

渤海汇金汇鑫益 3 个月定期开放债券型发起式 证券投资基金 2026 年中期报告

2026 年 06 月 30 日

基金管理人:渤海汇金证券资产管理有限公司

基金托管人:兴业银行股份有限公司

报告送出日期:2026 年 08 月 31 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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2026年08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01月01日起至2026年06月30日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
§ 2 基金简介	4
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	7
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	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	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	11
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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	16
§ 7 投资组合报告	36
7.1 期末基金资产组合情况	36
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	36
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	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	36
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	37
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	37
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	37
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	37
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	37
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	38
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	38

7.12 投资组合报告附注	38
§ 8 基金份额持有人信息	38
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	38
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	39
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	39
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	39
§ 9 开放式基金份额变动	39
§ 10 重大事件揭示	40
10.1 基金份额持有人大会决议	40
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	40
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	40
10.4 基金投资策略的改变	40
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	40
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	40
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	41
10.8 其他重大事件	41
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	42
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	43
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	43
§ 12 备查文件目录	43
12.1 备查文件目录	43
12.2 存放地点	43
12.3 查阅方式	43

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	渤海汇金汇鑫益 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金
基金简称	渤海汇金汇鑫益 3 个月定开债发起
基金主代码	016026
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2023 年 02 月 28 日
基金管理人	渤海汇金证券资产管理有限公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,115,713,557.66 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	通过把握债券市场的收益率变化，在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，力求为投资者提供稳健的回报。
投资策略	1、封闭期投资策略 （1）资产配置策略 本基金将在分析和判断国内外宏观经济形势、市场利率走势、信用利差状况和债券市场供求关系等因素的基础上，动态调整组合久期和债券的结构，并通过自下而上精选债券，获取优化收益。 （2）债券类金融工具投资策略 1) 债券类金融工具类属配置策略 类属配置是指对各市场及各种类的债券类金融工具之间的比例进行适时、动态的分配和调整，确定最能符合本基金风险收益特征的资产组合。具体包括市场配置和品种选择两个层面。 在市场配置层面，本基金将在控制市场风险与流动性风险的前提下，根据交易所市场和银行间市场等市场债券类金融工具的到期收益率变化、流动性变化 and 市场规模等情况，择机调整不同市场中债券类金融工具所占的投资比例。 在品种选择层面，本基金将基于各品种债券类金融工具收益率水平的变化特征、宏观经济预测分析以及税收因素的影响，综合考虑流动性、收益性等因素，采取定量分析和定性分析结合的方法，在各种债券类金融工具之间进行优化配置。 2) 久期调整策略 债券投资受利率风险的影响。本基金将根据对影响债券投资的宏观经济状况和货币政策等因素的分析判断，形成对未来

	市场利率变动方向的预期，进而主动调整所持有的债券资产组合的久期值，达到增加收益或减少损失的目的。 当预期市场总体利率水平降低时，本基金将延长所持有的债券组合的久期值，从而可以在市场利率实际下降时获得债券价格上升收益；反之，当预期市场总体利率水平上升时，则缩短组合久期，以规避债券价格下降的风险带来的资本损失，获得较高的再投资收益。 3) 收益率曲线配置策略 本基金将综合考察收益率曲线和信用利差曲线，通过预期收益率曲线形态变化和信用利差曲线走势来调整投资组合的头寸。 在考察收益率曲线的基础上，本基金将确定采用集中策略、哑铃策略或梯形策略等，以从收益率曲线的形变和不同期限信用债券的相对价格变化中获利。一般而言，当预期收益率曲线变陡时，本基金将采用集中策略；当预期收益率曲线变平时，将采用哑铃策略；在预期收益率曲线不变或平行移动时，则采用梯形策略。 本基金还将通过研究影响信用利差曲线的经济周期、市场供求关系和流动性变化等因素，确定信用债券的行业配置和各信用级别信用债券所占投资比例。 4) 基于信用变化策略 信用债券的信用利差与债券发行人所在行业特征和自身情况密切相关。本基金将通过行业分析、公司资产负债分析、公司现金流分析、公司运营管理分析和公司发展前景分析等细致的调查研究，依靠本基金内部信用评级系统建立信用债券的内部评级，分析违约风险及合理的信用利差水平，对信用债券进行独立、客观的价值评估。 5) 息差策略 当回购利率低于债券收益率时，本基金将实施正回购并将所融入的资金投资于债券，从而获取债券收益率超出回购资金成本（即回购利率）的套利价值。 6) 信用债券精选策略（含资产支持证券，下同） 本基金将根据信用债券市场的收益率水平，在综合考虑信用等级、期限、流动性、市场分割、息票率、税赋特点、提前偿还和赎回等因素的基础上，建立不同品种的收益率曲线预测模型和信用利差曲线预测模型，并通过这些模型进行估值，重点选择具备以下特征的信用债券：较高到期收益率、较高当期收入、价值被低估、预期信用质量将改善、期权和债权突出、属于创新品种而价值尚未被市场充分发现。 本基金可投资的信用债评级须在 AA+（含 AA+）以上，除短期融资券、超短期融资券以外的信用债采用债项评级（若无债项评级，依照其主体评级），短期融资券、超短期融资券采用主体评级。 其中：
--	--

	AA+评级债券投资占比不超过本基金投资信用债资产的 50%；AAA 及以上评级债券投资占比不低于本基金投资信用债资产的 50%。 本基金对信用债券评级的认定参照基金管理人选定的评级机构出具的债券信用评级。 基金持有信用债期间，如果其信用等级下降、基金规模变动、变现信用债支付赎回款项等使得投资比例不再符合上述约定，应在评级报告发布之日或不再符合上述约定之日起 3 个月内调整至符合规定。 （3）国债期货投资策略 本基金将认真研究国债期货市场运行特征，根据风险管理的原则，以套期保值为目的，使用该类投资工具，提高组合收益。 2、开放期投资策略 开放期内，本基金为保持较高的组合流动性，方便投资人安排投资，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，将主要投资于高流动性的投资品种，防范流动性风险，满足开放期流动性的需求。
业绩比较基准	中债综合全价(总值)指数收益率*80%+1 年期银行定期存款利率(税后)*20%
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期风险和预期收益低于股票型基金、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		渤海汇金证券资产管理有限公司	兴业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吴国威	冯萌
	联系电话	022-23861655	021-52629999-213310
	电子邮箱	liujia@bhhjamc.com	fengmeng@cib.com.cn
客户服务电话		400-651-1717	95561
传真		022-23861651	021-62159217
注册地址		深圳市前海深港合作区南山街道桂湾五路 128 号基金小镇对冲基金中心 506	福建省福州市台江区江滨中大道 398 号兴业银行大厦
办公地址		深圳市前海深港合作区南山街道桂湾五路 128 号基金小镇对冲基金中心 506	上海市浦东新区银城路 167 号 4 楼
邮政编码		518054	200120
法定代表人		齐朝晖	吕家进

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	https://www.bhhjmc.com
基金中期报告置备地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	渤海汇金证券资产管理有限公司	天津市南开区宾水西道 8 号

§ 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	6,811,916.72
本期利润	20,817,146.97
加权平均基金份额本期利润	0.0186
本期加权平均净值利润率	1.83%
本期基金份额净值增长率	1.94%
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	22,735,974.29
期末可供分配基金份额利润	0.0204
期末基金资产净值	1,147,140,708.03
期末基金份额净值	1.0282
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	11.28%

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（不含公允价值变动损益）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、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

3.2 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

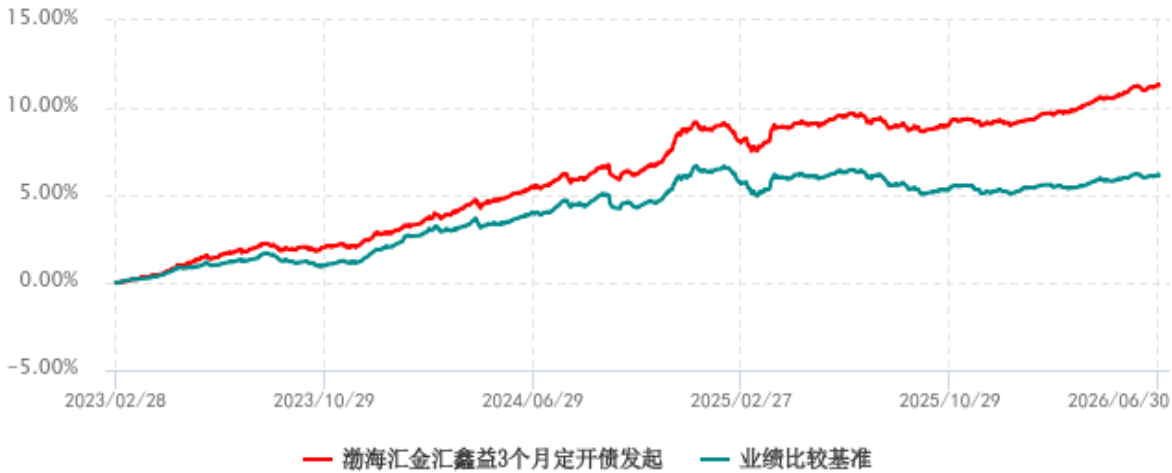
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	1.11%	0.04%	0.57%	0.03%	0.54%	0.01%
过去六个月	1.94%	0.04%	0.88%	0.03%	1.06%	0.01%
过去一年	1.64%	0.05%	-0.15%	0.04%	1.79%	0.01%

过去三年	9.53%	0.07%	5.02%	0.06%	4.51%	0.01%
自基金合同生效起至今	11.28%	0.07%	6.14%	0.06%	5.14%	0.01%

注：业绩比较基准：中债综合全价(总值)指数收益率 $\times$ 80%+1 年期银行定期存款利率(税后) $\times$ 20%

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

渤海汇金汇鑫益3个月定期开放债券型发起式证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2023年02月28日-2026年06月30日)



注：1、本基金合同于 2023 年 02 月 28 日生效。
2、本报告期内，本基金的各项投资比例达到基金合同约定的各项比例要求。

§ 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

渤海汇金证券资产管理有限公司（简称渤海汇金、渤海汇金资管）前身为渤海证券资产管理总部，经中国证监会证监许可[2016]3 号文批准，成立于 2016 年 5 月 18 日。注册地为深圳，注册资本为 11 亿元，业务范围为证券资产管理、公开募集证券投资基金管理业务，是渤海证券股份有限公司的全资子公司。

截至 2026 年 06 月 30 日，本基金管理人共管理 20 只公募基金：渤海汇金汇添金货币市场基金、渤海汇金汇增利 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、渤海汇金汇添益 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、渤海汇金汇裕 87 个月定期开放债券型证券投资基金、渤海汇金新动能主题混合型证券投资基金、渤海汇金兴荣一年定期开放债券型发起式证券投资基金、渤海汇金兴宸一年定期开放债券型发起式证券投资基金、渤海汇金 30 天滚动持有中短债债券型发起式证券投资基金、

渤海汇金汇鑫益 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、渤海汇金优选进取 6 个月持有期混合型发起式基金中基金(FOF)、渤海汇金优选稳健 6 个月持有期混合型发起式基金中基金(FOF)、渤海汇金汇享益利率债债券型证券投资基金、渤海汇金 2 个月滚动持有债券型发起式证券投资基金、渤海汇金优选价值混合型发起式证券投资基金、渤海汇金 1 个月持有期债券型发起式证券投资基金、渤海汇金鑫泉平衡混合型发起式证券投资基金、渤海汇金中证全指自由现金流指数发起式证券投资基金、渤海汇金多元积极配置 3 个月持有期混合型发起式基金中基金(ETF-FOF)、渤海汇金中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期发起式证券投资基金、渤海汇金鑫享债券型发起式证券投资基金。

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		
李杨	本基金基金经理	2023-02-28	-	9 年	中国国籍，天津财经大学经济学学士，具有基金从业资格。 2011 年 10 月到 2014 年 4 月，在包商银行股份有限公司任债券交易员，2014 年 5 月到 2016 年 8 月，在天津银行股份有限公司任债券交易员，2016 年 9 月至今，在渤海汇金证券资产管理有限公司任基金经理。 2017 年 8 月至 2021 年 8 月任渤海汇金汇添金货币市场基金基金经理。2017 年 12 月至 2022 年 1 月任渤海汇金汇增利 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。2017 年 12 月至 2023 年 6 月担任渤海汇金汇添益 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。2018 年 2 月至 2022 年 12 月担任渤海汇金睿选混合基金基金经理。2020 年 11 月起担任渤海汇金汇裕 87 个月定开基金基金经理。2021 年 8 月至 2024 年 9 月任渤海汇金兴荣一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。2022 年 6 月起任渤海汇金兴宸一年定期开放

					债券型发起式证券投资基金基金经理。2023 年 2 月起任渤海汇金汇鑫益 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。2024 年 1 月起担任渤海汇金汇享益利率债债券型证券投资基金基金经理。2025 年 4 月起担任渤海汇金 1 个月持有期债券型发起式证券投资基金基金经理。
张殷鹏	本基金基金经理	2024-11-07	-	6 年	中国国籍，对外经济贸易大学经济学硕士，具有基金从业资格。曾任职于中诚信国际信用评级有限公司、和泰人寿保险股份有限公司等。2020 年 5 月加入渤海汇金证券资产管理有限公司，现任公募固收部信用投资团队基金经理，主要从事资金管理、债券交易以及固定收益投资管理工作。2024 年 11 月起任渤海汇金兴荣一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。2024 年 11 月起任渤海汇金 2 个月滚动持有债券型发起式证券投资基金基金经理。2024 年 11 月起任渤海汇金汇鑫益 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。

注：1、本基金首任基金经理的任职日期为本基金合同生效日，后任基金经理的任职日期以及历任基金经理的离任日期为公司相关会议作出决定的公告（生效）日期；
2、证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

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

注：无

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关法律法规及其各项实施准则的规定以及《渤海汇金汇鑫益 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》等基金法律文件的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，为基金份额持有人谋求利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有损

害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理人公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，各投资组合在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。交易员按最优原则，对指令进行综合平衡，保证交易在各资产组合间的公平执行，保证各类投资人得到公平对待，并通过恒生 032 系统和人工监控等方式进行日常监控，公平对待旗下管理的所有投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

公司严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。报告期内，本基金未发生异常交易行为，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易不存在成交较少的单边交易量超过该证券交易当日成交量的 5% 的情形。

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

2026 年上半年，债市表现较好，收益率整体下行。年初，债市偏强，利率债和信用债收益率均快速下行，特别是宽货币预期升温，短端收益率在流动性呵护下持续走低。随后，中东局势出现变化，市场先定价高油价引发的通胀担忧，后定价高油价引发的衰退风险，利率债先弱后强，特别是 4 月份，流动性宽松下市场走出压利差行情，超长期利率债当月表现强势。随后资金面发生扰动，市场在 6 月份出现调整，但宽松预期仍在，债市先弱后强，收益率又开始小幅下行。

整体来看，上半年经济仍处在弱复苏过程中，二季度数据不及预期，央行持续呵护资金面，虽有地缘政治冲突扰动，但债市整体顺风。

报告期内，本基金坚持“信用债+利率债”双轮驱动的投资策略，主要投资于高等级信用债和利率债品种，灵活调整久期、杠杆，积极捕捉利差收益。具体操作方面，本基金坚持以高等级信用债打底，积极捕捉期限利差和品种利差，把握城投债、金融债等资产的投资机会；利率债操作灵活，仓位和久期灵活调整，为产品进行收益增厚。本基金力争把握两个信用债和利率债两大品种的投资机会，在严控信用风险的基础上努力提升基金回报率。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末渤海汇金汇鑫益 3 个月定开债发起基金份额净值为 1.0282 元，本报告期内，基金份额净值增长率为 1.94%，同期业绩比较基准收益率为 0.88%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2026 年下半年，国内经济预计将延续温和修复态势，财政政策与货币政策协同发挥作用，预计

全年可顺利实现经济增长目标。具体来看，新动能对经济增长的贡献率快速提升，叠加出口表现强势，已成为支撑经济增长的核心动力。而促消费、稳投资政策预计会继续加码，以“六张网”为核心的基建投资会逐渐发力，但内需修复斜率仍相对平缓，全球经济走弱的大背景不变，经济基本面难以形成对债市的强约束。流动性层面，适度宽松的货币政策基调将延续，政治局会议提到综合运用并适时调整货币政策工具，后续不排除总量货币政策出台，流动性继续对债市有利。

债市行情方面，预计下半年整体将维持区间震荡、慢牛延续的格局，10 年期国债收益率大概率在 1.65%-1.85% 区间运行，难以出现趋势性大幅上行或下行，30 年-10 年利差处在高位，后续有继续压降的可能性。当前地方政府仍处在化债的大背景下，信用债管控得当，信用风险预计可控，性价比仍处在较高位置，仍有一定配置价值。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人与基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

本基金管理人设立估值委员会，估值委员会成员由公司总经理、分管公募基金业务的管理人员、合规总监、首席风险官、财务负责人、公募投资部门负责人、产品部及研究部负责人等人组成，负责研究、指导基金估值业务。基金管理人估值委员和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经历。公募投资部门负责人同时兼任基金经理、估值委员，基金经理参加估值委员会会议，但不介入基金日常估值业务；参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突；与估值相关的机构包括但不限于上海、深圳证券交易所，中国证券登记结算有限责任公司，中央国债登记结算有限责任公司，中证指数有限公司以及中国证券投资基金业协会等。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金合同（第十六部分基金的收益与分配中三、基金收益分配原则）的约定，报告期内本基金未实施利润分配，符合法律法规的规定和基金合同的相关约定。

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

本基金为发起式基金，报告期内本基金基金合同生效已满 3 年。基金合同生效满 3 年后的报告期内，本基金未出现连续 20 个工作日基金资产净值低于 5000 万元的情形。本基金自 2026 年 3 月 1 日至 2026 年 5 月 21 日连续 55 个工作日基金份额持有人数量不满 200 人。

§ 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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

报告期内，本托管人根据自身能够获取的数据和信息，依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

本托管人根据自身能够获取的数据和信息，认真复核了本中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 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：渤海汇金汇鑫益 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金

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	573,550.36	3,093,366.09
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	1,217,101,274.50	1,835,530,746.43
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		1,217,101,274.50	1,835,530,746.43
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		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		1,217,674,824.86	1,838,624,112.52
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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		70,014,383.56	227,012,627.87
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		282,581.58	410,441.74
应付托管费		94,193.85	136,813.90
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		42,054.03	1,282.06
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	100,903.81	194,758.15
负债合计		70,534,116.83	227,755,923.72
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	1,115,713,557.66	1,597,083,233.14
未分配利润	6.4.7.8	31,427,150.37	13,784,955.66
净资产合计		1,147,140,708.03	1,610,868,188.80
负债和净资产总计		1,217,674,824.86	1,838,624,112.52

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.0282 元，基金份额总额 1,115,713,557.66 份。

6.2 利润表

会计主体：渤海汇金汇鑫益 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金

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		24,021,615.38	19,696,095.82
1. 利息收入		126,000.53	4,114.76
其中：存款利息收入	6.4.7.9	1,781.23	2,769.05
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		124,219.30	1,345.71
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		9,890,384.60	46,785,623.76
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	9,890,384.60	46,785,623.76
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	-	-
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	14,005,230.25	-27,093,642.70
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		3,204,468.41	7,925,009.86
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,691,591.27	3,051,368.58
2. 托管费	6.4.10.2.2	563,863.74	1,017,122.85
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		835,313.53	3,758,388.56
其中：卖出回购金融资产支出		835,313.53	3,758,388.56
6. 信用减值损失	6.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		20,481.76	-
8. 其他费用	6.4.7.19	93,218.11	98,129.87
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		20,817,146.97	11,771,085.96
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		20,817,146.97	11,771,085.96
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		20,817,146.97	11,771,085.96

6.3 净资产变动表

会计主体：渤海汇金汇鑫益 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金

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	1,597,083,233.14	13,784,955.66	1,610,868,188.80
二、本期期初净资产	1,597,083,233.14	13,784,955.66	1,610,868,188.80
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-481,369,675.48	17,642,194.71	-463,727,480.77
(一)、综合收益总额	-	20,817,146.97	20,817,146.97
(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)	-481,369,675.48	-3,174,952.26	-484,544,627.74
其中: 1. 基金申购款	105,713,984.01	2,284,925.77	107,998,909.78
2. 基金赎回款	-587,083,659.49	-5,459,878.03	-592,543,537.52
(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	1,115,713,557.66	31,427,150.37	1,147,140,708.03
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	1,997,082,762.83	55,538,139.81	2,052,620,902.64
二、本期期初净资产	1,997,082,762.83	55,538,139.81	2,052,620,902.64
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-29.69	11,771,085.18	11,771,055.49
(一)、综合收益总额	-	11,771,085.96	11,771,085.96
(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)	-29.69	-0.78	-30.47
其中: 1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-29.69	-0.78	-30.47
(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	1,997,082,733.14	67,309,224.99	2,064,391,958.13

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:

吴国威	吴国威	宁晓明
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

渤海汇金汇鑫益 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金(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〔2022〕1147 号《关于准予渤海汇金汇鑫益 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金注册的批复》核准,由渤海汇金证券资产管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《渤海汇金汇鑫益 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》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 2,959,997,500.00 元,已经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)德师报(验)字(23)第 00062 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《渤海汇金汇鑫益 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》于 2023 年 2 月 28 日正式生效,基金成立日的基金份额总额为 2,959,997,500.00 份基金份额,其中认购资金利息折合 0.00 份基金份额。本基金的基金管理人为渤海汇金证券资产管理有限公司,基金托管人为兴业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《渤海汇金汇鑫益 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的债券(包括国债、金融债、央行票据、公司债、企业债、地方政府债、政府支持机构债券、公开发行的次级债、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、货币市场工具、国债期货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的相关规定)。本基金不投资于股票;也不投资于可转换债券、可交换债券。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

本基金的投资组合比例为:本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%,但应开放期流动性需要,为保护基金份额持有人利益,在每次开放期开始前 10 个工作日、开放期及开放期结束后 10 个工作日的期间内,基金投资不受上述比例限制。在开放期内每个交易日日终,扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后,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。在封闭期内,本基金不受上述 5%的限制,但每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于交易保证金一倍的现金。其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制,基金管理人在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准为:中债综合全价(总值)指数收益率*80%+1 年期银行定期存款利率(税后)*20%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则及相关规定(以下简称“企业会计准则”)、《资产管理产品相关会计处理规定》(财会[2022]14 号)以及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制,同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》(财会[2022]14 号)和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求,真实、完整地反映了本基金 2026

年 06 月 30 日的财务状况以及 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 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 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

本基金本报告期内无需要说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局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]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》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 证券投资基金(封闭式证券投资基金、开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖债券免征增值税；2018 年 1 月 1 日起，公开募集证券投资基金运营过程中发生的资管产品运营业务，以基金管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

(2) 对证券投资基金取得的自 2025 年 8 月 8 日之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复缴纳增值税；取得的在 2025 年 8 月 8 日之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分)的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。

(3) 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，暂不缴纳企业所得税。

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	573,550.36
等于：本金	573,492.06
加：应计利息	58.30
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	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	573,550.36

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	-	-	-
	银行间市场	1,194,253,206.48	13,913,274.50	1,217,101,274.50
	合计	1,194,253,206.48	13,913,274.50	1,217,101,274.50
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,194,253,206.48	13,913,274.50	1,217,101,274.50	8,934,793.52

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

注：本基金本报告期末无衍生金融工具。

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

注：本基金本报告期末无各项买入返售金融资产期末余额。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 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	19,699.75
其中：交易所市场	-
银行间市场	19,699.75
应付利息	-
预提费用	81,204.06
合计	100,903.81

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	1,597,083,233.14	1,597,083,233.14
本期申购	105,713,984.01	105,713,984.01
本期赎回（以“-”号填列）	-587,083,659.49	-587,083,659.49
本期末	1,115,713,557.66	1,115,713,557.66

注：（1）申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

（2）本基金以定期开放式运作，开放期内开放申购或赎回，封闭期内不开放申购或赎回。

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	19,777,056.89	-5,992,101.23	13,784,955.66
本期期初	19,777,056.89	-5,992,101.23	13,784,955.66
本期利润	6,811,916.72	14,005,230.25	20,817,146.97
本期基金份额交易产生的变动数	-3,852,999.32	678,047.06	-3,174,952.26
其中：基金申购款	1,731,719.92	553,205.85	2,284,925.77
基金赎回款	-5,584,719.24	124,841.21	-5,459,878.03
本期已分配利润	-	-	-
本期末	22,735,974.29	8,691,176.08	31,427,150.37

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	1,781.23
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	1,781.23

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

注：本基金本报告期内无股票投资收益-买卖股票差价收入。

6.4.7.10.2 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期内无股票投资收益-证券出借差价收入。

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
债券投资收益——利息收入	15,058,091.15
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-5,167,706.55

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	9,890,384.60

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	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	2,033,708,846.38
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	2,013,840,661.38
减：应计利息总额	25,007,536.55
减：交易费用	28,355.00
买卖债券差价收入	-5,167,706.55

6.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益——申购差价收入。

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.12.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.12.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.12.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益——申购差价收入。

6.4.7.13 贵金属投资收益

6.4.7.13.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.13.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益-买卖贵金属差价收入。

6.4.7.13.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益-赎回差价收入。

6.4.7.13.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益-申购差价收入。

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期内无衍生工具收益-买卖权证差价收入。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期内无衍生工具收益-其他投资收益。

6.4.7.15 股利收益

注：本基金本报告期内无股利收益。

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	14,005,230.25
——股票投资	—
——债券投资	14,005,230.25
——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	14,005,230.25

6.4.7.17 其他收入

注：本基金本报告期内无其他收入。

6.4.7.18 信用减值损失

注：本基金本报告期内无信用减值损失。

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	12,396.69
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费	2,714.05
账户维护费	18,600.00
合计	93,218.11

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，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无需要披露的重大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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
渤海汇金证券资产管理有限公司（“渤海汇金资管”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
兴业银行股份有限公司（“兴业银行”）	基金托管人、基金销售机构
渤海证券股份有限公司（“渤海证券”）	基金管理人的独资股东

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。

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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内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

注：本基金本报告期内及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

注：本基金本报告期内及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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内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	1,691,591.27	3,051,368.58
其中：应支付销售机构的客户维护费	37,655.68	269,093.13
应支付基金管理人的净管理费	1,653,935.59	2,782,275.45

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.30%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E\times 0.30\%/ \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

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	563,863.74	1,017,122.85

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$H=E\times 0.10\%/ \text{当年天数}$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.2.3 销售服务费

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内无销售服务费。

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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内未与关联方发生重大转融通证券出借业务。

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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内未与关联方发生重大转融通证券出借业务。

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

份额单位：份

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
报告期初持有的基金份额	10,000,000.00	10,000,000.00
报告期间申购/买入总份额	—	—
报告期间因拆分变动份额	—	—
减：报告期间赎回/卖出总份额	—	—
报告期末持有的基金份额	10,000,000.00	10,000,000.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.90%	0.50%

注：基金管理人投资本基金适用的认(申)购/赎回费率按照本基金基金合同和招募说明书的规定执行。

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

注：本基金本报告期末及上年度可比期间末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日		2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
兴业银行	573,550.36	1,781.23	1,244,652.91	2,769.05

注：本基金的活期银行存款由基金托管人兴业银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内未有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

本基金本报告期内及上年度可比期间内无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2026 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金本报告期末无因认购新发/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

注：本基金本报告期末无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 06 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 70,014,383.56 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
220407	22 农发 07	2026-07-01	103.42	78,000	8,066,770.68
230415	23 农发 15	2026-07-01	104.56	700,000	73,191,271.23
合计				778,000	81,258,041.91

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无因交易所市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末无因参与转融通证券出借业务而出借的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金为 3 个月定期开放发起式债券型基金，基金整体的长期平均风险和预期收益率理论上低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。日常经营活动中本基金面临的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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。

公司建立了以董事会承担全面风险管理的最终责任，以审计委员会承担全面风险管理的监督责任，以经营层承担全面风险管理的主要责任，以首席风险官负责全面风险管理工作，以风险管理委员会为风险管理工作指导机构，由各类型风险管理工作的主责部门为风险管理的归口管理部门，由各部门、各分支机构为风险管理的具体落实部门，由稽核部门为风险管理的督导审计部门的多层级的全面风险管理体系。公司应当赋予风险管理组织机构、人员足够的权限与资源，建立各部门、各分支机构、风险管理部门、内审部门之间密切协作、相互衔接、有效制衡的运行机制。

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在托管人，与该银行存款相关的信用风险不重大。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；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理制度，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 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	60,509,075.07	-
合计	60,509,075.07	-

6.4.13.2.2 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 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
AAA	317,868,076.93	255,051,927.47
AAA 以下	124,514,147.95	-
未评级	714,209,974.55	1,580,478,818.96
合计	1,156,592,199.43	1,835,530,746.43

注：长期信用评级由中国人民银行许可的信用机构评级，并由债券发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。未评级的债券投资包括国债、央行票据和政策性银行金融债。

6.4.13.3 流动性风险

报告期内本基金组合资产的流动性风险分析本报告期内，基金管理人坚持组合管理、分散投资的基本原则，严格按照法律法规的有关规定和基金合同约定的投资范围与比例限制实施投资管理。本基金所持大部分证券在证券交易所上市或银行间同业市场交易，不存在具有重大流动性风险的投资品种。

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，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。

截至本报告期末及上年度末，本基金无重大流动性风险。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期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。

本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%。本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 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 15%。

于开放期内，本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

本基金本报告期末无重大流动性风险。

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。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以及银行间同业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	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
---	--------	----------	-------	-------	-----	----

期 末 202 6 年 06 月 30 日						
资 产						
货 币 资 金	573,550.36	-	-	-	-	573,550.36
交 易 性 金 融 资 产	60,509,075. 07	122,899,190 .68	613,992,625 .75	419,700,383 .00	-	1,217,101,274 .50
资 产 总 计	61,082,625. 43	122,899,190 .68	613,992,625 .75	419,700,383 .00	-	1,217,674,824 .86
负 债						
卖 出 回 购 金 融 资 产 款	70,014,383. 56	-	-	-	-	70,014,383.56
应 付 管 理 人 报 酬	-	-	-	-	282,581.58	282,581.58
应	-	-	-	-	94,193.85	94,193.85

付托管费						
应交税费	-	-	-	-	42,054.03	42,054.03
其他负债	-	-	-	-	100,903.81	100,903.81
负债总计	70,014,383.56	-	-	-	519,733.27	70,534,116.83
利率敏感度缺口	-8,931,758.13	122,899,190.68	613,992,625.75	419,700,383.00	-519,733.27	1,147,140,708.03
上年度末 2025 年 12 月 31 日	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产						
货币资金	3,093,050.70	-	-	-	315.39	3,093,366.09
交易性金融	201,460,000.00	80,784,000.00	811,654,000.00	716,801,000.00	24,831,746.43	1,835,530,746.43

资产						
资产总计	204,553,050.70	80,784,000.00	811,654,000.00	716,801,000.00	24,832,061.82	1,838,624,112.52
负债						
卖出回购金融资产款	226,999,459.50	-	-	-	13,168.37	227,012,627.87
应付管理人报酬	-	-	-	-	410,441.74	410,441.74
应付托管费	-	-	-	-	136,813.90	136,813.90
应交税费	-	-	-	-	1,282.06	1,282.06
其他负债	-	-	-	-	194,758.15	194,758.15
负债总计	226,999,459.50	-	-	-	756,464.22	227,755,923.72
利率敏	-22,446,408.80	80,784,000.00	811,654,000.00	716,801,000.00	24,075,597.60	1,610,868,188.80

感 度 缺 口						
------------------	--	--	--	--	--	--

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
	1. 市场利率上升 25 个基点	-12,783,823.24	-18,740,724.06
	2. 市场利率下降 25 个基点	12,783,823.24	19,180,301.58

注：上表反映了在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值变动将对基金净值产生的影响。

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以及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	1,217,101,274.50	106.10	1,835,530,746.43	113.95
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	1, 217, 101, 274. 50	106. 10	1, 835, 530, 746. 43	113. 95
----	----------------------	---------	----------------------	---------

6. 4. 13. 4. 4 采用风险价值法管理风险

本基金未采用风险价值法或类似方法进行分析、管理市场风险。

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 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	-	-
第二层次	1, 217, 101, 274. 50	1, 835, 530, 746. 43
第三层次	-	-
合计	1, 217, 101, 274. 50	1, 835, 530, 746. 43

6. 4. 14. 2. 2 公允价值所属层次间的重大变动

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

于 2026 年 06 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

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货币资金、卖出回购金融资产款及应付款项等，其账面价值与公允价值相差很小。

6. 4. 15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,217,101,274.50	99.95
	其中：债券	1,217,101,274.50	99.95
	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	573,550.36	0.05
8	其他各项资产	-	-
9	合计	1,217,674,824.86	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

注：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

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

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

注：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

注：本基金本报告期内未买入股票。

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

注：本基金本报告期内未卖出股票。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

注：本基金本报告期内未买卖股票。

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	83,739,343.31	7.30
2	央行票据	—	—
3	金融债券	598,898,111.79	52.21
	其中：政策性金融债	332,031,126.02	28.94
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	60,509,075.07	5.27
6	中期票据	432,948,517.81	37.74
7	可转债(可交换债)	—	—
8	同业存单	—	—
9	其他	41,006,226.52	3.57
10	合计	1,217,101,274.50	106.10

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	230415	23 农发 15	700,000	73,191,271.23	6.38
2	220205	22 国开 05	600,000	65,271,698.63	5.69
3	210205	21 国开 05	500,000	55,341,671.23	4.82
4	190215	19 国开 15	500,000	54,467,191.78	4.75
5	102483389	24 津城建 MTN030	500,000	52,017,846.58	4.53

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

注：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

注：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

注：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

无

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

不适用

7.11.2 本期国债期货投资评价

不适用

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受到监管部门立案调查或报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形说明

本报告期内未发现本基金投资的前十名证券的发行主体被监管部门立案调查，未发现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金本报告期内没有投资股票，因此不存在投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况。

7.12.3 期末其他各项资产构成

注：本基金本报告期末无其他资产。

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未持有股票。

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，分项之和与合计可能有尾差。

§ 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
206	5,416,085.23	1,115,713,484.01	100.00%	73.65	0.00%

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	0.00	0.00%

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
本基金基金经理持有本开放式基金	0

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占 基金总份额 比例	发起份额总数	发起份额占 基金总份额 比例	发起份额承 诺持有期限
基金管理人固有 资金	10,000,000.00	0.90%	10,000,000.00	0.90%	自合同生效 之日起不少 于三年
基金管理人高级 管理人员	—	—	—	—	—
基金经理等人员	—	—	—	—	—
基金管理人股东	—	—	—	—	—
其他	—	—	—	—	—
合计	10,000,000.00	0.90%	10,000,000.00	0.90%	—

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2023 年 02 月 28 日）基金份额总额	2,959,997,500.00
本报告期期初基金份额总额	1,597,083,233.14
本报告期基金总申购份额	105,713,984.01
减：本报告期基金总赎回份额	587,083,659.49
本报告期基金拆分变动份额	—

本报告期末基金份额总额	1,115,713,557.66
-------------	------------------

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人无重大人事变动，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

本报告期内，未发生影响基金管理人经营或基金运营业务的诉讼，无涉及基金财产、本基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

2026 年，本基金计划加大信用债投资力度。一方面，当前市场仍处于化债的大环境中，信用债（特别是央国企发行的信用债）发生信用风险事件的可能性较小；另一方面，近年来债券类资产波动较大，而信用债资产具有较为丰厚的票息，能够提供确定性更强的收益。在操作策略上，本产品的核心策略为投资中高等级信用债，捕捉信用债资产的期限利差和品种利差，并在此基础上通过利率债波段操作增厚收益。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

注：本报告期内，未发生基金管理人受调查或处罚的情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：本报告期内，未发生基金管理人相关从业人员受调查或处罚的情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

注：报告期内，本基金托管人在开展基金托管业务过程中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

注：报告期内，本基金托管人相关从业人员在开展基金托管业务过程中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	
兴业证券	2	-	-	-	-	-
渤海证券	2	-	-	-	-	-

注：1、本表“佣金”指本基金通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计。

2、交易单元的选择标准和程序

（1）选择标准：券商经营行为规范；具有较强的研究服务能力，包括研究及投资建议质量、报告的及时性和服务质量；交易佣金收费合理。

（2）选择程序：基金管理人根据以上标准对不同券商进行综合评价，然后根据评价选择券商，与其签订租用交易单元协议/证券经纪服务协议。

3、本基金本报告期内无新增或退租券商交易单元。

4、本部分的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；本公司网站披露的《渤海汇金证券资产管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025 年度）》的报告期为 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日，报告的主要内容报告期间本公司旗下存续过的所有公募基金通过租用境内证券公司交易单元和委托境内证券公司进行证券投资及佣金支付情况，包括报告期间成立、清算、转型（如有）的公募基金。敬请投资者关注上述报告的统计口径差异。

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	渤海汇金汇鑫益 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	中国证监会规定媒介	2026-01-22
2	渤海汇金证券资产管理有限公司旗下基金 2025 年第 4 季度报告的提示性公告	中国证监会规定媒介	2026-01-22
3	渤海汇金证券资产管理有限公司关于旗下渤海汇金汇鑫益 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金增加阳光人寿保险股份有限公司为代销机构并参与基金费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2026-03-24
4	渤海汇金证券资产管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025 年度）	中国证监会规定媒介	2026-03-30

5	渤海汇金汇鑫益 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金 2025 年年度报告	中国证监会规定媒介	2026-03-31
6	渤海汇金证券资产管理有限公司旗下基金 2025 年年度报告的提示性公告	中国证监会规定媒介	2026-03-31
7	渤海汇金证券资产管理有限公司关于旗下渤海汇金汇鑫益 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金增加诺亚正行基金销售公司作为代销机构并参与基金费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2026-04-07
8	渤海汇金证券资产管理有限公司关于旗下部分基金增加上海好买基金销售有限公司为代销机构并参与基金费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2026-04-08
9	渤海汇金汇鑫益 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	中国证监会规定媒介	2026-04-22
10	渤海汇金证券资产管理有限公司旗下基金 2026 年第 1 季度报告的提示性公告	中国证监会规定媒介	2026-04-22
11	渤海汇金汇鑫益 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金第十个开放期开放申购、赎回业务的公告	中国证监会规定媒介	2026-04-22
12	关于调整渤海汇金汇鑫益 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金单笔申购最低金额、单笔追加申购最低金额、单笔赎回最低份额和账户最低基金份额余额数量限制的公告	中国证监会规定媒介	2026-04-24
13	渤海汇金证券资产管理有限公司关于旗下部分基金增加基煜基金销售公司作为代销机构并参与基金费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2026-04-30
14	渤海汇金证券资产管理有限公司 关于旗下渤海汇金汇鑫益 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金增加上海证达通基金销售有限公司和苏州银行股份有限公司作为代销机构并参与基金费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2026-05-19
15	渤海汇金证券资产管理有限公司关于旗下部分基金增加上海华夏财富投资管理有限公司为代销机构并参与基金费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2026-06-11
16	渤海汇金证券资产管理有限公司关于旗下部分基金增加易方达财富（广州）基金销售有限公司为代销机构并参与基金费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2026-06-12
17	渤海汇金证券资产管理有限公司关于旗下渤海汇金汇鑫益 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金增加国泰海通证券股份有限公司为代销机构并参与基金费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2026-06-18

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20260101-20260121	587,083,659.49	-	587,083,659.49	-	0.00%
	2	20260101-20260630	999,999,500.00	-	-	999,999,500.00	89.63%
产品特有风险							
报告期内，本基金存在单一投资者持有基金份额比例超过 20%的情况。由此可能导致的特有风险主要包括： 1. 单一大额投资者大额赎回对基金净值波动的影响。 2. 单一大额投资者大额赎回时为应对赎回证券变现产生的冲击成本的风险。 3. 单一大额投资者退出后，可能出现迷你基金的情形，可能影响投资目标的实现。 4. 单一大额投资者可能对持有人大会施加重大影响。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，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、中国证券监督管理委员会批准渤海汇金汇鑫益 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金设立的文件；
- 2、《渤海汇金汇鑫益 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《渤海汇金汇鑫益 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金托管协议》；
- 4、《渤海汇金汇鑫益 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金招募说明书》；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
- 6、渤海汇金汇鑫益 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金在规定报刊上的各项公告。

12.2 存放地点

基金管理人渤海汇金证券资产管理有限公司处。

12.3 查阅方式

上述文件可在渤海汇金证券资产管理有限公司网站或中国证监会基金电子披露网站上查阅，或者在营业时间内到渤海汇金证券资产管理有限公司查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人渤海汇金证券资产管理有限公司。

客服电话：400-651-1717

管理人网站：<https://www.bhhjamc.com>

中国证监会基金电子披露网站：<http://eid.csrc.gov.cn/fund>

渤海汇金证券资产管理有限公司

二〇二六年八月三十一日