东海鑫兴 30 天持有期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:东海基金管理有限责任公司

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28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 4
2.4 信息披露方式 5
2.5 其他相关资料 5
§3 主要财务指标和基金净值表现 5
3.1 主要会计数据和财务指标 5
3.2 基金净值表现 6
3.3 其他指标 7
§4 管理人报告 7
4.1 基金管理人及基金经理情况 7
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 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遵规守信情况声明 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) 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 42
7.1 期末基金资产组合情况 42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 42
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 42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 43
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 43
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 44
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 44
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 44
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 44
7.11 投资组合报告附注 44

§8 基金份额持有人信息 45
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 45
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 45
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 46
§9 开放式基金份额变动 46
§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 47
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 47
10.4 基金投资策略的改变 47
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 47
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 47
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 47
10.8 其他重大事件 48
§11 影响投资者决策的其他重要信息 49
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 49
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	东海鑫兴 30 天持有期债券型证券投资基金	
基金简称	东海鑫兴 30 天持有债券	
基金主代码	021824	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2024 年 09 月 11 日	
基金管理人	东海基金管理有限责任公司	
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	68,628,646.77 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	东海鑫兴 30 天持有债券 A	东海鑫兴 30 天持有债券 C
下属分级基金的交易代码	021824	021825
报告期末下属分级基金的份额总额	14,179,870.03 份	54,448,776.74 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险和保持较高流动性的基础上，力求获得超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	1.资产配置策略；2.久期策略；3.类属配置策略；4.信用债和资产支持证券投资策略；5.杠杆投资策略；6.再投资策略；7.国债期货投资策略。
业绩比较基准	中债综合全价(总值)指数收益率*80%+一年期定期存款利率(税后)*20%
风险收益特征	本基金属于债券型基金，其预期的收益与风险理论上低于股票型基金、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		东海基金管理有限责任公司	兴业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	严晓珺	冯萌
	联系电话	021-60586900	021-52629999-213310
	电子邮箱	service@donghaifunds.com	fengmeng@cib.com.cn
客户服务电话		400-9595531	95561
传真		021-60586926	021-62159217
注册地址		上海市虹口区丰镇路 806 号 3 幢 360 室	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		上海市浦东新区世纪大道 1528 号陆家嘴基金大厦 15 楼	上海市浦东新区银城路 167 号 4 楼

邮政编码	200122	200120
法定代表人	严晓珺	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	《上海证券报》
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.donghaifunds.com
基金中期报告置备地点	基金管理人和基金托管人办公地址。

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	东海基金管理有限责任公司	上海市浦东新区世纪大道 1528 号陆家嘴基金大厦 15 楼

§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）	
	东海鑫兴 30 天持有债券 A	东海鑫兴 30 天持有债券 C
本期已实现收益	140,717.05	437,188.95
本期利润	419,405.60	1,457,697.93
加权平均基金份额本期利润	0.0249	0.0232
本期加权平均净值利润率	2.40%	2.24%
本期基金份额净值增长率	2.57%	2.45%
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	621,190.56	2,182,521.54
期末可供分配基金份额利润	0.0438	0.0401
期末基金资产净值	14,968,275.52	57,276,346.44
期末基金份额净值	1.0556	1.0519
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	5.56%	5.19%

注：(1)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；

(2)本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

(3)期末可供分配利润为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；

(4)本基金合同生效日为 2024 年 09 月 11 日。

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

东海鑫兴 30 天持有债券 A 净值表现

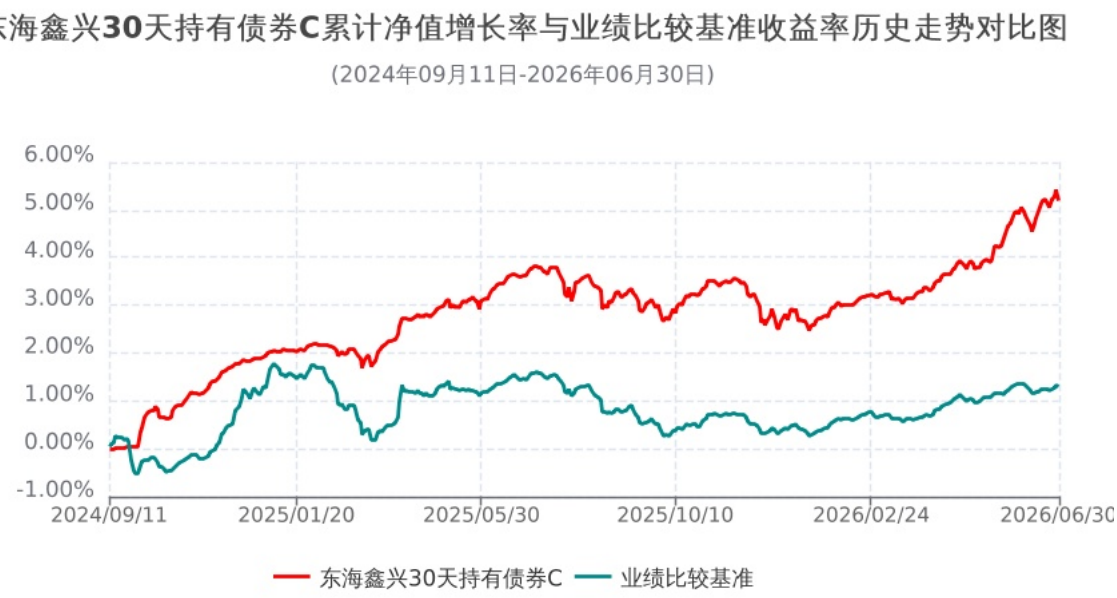
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	1.81%	0.09%	0.57%	0.03%	1.24%	0.06%
过去六个月	2.57%	0.07%	0.88%	0.03%	1.69%	0.04%
过去一年	1.73%	0.09%	-0.15%	0.04%	1.88%	0.05%
自基金合同生效起至今	5.56%	0.08%	1.30%	0.07%	4.26%	0.01%

东海鑫兴 30 天持有债券 C 净值表现

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	1.76%	0.09%	0.57%	0.03%	1.19%	0.06%
过去六个月	2.45%	0.07%	0.88%	0.03%	1.57%	0.04%
过去一年	1.52%	0.09%	-0.15%	0.04%	1.67%	0.05%
自基金合同生效起至今	5.19%	0.08%	1.30%	0.07%	3.89%	0.01%

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





3.3 其他指标

无。

§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

东海基金管理有限责任公司成立于 2013 年 2 月 25 日，注册地上海，是中国证监会批准设立的第 78 家公募基金管理公司，拥有公募基金管理、特定客户资产管理业务资格。

公司的愿景是成为专注资产配置的卓越基金公司，公司秉持信、惠、臻的企业价值观，以“坚持科技驱动、凝聚价值点滴、成就财富海洋”为公司使命。根据公司整体战略规划，东海基金将着力打造大类资产配置品牌，坚持投研一体和科技金融双轮驱动发展理念，以期显著提升产品规模、业绩，提升大类资产配置品牌，成为科技金融的践行者。

截至本报告期末，本基金管理人共管理东海美丽中国灵活配置混合型证券投资基金、东海中证社会发展安全产业主题指数型证券投资基金、东海祥龙灵活配置混合型证券投资基金(LOF)、东海核心价值精选混合型证券投资基金、东海科技动力混合型证券投资基金、东海祥苏短债债券型证券投资基金、东海鑫享 66 个月定期开放债券型证券投资基金、东海启航 6 个月持有期混合型证券投资基金等 28 只公开募集证券投资基金。

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	证券从业	说明

		理）期限		年限	
		任职日期	离任日期		
邢烨	本基金的基金经理、公募固收投资总监	2024-09-11	-	14 年	国籍：中国。金融硕士，特许金融分析师（CFA）。曾任德邦证券资产管理总部交易员、投资经理、投资副总监等职务，2020 年 7 月加入东海基金，现任公募固收投资总监、基金经理。2021 年 3 月 5 日起担任东海祥泰三年定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理；2021 年 4 月 16 日起担任东海祥苏短债债券型证券投资基金的基金经理；2021 年 6 月 15 日起担任东海祥利纯债债券型证券投资基金的基金经理；2021 年 7 月 19 日起担任东海鑫享 66 个月定期开放债券型证券投资基金的基金经理；2021 年 12 月 13 日至 2024 年 10 月 25 日担任东海启航 6 个月持有期混合型证券投资基金的基金经理；2022 年 8 月 12 日至 2025 年 8 月 11 日担任东海鑫宁利率债三个月定期开放债券型证券投资基金的基金经理；2023 年 3 月 17 日至 2024 年 4 月 17 日担任东海鑫乐一年定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理；2024 年 7 月 18 日至 2025 年 8 月 11 日担任东海中债 0-3 年政策性金融债指数证券投资基金的基金经理；2024 年 9 月 11 日起担任东海鑫兴 30 天持有期债券型证券投资基金的基金经理；2024 年 10 月 25 日起担任东海美丽中国灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2025 年 2 月 12 日起担任东海启元添益 6 个月持有期混合型发起式证券投资基金的基金经理；2025 年 7 月 7 日起担任东海合益 3

					个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理；2026 年 1 月 13 日起担任东海增裕债券型发起式证券投资基金的基金经理。
张浩硕	本基金的基金经理	2024-09-11	-	10 年	国籍：中国。金融工程硕士，特许金融分析师（CFA）。曾任上海新世纪资信评估投资服务有限公司信用分析师。2018 年 12 月加入东海基金，现任资产配置部基金经理。2022 年 3 月 9 日起担任东海祥瑞债券型证券投资基金和东海祥泰三年定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理；2022 年 3 月 14 日起担任东海祥苏短债债券型证券投资基金的基金经理；2022 年 3 月 14 日至 2025 年 6 月 5 日担任东海鑫享 66 个月定期开放债券型证券投资基金的基金经理；2023 年 3 月 17 日起担任东海鑫乐一年定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理；2023 年 7 月 12 日起担任东海美丽中国灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2024 年 9 月 11 日起担任东海鑫兴 30 天持有期债券型证券投资基金的基金经理；2024 年 10 月 25 日起担任东海启航 6 个月持有期混合型证券投资基金的基金经理；2025 年 5 月 12 日起担任东海海鑫双悦 3 个月持有期债券型证券投资基金的基金经理；2025 年 6 月 3 日起担任东海润兴债券型证券投资基金的基金经理；2025 年 6 月 9 日起担任东海锐安短债债券型发起式证券投资基金的基金经理。

注：（1）此处的任职日期、离职日期均指公司做出决定之日，若该基金经理自基金合同生效日起即任职，则任职日期为基金合同生效日。

（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

本报告期内，基金经理未兼任其他私募资产管理计划投资经理。

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》、中国证监会的有关规则和其他有关法律法规的规定，严格遵循本基金基金合同，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。本报告期内，本基金运作合法合规，无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

本基金管理人高度重视投资者利益的保护工作，建立了严格的投资决策流程和公平交易监控机制，从而保证旗下基金运作的公平。

公司建立资源共享的投资研究信息平台，确保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。公司拥有健全的投资授权制度，明确投资决策委员会、投资总监、基金经理等各投资决策主体的职责和权限划分，基金经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。公司在交易执行环节实行集中交易制度，建立公平的交易分配制度。对于交易所公开竞价交易，遵循“时间优先、价格优先、比例分配”的原则，全部通过交易系统进行比例分配；对于非集中竞价交易、以公司名义进行的场外交易，遵循“价格优先、比例分配”的原则按事前独立确定的投资方案对交易结果进行分配。

公司于每季度和年度对公司管理的不同投资组合进行了同向交易价差分析，采用了日内、3 日内、5 日内的时间窗口，假设不同组合间价差为零，进行了 T 分布检验，未发现旗下投资组合之间存在利益输送情况。

通过投资交易监控、交易数据分析以及专项稽核检查，公司未发现任何违反公平交易的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了公平交易制度和异常交易监控细则，同时加强对组合间同向交易和同日反向交易的监控和检查。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。

公司利用公平交易分析系统，对组合间不同时间窗口下的同向交易指标进行持续监控，并定期对组合间的同向交易分析。公司禁止组合内的同日反向交易，严格控制组合间的同日反向交易，对采用量化投资策略的组合与其他组合间发生的同日反向交易进行监控和分析。报告期内，本基金各项交易均严格按照相关法律法规、基金合同的有关要求执行。基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日总成交量 5%的交易次数为 0 次。

本报告期内，各组合投资交易未发现异常情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2026年上半年，债市总体呈现震荡走强的格局，收益率中枢持续下移，其中一季度短端资产下行幅度更大，二季度长端表现更佳，收益率曲线整体呈现"先陡后平"的特征，信用利差总体压缩。具体来看，报告期内10年期国债收益率最低为1.70%，最高为1.90%，至报告期末收于1.73%，较上年末下行12BP；1年期AA+中短期票据收益率最低为1.49%，最高为1.76%，至报告期末收于1.53%，较上年末下行24BP。

从市场节奏来看，一季度债券收益率总体先下后上，季度初央行宣布结构性降息，债市走出修复行情，随后商品期货走强叠加楼市放松政策的推出，市场定价通胀与基本面回升，债市出现回调；2月底中东地缘政治事件突发，引发资本市场剧烈动荡，债市交易主线围绕在油价波动下的通胀博弈、资金风险偏好切换等，走势偏震荡。二季度随着美伊谈判的反复不定，市场对于中东局势逐步脱敏，债市回归资金面主导，其中4-5月份资金利率总体维持在相对低位，叠加国内权益行情自高位回落，配置资金持续涌入债市，各期限收益率迎来一波流畅的下行。6月份资产荒行情再起，债市迎来一波流畅的下行，其中10年期国债活跃券向下挑战1.7%关口。6月债市主要围绕央行政策投放力度展开，债市回归区间震荡。

信用债方面，上半年信用债需求持续旺盛，“资产荒”行情不断演绎。其中一季度同业存单利率压降后短端信用债的下行空间得以打开，其收益率在突破新低后带动中长端信用利差持续压缩；二季度信用债跟随资金利率运行，信用利差总体先压缩后小幅走扩。值得关注的是，二季度各债券评级机构开展"评级虚高"情况排查，部分主体出现评级下调或终止评级，带动相关债券价格波动，对市场情绪形成一定扰动。

本报告期内，本基金重点配置了利率债和中高等级信用债，在保证流动性和信用风险可控的前提下通过适当的杠杆息差策略增厚收益，力争为投资人创造长期稳健的投资回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末东海鑫兴30天持有债券A基金份额净值为1.0556元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为2.57%，同期业绩比较基准收益率为0.88%；截至报告期末东海鑫兴30天持有债券C基金份额净值为1.0519元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为2.45%，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

展望下半年，当前逆全球化浪潮与地缘政治冲突持续交织，全球经济走势存在较大不确定性。在此背景下，国内稳增长、稳预期诉求仍高，货币政策仍延续适度宽松定调，财政政策预计将有所提速。从债市需求层面来看，实体融资偏弱、流动性整体偏松的环境下，债市“资产荒”逻辑犹存，尤其是利率中枢稳定的环境下超长端的配置需求有望释放，期限利差压缩仍可期。后续债市仍需关注国内经济政策的推出对基本面的拉动效果、政府债供给高峰的扰动情况，以及海外地缘政治事件的进展所引发的通胀变化等因素。

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，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。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备投资、研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。

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

本报告期内，本基金未进行利润分配，符合相关法律法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金未出现连续 20 个工作日基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 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

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内，本托管人根据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：东海鑫兴 30 天持有期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	423,944.38	289,842.71
结算备付金		2,281,114.80	1,660,760.52
存出保证金		97,232.54	598,627.95
交易性金融资产	6.4.7.2	89,908,796.95	114,419,197.99
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		89,908,796.95	114,419,197.99
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		608,097.75	-
应收股利		-	-
应收申购款		128,061.28	2,855,263.24
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		93,447,247.70	119,823,692.41
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		21,000,000.00	1,799,616.33

应付清算款		-	479.59
应付赎回款		87,190.88	161,235.41
应付管理人报酬		17,655.65	33,396.44
应付托管费		2,942.63	5,566.07
应付销售服务费		9,231.35	17,532.07
应付投资顾问费		-	-
应交税费		965.01	1,475.94
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	84,640.22	34,210.74
负债合计		21,202,625.74	2,053,512.59
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	68,628,646.77	114,649,182.37
未分配利润	6.4.7.12	3,615,975.19	3,120,997.45
净资产合计		72,244,621.96	117,770,179.82
负债和净资产总计		93,447,247.70	119,823,692.41

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 68,628,646.77 份。其中东海鑫兴 30 天持有债券 A 基金份额净值 1.0556 元，基金份额总额 14,179,870.03 份；东海鑫兴 30 天持有债券 C 基金份额净值 1.0519 元，基金份额总额 54,448,776.74 份。

6.2 利润表

会计主体：东海鑫兴 30 天持有期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		2,220,970.70	5,503,603.42
1.利息收入		18,413.30	37,402.42
其中：存款利息收入	6.4.7.13	11,391.76	15,942.72
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		7,021.54	21,459.70
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		903,359.87	5,887,605.18
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	1,146,345.53	5,140,740.25
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-

衍生工具收益	6.4.7.18	-242,985.66	746,864.93
股利收益	6.4.7.19	-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	1,299,197.53	-421,404.18
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	-	-
减：二、营业总支出		343,867.17	1,251,387.05
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	123,971.59	540,769.97
2.托管费	6.4.10.2.2	20,661.97	90,128.37
3.销售服务费	6.4.10.2.3	65,165.92	282,704.57
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		45,471.06	216,787.12
其中：卖出回购金融资产支出		45,471.06	216,787.12
6.信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7.税金及附加		796.45	15,475.28
8.其他费用	6.4.7.23	87,800.18	105,521.74
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,877,103.53	4,252,216.37
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,877,103.53	4,252,216.37
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		1,877,103.53	4,252,216.37

6.3 净资产变动表

会计主体：东海鑫兴30天持有期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	114,649,182.37	3,120,997.45	117,770,179.82
二、本期期初净资产	114,649,182.37	3,120,997.45	117,770,179.82
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-46,020,535.60	494,977.74	-45,525,557.86
（一）、综合收益总额	-	1,877,103.53	1,877,103.53
（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）	-46,020,535.60	-1,382,125.79	-47,402,661.39

其中：1.基金申购款	23,350,216.79	986,398.43	24,336,615.22
2.基金赎回款	-69,370,752.39	-2,368,524.22	-71,739,276.61
（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	68,628,646.77	3,615,975.19	72,244,621.96
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	430,650,784.08	8,604,401.75	439,255,185.83
二、本期期初净资产	430,650,784.08	8,604,401.75	439,255,185.83
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-166,224,609.61	996,773.87	-165,227,835.74
（一）、综合收益总额	-	4,252,216.37	4,252,216.37
（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）	-166,224,609.61	-3,255,442.50	-169,480,052.11
其中：1.基金申购款	296,464,061.97	7,233,044.56	303,697,106.53
2.基金赎回款	-462,688,671.58	-10,488,487.06	-473,177,158.64
（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	264,426,174.47	9,601,175.62	274,027,350.09

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:

严晓珺	黄河	黄河
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

东海鑫兴30天持有期债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)，经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2024]936号文《关于准予东海鑫兴30天持有期债券型证券投资基金注册的批复》准予注册，由东海基金管理有限责任公司(以下简称“东海基金”) 依照《中华人民共和国证券投资基金法》等相关法规和《东海鑫兴30天持有期债券型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”) 发售，基金合同于2024年9月11日正式生效。本基金为契约型开放式，存续期限为不定期，首次设立募集规模为398,522,009.05份基金份额。本基金的基金管理人为东海基金，基金托管人为兴业银行股份有限公司(以下简称“兴业银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《东海鑫兴30天持有期债券型证券投资基金基金合同》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，包括债券（含国

债、金融债、央行票据、企业债、公司债、中期票据、政府支持机构债、政府支持债、地方政府债、公开发行的次级债、可分离交易可转债的纯债部分、短期融资券、超短期融资券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（协议存款、通知存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、国债期货、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会相关规定。本基金不投资于股票，也不投资于可转换债券（可分离交易可转债的纯债部分除外）、可交换债券。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。

本基金债券资产的投资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，本基金持有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、应收申购款等。如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%+一年期定期存款利率(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财政部于 2006 年 02 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则－基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》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 2026 年中期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的 2026 年 06 月 30 日财务状况以及 2026 年上半年度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

本基金本报告期内所采用的会计政策、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

本报告期间，本基金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

本报告期间，本基金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

本报告期间，本基金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《财政部国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《财政部国家税务总局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《财政部国家税务总局关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2017]56号《财政部国家税务总局关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《财政部国家税务总局关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》（财政部税务总局公告2025年第4号）及其他相关税务法规和实务操作，本基金主要税项列示如下：

1．对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的差价收入及基金取得的同业存款、买入返售金融资产（质押式、买断式）利息收入免征增值税。对基金取得的国债、地方政府债、金融债券利息收入，2025年8月8日前已发行的上述债券（包含2025年8月8日之后续发行的部分），其利息收入继续免征增值税直至债券到期；2025年8月8日及以后新发行的上述债券，其利息收入不再享受免税政策。基金增值税应税行为包括贷款服务和金融商品转让。采用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对基金在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，已纳税额从基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。基金管理人运营基金提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：（1）提供贷款服务，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；（2）转让2017年12月31日前取得的债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。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。

2．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。

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	423,944.38
等于：本金	423,803.85
加：应计利息	140.53
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	423,944.38

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	31,782,161.17	171,702.93	31,988,763.03	34,898.93
	银行间市场	57,148,837.98	613,263.92	57,920,033.92	157,932.02
	合计	88,930,999.15	784,966.85	89,908,796.95	192,830.95
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		88,930,999.15	784,966.85	89,908,796.95	192,830.95

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

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	2,278,654.55	-	-	-
--国债期货	2,278,654.55	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	2,278,654.55	-	-	-

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/	合约市值	公允价值变动

		卖)		
TL2609	30 年期国债期货 2609 合约	2	2,275,000.00	-3,654.55
合计				-3,654.55
减：可抵销期货暂收款				-3,654.55
净额				0.00

注：衍生金融资产项下的利率衍生工具为国债期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持国债期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的国债期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵消后的净额为 0。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本报告期末，本基金未持有任何黄金衍生品。

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

本报告期末，本基金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

本报告期末，本基金未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

本报告期末，本基金未持有债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

本报告期末，本基金无债权投资减值准备计提情况。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

本报告期末，本基金未持有其他债权投资。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

本报告期末，本基金无其他债权投资减值准备计提情况。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

本报告期末，本基金未持有其他权益工具投资。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

本报告期末，本基金未持有其他权益工具投资。

6.4.7.8 其他资产

本报告期末，本基金未持有其他资产。

6.4.7.9 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	8,393.75
其中：交易所市场	-
银行间市场	8,393.75
应付利息	-
预提费用-信息披露费	59,507.37
预提费用-审计费	7,439.10
预提费用-账户维护费	9,300.00
合计	84,640.22

6.4.7.10 实收基金

东海鑫兴 30 天持有债券 A

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	23,945,905.37	23,945,905.37
本期申购	859,406.42	859,406.42
本期赎回（以“-”号填列）	-10,625,441.76	-10,625,441.76
本期末	14,179,870.03	14,179,870.03

东海鑫兴 30 天持有债券 C

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	90,703,277.00	90,703,277.00
本期申购	22,490,810.37	22,490,810.37
本期赎回（以“-”号填列）	-58,745,310.63	-58,745,310.63
本期末	54,448,776.74	54,448,776.74

6.4.7.11 其他综合收益

本报告期末，本基金无其他综合收益。

6.4.7.12 未分配利润

东海鑫兴 30 天持有债券 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	791,289.32	-91,028.87	700,260.45
本期期初	791,289.32	-91,028.87	700,260.45
本期利润	140,717.05	278,688.55	419,405.60
本期基金份额交易产生的变动数	-310,815.81	-20,444.75	-331,260.56
其中：基金申购款	35,718.49	10,087.51	45,806.00
基金赎回款	-346,534.30	-30,532.26	-377,066.56
本期已分配利润	-	-	-
本期末	621,190.56	167,214.93	788,405.49

东海鑫兴 30 天持有债券 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	2,757,106.76	-336,369.76	2,420,737.00
本期期初	2,757,106.76	-336,369.76	2,420,737.00
本期利润	437,188.95	1,020,508.98	1,457,697.93
本期基金份额交易产生的变动数	-1,011,774.17	-39,091.06	-1,050,865.23
其中：基金申购款	748,992.44	191,599.99	940,592.43
基金赎回款	-1,760,766.61	-230,691.05	-1,991,457.66
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,182,521.54	645,048.16	2,827,569.70

6.4.7.13 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	4,446.66
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	6,916.09
其他	29.01
合计	11,391.76

注：其他列示的是交易保证金利息收入及直销申购款利息收入。

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

本报告期，本基金无股票投资收益——买卖股票差价收入。

6.4.7.14.2 股票投资收益——证券出借差价收入

本报告期，本基金无股票投资收益——证券出借差价收入。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 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	1,107,612.65
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	38,732.88
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	1,146,345.53

6.4.7.15.2 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	379,208,758.03
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	376,801,177.99
减：应计利息总额	2,354,855.41
减：交易费用	13,991.75
买卖债券差价收入	38,732.88

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

本报告期，本基金无债券投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

本报告期，本基金无债券投资收益——申购差价收入。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

本报告期，本基金无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本报告期，本基金无资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

本报告期，本基金无资产支持证券投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

本报告期，本基金无资产支持证券投资收益——申购差价收入。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

本报告期，本基金无贵金属投资收益。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益--买卖贵金属差价收入

本报告期，本基金无贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本报告期，本基金无贵金属投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本报告期，本基金无贵金属投资收益——申购差价收入。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本报告期，本基金无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
国债期货投资收益	-242,985.66

6.4.7.19 股利收益

本报告期，本基金无股利收益。

6.4.7.20 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	946,682.07
——股票投资	-
——债券投资	946,682.07

——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	352,515.46
——权证投资	-
——期货投资	352,515.46
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	1,299,197.53

6.4.7.21 其他收入

本报告期，本基金无其他收入。

6.4.7.22 信用减值损失

本报告期，本基金无信用减值损失。

6.4.7.23 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	7,439.10
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费	2,253.71
账户维护费	18,600.00
合计	87,800.18

6.4.7.24 分部报告

本报告期，本基金无分部报告。

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，本基金无需要在财务报表附注中说明的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金无需要在财务报表附注中说明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

本基金本报告期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
东海基金管理有限责任公司(“东海基金”)	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、基金代销机构
东海证券股份有限公司(“东海证券”)	基金管理人的股东、基金代销机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本报告期及上年度可比期间，本基金均未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本报告期及上年度可比期间，本基金均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：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	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
东海证券	304,536,356.38	100.00%	23,252,060.00	100.00%

6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：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	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
东海证券	853,900,000.00	100.00%	-	-

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本报告期及上年度可比期间，本基金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	123,971.59	540,769.97
其中：应支付销售机构的客户维护费	61,754.18	269,410.19
应支付基金管理人的净管理费	62,217.41	271,359.78

注：支付基金管理人东海基金管理有限责任公司的基金管理费按前一日基金资产净值的0.3%年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

日基金管理费=前一日基金资产净值×0.3%/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	20,661.97	90,128.37

注：支付基金托管人兴业银行的基金托管费按前一日基金资产净值0.05%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

日基金托管费=前一日基金资产净值×0.05%/当年天数

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2026年01月01日至2026年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	东海鑫兴30天持有债券A	东海鑫兴30天持有债券C	合计
东海证券	-	53,059.21	53,059.21
兴业银行	-	6,143.11	6,143.11
合计	-	59,202.32	59,202.32
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		

	东海鑫兴30天持有债券A	东海鑫兴30天持有债券C	合计
东海证券	-	201,644.68	201,644.68
兴业银行	-	63,165.24	63,165.24
合计	-	264,809.92	264,809.92

注：本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额收取销售服务费。

支付销售机构的基金销售服务费按C类基金份额前一日基金资产净值0.2%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

C类日基金销售服务费=前一日C类基金资产净值×0.2%/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可比期间均未通过银行间同业市场与关联方进行银行间债券(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

本报告期及上年度可比期间，本基金均未与关联方通过约定申报方式进行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

本报告期及上年度可比期间，本基金均未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期及上年度可比期间，本基金的基金管理人均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

本报告期末及上年度末，本基金除基金管理人之外的其他关联方均未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年01月01日至2026年06月30日		上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
兴业银行	423,944.38	4,446.66	265,204.33	5,996.52

注：本基金的上述银行存款由基金托管人兴业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

本报告期及上年度可比期间，本基金均未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本报告期及上年度可比期间，本基金均无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本报告期内，本基金未进行利润分配。

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

于 2026 年 06 月 30 日，本基金未持有因认购新发或增发证券而受上述规定约束的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

于 2026 年 06 月 30 日，本基金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

于 2026 年 06 月 30 日，本基金未持有因债券正回购交易而作为抵押的银行间债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2026 年 6 月 30 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 21,000,000.00 元，于 2026 年 7 月 1 日（先后）到期。该类交易要求本基金在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

于 2026 年 06 月 30 日，本基金未持有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

本基金投资的金融工具主要包括债券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的管理人进行风险管理的主要目标是加强对投资风险的防范和控制，保证基金资产的安全，维护基金份额持有人的利益；同时，提升基金投资组合的风险调整后收益水平，将以上各种风险控制在限定的范围之内，在基金的风险和收益之间取得最佳的平衡，实现“风险和收益相匹配”的投资目标，谋求基金资产的长期稳定增长。

本基金的基金管理人建立了董事会领导下的架构清晰、控制有效、系统全面、切实可行的风险控制体系。董事会下设合规与风险管理委员会，负责对公司风险管理战略和政策、内部控制及风险

控制基本制度进行审定，对基本制度的执行情况、关联交易的合法合规性等进行监督和检查。董事会聘任督察长，负责公司及其基金运作的风险管理工作。公司管理层负责公司日常经营管理中的风险控制工作，公司下设投资决策委员会和风险控制委员会，负责对公司经营及基金运作中的风险进行研究、评估和防控。公司各业务部门根据具体情况制定本部门的作业流程及风险控制制度，加强对风险的控制，作为一线责任人，将风险控制在最小范围内。同时，公司设独立的风险管理部门对公司运作各环节的各类风险进行监控。

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。本基金的货币资金存放于信用良好的银行，与货币资金相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；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流程，通过对各类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	4,149,568.52	6,521,118.77
合计	4,149,568.52	6,521,118.77

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。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末均无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末均无按短期信用评级列示的同业存单投资。

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 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日

AAA	33,578,913.62	74,981,482.47
AAA 以下	-	-
未评级	52,180,314.81	32,916,596.75
合计	85,759,228.43	107,898,079.22

注：1.债券评级取自第三方评级机构的债项评级。2.未评级债券为公司债、中期票据、国债。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末均无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末均无按长期信用评级列示的同业存单投资。

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或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

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每日预测本基金的流动性需求，通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，建立流动性风险监控与预警机制，对流动性指标进行持续的监测和分析。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券 10%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。本基金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。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。

本基金所持的证券在证券交易所上市或可于银行间同业市场交易；因此，除在附注 6.4.12 中列示的本基金于期末持有的流通受限证券外，本期末本基金的资产均能及时变现。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%。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资产的公允价值。

本基金本报告期末及上年度末均无重大流动性风险。

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因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。

本基金持有的利率敏感性资产主要为货币资金、债券投资、结算备付金、存出保证金等。

下表统计了本基金面临的利率风险敞口，表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

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 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	423,944.38	-	-	-	-	-	423,944.38
结算备付金	2,281,114.80	-	-	-	-	-	2,281,114.80
存出保证金	97,232.54	-	-	-	-	-	9

							7,232.54
交易性金融资产	3,949,239.37	-	27,113,011.76	23,588,466.75	35,258,079.07	-	89,908,796.95
应收清算款	-	-	-	-	-	608,097.75	608,097.75
应收申购款	-	-	-	-	-	128,061.28	128,061.28
资产总计	6,751,531.09	-	27,113,011.76	23,588,466.75	35,258,079.07	736,159.03	93,

							447,247.70
负债							
卖出回购金融资产款	21,000,000.00	-	-	-	-	-	21,000,000.00
应付赎回款	-	-	-	-	-	87,190.88	87,190.88
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	17,655.65	17,655.65
应付托管费	-	-	-	-	-	2,942.63	2,

							942.63
应付销售服务费	-	-	-	-	-	9,231.35	9,231.35
应交税费	-	-	-	-	-	965.01	965.01
其他负债	-	-	-	-	-	84,640.22	84,640.22
负债总计	21,000,000.00	-	-	-	-	202,625.74	21,202,625.74
利率敏感度缺口	-14,248,468.76	-	27,113,011.76	23,588,466.75	35,258,079.07	533,533.29	72

	91						,244,621.96
上年度末 2025 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	289,842.71	-	-	-	-	-	289,842.71
结算备付金	1,660,760.52	-	-	-	-	-	1,660,760.52
存出保证金	598,627.95	-	-	-	-	-	598,627

							.95
交易性金融资产	-	-	28,971,039.87	75,116,297.70	10,331,860.42	-	114,419,197.99
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	2,855,263.24	2,855,263.24
应收清算款	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	2,549,231.18	-	28,971,039.87	75,116,297.70	10,331,860.42	2,855,263.24	119,823

							,692.41
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	161,235.41	161,235.41
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	33,396.44	33,396.44
应付托管费	-	-	-	-	-	5,566.07	5,566.07
应付清算款	-	-	-	-	-	479.59	479.59
卖出回购金融资产款	1,799,616.33	-	-	-	-	-	1,7

							99,616.33
应付销售服务费	-	-	-	-	-	17,532.07	17,532.07
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	1,475.94	1,475.94
其他负债	-	-	-	-	-	34,210.74	34,210.74
负债总计	1,799,616.33	-	-	-	-	253,896.26	2,053,

							512.59
利率敏感度缺口	749,614.85	-	28,971,039.87	75,116,297.70	10,331,860.42	2,601,366.98	117,770,179.82

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	该利率敏感性分析基于本基金于资产负债表日的利率风险状况，该利率敏感性分析假定所有期限利率均以相同幅度变动 25 个基点，且除利率之外的其他市场变量保持不变；该利率敏感性分析并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动；货币资金、结算备付金和存出保证金均以活期存款利率或相对固定的利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响。		
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	-1,719,436.27	-1,006,332.47
	市场利率下降 25 个基点	1,830,409.53	1,044,009.39

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。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券，所面临的其他价格风险来源于证券市场的整体波动，以及单个证券发行主体的自身经营情

况或特殊事件影响。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括特定指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

本报告期末及上年度末，本基金均无其他价格风险敞口。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

本报告期末及上年度末，本基金均未持有交易性权益类投资，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响。

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	89,908,796.95	114,419,197.99
第三层次	-	-
合计	89,908,796.95	114,419,197.99

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的金融工具，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，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金融工具的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的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，确定相关金融工具的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

于2026年06月30日，本基金无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工具主要包括应收款项、卖出回购金融资产和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

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，本基金无需要说明有助于理解和分析财务报表的其他重要事项。

§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	89,908,796.95	96.21
	其中：债券	89,908,796.95	96.21
	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	2,705,059.18	2.89
8	其他各项资产	833,391.57	0.89
9	合计	93,447,247.70	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

本报告期末，本基金未持有股票投资。

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本报告期末，本基金未持有港股通股票。

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

本报告期末，本基金未持有股票投资。

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

本报告期，本基金未持有股票投资。

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

本报告期，本基金未持有股票投资。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本报告期，本基金未持有股票投资。

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	50,649,538.46	70.11
2	央行票据	-	-
3	金融债券	28,707,946.08	39.74
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	10,551,312.41	14.60
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	89,908,796.95	124.45

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	160013	16 附息国债 13	100,000	13,544,211.96	18.75
2	250014	25 附息国债 14	108,000	11,043,872.88	15.29
3	250004	25 附息国债 04	72,000	7,213,310.06	9.98
4	092280069	22 华夏银行二级资本债 01	60,000	6,265,578.08	8.67
5	312410005	24 农行 TLAC 非资本债 01A(BC)	60,000	6,154,638.90	8.52

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

本报告期末，本基金未持有资产支持证券投资。

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

本报告期末，本基金未持有贵金属投资。

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

本报告期末，本基金未持有权证投资。

7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.10.1 本期国债期货投资政策

报告期内，本基金在进行国债期货投资时，根据风险管理原则，本着谨慎原则，适度参与国债期货投资，投资以套期保值为主要目的，参与流动性好、交易活跃的国债期货合约。通过对债券交易市场和期货市场运行趋势的研究，根据基金组合的实际情况及估值水平、基差水平、流动性等因素的分析，结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平，在最大限度保证基金资产安全的基础上，力求实现资产的长期稳定增值。

7.10.2 本期国债期货投资评价

报告期内，本基金运用国债期货工具调节组合的期限结构以及久期水平。报告期内，产品根据市场环境，择机通过国债期货交易，管理产品的利率风险，符合既定的投资策略和投资目标。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国农业银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到金融监管总局的处罚，华夏银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到金融监管总局、中国人民银行的处罚。

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，本基金投资的其他前十名证券的发行主体本期没有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。

7.11.2 基金投资的前十名股票超出基金合同约定的备选股票库情况的说明

本报告期末，本基金未持有股票投资。

7.11.3 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	97,232.54
2	应收清算款	608,097.75
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	128,061.28
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	833,391.57

7.11.4 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。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本报告期末，本基金未持有股票投资。

7.11.6 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公允价值占基金资产净值的比例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

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
东海鑫兴 30 天持有债券 A	182	77,911.37	0.00	0.00%	14,179,870.03	100.00%
东海鑫兴 30 天持有债券 C	812	67,055.14	5,626,344.42	10.33%	48,822,432.32	89.67%
合计	994	69,042.90	5,626,344.42	8.20%	63,002,302.35	91.80%

注：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）。

8.2 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	占基金总份额比例

		（份）	
基金管理人所有从业人员持有本基金	东海鑫兴 30 天持有债券 A	67,964.42	0.4793%
	东海鑫兴 30 天持有债券 C	0.00	0.0000%
	合计	67,964.42	0.0990%

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	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	东海鑫兴 30 天持有债券 A	0
	东海鑫兴 30 天持有债券 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	东海鑫兴 30 天持有债券 A	0~10
	东海鑫兴 30 天持有债券 C	0
	合计	0~10

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	东海鑫兴 30 天持有债券 A	东海鑫兴 30 天持有债券 C
基金合同生效日（2024 年 09 月 11 日）基金份额总额	80,658,233.11	317,863,775.94
本报告期期初基金份额总额	23,945,905.37	90,703,277.00
本报告期基金总申购份额	859,406.42	22,490,810.37
减：本报告期基金总赎回份额	10,625,441.76	58,745,310.63
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	14,179,870.03	54,448,776.74

§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

1.基金管理人 2026 年 5 月 1 日发布公告，严晓珺同志自 2026 年 4 月 30 日起代任基金管理人督察长；牛锐同志自 2026 年 4 月 30 日起不再担任基金管理人督察长。

2. 报告期内托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，为本基金进行审计的机构未发生变化，为容诚会计师事务所（特殊普通合伙）。

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，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，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，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

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	
东海证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-

股份有限公司						

注：1、本报告期内基金无新增证券公司交易单元。

2、本基金管理人负责选择证券经纪商。证券经纪商的选择标准如下：

（1）证券公司财务状况良好、经营行为规范，合规风控能力和交易、 研究等服务能力较强；

（2）证券公司具有较强的研究能力，能根据需求提供质量较高的研究报告，以及相应的信息咨询服务；

（3）证券公司承诺研究服务不包含内幕信息；

（4）证券公司具备高效、安全的通讯条件，交易设施满足代理各投资组合进行证券交易的需要；

（5）合作证券公司收取的佣金费率符合《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》等相关规定。

3、基金选择证券公司交易单元的程序如下：

本基金管理人根据上述券商选择标准并结合对券商研究服务工作的评分结果，确定合作券商以及交易席位的租用、调整分配、退租等管理工作，经公司督察长、总经理审批后与被选择的券商签订交易单元租用协议/证券经纪服务协议。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
东海证券股份有限公司	304,536,356.38	100.00%	853,900,000.00	100.00%	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-

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	东海基金管理有限责任公司关于提示投资者持续完善身份信息资料的公告	中国证监会指定报刊及网站	2026-01-06
2	东海基金管理有限责任公司关于防范不法分子冒用东海基金名义进行非法活动的重要提	中国证监会指定报刊及网站	2026-01-10

	示		
3	东海基金管理有限责任公司关于旗下部分基金新增华创证券股份有限公司为代销机构并开通定投业务、转换业务及参加费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2026-01-17
4	东海鑫兴 30 天持有期债券型证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2026-01-22
5	东海鑫兴 30 天持有期债券型证券投资基金 2025 年年度报告	中国证监会指定报刊及网站	2026-03-31
6	东海基金管理有限责任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）	中国证监会指定报刊及网站	2026-03-31
7	东海基金管理有限责任公司关于更新旗下公募基金风险等级的公告	中国证监会指定报刊及网站	2026-04-01
8	东海基金管理有限责任公司关于旗下部分基金新增上海基煜基金销售有限公司为代销机构并开通定投业务及参加费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2026-04-09
9	东海鑫兴 30 天持有期债券型证券投资基金 2026 年第一季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2026-04-22
10	东海基金管理有限责任公司高级管理人员变更公告	中国证监会指定报刊及网站	2026-05-01
11	东海基金管理有限责任公司关于旗下部分基金新增上海联泰基金销售有限公司为代销机构并开通定投业务及参加费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2026-06-06

§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

本报告期内，不存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情况。

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、中国证监会批准东海鑫兴 30 天持有期债券型证券投资基金设立的文件

2、《东海鑫兴 30 天持有期债券型证券投资基金基金合同》

3、《东海鑫兴 30 天持有期债券型证券投资基金招募说明书》

4、《东海鑫兴 30 天持有期债券型证券投资基金托管协议》

5、基金管理人业务资格批件、营业执照

6、基金托管人业务资格批件、营业执照

7、报告期内披露的各项公告

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

12.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人网站（www.donghaifunds.com）查阅，或在营业时间内至基金管理人办公场所查阅。

投资者对本报告如有疑问，可拨打基金管理人客户服务热线电话：400-959-5531 咨询相关信息。

东海基金管理有限责任公司

二〇二六年八月三十一日