

易米中证同业存单 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: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:2026 年 08 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2026年8月27日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2026年1月1日起至2026年6月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
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	11
§5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
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	11
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 净资产变动表	14
6.4 报表附注	16
§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	35
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	35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	35
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	35
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	36
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	36
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	36
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	36
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	36
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	37
7.12 投资组合报告附注	37
§8 基金份额持有人信息	42

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	42
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	42
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	42
§9 开放式基金份额变动	43
§10 重大事件揭示	43
10.1 基金份额持有人大会决议	43
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	43
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	44
10.4 基金投资策略的改变	44
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	44
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	44
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	44
10.8 其他重大事件	45
§11 影响投资者决策的其他重要信息	46
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	46
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	47
§12 备查文件目录	47
12.1 备查文件目录	47
12.2 存放地点	47
12.3 查阅方式	47

§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	44,488,186.10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	袁军

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.yimifund.com
基金中期报告置备地点	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
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02单元

§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 - 2026年06月30日)
本期已实现收益	301,799.41
本期利润	299,650.75
加权平均基金份额本期利润	0.0044
本期加权平均净值利润率	0.44%
本期基金份额净值增长率	0.41%
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	852,469.17
期末可供分配基金份额利润	0.0192
期末基金资产净值	45,340,655.27
期末基金份额净值	1.0192
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	1.92%

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 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	0.17%	0.01%	0.37%	0.00%	-0.20%	0.01%
过去六个月	0.41%	0.01%	0.80%	0.01%	-0.39%	0.00%
过去一年	0.90%	0.01%	1.64%	0.01%	-0.74%	0.00%
自基金合同 生效起至今	1.92%	0.01%	3.19%	0.01%	-1.27%	0.00%

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



§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、私募资产管理和中国证监会许可的其他业务。

截至2026年6月30日，易米基金管理有限公司共管理七只公募基金，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、易米和丰债券型证券投资基金、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、易米中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金和易米远景量化选股股票型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 （助理）期限		证券 从业 年限	说明
		任职日期	离任日期		
李秋实	本基金 基金经理	2024-09-19	2026-02-05	11	李秋实女士，毕业于复旦大学，硕士研究生。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固定收益部总监、基金经理、联席投资总监、投资经理。
杜雨楠	本基金 基金经理	2026-01-13	-	10	杜雨楠先生，毕业于英国帝国理工大学，硕士研究生。曾任华泰证券股份有限公司上海分公司营业部业务支持岗，中海基金管理有限公司助理债券研究员，汇丰晋信基金管理有限公司债券研究员、投资经理，光大证券股份有限公司资金管理岗，现任易米基金管理有限公司基金经理。

注：1.上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

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。

4.3.2 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

报告期内，本基金主要采用抽样复制指数与动态优化相结合的方法，主要投资于中证AAA同业存单指数的成份券和备选成份券。上半年，同业存单发行规模合计16.3万亿元，较上年同期减少1.09万亿元。在资金面维持宽松、银行同业存单再融资需求持续回落以及同业利率自律管理升级的共同作用下，同业存单一级发行利率进一步走低，1年期AAA级同业存单发行利率大幅下行至1.46%附近，与资金利率的利差压缩至历史低位。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末易米中证同业存单AAA指数7天持有期基金份额净值为1.0192元，本报告期内，基金份额净值增长率为0.41%，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

展望下半年，偏弱的经济基本面仍将为债券市场提供底部支撑，但资金面阶段性扰动、政府债供给提速后的市场承接能力以及全球市场风险偏好的波动，将是主导债市行情的核心变量。在此背景下，组合将继续以票息策略为主，同时根据市场情况，综合运用久期策略、骑乘策略、票息策略和杠杆策略等来增厚投资组合的收益，力争为持有人带来稳定的投资收益。

4.6 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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末未进行利润分配，符合相关法律法规及基金合同的规定。

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

本报告期内，本基金自2026年5月7日至2026年6月30日期间存在基金资产净值低于五千万的情形。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人--江苏银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规的规定以及《托管协议》的约定，尽职尽责履行了托管人应尽的义务，没有从事任何损害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

本报告期内，本基金托管人--江苏银行股份有限公司未发现易米基金管理有限公司在基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上存在损害基金份额持有人利益的行为，或违反《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、在各重要方面的运作违反基金合同规定的情况。

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

本报告期内，由基金管理人所编制和披露的定期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§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：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：2026年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	617,884.28	9,620,732.16
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	43,022,011.95	204,196,753.99
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		43,022,011.95	204,196,753.99
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	6.4.7.3	1,800,000.00	96,168,599.21
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		11.00	7,540,105.00
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		45,439,907.23	317,526,190.36

负债和净资产	附注号	本期末 2026年06月30日	上年度末 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		-	-
卖出回购金融资产款		-	1,000,099.14
应付清算款		-	-
应付赎回款		9,439.05	1,404,146.29
应付管理人报酬		7,479.18	22,710.68
应付托管费		1,869.81	5,677.68
应付销售服务费		7,479.18	22,710.68
应付投资顾问费		-	-
应交税费		112.95	901.35
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	72,871.79	181,392.73
负债合计		99,251.96	2,637,638.55
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	44,488,186.10	310,224,199.56
未分配利润	6.4.7.8	852,469.17	4,664,352.25
净资产合计		45,340,655.27	314,888,551.81
负债和净资产总计		45,439,907.23	317,526,190.36

注：报告截止日2026年6月30日，基金份额总额44,488,186.10份，基金份额净值1.0192元。

6.2 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：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 2026年01月01日至 2026年06月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至 2025年06月30日
一、营业总收入		612,358.39	3,461,350.94
1.利息收入		54,848.89	444,002.92
其中：存款利息收入	6.4.7.9	15,545.95	132,379.57
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		39,302.94	311,623.35
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		559,658.16	3,148,459.07
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-	-
基金投资收益	6.4.7.11	-	-
债券投资收益	6.4.7.12	559,658.16	3,148,459.07
资产支持证券投资收益	6.4.7.13	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
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）	6.4.7.16	-2,148.66	-131,111.05
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-	-
减：二、营业总支出		312,707.64	1,163,028.09
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	71,082.61	354,871.82
2.托管费	6.4.10.2.2	17,770.69	88,717.93
3.销售服务费	6.4.10.2.3	71,082.61	354,871.82
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		72,629.41	240,048.89
其中：卖出回购金融资产支出		72,629.41	240,048.89
6.信用减值损失	6.4.7.18	-	-
7.税金及附加		186.23	1,574.23
8.其他费用	6.4.7.19	79,956.09	122,943.40
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		299,650.75	2,298,322.85
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		299,650.75	2,298,322.85
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		299,650.75	2,298,322.85

6.3 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：2026年01月01日至2026年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 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	310,224,199.56	4,664,352.25	314,888,551.81
二、本期期初净资产	310,224,199.56	4,664,352.25	314,888,551.81
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-265,736,013.46	-3,811,883.08	-269,547,896.54
(一)、综合收益总额	-	299,650.75	299,650.75
(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)	-265,736,013.46	-4,111,533.83	-269,847,547.29
其中：1.基金申购款	12,244,612.26	204,952.57	12,449,564.83
2.基金赎回款	-277,980,625.72	-4,316,486.40	-282,297,112.12
(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	44,488,186.10	852,469.17	45,340,655.27
项 目	上年度可比期间 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	301,789,014.06	1,549,379.20	303,338,393.26
二、本期期初净资产	301,789,014.06	1,549,379.20	303,338,393.26
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	376,343,433.55	5,289,972.03	381,633,405.58
(一)、综合收益总额	-	2,298,322.85	2,298,322.85
(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)	376,343,433.55	2,991,649.18	379,335,082.73
其中：1.基金申购款	2,174,192,216.15	15,281,705.06	2,189,473,921.21
2.基金赎回款	-1,797,848,782.60	-12,290,055.88	-1,810,138,838.48
(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	678,132,447.61	6,839,351.23	684,971,798.84

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：

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

6.4 报表附注

6.4.1 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益属性的金融工具。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×95%+银行人民币一年定期存款利率（税后）×5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、本基金基金合同和在财务报表附注6.4.4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。

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1月1日至2026年6月30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2026年6月30日的财务状况以及2026年1月1日至2026年6月30日止期间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 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[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》、财政部、国家税务总局公告2025年第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，对除持有金融债券外的金融同业往来利息收入亦免征增值税。自2025年8月8日起，对在该日期之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、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，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) 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。

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 2026年06月30日
活期存款	608,715.36
等于：本金	608,120.56
加：应计利息	594.80
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	9,168.92
等于：本金	9,167.62
加：应计利息	1.30

减：坏账准备	-
合计	617,884.28

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。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 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	1,999,420.00	3,891.51	2,003,291.51	-20.00
	银行间市场	40,608,152.40	408,540.44	41,018,720.44	2,027.60
	合计	42,607,572.40	412,431.95	43,022,011.95	2,007.60
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		42,607,572.40	412,431.95	43,022,011.95	2,007.60

6.4.7.3 买入返售金融资产

6.4.7.3.1 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 2026年06月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	1,800,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	1,800,000.00	-

6.4.7.3.2 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。

6.4.7.4 其他债权投资

6.4.7.4.1 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。

6.4.7.5 其他权益工具投资

6.4.7.5.1 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。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 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	5,515.70
其中：交易所市场	-
银行间市场	5,515.70
应付利息	-
预提费用-审计费	17,356.09
预提费用-信息披露费	50,000.00
合计	72,871.79

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 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	310,224,199.56	310,224,199.56
本期申购	12,244,612.26	12,244,612.26
本期赎回（以“-”号填列）	-277,980,625.72	-277,980,625.72
本期末	44,488,186.10	44,488,186.10

注：申购含转换入份额；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	5,259,266.78	-594,914.53	4,664,352.25
本期期初	5,259,266.78	-594,914.53	4,664,352.25
本期利润	301,799.41	-2,148.66	299,650.75
本期基金份额交易产生的变动数	-4,620,338.95	508,805.12	-4,111,533.83
其中：基金申购款	228,010.30	-23,057.73	204,952.57
基金赎回款	-4,848,349.25	531,862.85	-4,316,486.40
本期已分配利润	-	-	-
本期末	940,727.24	-88,258.07	852,469.17

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
活期存款利息收入	15,495.49
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	40.02
结算备付金利息收入	-
其他	10.44
合计	15,545.95

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。

6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

无。

6.4.7.11 基金投资收益

无。

6.4.7.12 债券投资收益

6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
债券投资收益——利息收入	596,085.77
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-36,427.61
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	559,658.16

6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 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	206,327,530.48
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	204,224,603.56
减：应计利息总额	2,129,303.46
减：交易费用	10,051.07
买卖债券差价收入	-36,427.61

6.4.7.13 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.14 贵金属投资收益

无。

6.4.7.15 衍生工具收益

无。

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
------	----

	2026年01月01日至2026年06月30日
1.交易性金融资产	-2,148.66
——股票投资	-
——债券投资	-2,148.66
——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	-2,148.66

6.4.7.17 其他收入

无。

6.4.7.18 信用减值损失

无。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
审计费用	17,356.09
信息披露费	50,000.00
证券出借违约金	-
账户维护费-中债登	3,000.00
账户维护费-上清所	9,600.00
合计	79,956.09

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无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

本报告期不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。

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
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

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

6.4.10.1.1 股票交易

本报告期及上年度可比期间，本基金未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本报告期及上年度可比期间，本基金未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本报告期及上年度可比期间，本基金未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本报告期及上年度可比期间，本基金未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.5 基金交易

本报告期及上年度可比期间，本基金未通过关联方交易单元进行基金交易。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

本报告期及上年度可比期间，本基金无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至 2026年06月30日	上年度可比期间 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	71,082.61	354,871.82
其中：应支付销售机构的客户维护费	32,094.99	164,124.61
应支付基金管理人的净管理费	38,987.62	190,747.21

注：1.支付基金管理人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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至 2026年06月30日	上年度可比期间 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	17,770.69	88,717.93

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。

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 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
江苏银行股份有限公司	32,993.37

易米基金管理有限公司	326.93
合计	33,320.30
获得销售服务费的 各关联方名称	上年度可比期间 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
江苏银行股份有限公司	205,123.76
易米基金管理有限公司	1,506.96
合计	206,630.72

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。

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

本报告期及上年度可比期间，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。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未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。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未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。

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

本报告期及上年度可比期间，基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

报告期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 2026年01月01日至2026年06月30日		上年度可比期间 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
江苏银行股份有限公司	608,715.36	15,495.49	25,292,746.82	132,173.46

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。

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。

6.4.10.8 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。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末未进行利润分配。

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、风险控制与审计委员会、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与审计委员会，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。

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，其他存款存放在中信

证券股份有限公司和国泰海通证券股份有限公司，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。

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 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	2,003,291.51	7,230,902.05
合计	2,003,291.51	7,230,902.05

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。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有短期信用评级的资产支持证券。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	41,018,720.44	196,965,851.94
合计	41,018,720.44	196,965,851.94

6.4.13.2.4 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。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有长期信用评级的资产支持证券。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有长期信用评级的同业存单。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金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2026年6月30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。

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，由独立的风险管理人员对本基金的综合持仓集中度指标、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10%。于2026年6月30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2026年6月30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。

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。

本基金投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种比重较大，此外还持有银行存款及买入返售金融资产等利率敏感性资产，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 2026年06月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	617,884.28	-	-	-	617,884.28
交易性金融资产	43,022,011.95	-	-	-	43,022,011.95
买入返售金融资产	1,800,000.00	-	-	-	1,800,000.00

应收申购款	-	-	-	11.00	11.00
资产总计	45,439,896.23	-	-	11.00	45,439,907.23
负债					
应付赎回款	-	-	-	9,439.05	9,439.05
应付管理人报酬	-	-	-	7,479.18	7,479.18
应付托管费	-	-	-	1,869.81	1,869.81
应付销售服务费	-	-	-	7,479.18	7,479.18
应交税费	-	-	-	112.95	112.95
其他负债	-	-	-	72,871.79	72,871.79
负债总计	-	-	-	99,251.96	99,251.96
利率敏感度缺口	45,439,896.23	-	-	-99,240.96	45,340,655.27
上年度末 2025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	9,620,732.16	-	-	-	9,620,732.16
交易性金融资产	204,196,753.99	-	-	-	204,196,753.99
买入返售金融资产	96,168,599.21	-	-	-	96,168,599.21
应收申购款	100,000.00	-	-	7,440,105.00	7,540,105.00
资产总计	310,086,085.36	-	-	7,440,105.00	317,526,190.36
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	1,000,099.14	1,000,099.14
应付赎回款	-	-	-	1,404,146.29	1,404,146.29
应付管理人报酬	-	-	-	22,710.68	22,710.68
应付托管费	-	-	-	5,677.68	5,677.68
应付销售服务费	-	-	-	22,710.68	22,710.68
应交税费	-	-	-	901.35	901.35
其他负债	-	-	-	181,392.73	181,392.73
负债总计	-	-	-	2,637,638.55	2,637,638.55
利率敏感度缺口	310,086,085.36	-	-	4,802,466.45	314,888,551.81

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
	市场利率上升25个基点	-35,965.53	-205,787.45
	市场利率下降25个基点	36,053.32	206,281.60

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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30日		上年度末 2025年12月31日	
	公允价值	占基金资产 净值比例(%)	公允价值	占基金资产 净值比例(%)
交易性金融资产—股票投资	-	-	-	-
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	43,022,011.95	94.89	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	43,022,011.95	94.89	-	-

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 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
第一层次	-	-
第二层次	43,022,011.95	204,196,753.99
第三层次	-	-
合计	43,022,011.95	204,196,753.99

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期及上年度可比期间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。

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6月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

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

无。

§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	43,022,011.95	94.68
	其中：债券	43,022,011.95	94.68
	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	1,800,000.00	3.96
	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	617,884.28	1.36
8	其他各项资产	11.00	0.00
9	合计	45,439,907.23	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

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金本报告期末未持有股票。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金本报告期末未持有股票。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期末未持有股票。

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	2,003,291.51	4.42
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	41,018,720.44	90.47
9	其他	-	-
10	合计	43,022,011.95	94.89

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	112502253	25工商银行CD253	45,000	4,486,976.06	9.90
2	112503337	25农业银行CD337	45,000	4,484,756.86	9.89
3	112609049	26浦发银行CD049	45,000	4,476,618.79	9.87
4	112517144	25光大银行CD144	40,000	3,994,628.28	8.81
5	112620014	26广发银行CD014	40,000	3,968,250.49	8.75

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

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 25工商银行CD253（代码：112502253）为本基金前五大持仓债券之一。2026年7月2日，国家金融监督管理总局河北监管局对工商银行石家庄分行违规发放贷款的违规行为，罚款60万元。2026年7月1日，国家金融监督管理总局延边监管分局对工商银行汪清支行、图们支行贷款“三查”不到位的违规行为，合计罚款70万元；对延吉海兰江支行违规办理信用卡汽车专项分期付款业务的违规行为，罚款30万元。2026年6月26日，国家金融监督管理总局新余监管分局对工商银行新余分行、相关分支机构违规办理信用卡汽车分期业务等违规行为，合计罚款50万元。2026年6月25日，国家金融监督管理总局榆林监管分局对工商银行榆林分行贷款阶段划分不审慎等违规行为，罚款36万元。2026年6月12日，国家金融监督管理总局内蒙古监管局对工商银行内蒙古自治区分行授信审批不审慎的违规行为，罚款30万元。2026年5月29日，国家金融监督管理总局宁波监管局对工商银行宁波市分行内控管理不规范等违规行为，罚款380万元；对工商银行广州分行、广州同福中路支行内部控制和风险管理不到位的违规行为，合计罚款70万元。2026年5月11日，国家金融监督管理总局对工商银行重要信息系统投产变更风险管控不到位等违规行为，罚款105万元。2026年5月9日，国家金融监督管理总局晋中监管分局对工商银行晋中分行违规发放个人经营性贷款的违规行为，罚款30万元。2026年2月5日，国家金融监督管理总局广东监管局对工商银行广东省分行及相关分支机构内部控制、贷款业务严重违反审慎经营规则的违规行为，合计420万元。2026年1月21日，国家金融监督管理总局西藏监管局对工商银行西藏自治区分行受理不符合条件的固定资产贷款申请并发放贷款等违规行为，罚款30万元。2025年12月29日，国家金融监督管理总局广东监管局对工商银行广东省分行内部控制失效的违规行为，罚款35万元；国家金融监督管理总局海南监管局对工商银行海南省分行汽车分期业务管理不到位的违规行为，对工商银行海南省分行罚款40万元，对工商银行海南省分行营业部罚款35万元，对工商银行三亚分行罚款30万元，合计罚款105万元。2025年10月30日，国家金融监督管理总局河南监管局对工商银行河南省分行贷款审查不尽职的违规行为，罚款30万元。2025年10月11日，国家金融监督管理总局深圳监管局对工商银行深圳市分行贷款业务、保函业务三查违规等违规行为，罚款1150万元。2025年9月30日，国家金融监督管理总局贵州监管局对工商银行贵州省分行违规办理信用卡汽车专项分期业务的违规行为，罚款45万元。2025年9月23日，国家金融监督管理总局北京监管局对工商银行北京市分行贷款“三查”失职的违规行为，罚款35万元。

25农业银行CD337（代码：112503337）为本基金前五大持仓债券之一。2026年7月7日，国家金融监督管理总局陕西监管局对农业银行榆林分行隐瞒与保险合同有关的重要情况等违规行为，罚款22.5万元。2026年6月29日，国家金融监督管理总局喀什金融监管分局对农业银行代销业务管理不规范的违规行为，罚款30万元。2026年6月23日，国家金融监督管理总局新疆金融监管局对农业银行新疆维吾尔自治区分行员工行为管理不到位的违规行为，罚款30万元。2026年6月22日，中国人民银行青岛市分行对农业银行青岛市分行违反金融统计相关规定等违规行为，罚款127.76万元。2026年6月15日，国家金融监督管理总局烟台监管分局对农业银行烟台分行贷前调查不到位的违规行为，罚款35万元。2026年6月8日，国家金融监督管理总局吉林金融监管局对工商银行长春分行冲时点发放贷款虚增存贷款规模的违规行为，罚款30万元。2026年5月22日，国家金融监督管理总局深圳金融监管局对农业银行深圳市分行银行承兑汇票保证金来源不合规等违规行为，没收违法所得31,683元，并罚款205万元。2026年5月15日，国家金融监督管理总局天津监管局对农业银行天津武清支行员工管理不到位等违规行为，罚款60万元；国家金融监督管理总局宜春监管分局对农业银行宜春分行银行承兑汇票业务管理不尽职等违规行为，罚款105万元。2026年5月14日，中国人民银行佛山市分行对农业银行佛山分行违反金融统计等违规行为，罚款180.32万元。2026年5月9日，国家金融监督管理总局晋中监管分局对农业银行晋中市分行违规发放固定资产贷款的违规行为，罚款45万元。2026年4月22日，中国人民银行辽宁省分行对农业银行辽宁省分行违反金融统计相关规定等违规行为，罚款327.05万元。2026年4月17日，国家金融监督管理总局黄山监管分局对农业银行歙县支行贷前调查不审慎的违规行为，罚款30万元。2026年3月26日，中国人民银行阿克苏地区分行对农业银行阿克苏分行违反金融统计管理规定等违规行为，罚款60万元。2026年3月20日，国家金融监督管理总局青海监管局对农业银行西宁市城西支行、西宁市城中支行保险销售误导的违规行为，合计罚款24万元；对农业银行青海省分行保险执业登记管理不到位等违规行为，罚款30.5万元。2026年3月17日，中国人民银行博尔塔拉蒙古自治州分行对农业银行双河兵团分行违反支付结算管理规定等违规行为，罚款27.6万元。2026年3月12日，中国人民银行河南省分行对农业银行河南省分行违反金融统计相关规定等违规行为，罚款441.1万元；中国人民银行衡阳市分行对农业银行衡阳分行违反账户管理规定等违规行为，罚款52.9万元。2026年3月5日，中国人民银行平顶山市分行对农业银行平顶山分行违反金融统计相关规定等违规行为，罚款130.5万元。2026年3月4日，中国人民银行新疆维吾尔自治区分行对农业银行新疆维吾尔自治区分行违反金融统计管理规定的违规行为，罚款150万元。2026年3月3日，中国人民银行莱芜分行对农业银行莱芜分行违反账户管理规定等违规行为，罚款11.4万元；中国人民银行鹤岗市分行对农业银行鹤岗分行未按照规定开展客户尽职调查的违规行为，罚款25.05万元。2026年2月13日，国家金融监督管理总局舟山监管分局对农业银行舟山分行信贷管理不审慎的违规行为，罚款385万元。2026年1月27日，国家金融监督管理总

局大连监管局对农业银行大连市分行、大连金州支行虚增存贷款规模等违规行为，合计罚款60万元。2026年1月21日，国家金融监督管理总局浙江监管局对农业银行浙江省分行个人贷款管理不审慎等违规行为，罚款880万元。2026年1月15日，国家金融监督管理总局海南监管局对农业银行海南省分行及相关分支机构贷款相关业务不尽职等违规行为，合计罚款235万元。2025年12月31日，国家金融监督管理总局福建金融监管局对农业银行福州台江支行违规办理银行卡业务的违规行为，罚款80万元。2025年12月30日，中国人民银行上海市分行对农业银行上海市分行违反金融统计管理规定的违规行为，罚款49万元。2025年10月31日，国家金融监督管理总局对农业银行相关产品销售、服务收费不合规等违规行为，罚款2720万元。2025年10月24日，国家金融监督管理总局海东监管分局对农业银行民和回族土族自治县支行违反信用风险监管规定的违规行为，罚款25万元。2025年10月24日，国家金融监督管理总局安徽监管局对农业银行合肥瑶海区支行、合肥庐阳区支行贷前调查不尽职的违规行为，合计罚款60万元。2025年10月23日，国家金融监督管理总局阜阳监管分局对农业银行阜阳分行贷款三查不尽职的违规行为，罚款60万元。2025年10月21日，国家金融监督管理总局福建金融监管局对农业银行福州长乐支行贷后管理不到位等违规行为，罚款95万元。2025年10月15日，国家金融监督管理总局六安监管分局对农业银行六安金安区支行贷前调查不审慎的违规行为，罚款30万元。2025年10月11日，国家金融监督管理总局北京监管局对农业银行北京市分行涉企收费不规范等违规行为，罚款380万元。2025年9月16日，国家金融监督管理总局贵州监管局对农业银行贵州省分行银行承兑汇票业务风险管理不力的违规行为，罚款30万元。2025年9月10日，国家金融监督管理总局贵州金融监管局对农业银行修文县支行收费质价不符的违规行为，罚款30万元。

26浦发银行CD049（代码：112609049）为本基金前五大持仓债券之一。2026年6月29日，国家金融监督管理总局淮安监管分局对浦发银行淮安分行员工行为管理不到位的违规行为，罚款45万元。2026年6月8日，国家金融监督管理总局吉林金融监管局对浦发银行长春分行及旗下支行汽车金融业务严重违反审慎经营规则等违规行为，合计罚款230万元。2026年4月27日，国家金融监督管理总局晋中监管分局对浦发银行晋中分行违规发放贷款用途不真实的流动资金贷款的违规行为，罚款20万元。2026年3月10日，国家金融监督管理总局楚雄金融监管分局对浦发银行楚雄分行个人贷款管理不审慎的违规行为，罚款30万元。2026年2月12日，中国人民银行对浦发银行违反账户管理规定等违规行为，收违法所得27.545608万元，罚款4222.89万元。2026年1月21日，国家金融监督管理总局浙江监管局对浦发银行杭州分行流动资金贷款“三查”不到位等违规行为，罚款475万元。2026年1月5日，国家金融监督管理总局苏州监管分局对浦发银行苏州分行票据业务审核不严等违规行为，罚款110万元。2025年12月26日，国家金融监督管理总局惠州监管分局对浦发银行惠州分行信贷业务严重违反审慎经营规则的违规行为，罚款35万元。2025年12月19日，国家金融监督管理总局对浦发银行相关理财、代销等业务

管理不审慎等违规行为，罚款1560万元。2025年12月15日，国家金融监督管理总局云南金融监管局对浦发银行昆明分行贷款“三查”严重不尽职的违规行为，合计罚款120万元。2025年11月21日，国家金融监督管理总局宜昌监管分局对浦发银行宜昌分行贷后管理不尽职等违规行为，罚款32万元。2025年10月31日，国家金融监督管理总局对浦发银行相关互联网贷款、代销等业务管理不审慎的违规行为，罚款1270万元。2025年9月19日，中国人民银行安徽省分行对浦发银行合肥分行违反金融统计相关规定等违规行为，罚款87.6万元；国家金融监督管理总局青岛金融监管局对浦发银行青岛市南支行、青岛自贸区支行贷后管理不尽职等违规行为，合计罚款65万元。

25光大银行CD144（代码：112517144）为本基金前五大持仓债券之一。2026年4月8日，中国人民银行重庆市分行对光大银行重庆分行违反金融统计管理规定等违规行为，罚款208.6万元。2026年4月7日，中国人民银行安徽省分行对光大银行合肥分行违反金融统计相关规定等违规行为，罚款225.57万元。2026年3月27日，国家金融监督管理总局深圳金融监管局对光大银行深圳分行滚动开立银行承兑汇票的违规行为，没收违法所得6万元，罚款120万元。2026年1月29日，国家金融监督管理总局大庆监管分局对光大银行大庆分行贷款“三查”不到位的违规行为，罚款20万元。2026年1月23日，国家金融监督管理总局焦作监管分局对光大银行焦作分行贷后管理不到位等违规行为，罚款60万元。2026年1月12日，国家金融监督管理总局泰州监管分局对光大银行泰州分行项目贷款“三查”不到位等违规行为，罚款115万元。2026年1月6日，国家金融监督管理总局泉州金融监管分局对光大银行泉州分行个人经营性贷款贷前调查不尽职等违规行为，罚款120万元；国家金融监督管理总局沧州监管分局对光大银行沧州分行贷中审查不到位的违规行为，罚款35万元。2026年1月5日，国家金融监督管理总局威海监管分局对光大银行威海分行流动资金贷款贷后管理不到位的违规行为，罚款35万元。2025年12月30日，国家金融监督管理总局大同监管分局对光大银行大同分行贷后管理不到位等违规行为，罚款40万元。2025年12月29日，国家金融监督管理总局龙岩金融监管分局对光大银行龙岩分行个人经营性贷款贷前调查不尽职等违规行为，罚款115万元。2025年10月20日，国家金融监督管理总局镇江监管分局对光大银行镇江分行票据业务管理不到位的违规行为，罚款35万元。2025年10月17日，国家金融监督管理总局宁波监管局对光大银行宁波分行授信业务管理不审慎等违规行为，罚款171万元。2025年10月13日，中国人民银行北海市分行对光大银行北海分行未按规定履行客户身份识别义务的违规行为，罚款21.72万元。2025年9月30日，国家金融监督管理总局盐城监管分局对光大银行盐城分行员工行为管理不到位等违规行为，罚款100万元。2025年9月28日，国家金融监督管理总局丹东金融监管分局对光大银行丹东分行贷款“三查”严重不到位的违规行为，罚款50万元；中国人民银行浙江省分行对光大银行杭州分行违反金融统计管理规定等违规行为，罚款391.75万元。2025年9月12日，国家金融监督管理总局对光大银行信息科技外包管理存在不足等违规行为，罚款430万元。

26广发银行CD014（代码：112620014）为本基金前五大持仓债券之一。2026年6月22日，国家外汇局山东省分局对广发银行济南分行办理经常项目资金收付、因未对交易单证的真实性及其与外汇收支的一致性进行合理审查的违规行为，罚没41.44万元。2026年4月7日，中国人民银行本溪市分行对广发银行本溪分行违反账户管理规定等违规行为，罚款48.5万元。2026年3月16日，中国人民银行洛阳市分行对广发银行洛阳分行违反金融统计管理规定等违规行为，罚款86.16万元。2026年3月13日，中国人民银行巴南分行对广发银行重庆巴南支行违反金融统计管理规定的违规行为，罚款50万元。2026年1月30日，中国人民银行常德市分行对广发银行常德分行未按照规定开展客户尽职调查的违规行为，罚款17.2万元。2026年1月6日，国家金融监督管理总局广东监管局对广发银行广州分行、相关分支机构贷款业务严重违反审慎经营规则等违规行为，合计罚款185万元。2026年1月5日，国家金融监督管理总局江门监管分局对广发银行新会支行贷款业务严重违反审慎经营规则的违规行为，罚款31万元。2025年12月30日，国家金融监督管理总局吉林金融监管局对广发银行长春分行及其分支机构贷款资金回流转存保证金等违规行为，合计罚款110万元。2025年12月25日，中国人民银行南充市分行对广发银行南充分行违反账户管理规定的违规行为，罚款380万元。2025年12月9日，国家金融监督管理总局广东监管局对广发银行惠州分行贷款业务严重违反审慎经营规则的违规行为，罚款20万元。2025年11月28日，中国人民银行深圳市分行对广发银行深圳分行违反反假货币业务管理规定等违规行为，罚款204.25万元。2025年11月27日，国家外汇管理局广东省分局对广发银行逃汇、违反规定办理资本项目资金收付等违规行为，罚没1537.83万元。2025年11月21日，国家金融监督管理总局湖北监管局对广发银行武汉分行流动资金贷款贷前调查和贷后管理不尽职的违规行为，罚款35万元。2025年11月5日，国家金融监督管理总局中山监管分局对广发银行中山分行流动资金贷款业务严重违反审慎经营规则的违规行为，罚款154万元。2025年9月12日，国家金融监督管理总局对广发银行相关贷款、票据、保理等业务管理不审慎等违规行为，罚款6670万元。2025年9月5日，国家金融监督管理总局陕西监管局对广发银行西安分行、榆林分行贷款管理不审慎等违规行为，罚款146万元。

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。

7.12.2 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。

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	11.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11.00

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流通受限的股票。

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，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
736	60,445.91	11,600,450.35	26.08%	32,887,735.75	73.92%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	49,249.62	0.11%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和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

§9 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
本报告期期初基金份额总额	310,224,199.56
本报告期基金总申购份额	12,244,612.26
减：本报告期基金总赎回份额	277,980,625.72
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	44,488,186.10

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

（1）基金管理人的重大人事变动情况

2026年1月9日、2026年1月21日，基金管理人发布公告，自2026年1月8日起增聘魏鑫为易米开泰混合型证券投资基金基金经理，贺文奇自2026年1月20日起不再担任易米开泰混合型证券投资基金基金经理。

2026年1月14日、2026年2月7日，基金管理人发布公告，自2026年1月13日起增聘杜雨楠为易米中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金基金经理，李秋实自2026年2月5日起不再担任易米中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金基金经理。

2026年1月14日、2026年2月7日，基金管理人发布公告，自2026年1月13日起增聘杜雨楠为易米和丰债券型证券投资基金基金经理，李秋实自2026年2月5日起不再担任易米和丰债券型证券投资基金基金经理。

2026年3月28日，基金管理人发布公告，公司总经理助理兼首席投资官包丽华于2026年3月26日离任，并自2026年3月26日起不再担任易米开鑫价值优选混合型证券投资基金、易米鑫选品质混合型证券投资基金基金经理；黄晓峰自2026年3月27日起担任易米开鑫价值优选混合型证券投资基金、易米鑫选品质混合型证券投资基金基金经理。

2026年4月10日，基金管理人发布公告，自2026年4月9日起增聘黄晓峰为易米研究精选混合型发起式证券投资基金基金经理，熊颖自2026年4月8日起不再担任易米研究精选混合型发起式证券投资基金基金经理。

(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，托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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。

10.4 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。

10.5 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），报告期内无改聘情况。

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

本报告期内托管人无受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内托管人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

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

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元 数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	

国泰海通	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	105.07	100.00%	-

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。

10.7.2 基金租用或者通过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
国泰海通	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	9,456,038.33	100.00%	60,700,000.00	100.00%	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	易米中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金基金经理变更公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、《证券时报》	2026-01-14
2	易米中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金2025年第四季度报告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-01-22
3	易米基金管理有限公司旗下全部基金季度报告提示性公告	《证券时报》	2026-01-22
4	易米中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金基金经理变更公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、《证券时报》	2026-02-07
5	易米中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金暂停大额申购（含转换转入、	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、《证券时报》	2026-02-10

	定期定额投资)业务的公告		
6	易米中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金暂停大额申购(含转换转入、定期定额投资)业务的公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、《证券时报》	2026-02-26
7	易米中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金2025年年度报告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-03-30
8	易米基金管理有限公司旗下全部基金年度报告提示性公告	《证券时报》	2026-03-30
9	易米中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金2026年第一季度报告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-04-22
10	易米基金管理有限公司旗下部分基金季度报告提示性公告	《证券时报》	2026-04-22
11	易米中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金暂停大额申购(含转换转入、定期定额投资)业务的公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、《证券时报》	2026-04-27
12	易米基金管理有限公司关于调整旗下基金基金转换业务规则的公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、《证券时报》	2026-05-18
13	易米中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金暂停大额申购(含转换转入、定期定额投资)业务的公告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站、《证券时报》	2026-06-27

§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	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

别							
机构	1	20260129-20260630	15,000,450.00	-	5,000,000.00	10,000,450.00	22.48%
产品特有风险							
1.净值大幅波动的风险 由于本基金份额净值的计算保留到小数点后4位，小数点后第5位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。因此该投资者大额赎回时，有可能导致基金份额净值大幅波动，剩余的持有人存在大幅亏损的风险。 2.出现巨额赎回的风险 该投资者在开放日大额赎回时可能导致本基金发生巨额赎回，当基金出现巨额赎回时，根据基金当时资产组合状况，基金管理人有可能对部分赎回申请延期办理或对已确认的赎回进行部分延期支付。其他投资者的赎回申请也可能同时面临部分延期办理的风险或对已确认的赎回进行部分延期支付的风险。当连续2个开放日以上(含本数)发生巨额赎回，本基金管理人有可能暂停接受赎回申请，已接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过20个工作日。投资者可能面临赎回申请无法确认或者无法及时收到赎回款项的风险。 3.基金规模过小的风险 根据基金合同的约定，基金合同生效后，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5,000万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续60个工作日出现前述情形的，基金管理人应当在10个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案。该投资者在开放日大额赎回后，可能出现本基金的基金资产净值连续60个工作日低于5,000万元情形。							

11.2 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。

§12 备查文件目录

12.1 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。

12.2 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。

12.3 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
二〇二六年八月二十八日