | - |
| 等于：本金 | - |
| 加：应计利息 | - |
| 合计 | 371,871.09 |

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | | 本期末<br>2026 年 06 月 30 日 | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 成本 | 应计利息 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | | - | - | - | - |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | | - | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | - | - | - | - |
| | 银行间市场 | 3,759,518.80 | 36,593.21 | 3,796,563.21 | 451.20 |
| | 小计 | 3,759,518.80 | 36,593.21 | 3,796,563.21 | 451.20 |
| 资产支持证券 | | - | - | - | - |
| 基金 | | - | - | - | - |
| 其他 | | - | - | - | - |
| 合计 | | 3,759,518.80 | 36,593.21 | 3,796,563.21 | 451.20 |

### 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<br>2026 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 | - |
| 应付交易费用 | 1,659.75 |
| 其中：交易所市场 | - |
| 银行间市场 | 1,659.75 |
| 应付利息 | - |
| 合计 | 1,659.75 |

### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日 | |
|---|---|---|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 19,724,043.24 | 19,724,043.24 |
| 本期申购 | 104,003,039.15 | 104,003,039.15 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -119,648,519.59 | -119,648,519.59 |
| 本期末 | 4,078,562.80 | 4,078,562.80 |

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

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|---|---|---|---|
| 上年度末 | 331,186.45 | 27,627.21 | 358,813.66 |
| 本期期初 | 331,186.45 | 27,627.21 | 358,813.66 |
| 本期利润 | 29,866.99 | -896.15 | 28,970.84 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -280,353.97 | -20,831.35 | -301,185.32 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 其中：基金申购款 | 1,780,545.54 | 140,648.68 | 1,921,194.22 |
| 基金赎回款 | -2,060,899.51 | -161,480.03 | -2,222,379.54 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 80,699.47 | 5,899.71 | 86,599.18 |

## 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日 |
|---|---|
| 活期存款利息收入 | 3,951.09 |
| 定期存款利息收入 | - |
| 其他存款利息收入 | - |
| 结算备付金利息收入 | - |
| 其他 | 85.75 |
| 合计 | 4,036.84 |

## 6.4.7.10 股票投资收益

本基金本报告期内无股票投资收益。

## 6.4.7.11 债券投资收益

### 6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2026年01月01日至2026年06月30日 |
|---|---|
| 债券投资收益--利息收入 | 63,777.59 |
| 债券投资收益--买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | -9,435.80 |
| 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 | 54,341.79 |

### 6.4.7.11.2 债券投资收益--买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2026年01月01日至2026年06月30日 |
|---|---|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额 | 30,598,407.91 |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 30,241,858.25 |
| 减：应计利息总额 | 359,751.96 |
| 减：交易费用 | 6,233.50 |
| 买卖债券差价收入 | -9,435.80 |

## 6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

### 6.4.7.13 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

### 6.4.7.14 股利收益

本基金本报告期内无股利收益。

### 6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期<br>2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日 |
|---|---|
| 1.交易性金融资产 | -896.15 |
| --股票投资 | - |
| --债券投资 | -896.15 |
| --资产支持证券投资 | - |
| --基金投资 | - |
| --贵金属投资 | - |
| --其他 | - |
| 2.衍生工具 | - |
| --权证投资 | - |
| 3.其他 | - |
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税 | - |
| 合计 | -896.15 |

### 6.4.7.16 其他收入

本基金本报告期内无其他收入。

### 6.4.7.17 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

### 6.4.7.18 其他费用

本基金本报告期内无其他费用。

## 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

截至财务报表批准报出日，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、关联关系

### 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 |
| --- | --- |
| 华泰保兴基金管理有限公司（“华泰保兴基金”） | 基金管理人、登记机构、基金销售机构 |
| 平安银行股份有限公司（“平安银行”） | 基金托管人、基金销售机构 |

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

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的交易。

### 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<br>2026年01月01日至2026年06月30日 | 上年度可比期间<br>2025年01月01日至2025年06月30日 |
| --- | --- | --- |
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 10,130.04 | 3,229.85 |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 4,401.45 | 1,437.88 |
| 应支付基金管理人的净管理费 | 5,728.59 | 1,791.97 |

注：支付基金管理人华泰保兴基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.20%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 × 0.20% / 当年天数。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2026年01月01日至2026年06月30日 | 上年度可比期间<br>2025年01月01日至2025年06月30日 |
| --- | --- | --- |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 2,532.43 | 807.55 |

注：支付基金托管人平安银行的托管费按前一日基金资产净值 0.05%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 × 0.05% / 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<br>2026年01月01日至2026年06月30日 |
|---|---|
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 |
| 华泰保兴基金 | 824.14 |
| 平安银行 | 303.71 |
| 合计 | 1,127.85 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间<br>2025年01月01日至2025年06月30日 |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 |
| 华泰保兴基金 | 70.05 |
| 平安银行 | 757.00 |
| 合计 | 827.05 |

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金份额基金资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给华泰保兴基金，再由华泰保兴基金计算并支付给各基金销售机构。基金份额约定的销售服务费年费率为 0.20%。其计算公式为：

日销售服务费 = 前一日基金资产净值 × 0.20% / 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

本基金本报告期内及上年度可比期间均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

本基金本报告期内及上年度可比期间转融通证券出借业务未发生重大关联交易事项。

### 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

本报告期内及上年度可比期间基金管理人未持有过本基金份额。

### 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除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

### 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 | 上年度可比期间 |
|---|---|---|

| | 2026年01月01日至2026年06月30日 | | 2025年01月01日至2025年06月30日 | |
|---|---|---|---|---|
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 平安银行 | 371,871.09 | 3,951.09 | 99,279.06 | 1,515.95 |

注：本基金的银行存款由基金托管人平安银行保管，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未在承销期内参与关联方承销的证券。

### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

### 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 2026 年 06 月 30 日本基金持有的流通受限证券

### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

### 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证券出借业务的证券。

### 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

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了分工明确、相互制约的风险管理组织架构体系。公司的风险管理组织架构体系由公司董事会、董事会风险控制委员会、董事会审计委

员会、经理层及其合规和风险管理委员会、督察长、监察稽核部、风险管理部、各业务部门及全体员工共同组成。

董事会负责确定公司风险管理总体目标，制定公司风险管理战略和风险应对策略，对公司的风险控制承担最终责任；董事会下设风险控制委员会，负责对公司经营管理和投资业务进行合规性控制，检查公司内部风险控制制度的执行情况，并对公司出现的风险问题和存在的风险隐患进行研究并提出处理意见；董事会下设审计委员会，负责检查公司财务，并对公司董事、高级管理人员执行职务的行为进行监督，如公司董事、高级管理人员的行为损害公司或股东的利益时，有权要求其予以纠正。公司经理层负责根据董事会批准的风险控制制度和战略具体组织实施公司风险控制工作并对风险控制的有效性及其执行效果承担直接责任；总经理负责公司全面的风险控制工作，其他高级管理人员负责其分管业务范围的风险控制工作；公司经理层下设合规和风险管理委员会，负责协助经理层进行风险管理的咨询和议事，指导、协调和监督各职能部门和各业务单元开展风险管理工作。在业务操作层面，督察长按照中国证监会有关监管规定开展风险管理工作，负责分管并领导监察稽核部、风险管理部独立履行监察稽核及风险管理职责；监察稽核部对公司的风险控制承担独立评估、检查和报告职责；风险管理部对公司的风险控制承担评估、分析、评价职责，具体而言，风险管理部通过投资交易系统的风控参数设置，使得各投资组合的投资范围及投资比例限制合规；参与各投资组合新股申购、债券申购以及银行间交易等场外交易的风险识别与评估，保证场外交易的事中合规控制，并完成各投资组合的投资风险及绩效分析。公司各业务部门负责执行公司的风险控制政策及决策，定期对本部门的风险进行全面评估，并对本部门风险控制的有效性负责；公司所有员工是本岗位风险控制的直接责任人，负责具体风险管理职责的实施。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去评估各种风险可能产生的损失。从定性的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的额度；从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具的特征通过特定的风险量化指标、模型、日常量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，以及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之内。

### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人平安银行，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<br>2026 年 06 月 30 日 | 上年度末<br>2025 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| A-1 | - | - |
| A-1 以下 | - | - |
| 未评级 | 506,432.88 | 1,206,948.49 |
| 合计 | 506,432.88 | 1,206,948.49 |

注：未评级债券为政策性金融债。

### 6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2026 年 06 月 30 日 | 上年度末<br>2025 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| AAA | 3,290,130.33 | 16,961,916.09 |
| AAA 以下 | - | - |
| 未评级 | - | - |
| 合计 | 3,290,130.33 | 16,961,916.09 |

注：同业存单无债券债项评级，按照发行主体长期评级列示。

### 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，有效保障基金份额持有人利益。

于 2026 年 06 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约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，因此账面余额即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公司发行的证券不得超过该证券的 10%。

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%。

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。

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<br>2026 年 06 月 30 日 | 6 个月以内 | 6 个月-1 年 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 资产 | | | | | | |
| 货币资金 | 371,871.09 | - | - | - | - | 371,871.09 |
| 结算备付金 | - | - | - | - | - | - |
| 存出保证金 | - | - | - | - | - | - |
| 交易性金融资产 | 3,399,738.16 | 396,825.05 | - | - | - | 3,796,563.21 |
| 衍生金融资产 | - | - | - | - | - | - |
| 买入返售金融资产 | - | - | - | - | - | - |
| 应收清算款 | - | - | - | - | - | - |
| 应收股利 | - | - | - | - | - | - |
| 应收申购款 | - | - | - | - | 10.00 | 10.00 |
| 递延所得税资产 | - | - | - | - | - | - |
| 其他资产 | - | - | - | - | - | - |
| 资产总计 | 3,771,609.25 | 396,825.05 | - | - | 10.00 | 4,168,444.30 |
| 负债 | | | | | | |
| 短期借款 | - | - | - | - | - | - |
| 交易性金融负债 | - | - | - | - | - | - |
| 衍生金融负债 | - | - | - | - | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | - | - | - | - | - | - |
| 应付清算款 | - | - | - | - | - | - |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | - | - |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | 712.06 | 712.06 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | 177.95 | 177.95 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | 712.06 | 712.06 |
| 应付投资顾问费 | - | - | - | - | - | - |
| 应交税费 | - | - | - | - | 20.50 | 20.50 |
| 应付利润 | - | - | - | - | - | - |
| 递延所得税负债 | - | - | - | - | - | - |
| 其他负债 | - | - | - | - | 1,659.75 | 1,659.75 |
| 负债总计 | - | - | - | - | 3,282.32 | 3,282.32 |
| 利率敏感度缺口 | 3,771,609.25 | 396,825.05 | - | - | -3,272.32 | 4,165,161.98 |
| 上年度末 | 6 个月以内 | 6 个月-1 年 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |

| 2025 年 12 月 31 日 | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 资产 | | | | | | |
| 货币资金 | 1,740,545.12 | - | - | - | - | 1,740,545.12 |
| 结算备付金 | - | - | - | - | - | - |
| 存出保证金 | - | - | - | - | - | - |
| 交易性金融资产 | 14,205,485.94 | 3,963,378.64 | - | - | - | 18,168,864.58 |
| 衍生金融资产 | - | - | - | - | - | - |
| 买入返售金融资产 | - | - | - | - | - | - |
| 应收清算款 | - | - | - | - | - | - |
| 应收股利 | - | - | - | - | - | - |
| 应收申购款 | - | - | - | - | 3,189,622.00 | 3,189,622.00 |
| 递延所得税资产 | - | - | - | - | - | - |
| 其他资产 | - | - | - | - | - | - |
| 资产总计 | 15,946,031.06 | 3,963,378.64 | - | - | 3,189,622.00 | 23,099,031.70 |
| 负债 | | | | | | |
| 短期借款 | - | - | - | - | - | - |
| 交易性金融负债 | - | - | - | - | - | - |
| 衍生金融负债 | - | - | - | - | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | 3,000,240.22 | - | - | - | - | 3,000,240.22 |
| 应付清算款 | - | - | - | - | - | - |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | - | - |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | 4,231.15 | 4,231.15 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | 1,057.76 | 1,057.76 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | 4,231.15 | 4,231.15 |
| 应付投资顾问费 | - | - | - | - | - | - |
| 应交税费 | - | - | - | - | 42.36 | 42.36 |
| 应付利润 | - | - | - | - | - | - |
| 递延所得税负债 | - | - | - | - | - | - |
| 其他负债 | - | - | - | - | 6,372.16 | 6,372.16 |
| 负债总计 | 3,000,240.22 | - | - | - | 15,934.58 | 3,016,174.80 |
| 利率敏感度缺口 | 12,945,790.84 | 3,963,378.64 | - | - | 3,173,687.42 | 20,082,856.90 |

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

### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| 假设 | 除市场利率以外的其他市场变量保持不变 | | |
|---|---|---|---|
| 分析 | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） | |
| | | 本期末（2026 年 06 月 30 日） | 上年度末（2025 年 12 月 31 日） |
| | 市场利率下降 25 个基点 | 1,997.80 | 15,556.75 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| | 市场利率上升 25 个基点 | -1,994.20 | -15,512.92 |

### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外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固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

## 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<br>2026 年 06 月 30 日 | 上年度末<br>2025 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| 第一层次 | - | - |
| 第二层次 | 3,796,563.21 | 18,168,864.58 |
| 第三层次 | - | - |
| 合计 | 3,796,563.21 | 18,168,864.58 |

#### 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证券，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证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，确定相关证券的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 2026 年 06 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融工具（2025 年 12 月 31 日：同）。

### 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

截至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 | - | - |
| | 其中：股票 | - | - |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 3,796,563.21 | 91.08 |
| | 其中：债券 | 3,796,563.21 | 91.08 |
| | 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 | 371,871.09 | 8.92 |
| 8 | 其他各项资产 | 10.00 | 0.00 |
| 9 | 合计 | 4,168,444.30 | 100.00 |

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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

本基金本报告期内未进行股票买卖交易。

## 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 | 506,432.88 | 12.16 |
| | 其中：政策性金融债 | 506,432.88 | 12.16 |
| 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 | 3,290,130.33 | 78.99 |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 3,796,563.21 | 91.15 |

## 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 | 250211 | 25 国开 11 | 5,000 | 506,432.88 | 12.16 |
| 2 | 112515162 | 25 民生银行 CD162 | 4,000 | 399,977.22 | 9.60 |
| 3 | 112516088 | 25 上海银行 CD088 | 4,000 | 399,894.51 | 9.60 |
| 4 | 112514116 | 25 江苏银行 CD116 | 4,000 | 399,780.38 | 9.60 |
| 5 | 112617015 | 26 光大银行 CD015 | 4,000 | 399,363.09 | 9.59 |

## 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 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未进行股指期货投资。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未进行国债期货投资。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1 基金投资前十名证券的发行主体本期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、处罚说明

根据公开市场信息显示，本基金投资的前十名证券的发行主体中，国家开发银行在报告编制日前一年内受到行政处罚，详见《国家外汇管理局北京市分局外汇行政处罚信息查询（京汇罚〔2025〕30 号）》《中国人民银行政府信息公开（银罚决字〔2025〕66 号》。交通银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到行政处罚，详见《国家金融监督管理总局行政处罚信息公示列表（2026

年 6 月 5 日）》《中国人民银行政府信息公开行政处罚公示（银罚决字〔2025〕96 号）》。上海浦东发展银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到行政处罚，详见《国家金融监督管理总局行政处罚信息公示列表》（2025 年 10 月 31 日）《国家金融监督管理总局行政处罚信息公示列表》（2025 年 12 月 19 日）《国家外汇管理局上海市分局外汇行政处罚信息查询（上海汇管罚字〔2025〕10 号）》《中国人民银行行政处罚信息公示（银罚决字〔2026〕27 号）》。上海银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到行政处罚，详见《国家金融监督管理总局上海监管局行政处罚信息公开表（沪金罚决字〔2026〕17-20,22、23 号）》《中国人民银行政府信息公开（银罚决字〔2025〕10 号》。兴业银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到行政处罚，详见《国家金融监督管理总局行政处罚信息公示列表》（2025 年 12 月 5 日）。中国工商银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到行政处罚，详见《国家金融监督管理总局行政处罚信息公示列表（2026 年 6 月 5 日）》《国家外汇管理局北京市分局外汇行政处罚信息查询（京汇罚〔2025〕49 号）》《中国人民银行政府信息公开行政处罚公示（银罚决字〔2025〕110 号）》。中国光大银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到行政处罚，详见《国家金融监督管理总局行政处罚信息公示列表（2025 年 9 月 12 日）》。中国民生银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到行政处罚，详见《国家金融监督管理总局宁波监管局行政处罚信息公开表》（2025 年 12 月 31 日）《国家金融监督管理总局行政处罚信息公示列表》（2025 年 10 月 31 日）《国家金融监督管理总局行政处罚信息公示列表》（2025 年 9 月 12 日）。中国农业银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到行政处罚，详见《国家金融监督管理总局行政处罚信息公示列表》（2025 年 10 月 31 日）。本基金投资上述证券的投资决策程序，符合法律法规及公司投资制度有关规定。

### 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 | 应收清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 10.00 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |

| | | |
|---|---|---|
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 10.00 |

## 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

由于四舍五入原因，投资组合报告中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

| 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 |
| 355 | 11,488.91 | 1,233,907.91 | 30.25% | 2,844,654.89 | 69.75% |

## 8.2 盈利投资者数量占比

| 项目 | 过去一年（2025 年 07 月 01 日-2026 年 06 月 30 日） |
|---|---|
| 盈利投资者数量占比 | 88.85% |

注：盈利投资者数量占比=盈利投资者数量/投资者总数。其中，投资者指指标计算期间持有过基金份额的投资者，盈利投资者指投资者区间净收益不小于零的投资者。

## 8.3 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 | 2,214,583.88 | 54.30% |

## 8.4 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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | >100 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 10~50 |

# §9开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|---|---|
| 基金合同生效日（2023 年 11 月 07 日）基金份额总额 | 263,134,210.34 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 19,724,043.24 |
| 本报告期基金总申购份额 | 104,003,039.15 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 119,648,519.59 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 4,078,562.80 |

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

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

2026 年 6 月 23 日，根据托管人工作安排，聘任宋卓先生为平安银行股份有限公司资产托管部总经理。

## 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、基金财产的诉讼事项。

本报告期内，无涉及本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，本基金投资策略未改变。

## 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自 2024 年度起聘请德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。本报告期内，本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

## 10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

### 10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人无受调查或处罚等情况。

### 10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

### 10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门无受到调查或处罚等情况。

### 10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门相关从业人员无受到调查或处罚等情况。

## 10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

### 10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

本基金本报告期内未租用证券公司交易单元。

## 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 | 华泰保兴中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金 2025 年第 4 季度报告 | 管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2026年01月22日 |
| 2 | 华泰保兴基金管理有限公司关于旗下基金 2025 年年度报告的提示性公告 | 管理人网站、《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》《证券日报》 | 2026年03月31日 |
| 3 | 华泰保兴中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金 2025 年年度报告 | 管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2026年03月31日 |
| 4 | 华泰保兴基金管理有限公司关于旗下基金增加易方达财富管理基金销售（广州）有限公司为销售机构及开通相关业务的公告 | 管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》《证券日报》 | 2026年04月17日 |
| 5 | 华泰保兴基金管理有限公司关于旗下基金 2026 年第 1 季度报告的提示性公告 | 管理人网站、《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》《证券日报》 | 2026年04月22日 |
| 6 | 华泰保兴中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金 2026 年第 1 季度报告 | 管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2026年04月22日 |
| 7 | 华泰保兴基金管理有限公司以股东身份（通过公募基金持股）参与股东大会投票信息披露（2025 年度） | 管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2026年04月30日 |
| 8 | 华泰保兴基金管理有限公司关于旗下基金增加汇添富基金销售（上海）有限公司为销售机构及开通相关业务的公告 | 管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》《证券日报》 | 2026年06月18日 |

# §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 | 20260212-20260225,20260318-20260414 | - | 5,888,125.84 | 5,888,125.84 | - | - |
| | 2 | 20260306-20260317,20260415-20260630 | 937,054.56 | - | - | 937,054.56 | 22.98% |
| 个人 | 1 | 20260401-20260407 | - | 1,965,032.52 | 1,965,032.52 | - | - |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| 本基金本报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金总份额 20%的情况，在市场流动性不足的情况下，如遇投资者巨额赎回或集中赎回，存在基金资产无法以合理价格及时变现以支付投资者赎回款的风险，以及基金份额净值出现大幅波动的风险。 | | | | | | | |

注：申购份额含红利再投、转换入份额。赎回份额含转换出份额。

## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

为减轻“迷你基金”固定费用支出给基金投资者造成的负担，切实保障基金份额持有人利益，自 2024 年 6 月 17 日起，本基金的各类固定费用（包括信息披露费、审计费、持有人大会费（如有）、银行间账户维护费等）由基金管理人承担，不再从基金资产中列支。

# §12 备查文件目录

## 12.1 备查文件目录

1、中国证监会准予本基金注册的文件

2、《华泰保兴中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金基金合同》

3、《华泰保兴中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金托管协议》

4、《华泰保兴中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金招募说明书》

5、基金管理人业务资格批件、营业执照

6、报告期内本基金在规定媒介披露的各项公告

7、中国证监会要求的其他文件

## 12.2 存放地点

基金管理人办公场所及基金托管人住所

## 12.3 查阅方式

1、营业时间内至基金管理人办公场所免费查阅

2、登录基金管理人网站 www.ehuataifund.com 查阅

3、拨打基金管理人客服热线电话 400-632-9090（免长途话费）查询

华泰保兴基金管理有限公司

2026 年 08 月 29 日