新华利率债债券型证券投资基金

2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：新华基金管理股份有限公司

基金托管人：中国光大银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二六年八月二十八日

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同约定，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 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
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 10
4.1 基金管理人及基金经理情况 10
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 15
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 15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 16
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 16
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 16
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 16
5 托管人报告 16
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 16
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 17
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 17
6 半年度财务会计报告（未经审计） 17
6.1 资产负债表 17
6.2 利润表 18
6.3 净资产变动表 20
6.4 报表附注 21
7 投资组合报告 40
7.1 期末基金资产组合情况 40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 41
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 41
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 42
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 42
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 42
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 42
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 42
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 43
7.12 投资组合报告附注 43
8 基金份额持有人信息 44
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 44

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 44
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 45
9 开放式基金份额变动 45
10 重大事件揭示 46
10.1 基金份额持有人大会决议 46
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 46
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 46
10.4 基金投资策略的改变 46
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件 46
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况 46
10.7 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 46
10.8 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 46
10.9 其他重大事件 47
11 影响投资者决策的其他重要信息 48
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 48
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 49
12 备查文件目录 49
12.1 备查文件目录 49
12.2 存放地点 50
12.3 查阅方式 50

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	新华利率债债券型证券投资基金		
基金简称	新华利率债		
基金主代码	011038		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2021 年 3 月 18 日		
基金管理人	新华基金管理股份有限公司		
基金托管人	中国光大银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	30,873,896.57 份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称	新华利率债 A	新华利率债 C	新华利率债 E
下属分级基金的交易代码	011038	011039	016295
报告期末下属分级基金的份额总额	2,156,327.03 份	109,399.99 份	28,608,169.55 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险和保持较高流动性的基础上，重点投资利率债券，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金将在基金合同约定的投资范围内，通过对宏观经济运行状况、国家货币政策和财政政策、国家产业政策及资本市场资金环境的研究，积极把握宏观经济发展趋势、利率走势、债券市场相对收益率，并通过精选债券，获取优化收益。本基金的主要投资策略包括：资产配置策略、收益率曲线策略、骑乘策略、息差放大策略等。
业绩比较基准	中债-国债及政策性银行债指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型证券投资基金，其预期收益和预期风险水平低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		新华基金管理股份有限公司	中国光大银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	齐岩	王茵
	联系电话	010-68779688	010-63639180
	电子邮箱	qiyan@ncfund.com.cn	wangyin@cebbank.com
客户服务电话		4008198866	95595
传真		010-68779528	010-63639132
注册地址		重庆市江北区聚贤岩广场6号力帆中心2号楼19层	北京市西城区太平桥大街25号、甲25号中国光大中心

办公地址	重庆市江北区聚贤岩广场6号力帆中心2号楼19层,北京市西城区平安里西大街26号新时代大厦9层、11层	北京市西城区太平桥大街25号中国光大中心
邮政编码	400010	100033
法定代表人	银国宏	吴利军

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.ncfund.com.cn
基金中期报告置备地点	基金管理人、基金托管人的办公地

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	新华基金管理股份有限公司	重庆市江北区聚贤岩广场 6 号力帆中心 2 号楼 19 层

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	**报告期（2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日）**		
	新华利率债 A	新华利率债 C	新华利率债 E
本期已实现收益	85,387.50	6,628.33	2,642,891.16
本期利润	85,130.54	6,010.55	3,122,857.25
加权平均基金份额本期利润	0.0230	0.0170	0.0178
本期加权平均净值利润率	2.20%	1.67%	1.28%
本期基金份额净值增长率	1.89%	1.66%	1.85%
3.1.2 期末数据和指标	**报告期末(2026 年 6 月 30 日)**		
	新华利率债 A	新华利率债 C	新华利率债 E
期末可供分配利润	120,721.76	2,925.49	6,603,270.64
期末可供分配基金份额利润	0.0560	0.0267	0.2308
期末基金资产净值	2,277,048.79	112,325.48	40,397,964.46
期末基金份额净值	1.0560	1.0267	1.4121
3.1.3 累计期末指标	**报告期末(2026 年 6 月 30 日)**		

	新华利率债 A	新华利率债 C	新华利率债 E
基金份额累计净值增长率	17.41%	13.87%	103.93%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

2、以上所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如基金申购费赎回费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字；

3、对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）；

4、本基金自 2022 年 8 月 3 日起增加 E 类基金份额（基金代码：016295），份额首次确认日为 2022 年 8 月 5 日，增设当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

新华利率债 A

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	1.18%	0.06%	0.62%	0.06%	0.56%	0.00%
过去六个月	1.89%	0.05%	0.89%	0.06%	1.00%	-0.01%
过去一年	1.83%	0.05%	-0.45%	0.07%	2.28%	-0.02%
过去三年	9.63%	0.10%	5.23%	0.09%	4.40%	0.01%
过去五年	16.67%	0.08%	8.57%	0.09%	8.10%	-0.01%
自基金合同生效起至今	17.41%	0.08%	9.44%	0.09%	7.97%	-0.01%

新华利率债 C

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	1.05%	0.06%	0.62%	0.06%	0.43%	0.00%
过去六个月	1.66%	0.05%	0.89%	0.06%	0.77%	-0.01%
过去一年	1.40%	0.05%	-0.45%	0.07%	1.85%	-0.02%
过去三年	7.41%	0.10%	5.23%	0.09%	2.18%	0.01%
过去五年	13.28%	0.08%	8.57%	0.09%	4.71%	-0.01%
自基金合同生效起至今	13.87%	0.08%	9.44%	0.09%	4.43%	-0.01%

新华利率债 E

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标	①－③	②－④

		②		准差④		
过去三个月	1.15%	0.06%	0.62%	0.06%	0.53%	0.00%
过去六个月	1.85%	0.05%	0.89%	0.06%	0.96%	-0.01%
过去一年	1.76%	0.05%	-0.45%	0.07%	2.21%	-0.02%
过去三年	101.30%	3.23%	5.23%	0.09%	96.07%	3.14%
自基金合同生效起至今	103.93%	2.83%	5.85%	0.09%	98.08%	2.74%

注：本基金自 2022 年 8 月 3 日起增加 E 类基金份额（基金代码：016295），份额首次确认日为 2022 年 8 月 5 日，增设当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

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

新华利率债债券型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2021 年 3 月 18 日至 2026 年 6 月 30 日）

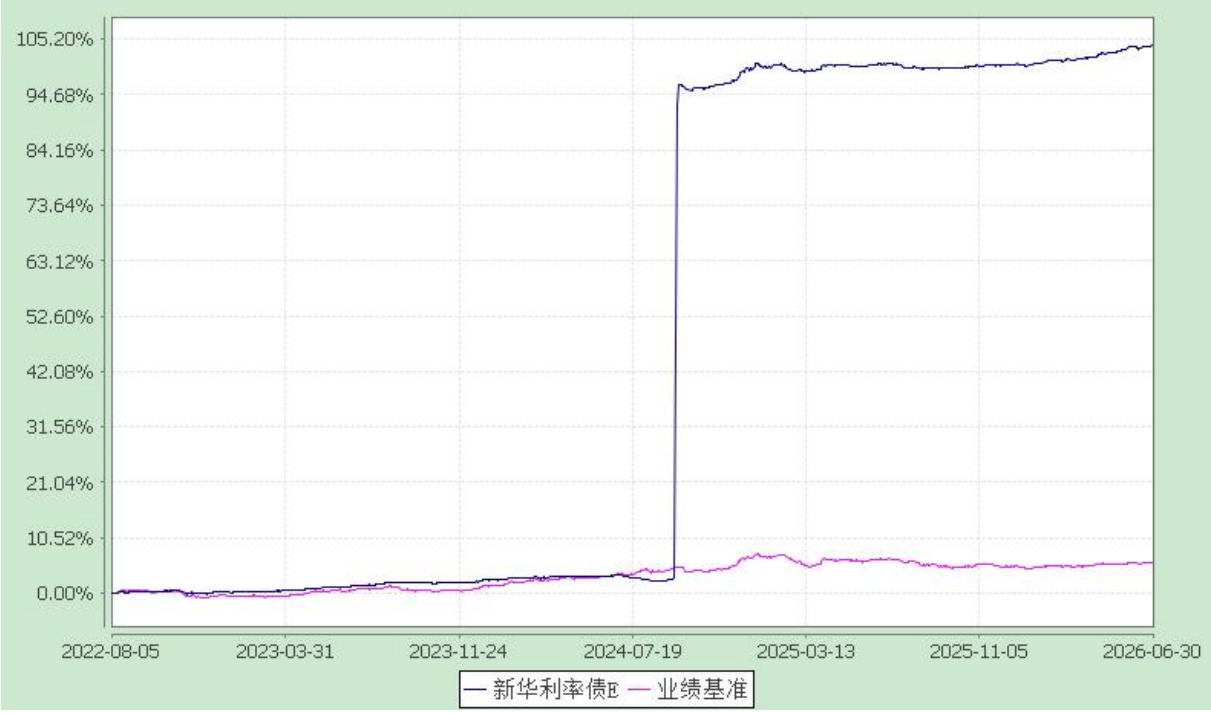
新华利率债 A



新华利率债 C



新华利率债 E



注：本基金自 2022 年 8 月 3 日起增加 E 类基金份额（基金代码：016295），份额首次确认日为 2022 年 8 月 5 日，增设当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

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

新华基金管理股份有限公司经中国证券监督管理委员会批复，于 2004 年 12 月 9 日注册成立。注册地为重庆市，是我国西部首家公募基金管理公司。

截至 2026 年 6 月 30 日，新华基金管理股份有限公司旗下管理着五十五只开放式基金，即新华优选分红混合型证券投资基金、新华优选成长混合型证券投资基金、新华泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金、新华钻石品质企业混合型证券投资基金、新华行业周期轮换混合型证券投资基金、新华中小市值优选混合型证券投资基金、新华优选消费混合型证券投资基金、新华纯债添利债券型发起式证券投资基金、新华行业轮换灵活配置混合型证券投资基金、新华趋势领航混合型证券投资基金、新华安享惠金定期开放债券型证券投资基金、新华壹诺宝货币市场基金、新华增怡债券型证券投资基金、新华鑫益灵活配置混合型证券投资基金、新华中证环保产业指数证券投资基金、新华活期添利货币市场基金、新华增盈回报债券型证券投资基金、新华策略精选股票型证券投资基金、新华稳健回报灵活配置混合型发起式证券投资基金、新华战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金、新华鑫回报混合型证券投资基金、新华积极价值灵活配置混合型证券投资基金、新华科技创新主题灵活配置混合型证券投资基金、新华鑫动力灵活配置混合型证券投资基金、新华双利债券型证券投资基金、新华丰利债券型证券投资基金、新华外延增长主题灵活配置混合型证券投资基金、新华红利回报混合型证券投资基金、新华安享多裕定期开放灵活配置混合型证券投资基金、新华恒稳添利债券型证券投资基金、新华鑫日享中短债债券型证券投资基金、新华聚利债券型证券投资基金、新华鼎利债券型证券投资基金、新华沪深 300 指数增强型证券投资基金、新华安享惠泽 39 个月定期开放债券型证券投资基金、新华景气行业混合型证券投资基金、新华安享惠融 88 个月定期开放债券型证券投资基金、新华利率债债券型证券投资基金、新华行业龙头主题股票型证券投资基金、新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合型证券投资基金、新华中证云计算 50 交易型开放式指数证券投资基金、新华中债 1-5 年农发行债券指数证券投资基金、新华中债 0-3 年政策性金融债指数证券投资基金、新华中证 A50 交易型开放式指数证券投资基金、新华中证 A500 指数增强型证券投资基金、新华中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、新华科技优选混合型发起式证券投资基金、新华低碳经济混合型发起式证券投资基金、新华医疗创新混合型发起式证券投资基金、新华大盘成长量化选股混合型发起式证券投资基金、新华中证云计算 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、新华锦利债券型证券投资基金、新华科技甄选混合型发起式证券投资基金、新华数字经

济混合型发起式证券投资基金、新华中证科创创业 50 指数型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

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		
李洁	本基金基金经理，新华活期添利货币市场基金基金经理、新华安享惠泽 39 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理、新华壹诺宝货币市场基金基金经理、新华中债 1-5 年农发行债券指数证券投资基金基金经理、新华中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金基金经理。	2024-08-07	-	13	经济学硕士，曾任中债信用业务经理、高级经理，新华基金固定收益与平衡投资部债券研究员、基金经理助理。
王滨	本基金基金经理，总经理助理兼固定收益投资总监、新华丰利债券型证券投资基金基金经理、新华纯债添利债券型发起式证券投资基金基金经理、新华鑫日享中短债债券型证券投资基金基金经理。	2024-08-07	2026-02-26	19	工商管理硕士，曾任中国工商银行投资经理、民生加银基金管理有限公司基金经理，新华基金管理股份有限公司固定收益投资部总监、基金经理，中邮创业基金管理股份有限公司固定收益部总经理、基金经理。
陈星屹	本基金基金经理助理，固定	2026-02-02	-	15	金融学硕士，曾任大公国际资信评估有限公司评级副总监，长城财富

	收益研究部总监，新华鑫回报混合型证券投资基金基金经理助理、新华纯债添利债券型发起式证券投资基金基金经理助理、新华安享惠金定期开放债券型证券投资基金基金经理助理、新华活期添利货币市场基金基金经理助理、新华壹诺宝货币市场基金基金经理助理、新华鑫日享中短债债券型证券投资基金基金经理助理、新华安享惠泽 39 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理助理、新华丰利债券型证券投资基金基金经理助理、新华安享惠融 88 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理助理、新华中债 1-5 年农发行债券指数证券投资基金基金经理助理、新华红利回报混合型证券投资基金基金经理助				保险资产管理股份有限公司信用评估总经理、宏利基金管理有限公司信用研究部总经理。

	理、新华聚利债券型证券投资基金基金经理助理、新华增怡债券型证券投资基金基金经理助理、新华增盈回报债券型证券投资基金基金经理助理、新华中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金基金经理助理。				
朱韦康	本基金基金经理助理，新华纯债添利债券型发起式证券投资基金基金经理助理、新华安享惠金定期开放债券型证券投资基金基金经理助理、新华鼎利债券型证券投资基金基金经理助理、新华活期添利货币市场基金基金经理助理、新华壹诺宝货币市场基金基金经理助理、新华鑫日享中短债债券型证券投资基金基金经理助理、新华安享惠泽39个月定期开放债券型证券投资基金基金经理助理、	2022-12-28	2026-02-12	8	经济学博士，曾任中国国际金融股份有限公司固定收益分析师，建信信托有限责任公司投资经理。

	新华丰利债券型证券投资基金基金经理助理、新华安享惠融 88 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理助理、新华中债 1-5 年农发行债券指数证券投资基金基金经理助理、新华红利回报混合型证券投资基金基金经理助理、新华聚利债券型证券投资基金基金经理助理、新华中债 0-3 年政策性金融债指数证券投资基金基金经理助理。				

注：1、首任基金经理，任职日期指基金合同生效日，离任日期指根据公司决定确定的解聘日期。

2、非首任基金经理，任职日期和离任日期均指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

3、证券从业的含义遵从《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》、《基金从业人员管理规则》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期末不存在基金经理同时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

本报告期，新华基金管理股份有限公司作为新华利率债债券型证券投资基金的管理人按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《新华利率债债券型证券投资基金基金合同》以及其它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持有人谋求最大利益。运作整体合法合规，无损害基金持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易相关制度，通过制度、流程、系统和技术手段落实公平交易原则，公平对待旗下管理的所有投资组合。本报告期，公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金未发生违法违规或对基金财产造成损失的异常交易行为；本基金管理人旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，未发生同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%情形。

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

上半年，宏观经济呈现前稳后缓的走势。一季度，宏观政策效应集中释放，财政资金靠前投放，基建投资大幅增长，经济实现良好开局，1—2 月经济数据好于市场预期，生产供给增长加快，市场需求稳中有升。进入二季度，外部环境发生重大变化，美伊军事冲突爆发及霍尔木兹海峡关闭等黑天鹅事件持续发酵，全球能源供应链受到严重冲击，国际原油价格大幅波动。国内方面，有效需求不足的问题仍待根本性解决，经济复苏斜率有所放缓，经济呈结构性分化态势。货币政策方面，上半年央行始终保持稳健精准的调控取向，更加注重运用结构性货币政策工具和公开市场操作的精准调控，保持流动性合理充裕。上半年资金面整体维持均衡格局，DR007 中枢稳定在政策利率附近。债券市场方面，上半年债市整体呈现结构性行情。一季度，大行配置行情之下，中短债走强，但超长债持续调整，收益率曲线陡峭化。二季度，受经济基本面预期反复及外部风险因素影响，债市整体走强，但超长端相对弱势。上半年 1 年期国债收益率由年初 1.35%下行至 1.10%；10 年期国债收益率由年初 1.905%下行至最低 1.70%，目前在 1.70%-1.75%区间窄幅震荡。

报告期内，本基金根据市场情况和产品规模，灵活调整组合久期及杠杆水平，目标是追求产品净值的长期稳定增长。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,本基金 A 类基金份额净值为 1.0560 元,本报告期份额净值增长率为 1.89%,同期业绩比较基准收益率为 0.89%;C 类基金份额净值为 1.0267 元,本报告期份额净值增长率为 1.66%,同期业绩比较基准收益率为 0.89%;E 类基金份额净值为 1.4121 元,本报告期份额净值增长率为 1.85%,同期业

绩比较基准收益率为 0.89%。

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，国际方面，地缘政治风险仍需密切关注，能源供给冲击的持续性有待观察，全球通胀走势存在较大不确定性。国内方面，宏观政策有望持续发力稳增长，财政政策和货币政策协同性将进一步增强。债券市场方面，预计资金面维持合理充裕，收益率区间波动格局延续，久期策略可逢调整进行交易。

在投资策略上我们将继续遵循稳健投资理念，组合当前保持中性久期，后续若市场出现大幅调整，我们将把握久期的交易机会，在保障流动性合理充裕的前提下，为持有人获取更好的回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金管理人已制定基金估值和份额净值计价的业务管理制度，明确基金估值的程序和技术。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。本基金管理人设有估值委员会，负责对各类投资品种的估值方法、估值模型等进行研究和论证，组织制定和适时修订估值政策和程序。本报告期内，参与估值流程各方之间不存在直接的重大利益冲突。 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

本基金本报告期内未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国光大银行股份有限公司在新华利率债债券型证券投资基金（以下称“本基金”）托管过程中，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理

办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，依法安全保管了基金的全部资产，对本基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督，对发现的问题及时提出了意见和建议。同时，按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告，没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为，诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，中国光大银行股份有限公司依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，对基金管理人的投资运作等行为进行了复核、监督，未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金在运作中遵守了有关法律法规的要求，各重要方面的运作严格依据基金合同的约定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

中国光大银行股份有限公司以自身能够获取的数据和信息为限，根据法律法规规定、基金合同和托管协议约定对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进行了复核，认为以上内容真实、准确、完整。

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：新华利率债债券型证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资　产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	413,787.75	13,270,176.64
结算备付金		28,361.81	-
存出保证金		433.23	-
交易性金融资产	6.4.7.2	44,856,992.76	1,185,307,991.23
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		44,856,992.76	1,185,307,991.23
资产支持证券投资		-	-

贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		14,917.00	116,248.80
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		45,314,492.55	1,198,694,416.67
负债和净资产	**附注号**	**本期末 2026 年 6 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		2,300,107.12	20,101,091.39
应付清算款		-	-
应付赎回款		110,569.24	150,600,321.01
应付管理人报酬		12,925.29	633,717.62
应付托管费		4,308.42	211,239.22
应付销售服务费		2,131.73	105,545.26
应付投资顾问费		-	-
应交税费		447.21	28,495.81
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	96,664.81	338,496.89
负债合计		2,527,153.82	172,018,907.20
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	30,873,896.57	741,550,215.12
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	11,913,442.16	285,125,294.35
净资产合计		42,787,338.73	1,026,675,509.47
负债和净资产总计		45,314,492.55	1,198,694,416.67

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额总额 30,873,896.57 份。其中：A 类基金份额净值 1.0560 元，基金份额 2,156,327.03 份；C 类基金份额净值 1.0267 元，基金份额 109,399.99 份；E 类基金份额净值 1.4121 元，基金份额 28,608,169.55 份。

6.2 利润表

会计主体：新华利率债债券型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		**3,931,568.28**	**9,954,498.53**
1.利息收入		43,021.75	3,198,841.09
其中：存款利息收入	6.4.7.9	13,920.58	1,101,839.46
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		29,101.17	2,097,001.63
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		3,407,834.60	10,031,772.12
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	3,407,834.60	10,031,772.12
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	6.4.7.16	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	479,091.35	-3,482,311.06
4.汇兑收益（损失以“一”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	1,620.58	206,196.38
减：二、营业总支出		**717,569.94**	**5,256,893.92**
1．管理人报酬		375,830.76	3,269,951.99
其中：暂估管理人报酬（若有）		-	-
2．托管费		125,276.87	1,089,984.04
3．销售服务费		62,273.85	609,315.03
4．投资顾问费		-	-
5．利息支出		55,948.58	170,020.39
其中：卖出回购金融资产支出		55,948.58	170,020.39
6. 信用减值损失	6.4.7.19	-	-
7．税金及附加		4,074.33	-
8．其他费用	6.4.7.20	94,165.55	117,622.47
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		**3,213,998.34**	**4,697,604.61**
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		**3,213,998.34**	**4,697,604.61**
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		3,213,998.34	4,697,604.61

6.3 净资产变动表

会计主体：新华利率债债券型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	741,550,215.12	-	285,125,294.35	1,026,675,509.47
二、本期期初净资产	741,550,215.12	-	285,125,294.35	1,026,675,509.47
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-710,676,318.55	-	-273,211,852.19	-983,888,170.74
（一）、综合收益总额	-	-	3,213,998.34	3,213,998.34
（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）	-710,676,318.55	-	-276,425,850.53	-987,102,169.08
其中：1.基金申购款	21,157,303.37	-	5,144,741.51	26,302,044.88
2.基金赎回款	-731,833,621.92	-	-281,570,592.04	-1,013,404,213.96
（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	30,873,896.57	-	11,913,442.16	42,787,338.73
项目		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	实收基金	其他综合收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	77,996,885.83	-	46,115,417.88	124,112,303.71
二、本期期初净资产	77,996,885.83	-	46,115,417.88	124,112,303.71

三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	2,232,745,891.05	-	1,235,390,191.12	3,468,136,082.17
（一）、综合收益总额	-	-	4,697,604.61	4,697,604.61
（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）	2,232,745,891.05	-	1,751,770,675.05	3,984,516,566.10
其中：1.基金申购款	3,579,904,847.49	-	2,542,281,440.15	6,122,186,287.64
2.基金赎回款	-1,347,158,956.44	-	-790,510,765.10	-2,137,669,721.54
（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）	-	-	-521,078,088.54	-521,078,088.54
四、本期期末净资产	2,310,742,776.88	-	1,281,505,609.00	3,592,248,385.88

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：

基金管理人负责人：银国宏，主管会计工作负责人：王宇成，会计机构负责人：涂运华

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

新华利率债债券型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2020]3252 号文的核准，由新华基金管理股份有限公司向社会公开募集，基金合同于 2021 年 3 月 18 日正式生效，首次设立募集规模为 1,515,214,164.29 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限为不定期。本基金的基金管理人为新华基金管理股份有限公司，基金托管人为中国光大银行股份有限公司。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表按照财政部颁布的《企业会计准则--基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《公开募集证券投资基金信息披露内容与格式准则第 2 号——定期报告的

内容与格式》、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》、《新华利率债债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注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

本基金编制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本报告期的财务状况、经营成果和净资产变动情况等相关信息。

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估计与最近一期年度报告相一致，所采用的会计政策与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错更正。

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[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定

资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2025]4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

（1）资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，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 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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，继续免征增值税直至债券到期。

（2）对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

（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。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

（4）基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

（5）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 6 月 30 日
活期存款	413,787.75
等于：本金	413,428.05

加：应计利息	359.70
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
合计	413,787.75

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 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	2,701,816.23	20,585.56	2,722,045.56	-356.23
	银行间市场	41,535,215.19	418,947.20	42,134,947.20	180,784.81
	合计	44,237,031.42	439,532.76	44,856,992.76	180,428.58
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		44,237,031.42	439,532.76	44,856,992.76	180,428.58

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 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	12,099.26
其中：交易所市场	-
银行间市场	12,099.26
应付利息	-
应付上海证券报	50,959.35
应付账户维护费	6,428.50
应付审计费	27,177.70
合计	96,664.81

6.4.7.7 实收基金

新华利率债 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	3,783,866.19	3,783,866.19
本期申购	9,354,229.99	9,354,229.99
本期赎回（以“-”号填列）	-10,981,769.15	-10,981,769.15
本期末	2,156,327.03	2,156,327.03

新华利率债 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	372,572.23	372,572.23
本期申购	69,866.30	69,866.30
本期赎回（以“-”号填列）	-333,038.54	-333,038.54
本期末	109,399.99	109,399.99

新华利率债 E

金额单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	737,393,776.70	737,393,776.70
本期申购	11,733,207.08	11,733,207.08
本期赎回（以“-”号填列）	-720,518,814.23	-720,518,814.23
本期末	28,608,169.55	28,608,169.55

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

新华利率债 A

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	1,598,027.19	-1,460,124.14	137,903.05
本期期初	1,598,027.19	-1,460,124.14	137,903.05
本期利润	85,387.50	-256.96	85,130.54
本期基金份额交易产生的变动数	-726,927.71	624,615.88	-102,311.83
其中：基金申购款	4,058,879.51	-3,642,273.81	416,605.70
基金赎回款	-4,785,807.22	4,266,889.69	-518,917.53
本期已分配利润	-	-	-
本期末	956,486.98	-835,765.22	120,721.76

新华利率债 C

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	144,647.36	-140,944.03	3,703.33

本期期初	144,647.36	-140,944.03	3,703.33
本期利润	6,628.33	-617.78	6,010.55
本期基金份额交易产生的变动数	-106,779.27	99,990.88	-6,788.39
其中：基金申购款	27,793.18	-26,584.02	1,209.16
基金赎回款	-134,572.45	126,574.90	-7,997.55
本期已分配利润	-	-	-
本期末	44,496.42	-41,570.93	2,925.49

新华利率债 E

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	149,609,872.41	135,373,815.56	284,983,687.97
本期期初	149,609,872.41	135,373,815.56	284,983,687.97
本期利润	2,642,891.16	479,966.09	3,122,857.25
本期基金份额交易产生的变动数	-145,649,492.93	-130,667,257.38	-276,316,750.31
其中：基金申购款	2,590,167.04	2,136,759.61	4,726,926.65
基金赎回款	-148,239,659.97	-132,804,016.99	-281,043,676.96
本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,603,270.64	5,186,524.27	11,789,794.91

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	8,977.52
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	12.82
其他	4,930.24
合计	13,920.58

注：本项结算备付金利息收入包含保证金利息收入。

6.4.7.10 股票投资收益

本基金本报告期无股票投资收益。

6.4.7.11 基金投资收益

本基金本报告期无基金投资收益。

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1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	2,152,438.94
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	1,255,395.66
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	3,407,834.60

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1月1日至2026年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,344,465,760.31
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,334,312,698.34
减：应计利息总额	8,879,521.31
减：交易费用	18,145.00
买卖债券差价收入	1,255,395.66

6.4.7.13 资产支持证券投资收益

6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期无衍生工具收益——其他投资收益。

6.4.7.16 股利收益

本基金本报告期无股利收益。

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
1.交易性金融资产	479,091.35
——股票投资	-
——债券投资	479,091.35
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	479,091.35

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
基金赎回费收入	1,620.58
合计	1,620.58

6.4.7.19 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
审计费用	27,177.70
信息披露费	50,959.35
证券出借违约金	-
账户维护费	15,428.50
查询费	600.00

合计	94,165.55

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报告批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

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

本报告期内本基金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
新华基金管理股份有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国光大银行股份有限公司	基金托管人
金融街证券股份有限公司	基金管理人股东、基金销售机构

注：1、自 2025 年 9 月 9 日起，公司控股股东恒泰证券股份有限公司更名为金融街证券股份有限公司。

2、以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期与上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期与上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期与上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期与上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期与上年度可比期间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1月1日至2026年6月30日	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	375,830.76	3,269,951.99
其中：应支付销售机构的客户维护费	94,252.53	545,516.75
应支付基金管理人的净管理费	281,578.23	2,724,435.24

注：1、本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.3%的年费率计提，每日计提，按月支付。其计算公式为：每日应计提的基金管理费=前一日资产净值×0.3%/当年天数；

2、客户维护费是指基金管理人与基金销售机构在基金销售协议中约定的依据销售机构销售基金的保有量提取一定比例的客户维护费，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1月1日至2026年6月30日	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	125,276.87	1,089,984.04

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.1%的年费率计提，每日计提，按月支付。其计算公式为：每日应计提的基金托管费=前一日资产净值×0.1%/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1月1日至2026年6月30日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	新华利率债 A	新华利率债 C	新华利率债 E	合计
新华基金管	-	0.49	13,024.51	13,025.00

理股份有限公司				
金融街证券股份有限公司	-	-	7.24	7.24
合计	-	0.49	13,031.75	13,032.24
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	新华利率债 A	新华利率债 C	新华利率债 E	合计
新华基金管理股份有限公司	-	0.12	238,310.82	238,310.94
金融街证券股份有限公司	-	-	0.08	0.08
合计	-	0.12	238,310.90	238,311.02

注：本基金 C 类的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值 0.4%的年费率计提，每日计提，按月支付。其计算公式为：每日应计提的基金销售服务费=前一日 C 类基金资产净值×0.4%/当年天数；

2025 年 1 月 1 日至 2025 年 2 月 13 日，本基金 E 类的销售服务费按前一日 E 类基金资产净值 0.5%的年费率计提，每日计提，按月支付。其计算公式为：每日应计提的基金销售服务费=前一日 E 类基金资产净值×0.5%/当年天数。2025 年 2 月 14 日起本基金 E 类的销售服务费按前一日 E 类基金资产净值 0.05%的年费率计提，每日计提，按月支付。其计算公式为：每日应计提的基金销售服务费=前一日 E 类基金资产净值×0.05%/当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行的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

报告期内，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

新华利率债 E

份额单位：份

关联方名称	新华利率债E本期末 2026年6月30日		新华利率债E上年度末 2025年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的 基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
金融街证券股份有限公司	3,555,176.34	12.43%	-	-

注：对于分级基金，下属分级份额占比的分母采用各自级别的份额。

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1月1日至2026年6月30日		上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国光大银行股份有限公司	413,787.75	8,977.52	29,535,373.11	1,100,481.09

注：本基金的上述银行存款由基金托管人中国光大银行股份有限公司保管，按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期与上年度可比期间在承销期内未参与关联方承销证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2026 年 6 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/增发证券产生的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2026 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 2,300,107.12 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
210215	21 国开 15	2026-07-01	110.18	25,000.00	2,754,436.30
合计				25,000.00	2,754,436.30

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

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

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了以董事会下设的审计委员会为核心的、由督察长、风险管理委员会、监察稽核部、相关职能部门和业务部门构成的风险管理架构体系。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金管理人通过严格的投资备选库制度、交易对手库管理和分散化投资方式防范信用风险。

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6月30日	上年末 2025年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	2,722,045.56	351,282,068.49
合计	2,722,045.56	351,282,068.49

注：1.债券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、政策性金融债、央票及无第三方机构评级的债券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本期末及上年度末，本基金未持有按短期信用评级列示的资产支持证券。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本期末及上年度末，本基金未持有按短期信用评级列示的同业存单。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2026年6月30日	上年末 2025年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	42,134,947.20	834,025,922.74
合计	42,134,947.20	834,025,922.74

注：1.债券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、政策性金融债、央票及无第三方机构评级的债券。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本期末及上年度末，本基金未持有按长期信用评级列示的资产支持证券。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本期末及上年度末，本基金未持有按长期信用评级列示的同业存单。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份

额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。本基金采用分散投资、控制流通受限证券比例等方式防范流动性风险。本基金所持大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。

除卖出回购金融资产款余额（计息但该利息金额不重大）以外，本基金承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一年以内且不计息，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按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金组合的流动性指标进行持续的监测和分析。本报告期内，本基金资产的投资比例符合基金流动性风险管理的相关规定，流动性风险较低。

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现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 6 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	413,787.75	-	-	-	413,787.75
结算备付金	28,361.81	-	-	-	28,361.81
存出保证金	433.23	-	-	-	433.23
交易性金融资产	34,832,719.54	10,024,273.22	-	-	44,856,992.76
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-

债权投资	-	-	-	-	-
其他债权投资	-	-	-	-	-
其他权益工具投资	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	14,917.00	14,917.00
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	35,275,302.33	10,024,273.22	-	14,917.00	45,314,492.55
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	2,300,107.12	-	-	-	2,300,107.12
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	110,569.24	110,569.24
应付管理人报酬	-	-	-	12,925.29	12,925.29
应付托管费	-	-	-	4,308.42	4,308.42
应付销售服务费	-	-	-	2,131.73	2,131.73
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	447.21	447.21
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	96,664.81	96,664.81
负债总计	2,300,107.12	-	-	227,046.70	2,527,153.82
利率敏感度缺口	32,975,195.21	10,024,273.22	-	-212,129.70	42,787,338.73
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	13,270,176.64	-	-	-	13,270,176.64
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	351,282,068.49	552,203,808.22	281,822,114.52	-	1,185,307,991.23
衍生金融资产	-	-	-	-	-

买入返售金融资产	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
其他债权投资	-	-	-	-	-
其他权益工具投资	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	116,248.80	116,248.80
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	364,552,245.13	552,203,808.22	281,822,114.52	116,248.80	1,198,694,416.67
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	20,101,091.39	-	-	-	20,101,091.39
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	150,600,321.01	150,600,321.01
应付管理人报酬	-	-	-	633,717.62	633,717.62
应付托管费	-	-	-	211,239.22	211,239.22
应付销售服务费	-	-	-	105,545.26	105,545.26
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	28,495.81	28,495.81
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	338,496.89	338,496.89
负债总计	20,101,091.39	-	-	151,917,815.81	172,018,907.20
利率敏感度缺口	344,451,153.74	552,203,808.22	281,822,114.52	-151,801,567.01	1,026,675,509.47

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同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	其他市场变量不变，市场利率上升或下降 25 个基点。

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 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
	市场利率上升 25.00 bp	-733,961.71	-11,613,074.91
	市场利率下降 25.00 bp	757,327.16	11,842,143.89

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。本基金的所有资产与负债均以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

在其他价格风险分析中，本基金管理人主要分析市场价格风险的影响。市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的债券，因此无重大其他价格风险。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	-	-
第二层次	44,856,992.76	1,185,307,991.23
第三层次	-	-
合计	44,856,992.76	1,185,307,991.23

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末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	44,856,992.76	98.99
	其中：债券	44,856,992.76	98.99
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-

	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	442,149.56	0.98
8	其他各项资产	15,350.23	0.03
9	合计	45,314,492.55	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通投资的股票。

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	12,746,318.78	29.79
2	央行票据	-	-

3	金融债券	32,110,673.98	75.05
	其中：政策性金融债	32,110,673.98	75.05
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	44,856,992.76	104.84

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	210205	21 国开 05	100,000	11,068,334.25	25.87
2	210215	21 国开 15	100,000	11,017,745.21	25.75
3	250208	25 国开 08	100,000	10,024,594.52	23.43
4	2600001	26 超长特别国债 01	100,000	10,024,273.22	23.43
5	019792	25 国债 19	13,000	1,313,640.03	3.07

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

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

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 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本基金投资的前十名证券的发行主体中，国家开发银行在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行、国家外汇管理局北京市分局的处罚。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

本基金投资范围不包含股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	433.23
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	14,917.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	15,350.23

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，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

份额级别	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
新华利率债 A	336	6,417.64	0.00	0.00%	2,156,327.03	100.00%
新华利率债 C	49	2,232.65	0.00	0.00%	109,399.99	100.00%
新华利率债 E	2,619	10,923.32	13,726,564.23	47.98%	14,881,605.32	52.02%
合计	3,004	10,277.60	13,726,564.23	44.46%	17,147,332.34	55.54%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	新华利率债 A	2,209.10	0.10%
	新华利率债 C	130.01	0.12%

	新华利率债 E	0.00	0.00%
	合计	2,339.11	0.01%

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的情况

项目	份额级别	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	新华利率债 A	0
	新华利率债 C	0
	新华利率债 E	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	新华利率债 A	0
	新华利率债 C	0
	新华利率债 E	0
	合计	0

9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	新华利率债 A	新华利率债 C	新华利率债 E
基金合同生效日（2021 年 3 月 18 日）基金份额总额	1,415,198,481.58	100,015,682.71	-
本报告期期初基金份额总额	3,783,866.19	372,572.23	737,393,776.70
本报告期基金总申购份额	9,354,229.99	69,866.30	11,733,207.08
减：本报告期基金总赎回份额	10,981,769.15	333,038.54	720,518,814.23
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	2,156,327.03	109,399.99	28,608,169.55

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内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

基金管理人于 2026 年 2 月 25 日发布公告，自 2026 年 2 月 24 日起张鹏先生担任公司副总经理兼财务负责人，徐端骞先生离任公司副总经理兼首席信息官。基金管理人于 2026 年 4 月 21 日发布公告，自 2026 年 4 月 20 日起王宇成先生担任公司副总经理兼首席信息官。上述事项经基金管理人董事会审议通过，并按照现行法律法规履行备案程序。

本报告期内基金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

本报告期未有涉及基金管理人、基金财产业务的诉讼。

本报告期内无涉及本基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略未发生改变。

10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

本报告期本基金未持有基金。

10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未有改聘会计师事务所的情况。

10.7 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.7.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人无受到调查或处罚等情况。

10.7.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人相关从业人员无受到调查或处罚等情况。

10.7.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人无受调查或处罚等情况。

10.7.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.8 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

10.8.1 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	
天风证券	2	-	-	-	-	-

注：一、交易单元的选择标准：

（一）基本情况：财务状况良好，财务指标符合证券公司监管要求；

（二）合规风控：公司治理完善，内部管理规范，内控制度健全；

（三）研究服务实力方面需满足以下条件：1、有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析的报告及丰富全面的信息服务；2、能根据公司所管理基金的特定要求，提供专题研究报告；3、具备较强的服务意识，能主动为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

（四）具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要。

二、交易单元的选择程序：

（一）公司研究部根据上述标准考察后确定合作的证券公司名单。

（二）公司与被选中的证券经营机构签订席位租用协议。

三、本基金管理人已根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》（证监会公告［2024］3 号）及证券业协会测算结果完成佣金调整工作。本部分数据统计时间区间与本报告的报告期一致，统计范围仅包括本基金。

10.8.2 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		回购交易		权证交易	
	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
天风证券	5,903,365.99	100.00%	11,300,000.00	100.00%	-	-

10.9 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	新华基金管理股份有限公司旗下基金 2025 年 4 季度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-01-22
2	新华利率债债券型证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-01-22
3	新华基金管理股份有限公司基金行业高级管理人员变更公告	中国证券报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-02-25
4	新华基金管理股份有限公司新华利率债债券型证券投资基金基金经理变更公告	上海证券报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-02-27
5	新华利率债债券型证券投资基金招募说明书（更新）	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-03-02
6	新华利率债债券型证券投资基金产品资料概要（更新）	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-03-02
7	新华基金管理股份有限公司旗下基金 2025 年年度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-03-30
8	新华利率债债券型证券投资基金 2025 年年度报告	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-03-30
9	新华基金管理股份有限公司旗下基金 2026 年 1 季度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-04-21
10	新华利率债债券型证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-04-21
11	新华基金管理股份有限公司基金行业高级管理人员变更公告	中国证券报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-04-21
12	新华基金管理股份有限公司关于终止中证金牛（北京）基金销售有限公司办理本公司旗下基金相关销售业务及后续投资者服务措施的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-06-01

11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比

		20%的时间区间					
机构	1	20260402-20260630	10,171,387.89	-	-	10,171,387.89	32.94%
	2	20260101-20260127	321,068,516.02	-	321,068,516.02	0.00	0.00%
	3	20260128-20260311	64,184,852.37	-	64,184,852.37	0.00	0.00%
	4	20260128-20260401	58,153,058.85	-	58,153,058.85	0.00	0.00%
	5	20260410-20260414	-	8,469,613.58	8,469,613.58	0.00	0.00%
产品特有风险							
1、巨额赎回的风险 持有基金份额比例较高的投资者大量赎回时，更容易触发巨额赎回条款，基金份额持有人将可能无法及时赎回所持有的全部基金份额。 2、基金规模较小导致的风险 持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后，可能导致基金规模较小，基金持续稳定运作可能面临一定困难。本基金管理人将继续勤勉尽责，执行相关投资策略，力争实现投资目标。 3、基金净值大幅波动的风险 持有基金份额比例较高的投资者大额赎回时，基金管理人进行基金财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内本基金未有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

(一)中国证监会准予新华利率债债券型证券投资基金注册的文件

(二)《关于申请募集新华利率债债券型证券投资基金之法律意见书》

(三)《新华利率债债券型证券投资基金基金合同》

(四)《新华利率债债券型证券投资基金托管协议》

(五)《新华利率债债券型证券投资基金招募说明书》（更新）

(六)基金管理人业务资格批件、营业执照

(七)基金托管人业务资格批件、营业执照

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间内免费查阅，也可按工本费购买复印件，或通过本基金管理人网站查阅。

新华基金管理股份有限公司

二〇二六年八月二十八日