

# 易米中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金

## 2024 年年度报告

2024 年 12 月 31 日

基金管理人:易米基金管理有限公司

基金托管人:江苏银行股份有限公司

送出日期:2025 年 03 月 28 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责任。本年度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。

基金托管人江苏银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2025年3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。

本报告期自2024年9月19日（基金合同生效日）起至2024年12月31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、基金净值表现及利润分配情况 .....                 | 6  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标 .....                         | 6  |
| 3.2 基金净值表现 .....                              | 7  |
| 3.3 过去三年基金的利润分配情况 .....                       | 8  |
| §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 .....              | 9  |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....                 | 10 |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 .....             | 10 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....             | 11 |
| 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 .....                 | 11 |
| 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....                | 12 |
| 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....                 | 12 |
| 4.9 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 .....                                | 13 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....                  | 13 |
| 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 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见 .....       | 13 |
| §6 审计报告 .....                                 | 13 |
| 6.1 审计报告基本信息 .....                            | 13 |
| 6.2 审计报告的基本内容 .....                           | 13 |
| §7 年度财务报表 .....                               | 16 |
| 7.1 资产负债表 .....                               | 16 |
| 7.2 利润表 .....                                 | 18 |
| 7.3 净资产变动表 .....                              | 19 |
| 7.4 报表附注 .....                                | 20 |
| §8 投资组合报告 .....                               | 43 |
| 8.1 期末基金资产组合情况 .....                          | 43 |
| 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....                    | 44 |
| 8.3 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 |
| 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....                     | 44 |
| 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....                    | 44 |
| 8.6 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 .....      | 45 |
| 8.7 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 .....   | 45 |
| 8.8 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 .....   | 45 |

|                                          |    |
|------------------------------------------|----|
| 8.9 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 ..... | 45 |
| 8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....                | 45 |
| 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....          | 45 |
| 8.12 投资组合报告附注 .....                      | 46 |
| §9 基金份额持有人信息 .....                       | 48 |
| 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....              | 48 |
| 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....           | 48 |
| 9.3 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 .....   | 49 |
| §10 开放式基金份额变动 .....                      | 49 |
| §11 重大事件揭示 .....                         | 49 |
| 11.1 基金份额持有人大会决议 .....                   | 49 |
| 11.2 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 .....   | 49 |
| 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....        | 50 |
| 11.4 基金投资策略的改变 .....                     | 50 |
| 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....              | 50 |
| 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....      | 50 |
| 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....             | 50 |
| 11.8 其他重大事件 .....                        | 51 |
| §12 影响投资者决策的其他重要信息 .....                 | 52 |
| 12.1 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 ..... | 52 |
| 12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....                | 52 |
| §13 备查文件目录 .....                         | 52 |
| 13.1 备查文件目录 .....                        | 52 |
| 13.2 存放地点 .....                          | 52 |
| 13.3 查阅方式 .....                          | 52 |

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

|            |                          |
|------------|--------------------------|
| 基金名称       | 易米中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金 |
| 基金简称       | 易米中证同业存单AAA指数7天持有期       |
| 基金主代码      | 021592                   |
| 基金运作方式     | 契约型开放式                   |
| 基金合同生效日    | 2024年09月19日              |
| 基金管理人      | 易米基金管理有限公司               |
| 基金托管人      | 江苏银行股份有限公司               |
| 报告期末基金份额总额 | 301,789,014.06份          |
| 基金合同存续期    | 不定期                      |

2.2 基金产品说明

|        |                                                                                                                                              |
|--------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标   | 本基金采用指数化投资，密切跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。                                                                                                        |
| 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，以实现对标的有效跟踪。在正常市场情况下，力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%，年跟踪误差不超过2%。 |
| 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 | 本基金风险与收益低于股票型基金、偏股混合型基金，高于货币市场基金。本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      |      | 易米基金管理有限公司       | 江苏银行股份有限公司              |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 安萍               | 田作全                     |
|         | 联系电话 | 021-60857133     | 025-58588321            |
|         | 电子邮箱 | Anp@yimifund.com | tianzuoquan@jsbchina.cn |

|        |                            |              |
|--------|----------------------------|--------------|
| 客户服务电话 | 4006-046-899               | 95319        |
| 传真     | 021-60857112               | 025-58588155 |
| 注册地址   | 上海市虹口区保定路450号<br>9幢320室    | 南京市中华路26号    |
| 办公地址   | 上海市浦东新区杨高南路<br>759号29层02单元 | 南京市中华路26号    |
| 邮政编码   | 200127                     | 210001       |
| 法定代表人  | 李毅                         | 葛仁余          |

2.4 信息披露方式

|                         |                        |
|-------------------------|------------------------|
| 本基金选定的信息披露<br>报纸名称      | 证券时报                   |
| 登载基金年度报告正文<br>的管理人互联网网址 | www.yimifund.com       |
| 基金年度报告备置地点              | 上海市浦东新区杨高南路759号29层02单元 |

2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称                   | 办公地址                                    |
|--------|----------------------|-----------------------------------------|
| 会计师事务所 | 容诚会计师事务所（特殊普通<br>合伙） | 北京市西城区阜成门外大街22号1幢<br>外经贸大厦901-22至901-26 |
| 注册登记机构 | 易米基金管理有限公司           | 上海市浦东新区杨高南路759号29层<br>02单元              |

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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 | 本期2024年09月19日（基金合同生效日） -<br>2024年12月31日 |
| 本期已实现收益       | 4,114,491.53                            |
| 本期利润          | 4,382,895.56                            |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0052                                  |
| 本期加权平均净值利润率   | 0.52%                                   |
| 本期基金份额净值增长率   | 0.51%                                   |

| 3.1.2 期末数据和指标 | 2024年末         |
|---------------|----------------|
| 期末可供分配利润      | 1,357,189.81   |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.0045         |
| 期末基金资产净值      | 303,338,393.26 |
| 期末基金份额净值      | 1.0051         |
| 3.1.3 累计期末指标  | 2024年末         |
| 基金份额累计净值增长率   | 0.51%          |

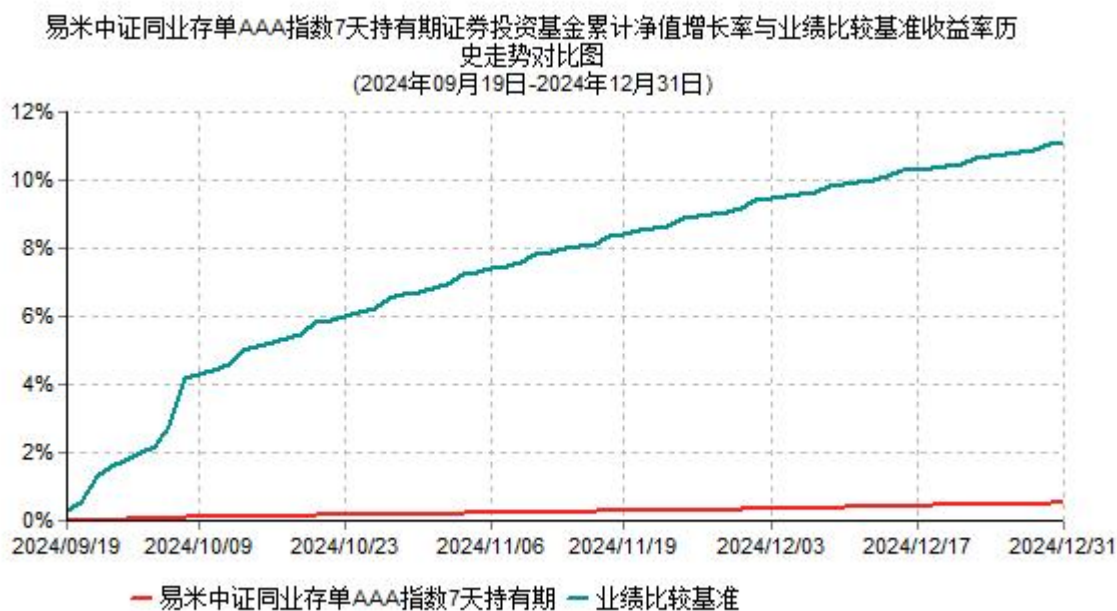
注：1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；  
2.本报告所列示的基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；  
3.期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分孰低数。

3.2 基金净值表现

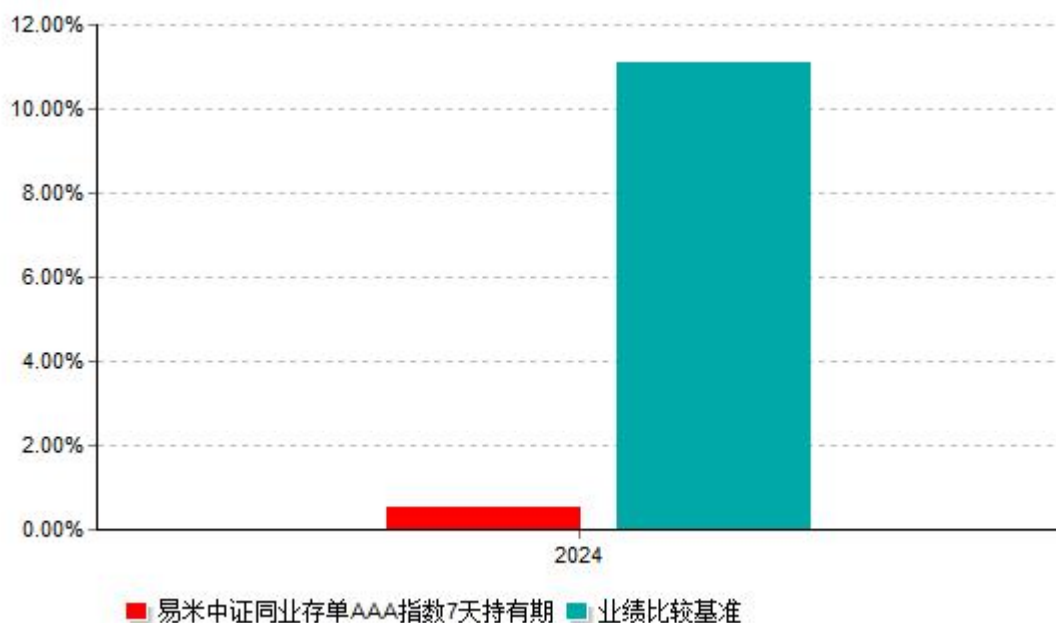
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段             | 份额净值<br>增长率① | 份额净值<br>增长率标<br>准差② | 业绩比较<br>基准收益<br>率③ | 业绩比较<br>基准收益<br>率标准差<br>④ | ①-③     | ②-④    |
|----------------|--------------|---------------------|--------------------|---------------------------|---------|--------|
| 过去三个月          | 0.46%        | 0.01%               | 8.13%              | 0.18%                     | -7.67%  | -0.17% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 0.51%        | 0.01%               | 11.10%             | 0.19%                     | -10.59% | -0.18% |

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



### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年无利润分配事项。

## §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

本基金管理人为易米基金管理有限公司。公司成立于2017年5月24日，2020年7月24日取得中国证监会《关于核准设立易米基金管理有限公司的批复》，2021年7月12日获得《经营证券期货业务许可证》。公司注册资本1.5亿元人民币，注册地上海市，经营范围为公开募集证券投资基金管理、基金销售、私募资产管理和中国证监会许可的其他业务。

截至2024年12月31日，易米基金管理有限公司共管理九只公募基金，为易米开鑫价值优选混合型证券投资基金、易米开泰混合型证券投资基金、易米中证科创创业50指数增强型发起式证券投资基金、易米和丰债券型证券投资基金、易米低碳经济股票型发起式证券投资基金、易米研究精选混合型发起式证券投资基金、易米鑫选品质混合型证券投资基金、易米远见价值一年定期开放混合型证券投资基金和易米中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金。

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<br>（助理）期限 |          | 证券<br>从业<br>年限 | 说明                                                                      |
|-----|-------------|---------------------|----------|----------------|-------------------------------------------------------------------------|
|     |             | 任职日期                | 离任<br>日期 |                |                                                                         |
| 李秋实 | 本基金基金<br>经理 | 2024-09-19          | -        | 10             | 李秋实，复旦大学硕士。曾任中银国际证券股份有限公司债券交易员，易米基金管理有限公司投资经理，现任易米基金管理有限公司基金经理、固定收益部总监。 |

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。  
2.证券从业的含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。  
3.本基金无基金经理助理。  
4.本基金本报告期内没有基金经理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遵规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》及其各项实施准则、《易米中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金基金合同》和其他有关法律

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，无损害基金份额持有人利益的行为。

本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定，无违法、违规行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《易米基金管理有限公司公平交易制度》和《易米基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》。公司通过科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，通过监察稽核、事后分析和信息披露来保证公平交易过程和结果的监督。

##### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《易米基金管理有限公司公平交易制度》和《易米基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》。本基金管理人通过建立科学的公平交易体系，将公平交易理念贯彻投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评价等环节，确保各个投资组合享有公平的投资决策机会。

报告期内，本基金管理人通过统计检验的方法对管理的不同投资组合，在不同时间窗下（1日内、3日内、5日内）的本季度同向交易价差进行了专项分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

##### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金管理人旗下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不存在超过该证券当日成交量的5%的情形。

报告期内，本基金管理人未发现可能导致不公平交易和利益输送的异常交易情况。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2024年，国内经济结构上出口和生产相对稳健，内需有所承压。稳健的货币政策为支持性基调，逆周期特征明显，利率中枢延续下行，全年累计2次降准1%，2次调降政策利率0.3%，同时广谱利率多次调降。但与此同时，整治手工补息、存款利率调降、同业活期存款利率自律管理等也对银行负债端规模形成了一定的压力，同业存单品种期限溢价较低，与同期限国开债相比具有较强的配置价值。

本基金以中证同业存单 AAA 指数为基准，根据组合特点合理选择其中具有代表性和流动性的成份券，以实现对标的指数的有效跟踪。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末中证同业存单AAA指数7天持有期基金份额净值为1.0051元，本报告期内，基金份额净值增长率为0.51%，同期业绩比较基准收益率为11.10%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本轮周期虽已处于偏底部，但重拾内生动能还需一些时间，货币政策将继续维持宽松取向，为经济的修复保驾护航。展望后市，货币政策宽松政策操作尚未落地，银行负债成本压降仍有必要，后续更需注重货币节奏的把握，灵活配置存单资产，力争为持有人带来稳定的投资收益。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，基金管理人根据法规、市场、监管要求的变化和业务发展的实际需要，继续重点围绕严守合规底线、履行合规义务、防控内幕交易等进一步完善公司内控，持续强化制度的完善及对制度执行情况的监督检查，有效保证了旗下基金管理运作及公司各项业务的合法合规和稳健有序。报告期内，基金管理人的监察稽核体系运行顺利，本基金没有出现违法违规行为。报告期内，基金管理人有关法律稽核工作情况如下：

（1）根据相关监管规定及公司规定，对基金发行前的基金文件进行合规性审查，确保相关基金文件的合法合规。

（2）结合新法规的实施、新的监管要求和公司业务发展实际，推动公司各部门及时完善与更新制度规范和业务流程，确保内控制度的适时性、全面性和合法合规性，并加强内部督导，将风险意识贯穿于各岗位与各业务环节。

（3）日常监察和专项监察相结合，通过定期检查、不定期抽查、专项监察等工作方法，加强对基金日常业务的合规审核和合规监测，并加强对重要业务和关键业务环节的监督检查。

（4）规范基金销售业务，保证基金销售业务的合法合规性。公司在基金募集和持续营销活动中，严格规范基金销售业务，按照相关法规规定审查宣传推介材料，逐步落实反洗钱法律法规各项要求，做好投资者教育和投资者适当性工作。

（5）规范基金投资业务，保证投资管理工作规范有序、合法合规进行。公司制定了严格规范的投资管理制度和流程机制，投资业务均按照管理制度和业务流程执行。

（6）以外聘律师、讲座等多种方式加强合规教育与培训，促进公司合规文化的建设，及时向公司传达基金相关的法律法规；加大对员工行为的监察稽核力度，从源头上防范合规风险，防范利益输送行为。

公司自成立以来，各项业务运作正常，内部控制和风险防范措施逐步完善并积极作用。公司将继续以风险控制为核心，进一步提高内部监察工作的科学性和有效性，切实保障基金的规范运作，充分保障基金份额持有人的利益。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

为合理、公允地对基金所投资品种进行估值，保护基金份额持有人利益，本基金管理人设立估值委员会，专门负责讨论和决策基金估值的重大问题，直接向公司管理层负责，在确定公司旗下基金的估值方法、估值模型选择、估值模型假设及估值政策和程序的建立等方面为公司管理层提供参考意见，为业务部门的操作提供指导意见并对执行情况进行监督。估值委员会设主任委员一名，由公司分管运营副总经理担任，常务副主任委员一名，由运营部负责人担任，专业委员若干名，由投资、研究、交易、监察稽核、市场、运营等相关部门的指定人员组成。估值委员会的职责主要包括有：

- (1) 制定、修订估值管理办法，并提交有权机构审批；
- (2) 制订合理、公允的估值方法；
- (3) 对估值方法进行讨论并作出评价，在发生了影响估值公允性及合理性的情况后及时修订估值方法，以保证其持续适用；
- (4) 评价现有估值方法对新投资策略或新投资品种的适用性，对新投资策略或新投资品种采用的估值方法作出决定；
- (5) 对是否暂停估值及是否启用摆动定价、侧袋估值等估值技术作出决定；
- (6) 讨论、决定其他与估值相关的重大问题。

参与估值流程的各方还包括基金托管人和会计师事务所。基金托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任，当存有异议时，基金托管人有责任要求基金管理人作出合理解释，通过积极商讨达成一致意见。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中债金融估值中心有限公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法律法规及基金合同的规定。

#### 4.9 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

本报告期内，本基金无应说明的预警信息。

§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遵规守信、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

本托管人认真复核了本年度报告中的财务指标、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 审计报告

6.1 审计报告基本信息

|            |                      |
|------------|----------------------|
| 财务报表是否经过审计 | 是                    |
| 审计意见类型     | 标准无保留意见              |
| 审计报告编号     | 容诚审字[2025]200Z1871 号 |

6.2 审计报告的基本内容

|         |                                                                                                                                                                |
|---------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 审计报告标题  | 审计报告                                                                                                                                                           |
| 审计报告收件人 | 易米中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金全体基金份额持有人                                                                                                                              |
| 审计意见    | 我们审计了易米中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金（以下简称“易米中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期基金”）财务报表，包括 2024 年 12 月 31 日的资产负债表，2024 年 9 月 19 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日止期间的利润表、净资产变动表以及相关财务 |

|                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
|-----------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|                 | 报表附注。我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“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，公允反映了易米中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期基金 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年 9 月 19 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净资产变动情况。                                                         |
| 形成审计意见的基础       | 我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于易米中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。                                                                                                                           |
| 强调事项            | 无                                                                                                                                                                                                                                                                                               |
| 其他事项            | 无                                                                                                                                                                                                                                                                                               |
| 其他信息            | 无                                                                                                                                                                                                                                                                                               |
| 管理层和治理层对财务报表的责任 | 易米中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期基金的基金管理人易米基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估易米中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算易米中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期基金、终止运营或别无其他现实 |

|                        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |
|------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|                        | <p>的选择。基金管理人治理层负责监督易米中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期基金的财务报告过程。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |
| <p>注册会计师对财务报表审计的责任</p> | <p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。（2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。（3）评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。（4）对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对易米中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致易米中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期基金不能持续</p> |

|           |                                                                                                                |     |
|-----------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----|
|           | 经营。（5）评价财务报表的总体列报、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。 |     |
| 会计师事务所的名称 | 容诚会计师事务所（特殊普通合伙）                                                                                               |     |
| 注册会计师的姓名  | 赵钰                                                                                                             | 姜爱悦 |
| 会计师事务所的地址 | 北京市西城区阜成门外大街22号1幢外经贸大厦901-22至901-26                                                                            |     |
| 审计报告日期    | 2025-03-25                                                                                                     |     |

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：易米中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金

报告截止日：2024年12月31日

单位：人民币元

| 资产       | 附注号     | 本期末<br>2024年12月31日 |
|----------|---------|--------------------|
| 资产：      |         |                    |
| 货币资金     | 7.4.7.1 | 1,969,880.22       |
| 结算备付金    |         | -                  |
| 存出保证金    |         | -                  |
| 交易性金融资产  | 7.4.7.2 | 300,246,980.08     |
| 其中：股票投资  |         | -                  |
| 基金投资     |         | -                  |
| 债券投资     |         | 300,246,980.08     |
| 资产支持证券投资 |         | -                  |
| 贵金属投资    |         | -                  |
| 其他投资     |         | -                  |
| 衍生金融资产   |         | -                  |
| 买入返售金融资产 | 7.4.7.3 | 12,203,074.27      |
| 应收清算款    |         | -                  |

|               |            |                            |
|---------------|------------|----------------------------|
| 应收股利          |            | -                          |
| 应收申购款         |            | 241,310.23                 |
| 递延所得税资产       |            | -                          |
| 其他资产          | 7.4.7.6    | -                          |
| 资产总计          |            | 314,661,244.80             |
| <b>负债和净资产</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2024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        |            | -                          |
| 卖出回购金融资产款     |            | 9,999,107.19               |
| 应付清算款         |            | -                          |
| 应付赎回款         |            | 966,772.87                 |
| 应付管理人报酬       |            | 57,916.33                  |
| 应付托管费         |            | 14,479.07                  |
| 应付销售服务费       |            | 57,916.33                  |
| 应付投资顾问费       |            | -                          |
| 应交税费          |            | 368.80                     |
| 应付利润          |            | -                          |
| 递延所得税负债       |            | -                          |
| 其他负债          | 7.4.7.7    | 226,290.95                 |
| 负债合计          |            | 11,322,851.54              |
| <b>净资产：</b>   |            |                            |
| 实收基金          | 7.4.7.8    | 301,789,014.06             |
| 未分配利润         | 7.4.7.9    | 1,549,379.20               |
| 净资产合计         |            | 303,338,393.26             |
| 负债和净资产总计      |            | 314,661,244.80             |

注：1.报告截止日2024年12月31日，基金份额总额301,789,014.06份，基金份额净值1.0051元。

2.本财务报表的实际编制期间为2024年9月19日(基金合同生效日)至2024年12月31日止期间。

## 7.2 利润表

会计主体：易米中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金

本报告期：2024年09月19日（基金合同生效日）至2024年12月31日

单位：人民币元

| 项 目                   | 附注号        | 本期<br>2024年09月19日（基金合同<br>生效日）至2024年12月31日 |
|-----------------------|------------|--------------------------------------------|
| <b>一、营业总收入</b>        |            | <b>5,823,353.16</b>                        |
| 1.利息收入                |            | 4,063,218.40                               |
| 其中：存款利息收入             | 7.4.7.10   | 2,021,955.69                               |
| 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            |            | 2,041,262.71                               |
| 其他利息收入                |            | -                                          |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）      |            | 1,491,730.73                               |
| 其中：股票投资收益             | 7.4.7.11   | -                                          |
| 基金投资收益                | 7.4.7.12   | -                                          |
| 债券投资收益                | 7.4.7.13   | 1,491,730.73                               |
| 资产支持证券投资收益            | 7.4.7.14   | -                                          |
| 贵金属投资收益               | 7.4.7.15   | -                                          |
| 衍生工具收益                | 7.4.7.16   | -                                          |
| 股利收益                  |            | -                                          |
| 其他投资收益                |            | -                                          |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 7.4.7.17   | 268,404.03                                 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）     |            | -                                          |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）     | 7.4.7.18   | -                                          |
| <b>减：二、营业总支出</b>      |            | <b>1,440,457.60</b>                        |
| 1.管理人报酬               | 7.4.10.2.1 | 508,366.34                                 |
| 2.托管费                 | 7.4.10.2.2 | 127,091.58                                 |
| 3.销售服务费               | 7.4.10.2.3 | 508,366.34                                 |
| 4.投资顾问费               |            | -                                          |
| 5.利息支出                |            | 72,983.86                                  |

|                     |          |              |
|---------------------|----------|--------------|
| 其中：卖出回购金融资产支出       |          | 72,983.86    |
| 6.信用减值损失            | 7.4.7.19 | -            |
| 7.税金及附加             |          | 12,849.48    |
| 8.其他费用              | 7.4.7.20 | 210,800.00   |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） |          | 4,382,895.56 |
| 减：所得税费用             |          | -            |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列）   |          | 4,382,895.56 |
| 五、其他综合收益的税后净额       |          | -            |
| 六、综合收益总额            |          | 4,382,895.56 |

7.3 净资产变动表

会计主体：易米中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金

本报告期：2024年09月19日（基金合同生效日）至2024年12月31日

单位：人民币元

| 项 目                                  | 本期<br>2024年09月19日（基金合同生效日）至2024年12月31日 |               |                   |
|--------------------------------------|----------------------------------------|---------------|-------------------|
|                                      | 实收基金                                   | 未分配利润         | 净资产合计             |
| 一、上期期末净资产                            | -                                      | -             | -                 |
| 二、本期期初净资产                            | 1,852,841,970.74                       | -             | 1,852,841,970.74  |
| 三、本期增减变动额<br>（减少以“-”号填列）             | -1,551,052,956.68                      | 1,549,379.20  | -1,549,503,577.48 |
| （一）、综合收益总额                           | -                                      | 4,382,895.56  | 4,382,895.56      |
| （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）  | -1,551,052,956.68                      | -2,833,516.36 | -1,553,886,473.04 |
| 其中：1.基金申购款                           | 88,818,181.05                          | 256,771.99    | 89,074,953.04     |
| 2.基金赎回款                              | -1,639,871,137.73                      | -3,090,288.35 | -1,642,961,426.08 |
| （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、本期期末净资产 | 301,789,014.06 | 1,549,379.20 | 303,338,393.26 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署:

|          |           |         |
|----------|-----------|---------|
| 李毅       | 李毅        | 伍军华     |
| 基金管理人负责人 | 主管会计工作负责人 | 会计机构负责人 |

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

易米中证同业存单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[2024]803号《关于准予易米中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金注册的批复》注册，由易米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《易米中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金基金合同》负责公开募集。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1,852,267,380.10元，业经容诚会计师事务所(特殊普通合伙)容诚验字[2024]200Z0037号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，

《易米中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金基金合同》于2024年9月19日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为1,852,841,970.74份基金份额，其中认购资金利息折合574,590.64份基金份额。本基金的基金管理人为易米基金管理有限公司，基金托管人为江苏银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《易米中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于标的指数成份券及备选成份券，为更好实现投资目标，还可以投资于非属成份券及备选成份券的其他同业存单、债券（含国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持债券、政府支持机构债券、地方政府债券、证券公司短期公司债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包含协议存款、定期存款及其他银行存款）、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）、可交换债券及其他带有权属属性的金融工具。本基金的投资组合比例为：本基金投资于同业存单的比例不低于基金资产的80%；本基金投资于标的指数成份券及其备选成份券的比例不低于本基金非现金基金资产的80%；本基金应当保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本

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

本财务报表由本基金的基金管理人易米基金管理有限公司于2025年3月24日批准报出。

#### 7.4.2 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》、本基金基金合同和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会、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。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2024年09月19日(基金合同生效日)至2024年12月31日止期间的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12月31日的财务状况以及2024年09月19日(基金合同生效日)至2024年12月31日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为2024年09月19日(基金合同生效日)至2024年12月31日。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产、金融负债或权益工具。

###### (1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资

产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

#### 债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

##### 以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

##### 以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

#### (2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和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。本基金持有的以摊余成本计量的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。

#### (3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来12个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来12个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金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；或者(3) 该金融资产已转移，虽然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，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征：(1) 赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利，这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位，并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量；(2) 该工具所属的类别次于其他所有工具类别，即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具，且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权；(3) 该工具所属的类别中(该类别次于其他所有工具类别)，所有工具具有相同的特征(例如它们必须都具有可回售特征，并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同)；(4) 除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外，该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征；(5) 该工具在存续期内的预计现金流量总额，应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括本基金的任何影响)。

可回售工具，是指根据合同约定，持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融资产的权利，或者在未来某一不确定事项发生或者持有方死亡或退休时，自动回售给发行方的金融工具。

本基金没有同时具备下列特征的其他金融工具或合同：(1) 现金流量总额实质上基于基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括该基金或合同的任何影响)；(2) 实质上限制或固定了上述工具持有方所获得的剩余回报。

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

债券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息后的净额确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法确认。

以摊余成本计量的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。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

#### 7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 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，本基金确定以下类别债券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债券，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》，根据具体情况采用现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 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》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布<关于固定收益品种的估值处理标准>的通知》之附件《关于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债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 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。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生重大会计估计变更。

#### 7.4.5.3 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。

7.4.6 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[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》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) 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。

(4) 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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

| 项目     | 本期末<br>2024年12月31日 |
|--------|--------------------|
| 活期存款   | 1,949,316.79       |
| 等于：本金  | 1,947,922.31       |
| 加：应计利息 | 1,394.48           |
| 减：坏账准备 | -                  |
| 定期存款   | -                  |
| 等于：本金  | -                  |

|              |              |
|--------------|--------------|
| 加：应计利息       | -            |
| 减：坏账准备       | -            |
| 其中：存款期限1个月以内 | -            |
| 存款期限1-3个月    | -            |
| 存款期限3个月以上    | -            |
| 其他存款         | 20,563.43    |
| 等于：本金        | 20,561.42    |
| 加：应计利息       | 2.01         |
| 减：坏账准备       | -            |
| 合计           | 1,969,880.22 |

注：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。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目                |       | 本期末<br>2024年12月31日 |              |                |            |
|-------------------|-------|--------------------|--------------|----------------|------------|
|                   |       | 成本                 | 应计利息         | 公允价值           | 公允价值变动     |
| 股票                |       | -                  | -            | -              | -          |
| 贵金属投资-<br>金交所黄金合约 |       | -                  | -            | -              | -          |
| 债券                | 交易所市场 | 16,902,624.30      | 100,751.78   | 17,031,171.78  | 27,795.70  |
|                   | 银行间市场 | 279,692,391.67     | 3,282,808.30 | 283,215,808.30 | 240,608.33 |
|                   | 合计    | 296,595,015.97     | 3,383,560.08 | 300,246,980.08 | 268,404.03 |
| 资产支持证券            |       | -                  | -            | -              | -          |
| 基金                |       | -                  | -            | -              | -          |
| 其他                |       | -                  | -            | -              | -          |
| 合计                |       | 296,595,015.97     | 3,383,560.08 | 300,246,980.08 | 268,404.03 |

7.4.7.3 买入返售金融资产

7.4.7.3.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2024年12月31日 |
|----|--------------------|
|----|--------------------|

|       | 账面余额          | 其中：买断式逆回购 |
|-------|---------------|-----------|
| 交易所市场 | -             | -         |
| 银行间市场 | 12,203,074.27 | -         |
| 合计    | 12,203,074.27 | -         |

**7.4.7.3.2 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。

**7.4.7.4 其他债权投资**

**7.4.7.4.1 其他债权投资情况**

本基金本报告期末未持有其他债权投资。

**7.4.7.5 其他权益工具投资**

**7.4.7.5.1 其他权益工具投资情况**

本基金本报告期末未持有其他权益工具投资。

**7.4.7.6 其他资产**

本基金本报告期末未持有其他资产。

**7.4.7.7 其他负债**

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2024年12月31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      | 16,290.95          |
| 其中：交易所市场    | -                  |
| 银行间市场       | 16,290.95          |
| 应付利息        | -                  |
| 预提费用-审计费    | 90,000.00          |
| 预提费用-信息披露费  | 120,000.00         |
| 合计          | 226,290.95         |

7.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2024年09月19日（基金合同生效日）至2024年12月31日 |                   |
|---------------|----------------------------------------|-------------------|
|               | 基金份额（份）                                | 账面金额              |
| 基金合同生效日       | 1,852,841,970.74                       | 1,852,841,970.74  |
| 本期申购          | 88,818,181.05                          | 88,818,181.05     |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -1,639,871,137.73                      | -1,639,871,137.73 |
| 本期末           | 301,789,014.06                         | 301,789,014.06    |

注：1.申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

2.本基金自2024年9月2日至2024年9月13日止期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币1,852,267,380.10元，折合为1,852,267,380.10份基金份额。根据《易米中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金招募说明书》和《易米中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金基金份额发售公告》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入人民币574,590.64元，在本基金成立后，折合为574,590.64份基金份额，划入基金份额持有人账户。

3.根据《易米中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金基金合同》、《易米中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金招募说明书》及《易米中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金开放日常申购、赎回、转换和定期定额投资业务的公告》的相关规定，本基金于2024年9月19日(基金合同生效日)至2024年10月20日止期间暂不向投资人开放基金交易，申购业务、赎回业务和转换业务自2024年10月21日起开始办理。

7.4.7.9 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           | -             | -          | -             |
| 基金合同生效日        | -             | -          | -             |
| 本期利润           | 4,114,491.53  | 268,404.03 | 4,382,895.56  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -2,757,301.72 | -76,214.64 | -2,833,516.36 |
| 其中：基金申购款       | 246,133.88    | 10,638.11  | 256,771.99    |
| 基金赎回款          | -3,003,435.60 | -86,852.75 | -3,090,288.35 |
| 本期已分配利润        | -             | -          | -             |
| 本期末            | 1,357,189.81  | 192,189.39 | 1,549,379.20  |

7.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2024年09月19日（基金合同生效日）至2024年12月31日 |
|-----------|----------------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 2,012,539.04                           |
| 定期存款利息收入  | -                                      |
| 其他存款利息收入  | 9,416.65                               |
| 结算备付金利息收入 | -                                      |
| 其他        | -                                      |
| 合计        | 2,021,955.69                           |

注：其他存款利息收入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产生的利息收入。

7.4.7.11 股票投资收益——买卖股票差价收入

无。

7.4.7.12 基金投资收益

无。

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目                           | 本期<br>2024年09月19日（基金合同生效日）至2024年<br>12月31日 |
|------------------------------|--------------------------------------------|
| 债券投资收益——利息收入                 | 2,683,999.74                               |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | -1,192,269.01                              |
| 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                           | 1,491,730.73                               |

7.4.7.13.2 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>2024年09月19日（基金合同生效日）至2024年12月31日 |
|------------------------|----------------------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额   | 492,878,015.41                         |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 487,014,206.91                         |
| 减：应计利息总额               | 7,043,116.41                           |
| 减：交易费用                 | 12,961.10                              |
| 买卖债券差价收入               | -1,192,269.01                          |

7.4.7.14 资产支持证券投资收益

无。

7.4.7.15 贵金属投资收益

无。

7.4.7.16 衍生工具收益

无。

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称       | 本期<br>2024年09月19日（基金合同生效日）至2024年12月31日 |
|------------|----------------------------------------|
| 1.交易性金融资产  | 268,404.03                             |
| ——股票投资     | -                                      |
| ——债券投资     | 268,404.03                             |
| ——资产支持证券投资 | -                                      |
| ——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                     | 268,404.03 |

7.4.7.18 其他收入

无。

7.4.7.19 信用减值损失

无。

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2024年09月19日（基金合同生效日）至2024年12月31日 |
|---------|----------------------------------------|
| 审计费用    | 90,000.00                              |
| 信息披露费   | 120,000.00                             |
| 证券出借违约金 | -                                      |
| 开户费     | 800.00                                 |
| 合计      | 210,800.00                             |

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

| 关联方名称      | 与本基金的关系               |
|------------|-----------------------|
| 易米基金管理有限公司 | 基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构 |
| 江苏银行股份有限公司 | 基金托管人、基金销售机构          |
| 李毅         | 基金管理人的股东              |
| 董涛         | 基金管理人的股东              |

|                          |          |
|--------------------------|----------|
| 郭之英                      | 基金管理人的股东 |
| 杨旭蔚                      | 基金管理人的股东 |
| 陈华晨                      | 基金管理人的股东 |
| 梁旭                       | 基金管理人的股东 |
| 刘鹏宇                      | 基金管理人的股东 |
| 上海易米满堂企业管理合伙企业<br>（有限合伙） | 基金管理人的股东 |
| 上海易米满怀企业管理合伙企业<br>（有限合伙） | 基金管理人的股东 |

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。

**7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易**

**7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易**

**7.4.10.1.1 股票交易**

本报告期，本基金未通过关联方交易单元进行股票交易。

**7.4.10.1.2 权证交易**

本报告期，本基金未通过关联方交易单元进行权证交易。

**7.4.10.1.3 债券交易**

本报告期，本基金未通过关联方交易单元进行债券交易。

**7.4.10.1.4 债券回购交易**

本报告期，本基金未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

**7.4.10.1.5 基金交易**

本报告期，本基金未通过关联方交易单元进行基金交易。

**7.4.10.1.6 应支付关联方的佣金**

本报告期，本基金无应支付关联方的佣金。

**7.4.10.2 关联方报酬**

**7.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

| 项目               | 本期<br>2024年09月19日（基金合同生效日）至2024年<br>12月31日 |
|------------------|--------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费   | 508,366.34                                 |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 229,061.70                                 |
| 应支付基金管理人的净管理费    | 279,304.64                                 |

注：1.支付基金管理人易米基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值0.20%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：日基金管理费=前一日基金资产净值×0.20%/当年天数。

2.客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用按照基金销售机构所代销基金的份额保有量作为基数进行计算，从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2024年09月19日（基金合同生效日）至2024年<br>12月31日 |
|----------------|--------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 127,091.58                                 |

注：支付基金托管人的基金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：日基金托管费=前一日的基金资产净值×0.05%/当年天数。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的<br>各关联方名称 | 本期<br>2024年09月19日（基金合同生效日）至2024年12月31日 |
|--------------------|----------------------------------------|
|                    | 当期发生的基金应支付的销售服务费                       |
| 江苏银行股份有限公司         | 80,285.07                              |
| 易米基金管理有限公司         | 1,224.81                               |
| 合计                 | 81,509.88                              |

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金份额0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给基金管理人，再由基金管理人计算并支付给各基金销售机构。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。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期，本基金未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

7.4.10.4 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

7.4.10.4.1 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

本基金本报告期未发生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。

7.4.10.4.2 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

本基金本报告期未发生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。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 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，基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.5.2 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

份额单位：份

| 关联方名称 | 本期末<br>2024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 |
| 刘鹏宇   | 139,671.80         | 0.05%            |

注：上述关联方投资本基金适用的认购、申购、赎回费率按照本基金招募说明书的费率执行。

7.4.10.6 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<br>2024年09月19日（基金合同生效日）至2024年12月31日 |
|-------|----------------------------------------|
|       |                                        |

|            | 期末余额         | 当期利息收入       |
|------------|--------------|--------------|
| 江苏银行股份有限公司 | 1,949,316.79 | 2,012,539.04 |

注：本基金的活期银行存款由基金托管人江苏银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

**7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本报告期内无本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况。

**7.4.10.8 其他关联交易事项的说明**

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

**7.4.11 利润分配情况**

本基金本报告期末未进行利润分配。

**7.4.12 期末（2024年12月31日）本基金持有的流通受限证券**

**7.4.12.1 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。

**7.4.12.2 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。

**7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**

**7.4.12.3.1 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形成的卖出回购证券款余额。

**7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

截至本报告期末 2024年12月31日止，本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9,999,107.19元，截至2025年1月3日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，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。

**7.4.12.4 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。

**7.4.13 金融工具风险及管理**

#### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为指数型基金，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，对投资组合进行积极的管理与风险控制。本基金在日常经营活动中面临的与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密切跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理理念，建立了在董事会领导下的架构清晰、控制有效、系统全面、切实可行的风险控制体系。公司风险控制的体系由公司董事会、监事、经理层、督察长、监察稽核部和各部门风险控制组成。在全面风险管理体系的框架下，董事会对有效的风险管理承担最终责任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。董事会下设风险控制委员会，制定相应的议事规则，负责对涉及风险管控方面的专项问题进行研究指导，为董事会决策提供参考意见。公司总经理对有效的风险管理承担直接责任，负责具体执行公司日常经营管理中的风险控制工作。公司经营层下设置风险管理委员会，风险管理委员会为公司日常运作的最高风险管理机构，负责确定风险管理理念、原则、目标和方法，促进风险管理环境、文化的形成，组织风险管理体系建设，审议风险管理制度和流程，审议重大风险事件。公司监察稽核部作为独立负责风险管理的部门，负责落实市场风险、信用风险、流动性风险、合规风险的管理，监督各业务部门实施管理操作风险、声誉风险等，督促、检查各业务部门、各业务环节的风险管理工作落实情况。

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估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 7.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的基金托管人江苏银行股份有限公司，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。

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。

7.4.13.2.1 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>2024年12月31日 |
|--------|--------------------|
| A-1    | -                  |
| A-1以下  | -                  |
| 未评级    | 17,031,171.78      |
| 合计     | 17,031,171.78      |

注：1.以上评级取自第三方评级机构的债项评级。

2.未评级债券为国债。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末未持有短期信用评级的资产支持证券。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2024年12月31日 |
|--------|--------------------|
| A-1    | -                  |
| A-1以下  | -                  |
| 未评级    | 283,215,808.30     |
| 合计     | 283,215,808.30     |

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有长期信用评级的债券。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末未持有长期信用评级的资产支持证券。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末未持有长期信用评级的同业存单。

### 7.4.13.3 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，另一方面来自于基金份额持有人可依据基金合同约定要求赎回其持有的基金份额。本基金的基金管理人以专业审慎、勤勉尽责地管控本基金的流动性风险，全覆盖、多维度的建立以压力测试为核心的流动性风险监测与预警制度，确保本基金组合的资产变现能力满足投资者赎回需求。

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2024年12月31日，本基金的卖出回购金融资产款计息且利息金额不重大；除此之外，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，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

#### 7.4.13.3.1 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，由独立的风险管理人员对本基金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%（完全按照有关指数的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7.4.12。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10%。于2024年12月31日，本基金未持有流动性受限资产。

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12月31日，本基金确认的净赎回申请未超过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。

7.4.13.4 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，主要包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2024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               | 1,969,880.22   | -    | -    | -          | 1,969,880.22   |
| 交易性金融资产            | 300,246,980.08 | -    | -    | -          | 300,246,980.08 |
| 买入返售金融资产           | 12,203,074.27  | -    | -    | -          | 12,203,074.27  |
| 应收申购款              | -              | -    | -    | 241,310.23 | 241,310.23     |
| 资产总计               | 314,419,934.57 | -    | -    | 241,310.23 | 314,661,244.80 |

| 负债        |                |   |   |               |                |
|-----------|----------------|---|---|---------------|----------------|
| 卖出回购金融资产款 | 9,999,107.19   | - | - | -             | 9,999,107.19   |
| 应付赎回款     | -              | - | - | 966,772.87    | 966,772.87     |
| 应付管理人报酬   | -              | - | - | 57,916.33     | 57,916.33      |
| 应付托管费     | -              | - | - | 14,479.07     | 14,479.07      |
| 应付销售服务费   | -              | - | - | 57,916.33     | 57,916.33      |
| 应交税费      | -              | - | - | 368.80        | 368.80         |
| 其他负债      | -              | - | - | 226,290.95    | 226,290.95     |
| 负债总计      | 9,999,107.19   | - | - | 1,323,744.35  | 11,322,851.54  |
| 利率敏感度缺口   | 304,420,827.38 | - | - | -1,082,434.12 | 303,338,393.26 |

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。

7.4.13.4.1.2 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<br>(单位：人民币元) |
|    |                    | 本期末<br>2024年12月31日              |
|    | 市场利率上升25个基点        | -303,247.39                     |
|    | 市场利率下降25个基点        | 304,002.13                      |

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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。本基金主要投资于交易所市场和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。

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 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>2024年12月31日 |
|---------------|--------------------|
| 第一层次          | -                  |
| 第二层次          | 300,246,980.08     |
| 第三层次          | -                  |
| 合计            | 300,246,980.08     |

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2024年12月31日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

7.4.14.4 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。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§8 投资组合报告

8.1 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            | 300,246,980.08 | 95.42  |
|   | 其中：债券             | 300,246,980.08 | 95.42  |
|   | 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          | 12,203,074.27  | 3.88   |
|   | 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      | 1,969,880.22   | 0.63   |
| 8 | 其他各项资产            | 241,310.23     | 0.08   |
| 9 | 合计                | 314,661,244.80 | 100.00 |

8.2 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。

8.3 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。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金本报告期末未持有股票。

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金本报告期末未持有股票。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期末未持有股票。

8.5 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 | 17,031,171.78 | 5.61         |

|    |           |                |       |
|----|-----------|----------------|-------|
| 2  | 央行票据      | -              | -     |
| 3  | 金融债券      | -              | -     |
|    | 其中：政策性金融债 | -              | -     |
| 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      | 283,215,808.30 | 93.37 |
| 9  | 其他        | -              | -     |
| 10 | 合计        | 300,246,980.08 | 98.98 |

8.6 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  | 112406230 | 24交通银行CD230 | 300,000 | 29,747,950.68 | 9.81         |
| 2  | 112408115 | 24中信银行CD115 | 200,000 | 19,930,349.92 | 6.57         |
| 3  | 112418261 | 24华夏银行CD261 | 200,000 | 19,782,677.59 | 6.52         |
| 4  | 112420250 | 24广发银行CD250 | 200,000 | 19,743,075.51 | 6.51         |
| 5  | 019749    | 24国债15      | 169,000 | 17,031,171.78 | 5.61         |

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.11 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持有国债期货。

## 8.12 投资组合报告附注

**8.12.1 交通银行CD230（代码：112406230）**为本基金前五大持仓债券之一。2024年1月4日，中国人民银行大连市分行对交通银行大连分行未按规定履行客户身份识别义务的违规行为，罚款86万元。2024年1月16日，国家金融监督管理总局三明监管分局对交通银行三明分行流动资金贷款贷前调查不尽职等违规行为，合计处以95万元罚款。2024年1月31日，中国人民银行湖北省分行对交通银行湖北省分行违反账户管理规定等违规行为，予以警告，并罚款260.6万元。2024年4月28日，国家金融监督管理总局吉林监管分局对交通银行吉林分行贷款风险分类不准确的违规行为，罚款30万元。2024年5月6日，国家金融监督管理总局湖州监管分局对交通银行湖州分行流动资金贷款发放不审慎等违规行为，罚款105万元。2024年6月3日，国家金融监督管理总局对交通银行安全测试存在薄弱环节等违规行为，罚款160万元。2024年6月7日，国家金融监督管理总局延边监管分局对交通银行延边分行贷后管理不到位的违规行为，罚款35万元。2024年7月29日，国家金融监督管理总局常州监管分局对交通银行常州分行项目贷款资本金核实不到位等违规行为，罚款75万元。2024年7月29日，国家金融监督管理总局湖北监管局对交通银行湖北省分行线上抵押贷款管理不尽职等违规行为，罚款490万元。2024年10月25日，国家金融监督管理总局昭通监管分局对交通银行昭通分行违规办理个人贷款业务等违规行为，罚款70万元。2024年11月14日，国家金融监督管理总局抚顺监管分局对交通银行抚顺分行严重违反审慎经营规则等违规行为，罚款30万元。2024年12月10日，国家金融监督管理总局阳泉监管分局对交通银行阳泉分行信贷资金被挪用的违规行为，罚款70万元。2024年12月17日，国家金融监管总局文山金融监管分局对交通银行文山分行贷后管理不尽职的违规行为，罚款30万元。2024年12月24日，国家金融监督管理总局上海监管局对交通银行上海市分行贷款管理严重违反审慎经营规则的违规行为，罚款90万元。2025年1月10日，深圳金融监管局对交通银行内部控制存在薄弱环节的违规行为，罚款50万元。

**24中信银行CD115（代码：112408115）**为本基金前五大持仓债券之一。2024年4月8日，吉林证监局对中信银行基金销售业务人员资质管理不到位的违规行为，采取了出具警示函的监督管理措施。2024年12月10日，河南金融监管局对中信银行郑州分行及其分支机构多项违规行为，合计罚款580万元。2024年12月20日，国家金融监督管理总局重庆监管局对中信银行重庆分行贷款“三查”严重不尽职的违规行为，罚款50万元。

**24华夏银行CD261（代码：112418261）**为本基金前五大持仓债券之一。2025年1月26日，深圳金融监管局对华夏银行深圳分行违规开展不良资产转让业务等违规行为，罚款560万元。2024年12月31日，国家金融监督管理总局大同监管分局对华夏银行大同分行贷后管理不到位等违规行为，罚款50万元。2024年12月31日，扬州金融监管分局华夏

银行扬州分行以贷款、贴现资金等转作存款或保证金的违规行为，罚款60万元。2024年12月30日，云南金融监管局对华夏银行昆明分行流动资金贷款管理不审慎等违规行为，罚款225万元。2024年12月4日，国家金融监督管理总局临沂监管分局对华夏银行临沂罗庄支行贷款管理不到位的违规行为，罚款30万元。2024年7月30日，国家金融监管总局南通监管分局对华夏银行南通分行银票及国内信用证业务管理不尽职的违规行为，罚款40万元。2024年6月27日，中国人民银行湖北省分行对华夏银行武汉分行违反账户管理规定等违规行为，予以警告，并罚款83.5万元。2024年5月28日，国家金融监督管理总局青海监管局对华夏银行西宁分行未经任职资格核准实际履职的违规行为，罚款25万元。2024年5月31日，国家金融监督管理总局新疆监管局对华夏银行乌鲁木齐高新区支行等3家支行贷后管理不到位、承兑汇票贸易背景审核不严等违规行为，合计罚款140万元。2024年5月10日，国家金融监督管理总局江西监管局对华夏银行南昌分行未按规定报送案件信息的违规行为，罚款50万元。2024年2月6日，国家金融监督管理总局北京监管局对华夏银行北京分行个人经营性贷款管理不到位等违规行为，予以警告，并罚款合计461万元。2024年1月8日，国家金融监督管理总局丽水监管分局对华夏银行丽水分行信用证业务开展不审慎的违规行为，罚款30万元。

24广发银行CD250（代码：112420250）为本基金前五大持仓债券之一。2024年12月26日，徐州金融监管分局对广发银行徐州分行贷后管理不到位等违规行为，罚款35万元。2024年8月21日，国家金融监督管理总局北京监管局对广发银行北京分行员工行为管理不到位得违规行为，罚款50万元。2024年7月25日，国家金融监督管理总局安阳监管分局对广发银行安阳分行线上消费贷款违规流入股市等违规行为，罚款95万元。2024年7月19日，国家金融监督管理总局深圳监管局对广发银行深圳分行贷款“三查”不到位等违规行为，罚款300万元。2024年7月3日，国家金融监督管理总局广东监管局对广发银行信用卡中心新增信用卡业务产品种类未按规定期限报告的违规行为，罚款25万元。2024年2月7日，国家金融监督管理总局三门峡监管分局对广发银行三门峡分行贷款“三查”不尽职且形成风险的违规行为，罚款30万元。2024年2月4日，国家金融监督管理总局洛阳监管分局对广发银行洛阳分行贷前调查不到位等违规行为，没收违法所得并处罚款合计80.94万元。

本基金投资上述证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除上述证券外，未发现本基金投资的前五名证券的发行主体本期存在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、处罚的情形。

**8.12.2** 本基金本报告期内未持有股票，故不存在所投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库的情况。

### **8.12.3 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 | 241,310.23 |
| 6  | 其他应收款 | -          |
| 7  | 待摊费用  | -          |
| 8  | 其他    | -          |
| 9  | 合计    | 241,310.23 |

8.12.4 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可转换债券。

8.12.5 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流通受限的股票。

8.12.6 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，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§9 基金份额持有人信息

9.1 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<br>(户) | 户均持有的<br>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<br>额比例 | 持有份额           | 占总份<br>额比例 |
| 1,534        | 196,733.39    | 113,320,136.39 | 37.55%     | 188,468,877.67 | 62.45%     |

9.2 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 | 60,313.04 | 0.02%    |

9.3 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、基金投资和研究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 开放式基金份额变动

单位：份

|                            |                  |
|----------------------------|------------------|
| 基金合同生效日(2024年09月19日)基金份额总额 | 1,852,841,970.74 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额      | 88,818,181.05    |
| 减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额    | 1,639,871,137.73 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额     | -                |
| 本报告期期末基金份额总额               | 301,789,014.06   |

§11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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情况

2024年6月6日，基金管理人发布公告，自2024年6月4日起新任郭之英为公司副总经理（兼副董事长）。

2024年7月25日，基金管理人发布公告，自2024年7月24日起新任包丽华为公司总经理助理兼首席投资官，并离任副总经理程伟庆。

2024年5月29日、7月25日，基金管理人发布公告，自2024年5月27日起增聘贺文奇担任易米开泰混合型证券投资基金基金经理，并于2024年7月23日解聘原基金经理程伟庆。

2024年7月25日，基金管理人发布公告，于2024年7月23日解聘易米低碳经济股票型发起式证券投资基金原基金经理程伟庆。

2024年8月8日，基金管理人发布公告，自2024年8月7日起增聘魏鑫担任易米远见价值一年定期开放混合型证券投资基金基金经理。

2025年1月1日，基金管理人发布公告，自2024年12月30日起增聘熊颖担任易米研究精选混合型发起式证券投资基金基金经理，并解聘原基金经理王磊。

2025年1月1日，基金管理人发布公告，于2024年12月30日解聘易米中证科创创业50指数增强型发起式证券投资基金原基金经理王磊。

(2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金的审计机构为容诚会计师事务所（特殊普通合伙），该审计机构自基金合同生效日起向本基金提供审计服务，无改聘情况。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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<br>数量 | 股票交易 |              | 应支付该券商的佣金 |            | 备<br>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 |        |
| 国泰君安 | 2          | -    | -            | 307.18    | 10.52%     | -      |
| 中信证券 | 2          | -    | -            | 2,612.42  | 89.48%     | -      |

注：1.本基金使用券商交易结算模式，可免于执行《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》关于交易佣金分仓的规定。

2.本基金管理人负责选择证券经纪商，使用其交易单元作为本基金的交易单元。基金证券经纪商选择标准包括：证券公司经营管理状况、证券交易的安全性和效率、清算效率等方面。根据前述标准由基金管理人考察后确定选用证券经纪商，并与其签订证券经纪服务协议。

11.7.2 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 |
| 国泰君安 | 30,720,805.53  | 16.31%       | 1,435,292,000.00 | 31.08%         | -    | -            | -    | -            |
| 中信证券 | 157,634,226.22 | 83.69%       | 3,182,981,000.00 | 68.92%         | -    | -            | -    | -            |

11.8 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  | 易米中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金基金份额发售公告                 | 《证券时报》、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2024-08-28 |
| 2  | 易米基金管理有限公司旗下基金改聘会计师事务所公告                         | 《证券时报》、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2024-09-14 |
| 3  | 易米中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金基金合同生效公告                 | 《证券时报》、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2024-09-20 |
| 4  | 易米中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金开放日常申购、赎回、转换和定期定额投资业务的公告 | 《证券时报》、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2024-10-16 |
| 5  | 易米基金管理有限公司关于旗下基金参加东方证券股份有限公司投顾组合费率优惠活动的公告        | 《证券时报》、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2024-11-18 |

|   |                                           |                              |            |
|---|-------------------------------------------|------------------------------|------------|
| 6 | 易米基金管理有限公司关于旗下基金参加恒泰证券股份有限公司投顾组合费率优惠活动的公告 | 《证券时报》、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2024-11-28 |
|---|-------------------------------------------|------------------------------|------------|

## §12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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

本报告期内，本基金不存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金不存在影响投资者决策的其他重要信息。

## §13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

1.中国证监会准予易米中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金募集注册的文件；

2.《易米中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金基金合同》；

3.《易米中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金托管协议》；

4.法律意见书；

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。

### 13.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人及基金托管人的办公场所。

### 13.3 查阅方式

投资者可在营业时间到基金管理人和/或基金托管人的办公场所免费查阅备查文件，或通过基金管理人、基金托管人、其他基金销售机构的网站查询。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

易米基金管理有限公司  
二〇二五年三月二十八日