兴业嘉远债券型证券投资基金

2026 年中期报告

2026 年 06 月 30 日

基金管理人:兴业基金管理有限公司

基金托管人:北京银行股份有限公司

送出日期:2026 年 08 月 29 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人北京银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2026年08月26日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2026年01月01日起至06月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录 2
1.1 重要提示 2
1.2 目录 3
§2 基金简介 5
2.1 基金基本情况 5
2.2 基金产品说明 5
2.3 基金管理人和基金托管人 5
2.4 信息披露方式 6
2.5 其他相关资料 6
§3 主要财务指标和基金净值表现 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遵规守信情况的说明 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 11
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遵规守信情况声明 11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 12
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 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 14
6.3 净资产变动表 15
6.4 报表附注 17
§7 投资组合报告 34
7.1 期末基金资产组合情况 34
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 34
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 34
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 34
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 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 35
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 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 36
7.12 投资组合报告附注 36
§8 基金份额持有人信息 37

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 37
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 37
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 37
§9 开放式基金份额变动 38
§10 重大事件揭示 38
10.1 基金份额持有人大会决议 38
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 38
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 38
10.4 基金投资策略的改变 38
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 38
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 39
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 39
10.8 其他重大事件 40
§11 影响投资者决策的其他重要信息 41
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 41
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 41
§12 备查文件目录 41
12.1 备查文件目录 41
12.2 存放地点 42
12.3 查阅方式 42

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	兴业嘉远债券型证券投资基金
基金简称	兴业嘉远债券
基金主代码	018829
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2023年09月08日
基金管理人	兴业基金管理有限公司
基金托管人	北京银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	8,359,874,212.34份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制投资组合风险的前提下，通过积极主动的资产配置，力争获得超越业绩比较基准的收益。
投资策略	1、大类资产配置策略；2、债券投资策略：（1）久期管理策略、（2）期限结构配置策略、（3）类属配置策略、（4）信用债券（含资产支持证券）投资策略、（5）证券公司短期公司债券投资策略；3、杠杆策略；4、国债期货投资策略；5、信用衍生品投资策略。
业绩比较基准	中国债券综合全价指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

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		兴业基金管理有限公司	北京银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张顺国	闫朝
	联系电话	021-22211888	010-66223587
	电子邮箱	zhaoyue@cib-fund.com.cn	yanzhao@bankofbeijing.com.cn

客户服务电话	40000-95561	95526
传真	021-22211997	010-89661115
注册地址	福建省福州市鼓楼区湖东路154号中山大厦A座5层507室	北京市西城区金融大街甲17号首层
办公地址	上海市浦东新区银城路167号13、14层	北京市西城区金融大街丙17号
邮政编码	200120	100033
法定代表人	刘宗治	关文杰

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.cib-fund.com.cn
基金中期报告置备地点	上海市浦东新区银城路167号13、14层

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	兴业基金管理有限公司	上海市浦东新区银城路167号13、14层

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 （2026年01月01日- 2026年06月30日）
本期已实现收益	49,156,095.71
本期利润	141,506,413.59
加权平均基金份额本期利润	0.0170
本期加权平均净值利润率	1.67%

本期基金份额净值增长率	1.78%
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	69,718,152.06
期末可供分配基金份额利润	0.0083
期末基金资产净值	8,595,752,388.63
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	9.34%

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、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（为期末余额，不是当期发生数）。

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	1.05%	0.06%	0.62%	0.04%	0.43%	0.02%
过去六个月	1.78%	0.05%	0.91%	0.04%	0.87%	0.01%
过去一年	1.05%	0.07%	-0.56%	0.06%	1.61%	0.01%
自基金合同生效起至今	9.34%	0.09%	4.89%	0.08%	4.45%	0.01%

注：本基金的业绩比较基准为：中债综合（全价）指数收益率

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

兴业基金管理有限公司（以下简称“兴业基金”或“公司”）成立于2013年4月17日，是兴业银行控股下的全国性基金管理公司。公司注册资本人民币12亿元，其中，兴业银行股份有限公司出资10.8亿元，持股比例90%；中海集团投资有限公司出资1.2亿元，持股比例10%。公司业务范围主要包括基金募集、基金销售、特定客户资产管理、资产管理和中国证监会许可的其他业务。2015年兴业基金成功核准获批QDII资格；2017年2月，兴业基金获批受托管理保险资金资格。目前，兴业基金已设立了北京、上海、深圳、福州四个分公司，并设立基金子公司-兴业财富资产管理有限公司。截至2026年6月30日，兴业基金共管理128只公募基金。

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	离任		

		日期	日期		
伍方方	固定收益研究部总经理助理（主持工作）、基金经理	2023-09-08	-	15年	中国籍，硕士学位，具有证券投资基金从业资格。2010年12月至2017年12月，在兴业银行资金营运中心担任交易员，从事人民币资金交易、流动性管理、债券借贷、同业存单发行与投资交易、投资策略研究以及其他资产负债管理相关工作。2017年12月加入兴业基金管理有限公司，现任固定收益研究部总经理助理（主持工作）、基金经理。
宁瑶	基金经理助理	2026-02-13	-	10年	中国籍，华东师范大学金融学硕士学历，具有证券投资基金从业资格。2017年12月加入兴业基金管理有限公司，先后担任交易部债券交易岗、固定收益投资部专户投资经理助理、固定收益投资部基金经理助理。

1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离职日期”为根据公司决定确定的解聘日期，除首任基金经理外，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期；

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套法律法规、基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，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。报告期内，本基金运作整体合法合规，未发现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

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》，完善相应制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的基金和投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，债券总体震荡偏强，收益率陡峭化下行。一季度债券收益率曲线陡峭化，中短端表现明显优于长端和超长端利率。在央行维护流动性充裕、银行负债成本降低、风险偏好降低的环境下，债市表现超预期，票息资产表现最优。美伊战争带来油价暴涨，通胀问题上升为市场关注的焦点，全球资本市场剧烈波动，中国资产表现相对稳健。二季度债市震荡偏强，各期限收益率以下行为主。央行继续维护流动性充裕，美伊战争出现缓和，油价从高位回落，国内经济基本面表现分化，债市总体表现偏强。上半年，1年期国债收益率从去年末的1.34%下行至6月末的1.12%，累计下行22bp；3年期国债收益率从去年末的1.38%下行至6月末的1.29%，累计下行9bp；5年期国债收益率从去年末的1.63%下行至6月末的1.44%，累计下行19bp；10年期国债收益率从去年末的1.85%下行至6月末的1.73%，累计下行12bp；30年期国债收益率从去年末的2.27%下行至6月末的2.23%，累计下行4bp。报告期内，本组合严格把握债券的信用风险，全部配置利率债，根据市场情况灵活调整久期和杠杆水平。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末兴业嘉远债券基金份额净值为1.0282元，本报告期内，基金份额净值增长率为1.78%，同期业绩比较基准收益率为0.91%。

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，经济“向优向新”形势不变，内生复苏动能仍需提升，融资需求尚待改善，债券市场稳定性更加重要。货币政策方面，央行强调保持流动性充裕，对利率进行引导调控，预计债券波动较小。

下一阶段将密切关注经济基本面、政策面、风险偏好边际变化，稳中求进，灵活调整组合久期和持仓结构，力争组合安全性和流动性的有机结合，为投资者获取稳定的投资回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人设有估值委员会，估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。

估值委员会设主任委员一名，由分管运营的公司领导担任，副主任委员一名，由分管合规的公司领导担任，专业委员若干名，由研究部、投资管理部门（视会议议题内容选择相关投资方向部门）、风险部门、监察稽核部门、基金运营部门负责人或其指定人员组成。以上所有相关人员具备较高的专业能力和丰富的行业从业经验。

估值委员会主要工作职责如下：制定合理、公允的估值方法；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；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；讨论、决定其他与估值相关的重大问题。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值价格的最终决策。

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。

会计师事务所对相关估值模型、假设及参数的适当性出具意见。

定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《基金合同》基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

本报告期内，本基金实施利润分配1次。2026年6月22日分配利润28,760,341.67元。符合本基金合同规定。

本报告期没有应分配但尚未分配的利润。

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，本基金不存在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，本基金托管人在托管兴业嘉远债券型证券投资基金过程中，严格遵守了《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有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本基金托管人按照相关法律法规、基金合同、托管协议约定，对本基金的投资运作进行了监督，为本基金独立建账、独立核算、独立估值，按照托管协议约定的频率与管理人进行账务核对，本报告中利润分配情况真实、准确。

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，本基金托管人在能够知悉和掌握的信息范围内，按照国家法律法规规定、基金合同和托管协议约定，复核了本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告（注：财务会计报告中的“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”、“关联方报酬-应支付销售机构的客户维护费”、“关联方报酬-销售服务费”、“各关联方投资本基金的情况”、“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告相关内容，复核内容真实、准确和完整。

§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：兴业嘉远债券型证券投资基金

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	9,644,148.55	927,669.65
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	9,988,961,630.17	14,300,670,031.58
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		9,988,961,630.17	14,300,670,031.58
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		-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	104.37
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.3	-	-
资产总计		9,998,605,778.72	14,301,597,805.60
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		1,400,058,558.90	913,053,735.62
应付清算款		-	-
应付赎回款		4,548.08	-
应付管理人报酬		1,881,028.95	2,949,707.49
应付托管费		627,009.66	983,235.82
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		60,697.85	44,111.52
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.4	221,546.65	335,161.77
负债合计		1,402,853,390.09	917,365,952.22
净资产：			
实收基金	6.4.7.5	8,359,874,212.34	13,197,125,364.82
未分配利润	6.4.7.6	235,878,176.29	187,106,488.56

净资产合计		8,595,752,388.63	13,384,231,853.38
负债和净资产总计		9,998,605,778.72	14,301,597,805.60

注：报告截止日2026年6月30日，基金份额净值1.0282元，基金份额总额8,359,874,212.34份。

6.2 利润表

会计主体：兴业嘉远债券型证券投资基金

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		173,588,403.30	74,676,563.83
1.利息收入		1,235,498.47	1,213,065.44
其中：存款利息收入	6.4.7.7	1,235,498.47	410,748.98
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		-	802,316.46
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		80,002,586.95	209,647,816.13
其中：股票投资收益	6.4.7.8	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.9	80,002,586.95	209,647,816.13
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.10	-	-
股利收益	6.4.7.11	-	-
其他投资收益		-	-

3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.12	92,350,317.88	-136,184,319.27
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）		-	1.53
减：二、营业总支出		32,081,989.71	30,938,921.11
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	12,663,921.08	14,522,129.76
2.托管费	6.4.10.2.2	4,221,307.04	4,840,709.93
3.销售服务费		-	-
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		15,058,757.38	11,467,979.87
其中：卖出回购金融资产支出		15,058,757.38	11,467,979.87
6.信用减值损失	6.4.7.13	-	-
7.税金及附加		27,798.83	-
8.其他费用	6.4.7.14	110,205.38	108,101.55
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		141,506,413.59	43,737,642.72
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		141,506,413.59	43,737,642.72
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		141,506,413.59	43,737,642.72

6.3 净资产变动表

会计主体：兴业嘉远债券型证券投资基金

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	13,197,125,364.82	187,106,488.56	13,384,231,853.38
二、本期期初净资产	13,197,125,364.82	187,106,488.56	13,384,231,853.38
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-4,837,251,152.48	48,771,687.73	-4,788,479,464.75
（一）、综合收益总额	-	141,506,413.59	141,506,413.59
（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）	-4,837,251,152.48	-63,974,384.19	-4,901,225,536.67
其中：1.基金申购款	1,384,240,623.46	36,075,338.14	1,420,315,961.60
2.基金赎回款	-6,221,491,775.94	-100,049,722.33	-6,321,541,498.27
（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）	-	-28,760,341.67	-28,760,341.67
四、本期期末净资产	8,359,874,212.34	235,878,176.29	8,595,752,388.63
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	12,440,612,309.67	502,273,772.91	12,942,886,082.58
二、本期期初净资产	12,440,612,309.67	502,273,772.91	12,942,886,082.58
三、本期增减变动	6,492,875,693.71	93,282,792.97	6,586,158,486.68

额（减少以“-”号填列）			
（一）、综合收益总额	-	43,737,642.72	43,737,642.72
（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）	6,492,875,693.71	196,140,282.24	6,689,015,975.95
其中：1.基金申购款	11,945,228,998.74	377,631,898.54	12,322,860,897.28
2.基金赎回款	-5,452,353,305.03	-181,491,616.30	-5,633,844,921.33
（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）	-	-146,595,131.99	-146,595,131.99
四、本期期末净资产	18,933,488,003.38	595,556,565.88	19,529,044,569.26

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:

刘宗治	蒲延杰	楼怡斐
_____	_____	_____
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

兴业嘉远债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)系由基金管理人兴业基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《兴业嘉远债券型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)及其他有关法律法规的规定，经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)以证监许可[2023]1337号文准予募集注册。本基金为契约型开放式基金，存续期限为不定期，首次设立募集基金份额为7,999,991,492.08份，经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)验证，并出具了编号为德师报(验)字(23)第00226号

的验资报告。基金合同于2023年9月8日正式生效。本基金的基金管理人为兴业基金管理有限公司，基金托管人为北京银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同及截至报告期末最新公告的《兴业嘉远债券型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行和上市交易的债券(含国债、央行票据、金融债、地方政府债、企业债、公司债、政府支持债券、政府支持机构债券、证券公司短期公司债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、公开发行的次级债券)、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、信用衍生品、国债期货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。本基金不投资股票资产，也不投资可交换债券、可转换债券及分离交易可转债上市后分离出来的债券。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%；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，本基金保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%;其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。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：中国债券综合全价指数收益率。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则-基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称“企业会计准则”)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日的财务状况以及自2026年1月1日起至2026年6月30日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

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 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[2025]4号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、国务院令第826号《中华人民共和国增值税法实施条例》、财税[2026]10号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》、财税[2026]12号《关于明确增值税应税交易销售额计算口径的公告》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)自2026年1月1日至2027年12月31日，公开募集证券投资基金管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，以基金管理人为增值税纳税人，可以选择适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对公募证券投资基金(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股票、债券取得的收入以及金融同业往来利息收入免征增值税。

(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，恢复征收增值税；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)对证券投资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，股权的股息、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。

(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	9,644,148.55
等于：本金	9,641,436.64
加：应计利息	2,711.91
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	9,644,148.55

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	9,841,805,921.85	83,324,730.17	9,988,961,630.17	63,830,978.15
	合计	9,841,805,921.85	83,324,730.17	9,988,961,630.17	63,830,978.15
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		9,841,805,921.85	83,324,730.17	9,988,961,630.17	63,830,978.15

6.4.7.3 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.4 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	-
应付交易费用	135,683.19
其中：交易所市场	-
银行间市场	135,683.19
应付利息	-
预提费用	85,863.46
合计	221,546.65

6.4.7.5 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	13,197,125,364.82	13,197,125,364.82
本期申购	1,384,240,623.46	1,384,240,623.46
本期赎回（以“-”号填列）	-6,221,491,775.94	-6,221,491,775.94
本期末	8,359,874,212.34	8,359,874,212.34

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。

6.4.7.6 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	66,081,298.27	121,025,190.29	187,106,488.56
本期期初	66,081,298.27	121,025,190.29	187,106,488.56
本期利润	49,156,095.71	92,350,317.88	141,506,413.59
本期基金份额交易产	-16,758,900.25	-47,215,483.94	-63,974,384.19

生的变动数			
其中：基金申购款	10,801,756.10	25,273,582.04	36,075,338.14
基金赎回款	-27,560,656.35	-72,489,065.98	-100,049,722.33
本期已分配利润	-28,760,341.67	-	-28,760,341.67
本期末	69,718,152.06	166,160,024.23	235,878,176.29

6.4.7.7 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	1,204,267.08
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	31,231.39
合计	1,235,498.47

6.4.7.8 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金本报告期无股票投资收益。

6.4.7.9 债券投资收益

6.4.7.9.1 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	107,717,069.93
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-27,714,482.98
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	80,002,586.95

6.4.7.9.2 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	8,660,824,002.50
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	8,600,738,707.88
减：应计利息总额	87,726,017.10
减：交易费用	73,760.50
买卖债券差价收入	-27,714,482.98

6.4.7.10 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.11 股利收益

本基金本报告期内无股利收益。

6.4.7.12 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	92,350,317.88
——股票投资	-
——债券投资	92,350,317.88
——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	92,350,317.88

6.4.7.13 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.14 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	59,507.37
汇划手续费	14,741.92
帐户维护费	18,000.00
其他费用	600.00
合计	110,205.38

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

本报告期间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

兴业基金管理有限公司(以下简称"兴业基金")	基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构
北京银行股份有限公司(以下简称"北京银行")	基金托管人
兴业银行股份有限公司(以下简称"兴业银行")	基金管理人的控股股东、基金销售机构
中海集团投资有限公司(以下简称"中海集团")	基金管理人的股东
兴业财富资产管理有限公司(以下简称"兴业财富")	基金管理人控制的公司

下述关联方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

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生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

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生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

本基金本报告期内及上年度可比期间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

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间均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20	上年度可比期间 2025年01月01日至20

	26年06月30日	25年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	12,663,921.08	14,522,129.76
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,802,726.79	1,874,415.48
应支付基金管理人的净管理费	10,861,194.29	12,647,714.28

注：支付基金管理人兴业基金的基金管理人报酬按前一日基金资产净值0.30%的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：日基金管理人报酬＝前一日基金资产净值×0.30%÷当年天数。

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	4,221,307.04	4,840,709.93

注：支付基金托管人北京银行的基金托管费按前一日基金资产净值0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：日基金托管费＝前一日基金资产净值×0.10%÷当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间均无与关联方进行银行间同业市场债券(含回购)交易的情况。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间均无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2026年06月30日		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

兴业财富	102,559,024.39	1.23%	102,559,024.39	0.78%
兴业银行	2,056,379,314.47	24.60%	4,001,893,312.81	30.32%
北京银行	3,382,204,612.88	40.46%	3,382,204,612.88	25.63%

6.4.10.5 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
北京银行股份有限公司	9,644,148.55	1,204,267.08	4,242,665,014.26	378,948.29

本基金的活期银行存款由基金托管人北京银行股份有限公司保管，按银行同业利率或协议利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金报告期间未发生在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无须说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
1	2026-06-22	2026-06-22	0.040	27,508,129.65	1,252,212.02	28,760,341.67	-
合计			0.040	27,508,129.65	1,252,212.02	28,760,341.67	-

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/增发证券而流通受限的证券。

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，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为人民币1,400,058,558.90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
230203	23国开03	2026-07-01	103.33	4,211,000	435,118,361.32
250203	25国开03	2026-07-01	99.91	5,745,000	573,996,643.56
250208	25国开08	2026-07-01	100.25	4,650,000	466,143,645.20
合计				14,606,000	1,475,258,650.08

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。

6.4.13 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面临的与本基金所投资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。本基金基金管理人从事风险管理的主要目标是在有效控制上述风险的前提下，通过对各类市场影响因素分析以及投资组合积极主动管理，力争获得超过业绩比较基准的长期稳定收益，使本基金在风险和收益之间取得最佳平衡。

本基金基金管理人按照"自上而下与自下而上相结合，全面管理、专业分工"的思路，将风险控制嵌入到全公司的组织架构中，对风险实行多层次、多角度、全方位的管理。本基金基金管理人建立的风险管理体系由三层风险防范等级构成：

一级风险防范是指公司董事会层面对公司的风险进行的预防和控制。董事会下设审计与风险管理委员会，负责公司审计风险的控制、管理、监督和评价；对公司经营的合法、合规性进行监控和检查，对经营活动进行审计。

二级风险防范是指公司内部控制与风险管理委员会、投资决策委员会和风险管理部层次对公司风险进行的预防和控制。管理层下设内部控制与风险管理委员会，对公司在经营管理和基金运作中的风险进行研究、分析与评估，制定相应风险控制制度并监督其执行，全面、及时、有效地防范公司经营过程中可能面临的各类风险。

三级风险防范是指公司各部门对自身业务工作风险进行的自我检查和控制。公司各部门根据经营计划、业务规则及部门具体情况，制定本部门业务流程及风险控制措施。

针对金融工具所面临的相关风险，本基金基金管理人主要通过定性与定量分析相结合的方法进行管理，即依据定性分析以判断风险损失的严重程度及同类风险损失的发生频度，凭借定量分析以确定风险损失的限度及相应的置信程度，进而及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，以确保将风险控制在可承受范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金所投资证券的发行人出现违约或拒绝支付到期利息、本金，或基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任等，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金基金管理人建立了较为完善的信用风险管理流程，通过对信用债券发行人基本面调研分析，结合流动性、信用利差、信用评级、违约风险等方面的综合评估结果，选取具有价格优势和套利机会的优质信用债券产品进行投资。

本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，申购交易均通过具有基金销售资格的金融机构进行。本基金通过对银行间同业市场交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，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基金管理人旗下其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的10%。本基金的交易所交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手，并完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小。

除国债、央行票据、政策性金融债外，本基金报告期末及上年度末未持有按信用评级列示的债券。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险指因市场交易相对不活跃导致基金投资资产无法以适当价格及时变现，进而无法应对债务到期偿付或投资者赎回款按时支付的风险。

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，有效保障基金持有人利益。

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。

截止本报告期末及上年度末，本基金无重大流动性风险。

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

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。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。本基金基金管理人主要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。

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	9,644,148.55	-	-	-	9,644,148.55
交易性金融资产	730,796,972.61	6,037,547,024.65	3,220,617,632.91	-	9,988,961,630.17

资产总计	740,441,121.16	6,037,547,024.65	3,220,617,632.91	-	9,998,605,778.72
负债					
卖出回购金融资产款	1,400,058,558.90	-	-	-	1,400,058,558.90
应付赎回款	-	-	-	4,548.08	4,548.08
应付管理人报酬	-	-	-	1,881,028.95	1,881,028.95
应付托管费	-	-	-	627,009.66	627,009.66
应交税费	-	-	-	60,697.85	60,697.85
其他负债	-	-	-	221,546.65	221,546.65
负债总计	1,400,058,558.90	-	-	2,794,831.19	1,402,853,390.09
利率敏感度缺口	-659,617,437.74	6,037,547,024.65	3,220,617,632.91	-2,794,831.19	8,595,752,388.63
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	927,669.65	-	-	-	927,669.65
交易性金融资产	1,059,247,826.19	9,331,987,720.29	3,909,434,485.10	-	14,300,670,031.58
应收申购款	-	-	-	104.37	104.37
资产总计	1,060,175,495.84	9,331,987,720.29	3,909,434,485.10	104.37	14,301,597,805.60

负债					
卖出回购金融资产款	913,053,735.62	-	-	-	913,053,735.62
应付管理人报酬	-	-	-	2,949,707.49	2,949,707.49
应付托管费	-	-	-	983,235.82	983,235.82
应交税费	-	-	-	44,111.52	44,111.52
其他负债	-	-	-	335,161.77	335,161.77
负债总计	913,053,735.62	-	-	4,312,216.60	917,365,952.22
利率敏感度缺口	147,121,760.22	9,331,987,720.29	3,909,434,485.10	-4,312,112.23	13,384,231,853.38

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，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		
假设	利率曲线平行移动		
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	-130,626,199.67	-172,199,221.89
	市场利率下降25个基点	134,909,078.20	177,372,453.37

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无其他重大价格风险。

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06月30日	上年度末 2025年12月31日
第一层次	-	-
第二层次	9,988,961,630.17	14,300,670,031.58
第三层次	-	-
合计	9,988,961,630.17	14,300,670,031.58

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可转换债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别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不将相关股票和可转换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，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

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、应收款项和其他金融负债，其公允价值和账面价值相等。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截止资产负债表日，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	9,988,961,630.17	99.90
	其中：债券	9,988,961,630.17	99.90
	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	9,644,148.55	0.10
8	其他各项资产	-	-
9	合计	9,998,605,778.72	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

本基金本报告期未卖出股票。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期未买入、卖出股票。

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	938,799,145.51	10.92
2	央行票据	-	-
3	金融债券	9,050,162,484.66	105.29
	其中：政策性金融债	9,050,162,484.66	105.29
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	9,988,961,630.17	116.21

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	240208	24国开08	11,200,000	1,153,302,356.16	13.42
2	250208	25国开08	11,350,000	1,137,791,478.08	13.24
3	250203	25国开03	10,600,000	1,059,071,265.75	12.32

4	230203	23国开03	7,000,000	723,302,904.11	8.41
5	240203	24国开03	6,790,000	700,068,532.88	8.14

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

本基金投资范围不包含股指期货。

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

本基金投资国债期货，将根据风险管理的原则，充分考虑国债期货的流动性和风险收益特征，在风险可控的前提下，适度参与国债期货投资。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期未投资国债期货。

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中，国家开发银行在报告编制日前一年内曾受到央行、国家外汇管理局北京市分局的处罚。中国农业发展银行在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚。

本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的其他前十名证券的发行主体本期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。

7.12.2 本基金为债券型基金,未涉及股票相关投资。

7.12.3 期末其他各项资产构成

本基金本报告期末未持有其他资产。

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

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股票。

§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
241	34,688,274.74	8,359,505,328.77	99.9956%	368,883.57	0.0044%

注：1、分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属两级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属两级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

2、持有人户数（户）合计数中针对同时持有各分级基金份额的持有人算为一户。

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	107,499.63	0.0013%

注：分级基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

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	0~10

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2023年09月08日)基金份额总额	7,999,991,492.08
本报告期期初基金份额总额	13,197,125,364.82
本报告期基金总申购份额	1,384,240,623.46
减：本报告期基金总赎回份额	6,221,491,775.94
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	8,359,874,212.34

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

1、2026年7月20日，黄文锋先生离任兴业基金管理有限公司副总经理。详见本公司于2026年7月21日发布的《兴业基金管理有限公司高级管理人员变更公告》。

2、2026年7月20日，李辉先生离任兴业基金管理有限公司总经理，由董事长刘宗治先生代为履行总经理职务。详见本公司于2026年7月21日发布的《兴业基金管理有限公司高级管理人员变更公告》。

3、2026年7月31日，周鸣女士担任兴业基金管理有限公司总经理助理。详见本公司于2026年8月3日发布的《兴业基金管理有限公司高级管理人员变更公告》。

4、报告期内，未发生基金托管人专门基金托管部门的重大人事变动。

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，无涉及对公司运营管理及基金运作产生重大影响的，与基金管理人、基金财产、基金托管业务相关的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金的投资策略未有重大变化。

10.5 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改聘会计师事务所。

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，本基金管理人无受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

报告期内，未发生托管人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

报告期内，未发生托管人相关从业人员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	
天风证券	2	-	-	-	-	-

①为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即：i资力雄厚,信誉良好,注册资本不少于3亿元人民币。ii财务状况良好,经营行为规范,最近一年未因发生重大违法违规行为而受到有关管理机关处罚。iii内部管理规范、严格,具备健全的内控制度,合规风控能力较强，并能满足各产品运作高度保密的要求。iv具备各标准化产品运作所需的高效、安全的通讯条件,交易设施符合代理各标准化产品进行证券交易的需要,并能为各标准化产品提供全面的信息服务，交易能力较强。v研究综合实力较强。vi其他因素（例如，虽综合能力一般，但在某些特色领域或行业，其研究能力、深度和质量在行业领先）。开立交易单元原则上券商应至少已提供两个季度以上的研究服务，并且在最

近一季度服务评价评分中排名在前十名。
②券商专用交易单元选择程序：i本基金管理人组织相关人员依据上述标准评估及确定选用的券商。ii 本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。
③在上述租用的券商交易单元中，i本期未新增券商交易单元，ii本期未剔除券商交易单元

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

本基金本报告期内无租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况。

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	兴业嘉远债券型证券投资基金2025年第四季度报告	中国证监会规定的媒介	2026-01-22
2	兴业嘉远债券型证券投资基金招募说明书更新	中国证监会规定的媒介	2026-02-13
3	兴业基金管理有限公司关于变更基金经理助理的公告	中国证监会规定的媒介	2026-02-13
4	兴业基金管理有限公司关于住所变更的公告	中国证监会规定的媒介	2026-03-27
5	兴业嘉远债券型证券投资基金2025年年度报告	中国证监会规定的媒介	2026-03-28
6	兴业基金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）	中国证监会规定的媒介	2026-03-31
7	兴业嘉远债券型证券投资基金2026年第一季度报告	中国证监会规定的媒介	2026-04-22
8	兴业嘉远债券型证券投资基金暂停大额申购(含转换转入和定期定额投资)公告	中国证监会规定的媒介	2026-06-11
9	兴业基金管理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	中国证监会规定的媒介	2026-06-16

	下基金销售业务的公告		
10	兴业嘉远债券型证券投资基金2026年第1次分红公告	中国证监会规定的媒介	2026-06-18
11	兴业基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金风险评价结果及旗下部分基金风险等级调整的通知	中国证监会规定的媒介	2026-06-18
12	兴业嘉远债券型证券投资基金恢复大额申购（含转换转入和定期定额投资）的公告	中国证监会规定的媒介	2026-06-22
13	兴业嘉远债券型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会规定的媒介	2026-06-23

§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	20260101-20260630	3,382,204,612.88	-	-	3,382,204,612.88	40.46%
	2	20260101-20260630	4,001,893,312.81	-	1,945,513,998.34	2,056,379,314.47	24.60%
产品特有风险							
本基金本报告期出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。如果该类投资者集中赎回，可能会对本基金造成流动性压力；同时，该等集中赎回将可能产生（1）份额净值尾差风险；（2）基金净值波动的风险；（3）因引发基金本身的巨额赎回而导致中小投资者无法及时赎回的风险；（4）因基金资产净值低于5000万元从而影响投资目标实现或造成基金终止等风险。管理人将在基金运作中保持合适的流动性水平，并对申购赎回进行合理的应对，加强防范流动性风险，保护持有人利益。							

注：上述份额占比为四舍五入，保留两位小数后的结果。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

（一）中国证监会准予兴业嘉远债券型证券投资基金募集注册的文件
（二）《兴业嘉远债券型证券投资基金基金合同》
（三）《兴业嘉远债券型证券投资基金托管协议》
（四）法律意见书
（五）基金管理人业务资格批件和营业执照
（六）基金托管人业务资格批件和营业执照
（七）中国证监会要求的其他文件

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人的住所

12.3 查阅方式

投资者可在基金管理人营业时间内免费查阅 。

网站：http：//www.cib-fund.com.cn

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人兴业基金管理有限公司。

客户服务中心电话 4000095561

兴业基金管理有限公司

二〇二六年八月二十九日