

# 博远利兴纯债一年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:博远基金管理有限公司

基金托管人:兴业银行股份有限公司

送出日期:2026 年 08 月 28 日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。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规定，于2026年8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。

本报告财务资料未经审计。

本报告期自2026年1月1日起至2026年6月30日止。

## 1.2 目录

|                                         |    |
|-----------------------------------------|----|
| §1 重要提示及目录                              | 2  |
| 1.1 重要提示                                | 2  |
| 1.2 目录                                  | 3  |
| §2 基金简介                                 | 5  |
| 2.1 基金基本情况                              | 5  |
| 2.2 基金产品说明                              | 5  |
| 2.3 基金管理人和基金托管人                         | 5  |
| 2.4 信息披露方式                              | 6  |
| 2.5 其他相关资料                              | 6  |
| §3 主要财务指标和基金净值表现                        | 6  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 6  |
| 3.2 基金净值表现                              | 7  |
| §4 管理人报告                                | 8  |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 8  |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明              | 11 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 12 |
| 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             | 12 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 12 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 13 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 13 |
| 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       | 14 |
| §5 托管人报告                                | 14 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 14 |
| 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 | 14 |
| 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       | 14 |
| §6 半年度财务会计报告（未经审计）                      | 14 |
| 6.1 资产负债表                               | 14 |
| 6.2 利润表                                 | 16 |
| 6.3 净资产变动表                              | 18 |
| 6.4 报表附注                                | 20 |
| §7 投资组合报告                               | 39 |
| 7.1 期末基金资产组合情况                          | 39 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合                    | 40 |
| 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       | 40 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动                     | 40 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 40 |
| 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      | 41 |
| 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   | 41 |
| 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   | 41 |
| 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      | 41 |
| 7.10 本基金投资股指期货的投资政策                     | 41 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明               | 42 |
| 7.12 投资组合报告附注                           | 42 |
| §8 基金份额持有人信息                            | 43 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构                   | 43 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况                | 43 |

|                                         |    |
|-----------------------------------------|----|
| 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.....   | 43 |
| 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况 .....               | 44 |
| §9 开放式基金份额变动.....                       | 44 |
| §10 重大事件揭示 .....                        | 44 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 .....                  | 44 |
| 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 .....  | 44 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....       | 45 |
| 10.4 基金投资策略的改变 .....                    | 45 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....              | 45 |
| 10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 .....      | 45 |
| 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 .....  | 45 |
| 10.8 其他重大事件 .....                       | 46 |
| §11 影响投资者决策的其他重要信息.....                 | 48 |
| 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况..... | 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.....                          | 49 |
| 12.3 查阅方式.....                          | 50 |

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                          |
|------------|--------------------------|
| 基金名称       | 博远利兴纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金 |
| 基金简称       | 博远利兴纯债一年定开债券发起式          |
| 基金主代码      | 016015                   |
| 基金运作方式     | 契约型定期开放式                 |
| 基金合同生效日    | 2022年08月08日              |
| 基金管理人      | 博远基金管理有限公司               |
| 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 | 1,463,914,344.23份        |
| 基金合同存续期    | 不定期                      |

### 2.2 基金产品说明

|        |                                                                                       |
|--------|---------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标   | 本基金在有效控制投资组合风险并保持良好流动性的前提下，力争获得稳定增长的投资收益。                                             |
| 投资策略   | 本基金采用定期开放运作方式，封闭期和开放期的投资重点有所区别。封闭期的投资侧重于有效控制风险，追求基金资产的稳健增值；开放期则以流动性管理为主，有效应对投资者的申赎需求。 |
| 业绩比较基准 | 中债综合全价（总值）指数收益率*90%+一年期银行定期存款利率（税后）*10%                                               |
| 风险收益特征 | 本基金是债券型基金，其预期收益和风险水平高于货币市场基金，低于股票型和混合型基金。                                             |

### 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      |      | 博远基金管理有限公司                 | 兴业银行股份有限公司          |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 杜鹏                         | 冯萌                  |
|         | 联系电话 | 0755-29395888              | 021-52629999-213310 |
|         | 电子邮箱 | compliance@boyuanfunds.com | fengmeng@cib.com.cn |

|        |                                |                              |
|--------|--------------------------------|------------------------------|
| 客户服务电话 | 0755-29395858                  | 95561                        |
| 传真     | 0755-29395889                  | 021-62159217                 |
| 注册地址   | 深圳市福田区皇岗路5001号<br>深业上城T2栋4301室 | 福建省福州市台江区江滨中<br>大道398号兴业银行大厦 |
| 办公地址   | 深圳市福田区皇岗路5001号<br>深业上城T2栋4301室 | 上海市浦东新区银城路167号<br>4楼         |
| 邮政编码   | 518000                         | 200120                       |
| 法定代表人  | 钟鸣远                            | 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    | 证券时报                       |
| 登载基金中期报告的管理人互联网网址 | www.boyuanfunds.com        |
| 基金中期报告置备地点        | 深圳市福田区皇岗路5001号深业上城T2栋4301室 |

2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称         | 办公地址                       |
|--------|------------|----------------------------|
| 注册登记机构 | 博远基金管理有限公司 | 深圳市福田区皇岗路5001号深业上城T2栋4301室 |

§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<br>(2026年01月01日- 2026年06月30日) |
|---------------|-----------------------------------|
| 本期已实现收益       | 10,463,770.75                     |
| 本期利润          | 21,873,225.88                     |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0149                            |
| 本期加权平均净值利润率   | 1.45%                             |

|                      |                       |
|----------------------|-----------------------|
| 本期基金份额净值增长率          | 1.47%                 |
| <b>3.1.2 期末数据和指标</b> | 报告期末<br>(2026年06月30日) |
| 期末可供分配利润             | 45,679,196.35         |
| 期末可供分配基金份额利润         | 0.0312                |
| 期末基金资产净值             | 1,512,773,436.92      |
| 期末基金份额净值             | 1.0334                |
| <b>3.1.3 累计期末指标</b>  | 报告期末<br>(2026年06月30日) |
| 基金份额累计净值增长率          | 11.46%                |

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。

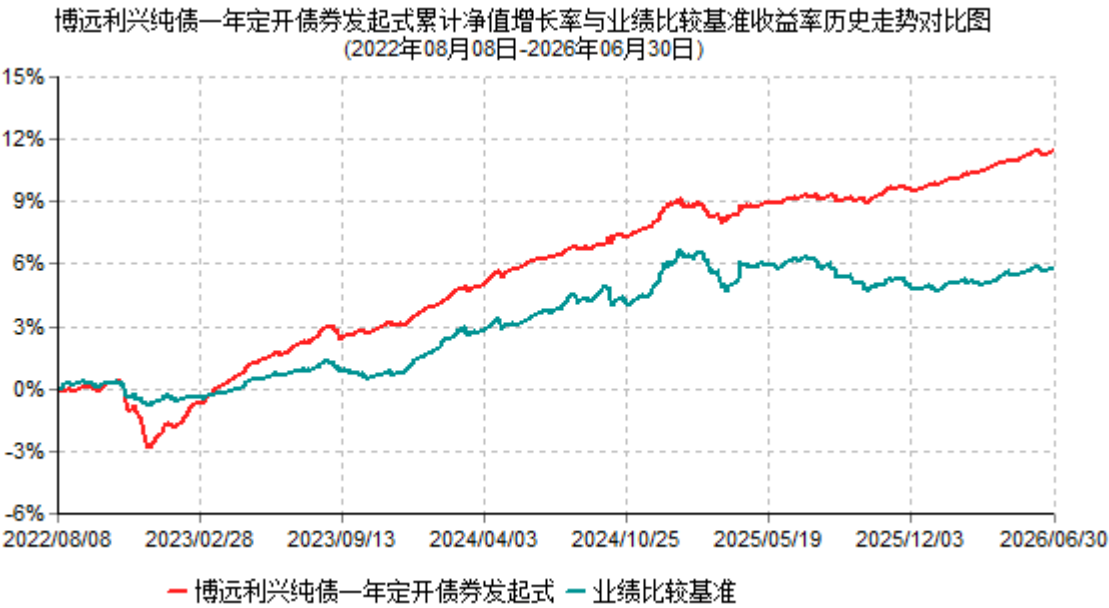
3、期末可供分配利润，为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

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<br>增长率① | 份额净值<br>增长率标<br>准差② | 业绩比较<br>基准收益<br>率③ | 业绩比较<br>基准收益<br>率标准差<br>④ | ①-③   | ②-④    |
|----------------|--------------|---------------------|--------------------|---------------------------|-------|--------|
| 过去三个月          | 0.70%        | 0.02%               | 0.60%              | 0.03%                     | 0.10% | -0.01% |
| 过去六个月          | 1.47%        | 0.02%               | 0.90%              | 0.03%                     | 0.57% | -0.01% |
| 过去一年           | 2.08%        | 0.03%               | -0.35%             | 0.05%                     | 2.43% | -0.02% |
| 过去三年           | 9.54%        | 0.04%               | 5.07%              | 0.07%                     | 4.47% | -0.03% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 11.46%       | 0.05%               | 5.80%              | 0.06%                     | 5.66% | -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



§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

博远基金管理有限公司经中国证券监督管理委员会证监许可【2018】1920号文批准，于2018年12月12日在深圳注册成立，注册资本1亿元人民币，并于2019年7月1日取得中国证券监督管理委员会核发的《经营证券期货业务许可证》。公司目前股东及其出资比例为：钟鸣远先生45.03%，深圳博远协创投资中心（有限合伙）40%，胡隽先生4.99%，黄军锋先生4.99%，姜俊先生4.99%。截止本报告期末，本基金管理人共管理了8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（助理）期限 |      | 证券从业年限 | 说明                                   |
|-----|---------------------|-----------------|------|--------|--------------------------------------|
|     |                     | 任职日期            | 离任日期 |        |                                      |
| 黄婧丽 | 固定收益投资总部总经理、本基金基金经理 | 2022-08-08      | -    | 13年    | 黄婧丽女士，中国国籍，具有基金从业资格，毕业于伦敦帝国理工学院，硕士研究 |

|  |  |  |  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
|--|--|--|--|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  |  |  | <p>                     生。历任世纪证券有限责任公司固定收益研究员、国海证券股份有限公司固定收益投资经理助理、东吴基金管理有限公司投资经理、基金经理。2021年8月加入博远基金管理有限公司，任固定收益投资总部基金经理，自2024年7月24日起任固定收益投资总部部门总经理、基金经理。2018年1月至2021年1月任东吴优益债券型证券投资基金基金经理；2018年5月至2020年12月任东吴悦秀纯债债券型证券投资基金基金经理；2018年11月至2021年7月任东吴鼎泰纯债债券型证券投资基金基金经理；2019年3月至2021年1月任东吴增鑫宝货币市场基金基金经理；2021年12月13日起任博远臻享3个月定期开放债券型证券投资基金基金经理；2022年3月8日至2024年7月8日兼任博远鑫享三个月持有期债券型证券投资基金基金经理；2022年6月2日起兼任博远增益纯债债券型证券投资基金基金经理；2022年8月8日起兼任博远利兴纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理；2022年12月14日起兼任博远增睿纯债债券型证券投资                 </p> |
|--|--|--|--|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|     |               |            |   |     |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
|-----|---------------|------------|---|-----|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|     |               |            |   |     | 资基金基金经理；2023年11月24日起兼任博远增裕利率债债券型证券投资基金基金经理；2024年8月7日起兼任博远增汇纯债债券型证券投资基金基金经理。                                                                                                                                                                                                                                                                                |
| 钟鸣远 | 公司总经理、本基金基金经理 | 2026-03-05 | - | 29年 | 钟鸣远先生，中国国籍，毕业于复旦大学金融学专业，经济学硕士学位，具有基金从业资格。现任博远基金管理有限公司总经理。历任国家开发银行深圳分行资金计划部职员，联合证券有限责任公司固定收益部投资经理，泰康人寿保险股份有限公司固定收益策略研究员，新华资产管理股份有限公司固定收益部高级投资经理，易方达基金管理有限公司固定收益总部总经理兼固定收益投资部总经理，大成基金管理有限公司副总经理。2019年11月19日起任博远增强回报债券型证券投资基金基金经理；2020年4月15日至2024年12月27日兼任博远双债增利混合型证券投资基金基金经理；2020年7月8日至2023年7月28日兼任博远博锐混合型发起式证券投资基金基金经理；2021年12月13日起兼任博远臻享3个月定期开放债券型证券投资基金基金 |

|  |  |  |  |  |                                                                                                                                                                                                                                                                                       |
|--|--|--|--|--|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  |  |  |  | 经理；2020年9月30日至2023年3月23日兼任博远鑫享三个月持有期债券型证券投资基金基金经理；2021年3月30日至2023年5月16日兼任博远优享混合型证券投资基金基金经理；2022年4月28日至2023年5月16日兼任博远增益纯债债券型证券投资基金基金经理；2023年11月24日起兼任博远增裕利率债债券型证券投资基金基金经理；2024年8月12日起兼任博远增汇纯债债券型证券投资基金基金经理；2025年10月17日起兼任博远增睿纯债债券型证券投资基金基金经理；2026年3月5日起兼任博远利兴纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。 |
|--|--|--|--|--|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

注：1、基金的首任基金经理，其"任职日期"为基金合同生效日。

2、证券从业年限的含义遵从《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。

3、本基金现任基金经理黄婧丽女士因休产假，自2026年3月11日起暂不能正常履行基金经理职责，由本基金管理人基金经理马杰先生代为管理，本基金管理人已于2026年3月11日发布了相关公告。

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

无。

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》及其他有关法律法规的规定及本基金合同的约定，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利益。本报告期内，本基金运作无重大违法、违规行为，不存在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

本报告期内，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》及公司制度的规定，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节监控交易的公平执行。本基金管理人按日内、3日内、5日内三个不同的时间窗口，对本基金管理人管理的全部投资组合在本报告期内的交易情况进行了同向交易价差分析，各投资组合交易过程中不存在显著的交易价差，不存在不公平交易的情况。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金管理人未发现本基金存在异常交易行为；严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，对于因投资组合的投资策略或流动性等需要而发生的同日反向交易，由相关投资组合经理出具决策依据，并留存记录备查；对于不同投资组合在不同时间窗口下相邻交易日（1日内、3日内、5日内）的同向交易及反向交易，未发现异常。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年，国内出口保持高速增长，但宏观经济动能边际放缓，经济结构K型分化特征愈发显著。地缘方面，伊朗局势由激烈冲突转向拉锯阶段，市场避险情绪边际降温。在内需偏弱与资金面被动宽松的共同作用下，流动性成为上半年债券市场交易的核心主线。

本报告期内，本基金主要进行了信用债和利率债的配置与交易，其中信用债以高等级金融债为主。管理人结合市场走势判断，动态、灵活调整组合的久期与仓位。策略上，年初基于对市场研判，适时提升优质信用债持仓占比，将杠杆率和久期维持在较高水平；随着央行持续回笼流动性，及时获利了结部分利率债及短期信用债，降低组合久期，取得了较好的收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末博远利兴纯债一年定开债券发起式基金份额净值为1.0334元，本报告期内，基金份额净值增长率为1.47%，同期业绩比较基准收益率为0.90%。

### 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，管理人认为尽管债券市场多空因素交织，但总体环境仍偏有利于债市。宏观层面，外需强于内需的特征延续。预计出口将保持较高增速，且内部结构分化显著：人工智能等高科技行业是主要的拉动力，而传统产业出口增速依旧疲弱。与此同时，国内消费和投资依然疲软，社会消费品零售总额预计仍将保持同比小幅负增长；房地产投资则预计维持同比负增长，磨底态势未改。当前出口增长主要由价格上涨驱动，导致剔除价格因素后的实际GDP增速面临压力。然而，考虑到去年同期基数较低，且仍有充足的增量政策空间，预计全年经济目标的实现依然有保障。此外，物价端呈现冲高回落态势。随着地缘冲突总体烈度下降，石油价格脱离高位，有望带动工业生产者出厂价格指数和消费者物价指数增速同步下行。从金融与政策端来看，受结构分化及内需疲软影响，信贷需求或显不足；预计下半年政府债发行将提速以支撑经济，货币政策有望维持支持性基调。综合来看，债市短期内或将呈现区间震荡走势，等待趋势性机会的到来。信用债方面，近期部分主体评级下调或终止的现象增多，需关注其对信用债市场的潜在影响。对此，管理人将紧密跟踪宏观经济数据、政策动向、市场情绪及机构行为变化，动态优化组合仓位、久期与品种结构，在平衡收益与风险的前提下，力争实现基金资产的稳健增值。

#### 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，公司基金运营部总经理担任估值委员会主席，权益投资总部、固定收益投资总部、研究部、风险监察部和基金运营部指定人员担任委员。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，来自投资、研究、基金会计和风控等相关岗位。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。本基金的日常估值程序由基金运营部基金估值核算人员执行，并与托管人的估值结果核对一致。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司、中证指数有限公司签署服务协议，各方按约定提供银行间同业市场的估值数据和交易所交易的债券品种的估值数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金管理人严格按照本基金基金合同的规定进行收益分配。本报告期内，博远利兴纯债一年定开债券发起式已分配利润14,639,143.49元，每10份基金份额分红0.100元，符合基金合同约定的分红比例。

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

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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：博远利兴纯债一年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<br>2026年06月30日 | 上年度末<br>2025年12月31日 |
|------|---------|--------------------|---------------------|
| 资 产： |         |                    |                     |
| 货币资金 | 6.4.7.1 | 799,827.34         | 574,453.27          |

|               |            |                            |                             |
|---------------|------------|----------------------------|-----------------------------|
| 结算备付金         |            | -                          | -                           |
| 存出保证金         |            | -                          | -                           |
| 交易性金融资产       | 6.4.7.2    | 2,304,483,112.88           | 1,783,943,099.20            |
| 其中：股票投资       |            | -                          | -                           |
| 基金投资          |            | -                          | -                           |
| 债券投资          |            | 2,304,483,112.88           | 1,783,943,099.20            |
| 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          |            | 2,305,282,940.22           | 1,784,517,552.47            |
| <b>负债和净资产</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2026年06月30日</b> | <b>上年度末<br/>2025年12月31日</b> |
| <b>负 债：</b>   |            |                            |                             |
| 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     |            | 791,832,124.90             | 278,219,315.72              |
| 应付清算款         |            | -                          | -                           |
| 应付赎回款         |            | -                          | -                           |
| 应付管理人报酬       |            | 372,645.16                 | 382,987.13                  |
| 应付托管费         |            | 124,215.05                 | 127,662.36                  |
| 应付销售服务费       |            | -                          | -                           |
| 应付投资顾问费       |            | -                          | -                           |

|          |         |                  |                  |
|----------|---------|------------------|------------------|
| 应交税费     |         | 46,315.94        | 21,121.48        |
| 应付利润     |         | -                | -                |
| 递延所得税负债  |         | -                | -                |
| 其他负债     | 6.4.7.6 | 134,202.25       | 227,111.25       |
| 负债合计     |         | 792,509,503.30   | 278,978,197.94   |
| 净资产：     |         |                  |                  |
| 实收基金     | 6.4.7.7 | 1,463,914,344.23 | 1,463,914,344.23 |
| 未分配利润    | 6.4.7.8 | 48,859,092.69    | 41,625,010.30    |
| 净资产合计    |         | 1,512,773,436.92 | 1,505,539,354.53 |
| 负债和净资产总计 |         | 2,305,282,940.22 | 1,784,517,552.47 |

注：报告截止日2026年06月30日，基金份额净值1.0334元，基金份额总额1,463,914,344.23份。

6.2 利润表

会计主体：博远利兴纯债一年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<br>2026年01月01日至<br>2026年06月30日 | 上年度可比期间<br>2025年01月01日至202<br>5年06月30日 |
|------------------|----------|-----------------------------------|----------------------------------------|
| 一、营业总收入          |          | 29,274,663.73                     | 8,499,664.16                           |
| 1.利息收入           |          | 2,127.10                          | 1,500.24                               |
| 其中：存款利息收入        | 6.4.7.9  | 2,127.10                          | 1,500.24                               |
| 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       |          | -                                 | -                                      |
| 其他利息收入           |          | -                                 | -                                      |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） |          | 17,863,081.50                     | 19,889,234.65                          |
| 其中：股票投资收益        | 6.4.7.10 | -                                 | -                                      |

|                                 |            |               |                |
|---------------------------------|------------|---------------|----------------|
| 基金投资收益                          | 6.4.7.11   | -             | -              |
| 债券投资收益                          | 6.4.7.12   | 17,863,081.50 | 19,889,234.65  |
| 资产支持证券投资<br>收益                  | 6.4.7.13   | -             | -              |
| 贵金属投资收益                         | 6.4.7.14   | -             | -              |
| 衍生工具收益                          | 6.4.7.15   | -             | -              |
| 股利收益                            | 6.4.7.16   | -             | -              |
| 其他投资收益                          |            | -             | -              |
| 3.公允价值变动收益（损失<br>以“-”号填列）       | 6.4.7.17   | 11,409,455.13 | -11,391,070.73 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”<br>号填列）           |            | -             | -              |
| 5.其他收入（损失以“-”<br>号填列）           | 6.4.7.18   | -             | -              |
| <b>减：二、营业总支出</b>                |            | 7,401,437.85  | 5,290,071.66   |
| 1.管理人报酬                         | 6.4.10.2.1 | 2,242,130.73  | 2,275,698.68   |
| 2.托管费                           | 6.4.10.2.2 | 747,376.94    | 758,566.22     |
| 3.销售服务费                         |            | -             | -              |
| 4.投资顾问费                         |            | -             | -              |
| 5.利息支出                          |            | 4,276,406.86  | 2,146,268.74   |
| 其中：卖出回购金融资产<br>支出               |            | 4,276,406.86  | 2,146,268.74   |
| 6.信用减值损失                        |            | -             | -              |
| 7.税金及附加                         |            | 23,363.91     | -              |
| 8.其他费用                          | 6.4.7.19   | 112,159.41    | 109,538.02     |
| <b>三、利润总额（亏损总额<br/>以“-”号填列）</b> |            | 21,873,225.88 | 3,209,592.50   |
| 减：所得税费用                         |            | -             | -              |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”<br/>号填列）</b>   |            | 21,873,225.88 | 3,209,592.50   |
| <b>五、其他综合收益的税后<br/>净额</b>       |            | -             | -              |

|          |  |               |              |
|----------|--|---------------|--------------|
| 六、综合收益总额 |  | 21,873,225.88 | 3,209,592.50 |
|----------|--|---------------|--------------|

6.3 净资产变动表

会计主体：博远利兴纯债一年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<br>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                                | 1,463,914,344.23              | 41,625,010.30  | 1,505,539,354.53 |
| 二、本期期初净资产                                | 1,463,914,344.23              | 41,625,010.30  | 1,505,539,354.53 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                     | -                             | 7,234,082.39   | 7,234,082.39     |
| （一）、综合收益总额                               | -                             | 21,873,225.88  | 21,873,225.88    |
| （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）      | -                             | -              | -                |
| 其中：1.基金申购款                               | -                             | -              | -                |
| 2.基金赎回款                                  | -                             | -              | -                |
| （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） | -                             | -14,639,143.49 | -14,639,143.49   |
| 四、本期期末净资产                                | 1,463,914,344.23              | 48,859,092.69  | 1,512,773,436.92 |

| 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                                | 1,473,414,996.34        | 59,159,225.93 | 1,532,574,222.27 |
| 二、本期期初净资产                                | 1,473,414,996.34        | 59,159,225.93 | 1,532,574,222.27 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                     | -                       | 3,209,592.50  | 3,209,592.50     |
| （一）、综合收益总额                               | -                       | 3,209,592.50  | 3,209,592.50     |
| （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）      | -                       | -             | -                |
| 其中：1.基金申购款                               | -                       | -             | -                |
| 2.基金赎回款                                  | -                       | -             | -                |
| （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                                | 1,473,414,996.34        | 62,368,818.43 | 1,535,783,814.77 |

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：

|          |           |         |
|----------|-----------|---------|
| 钟鸣远      | 钟鸣远       | 姚蓝      |
| -----    | -----     | -----   |
| 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

博远利兴纯债一年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]1156号《关于准予博远利兴纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金注册的批复》注册,由博远基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《博远利兴纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型定期开放式,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3,509,999,000.00元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2022)第0524号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《博远利兴纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》于2022年8月8日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为3,510,472,850.00份基金份额,其中认购资金利息折合473,850.00份基金份额。本基金的基金管理人为博远基金管理有限公司,基金托管人为兴业银行股份有限公司。本基金为发起式基金,截至2025年12月31日发起资金认购部分持有期限已不少于3年。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《博远利兴纯债一年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,包括国内依法发行的债券(含国债、央行票据、金融债、地方政府债、政府支持机构债、政府支持债券、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、证券公司短期公司债、可分离交易可转债的纯债部分)、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、国债期货等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。本基金不参与股票等权益类资产投资,也不参与可转换债券(可分离交易可转债的纯债部分除外)、可交换债券的投资。

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%,但应流动性管理需要,为保护基金份额持有人利益,在每次进入开放期前1个月、开放期内及开放期结束后1个月的期间内,基金投资不受前述比例限制。在开放期内,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,本基金持有现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%;在封闭期内,本基金不受前述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。

本基金的业绩比较基准为:中债综合全价(总值)指数收益率\*90%+一年期银行定期存款利率(税后)\*10%。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的《公开募集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》《证券投资基金会计核算业务指引》《博远利兴纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### **6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

本基金财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2026年6月30日的财务状况以及自2026年1月1日至2026年6月30日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

#### **6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明**

本基金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**

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### **6.4.5.2 会计估计变更的说明**

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### **6.4.5.3 差错更正的说明**

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### **6.4.6 税项**

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财政部、国家税务总局公告2025年第4号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、国务院令826号《中华人民共和国增值税法实施条例》、财政部、税

务总局公告2026年第10号《财政部 税务总局关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。2027年12月31日前，资管产品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，可以选择适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

2027年12月31日前，对证券投资基金管理人运用基金资产买卖债券的转让收入免征增值税，对除持有金融债券外的金融同业往来利息收入亦免征增值税。自2025年8月8日起，对在该日期之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(包含在2025年8月8日之后续发行的部分)的利息收入，免征增值税直至债券到期。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。

(4) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

| 项目           | 本期末<br>2026年06月30日 |
|--------------|--------------------|
| 活期存款         | 791,077.18         |
| 等于：本金        | 790,999.12         |
| 加：应计利息       | 78.06              |
| 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      | 8,750.16   |
| 等于：本金     | 8,748.86   |
| 加：应计利息    | 1.30       |
| 减：坏账准备    | -          |
| 合计        | 799,827.34 |

注：其他存款为存放在证券经纪商证券账户的证券交易结算资金。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            |       | 本期末<br>2026年06月30日 |               |                  |              |
|---------------|-------|--------------------|---------------|------------------|--------------|
|               |       | 成本                 | 应计利息          | 公允价值             | 公允价值变动       |
| 股票            |       | -                  | -             | -                | -            |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 |       | -                  | -             | -                | -            |
| 债券            | 交易所市场 | 1,271,415,200.00   | 9,305,582.47  | 1,285,930,582.47 | 5,209,800.00 |
|               | 银行间市场 | 1,005,059,471.18   | 9,228,530.41  | 1,018,552,530.41 | 4,264,528.82 |
|               | 合计    | 2,276,474,671.18   | 18,534,112.88 | 2,304,483,112.88 | 9,474,328.82 |
| 资产支持证券        |       | -                  | -             | -                | -            |
| 基金            |       | -                  | -             | -                | -            |
| 其他            |       | -                  | -             | -                | -            |
| 合计            |       | 2,276,474,671.18   | 18,534,112.88 | 2,304,483,112.88 | 9,474,328.82 |

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>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      | 35,642.10          |
| 其中：交易所市场    | -                  |
| 银行间市场       | 35,642.10          |
| 应付利息        | -                  |
| 预提费用-审计费    | 29,752.78          |
| 预提费用-信息披露费  | 59,507.37          |
| 预提费用-账户维护费  | 9,300.00           |
| 合计          | 134,202.25         |

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>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          | 1,463,914,344.23              | 1,463,914,344.23 |
| 本期申购          | -                             | -                |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -                             | -                |
| 本期末           | 1,463,914,344.23              | 1,463,914,344.23 |

注：申购含红利再投（如有）、转换入份额（如有）；赎回含转换出份额（如有）。

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           | 49,854,569.09  | -8,229,558.79 | 41,625,010.30  |
| 本期期初           | 49,854,569.09  | -8,229,558.79 | 41,625,010.30  |
| 本期利润           | 10,463,770.75  | 11,409,455.13 | 21,873,225.88  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -              | -             | -              |
| 其中：基金申购款       | -              | -             | -              |
| 基金赎回款          | -              | -             | -              |
| 本期已分配利润        | -14,639,143.49 | -             | -14,639,143.49 |
| 本期末            | 45,679,196.35  | 3,179,896.34  | 48,859,092.69  |

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2026年01月01日至2026年06月30日 |
|-----------|-------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 1,189.53                      |
| 定期存款利息收入  | -                             |
| 其他存款利息收入  | 937.57                        |
| 结算备付金利息收入 | -                             |
| 其他        | -                             |
| 合计        | 2,127.10                      |

注：其他存款利息收入为存放在证券经纪商证券账户的证券交易结算资金产生的利息收入。

6.4.7.10 股票投资收益

本基金本报告期无股票投资收益。

6.4.7.11 基金投资收益

本基金本报告期无基金投资收益。

6.4.7.12 债券投资收益

6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目                           | 本期<br>2026年01月01日至2026年06月30日 |
|------------------------------|-------------------------------|
| 债券投资收益——利息收入                 | 17,724,958.69                 |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | 138,122.81                    |
| 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                           | 17,863,081.50                 |

6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                     | 本期<br>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   | 524,865,326.36                |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 519,779,451.42                |
| 减：应计利息总额               | 4,934,168.41                  |
| 减：交易费用                 | 13,583.72                     |
| 买卖债券差价收入               | 138,122.81                    |

6.4.7.13 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

本基金本报告期无股利收益。

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称                   | 本期<br>2026年01月01日至2026年06月30日 |
|------------------------|-------------------------------|
| 1.交易性金融资产              | 11,409,455.13                 |
| ——股票投资                 | -                             |
| ——债券投资                 | 11,409,455.13                 |
| ——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                     | 11,409,455.13                 |

6.4.7.18 其他收入

本基金本报告期无其他收入。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2026年01月01日至2026年06月30日 |
|-----------|-------------------------------|
| 审计费用      | 29,752.78                     |
| 信息披露费     | 59,507.37                     |
| 汇划手续费     | 4,299.26                      |
| 账户维护费_中债登 | 9,000.00                      |

|           |            |
|-----------|------------|
| 其他        | 600.00     |
| 账户维护费_上清所 | 9,000.00   |
| 合计        | 112,159.41 |

注："其他"为上清所查询服务费。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本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             |
|------------|---------------------|
| 博远基金管理有限公司 | 基金管理人、基金销售机构、注册登记机构 |
| 兴业银行股份有限公司 | 基金托管人、基金销售机构        |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本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股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

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权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

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债券回购交易。

6.4.10.1.5 基金交易

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基金交易。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目               | 本期<br>2026年01月01日至20<br>26年06月30日 | 上年度可比期间<br>2025年01月01日至20<br>25年06月30日 |
|------------------|-----------------------------------|----------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费   | 2,242,130.73                      | 2,275,698.68                           |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 672,387.67                        | 678,058.75                             |
| 应支付基金管理人的净管理费    | 1,569,743.06                      | 1,597,639.93                           |

注:1、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：

$$H=E\times 0.30\%\div \text{当年天数}$$

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。

2、客户维护费是指基金管理人及基金销售机构在基金销售协议中约定的依据销售机构销售基金的保有量提取一定比例的客户维护费，用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2026年01月01日至2026<br>年06月30日 | 上年度可比期间<br>2025年01月01日至2025<br>年06月30日 |
|----------------|-----------------------------------|----------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 747,376.94                        | 758,566.22                             |

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：

$$H=E\times 0.10\%\div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场债券(含回购)的交易。

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

份额单位：份

| 项目                  | 本期<br>2026年01月01日至<br>2026年06月30日 | 上年度可比期间<br>2025年01月01日至<br>2025年06月30日 |
|---------------------|-----------------------------------|----------------------------------------|
| 报告期初持有的基金份额         | 500,000.00                        | 10,000,850.00                          |
| 报告期间申购/买入总份额        | 0.00                              | 0.00                                   |
| 报告期间因拆分变动份额         | 0.00                              | 0.00                                   |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额      | 0.00                              | 0.00                                   |
| 报告期末持有的基金份额         | 500,000.00                        | 10,000,850.00                          |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 0.03%                             | 0.68%                                  |

注：基金管理人投资本基金适用的交易费率与本基金法律文件规定一致。

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<br>2026年06月30日 |                  | 上年度末<br>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 |
|       |                    |                  |                     |                  |

|            |                  |        |                  |        |
|------------|------------------|--------|------------------|--------|
| 兴业银行股份有限公司 | 1,463,414,146.34 | 99.97% | 1,463,414,146.34 | 99.97% |
|------------|------------------|--------|------------------|--------|

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金适用的交易费率与本基金法律文件规定一致。

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<br>2026年01月01日至2026年06月30日 |          | 上年度可比期间<br>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   |
| 兴业银行股份有限公司 | 791,077.18                    | 1,189.53 | 824,795.44                         | 1,086.89 |

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，按银行约定利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间均无须作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<br>登记日  | 除息日        | 每10份基金<br>份额分红<br>数 | 现金形式<br>发放总额  | 再投资形<br>式发放总<br>额 | 本期利润<br>分配合计  | 备注 |
|----|------------|------------|---------------------|---------------|-------------------|---------------|----|
| 1  | 2026-03-04 | 2026-03-04 | 0.100               | 14,639,143.49 | -                 | 14,639,143.49 | -  |
| 合计 |            |            | 0.100               | 14,639,143.49 | -                 | 14,639,143.49 | -  |

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

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289,024,136.14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         |
|-----------|---------------|------------|--------|-----------|----------------|
| 092280134 | 22工行二级资本债04A  | 2026-07-01 | 103.88 | 600,000   | 62,329,232.88  |
| 232480106 | 24建行二级资本债03BC | 2026-07-01 | 101.85 | 200,000   | 20,369,229.59  |
| 232680003 | 26中行二级资本债01BC | 2026-07-01 | 100.91 | 300,000   | 30,271,969.31  |
| 232680011 | 26建行二级资本债01BC | 2026-07-01 | 100.24 | 200,000   | 20,048,226.85  |
| 240303    | 24进出03        | 2026-07-01 | 100.98 | 1,000,000 | 100,980,547.95 |
| 240413    | 24农发13        | 2026-07-01 | 102.17 | 100,000   | 10,217,150.68  |
| 2522029   | 25国银金租债03     | 2026-07-03 | 102.09 | 730,000   | 74,526,440.00  |
| 合计        |               |            |        | 3,130,000 | 318,742,797.26 |

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2026年06月30日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额502,807,988.76 元，截至2026年07月01日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，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。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为债券型基金，其预期收益和风险水平高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。本基金投资的金融工具主要为债券投资，不可投资于股票等权益类资产。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。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是通过灵活的资产配置和主动的投资管理，拓展大类资产配置空间，在精选个券的基础上适度集中投资，在控制风险的前提下为投资者谋求资本的长期稳健增值。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了由高层监控(董事会下设风险管理委员会、管理层层面设立风险控制委员会)、专业监控(督察长、风险监察部)、部门互控、岗位自控构成的风险管理架构体系。

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，及时对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 6.4.13.2 信用风险

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

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本基金的托管人兴业银行股份有限公司，因从事证券交易业务和期货交易业务（如有）存放在证券公司和期货公司的结算资金，与其相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的场内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（如适用）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，涉及信用风险的投资品种在入公司备选库前均由信用研究员进行研究支持与风险分析，且基金通过分散化投资以分散信用风险。

于2026年6月30日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为135.05%(2025年12月31日：95.54%)。

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<br>2026年06月30日 | 上年度末<br>2025年12月31日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| A-1    | -                  | -                   |
| A-1以下  | -                  | -                   |
| 未评级    | 151,388,887.67     | 50,148,243.84       |
| 合计     | 151,388,887.67     | 50,148,243.84       |

注：于2026年6月30日，未评级部分为主体评级AA级（含）以上的短期融资券及短期公司债券。于2025年12月31日，未评级部分为主体评级AA级（含）以上的短期公司债券。债券信用评级取自第三方评级机构。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2026年06月30日 | 上年度末<br>2025年12月31日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| A-1    | -                  | -                   |
| A-1以下  | -                  | -                   |
| 未评级    | -                  | 99,417,285.48       |
| 合计     | -                  | 99,417,285.48       |

注：债券信用评级取自第三方评级机构。

6.4.13.2.3 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<br>2026年06月30日 | 上年度末<br>2025年12月31日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| AAA    | 1,686,410,247.13   | 1,188,331,846.58    |
| AAA以下  | 205,150,520.55     | 100,467,397.26      |
| 未评级    | 261,533,457.53     | 345,578,326.04      |
| 合计     | 2,153,094,225.21   | 1,634,377,569.88    |

注：于2026年6月30日及2025年12月31日，未评级部分均为政策性金融债。债券信用评级取自第三方评级机构。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可于约定开放日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》等有关法规的要求建立开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。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可能带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金主要投资于交易所及银行间市场内交易的证券，除在附注期末“本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），其余均能及时变现。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，其上限不超过相关法规规定及基金合同约定。除附注“期末债券正回购交易中作为抵押的债券”中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在该类交易约定期限内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债（如有）的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

#### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人对本基金面临的利率敏感性缺口进行监测，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2026年0<br>6月30日 | 1年以内            | 1-5年             | 5年以上          | 不计息         | 合计               |
|------------------------|-----------------|------------------|---------------|-------------|------------------|
| 资产                     |                 |                  |               |             |                  |
| 货币资金                   | 799,827.34      | -                | -             | -           | 799,827.34       |
| 交易性金融资产                | 495,233,575.35  | 1,798,031,644.38 | 11,217,893.15 | -           | 2,304,483,112.88 |
| 资产总计                   | 496,033,402.69  | 1,798,031,644.38 | 11,217,893.15 | -           | 2,305,282,940.22 |
| 负债                     |                 |                  |               |             |                  |
| 卖出回购金融资产款              | 791,832,124.90  | -                | -             | -           | 791,832,124.90   |
| 应付管理人报酬                | -               | -                | -             | 372,645.16  | 372,645.16       |
| 应付托管费                  | -               | -                | -             | 124,215.05  | 124,215.05       |
| 应交税费                   | -               | -                | -             | 46,315.94   | 46,315.94        |
| 其他负债                   | -               | -                | -             | 134,202.25  | 134,202.25       |
| 负债总计                   | 791,832,124.90  | -                | -             | 677,378.40  | 792,509,503.30   |
| 利率敏感度缺口                | -295,798,722.21 | 1,798,031,644.38 | 11,217,893.15 | -677,378.40 | 1,512,773,436.92 |

| 上年度<br>末<br>2025年1<br>2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                        | 574,453.27     | -                | -              | -           | 574,453.27       |
| 交易性金融资产                     | 220,545,748.50 | 1,432,701,295.90 | 130,696,054.80 | -           | 1,783,943,099.20 |
| 资产总计                        | 221,120,201.77 | 1,432,701,295.90 | 130,696,054.80 | -           | 1,784,517,552.47 |
| 负债                          |                |                  |                |             |                  |
| 卖出回购金融资产款                   | 278,219,315.72 | -                | -              | -           | 278,219,315.72   |
| 应付管理人报酬                     | -              | -                | -              | 382,987.13  | 382,987.13       |
| 应付托管费                       | -              | -                | -              | 127,662.36  | 127,662.36       |
| 应交税费                        | -              | -                | -              | 21,121.48   | 21,121.48        |
| 其他负债                        | -              | -                | -              | 227,111.25  | 227,111.25       |
| 负债总计                        | 278,219,315.72 | -                | -              | 758,882.22  | 278,978,197.94   |
| 利率敏感度缺口                     | -57,099,113.95 | 1,432,701,295.90 | 130,696,054.80 | -758,882.22 | 1,505,539,354.53 |

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

|    |                    |                    |
|----|--------------------|--------------------|
| 假设 | 除市场利率以外的其他市场变量保持不变 |                    |
| 分析 | 相关风险变量的变动          | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额 |

|  |             | (单位：人民币元)      |                |
|--|-------------|----------------|----------------|
|  |             | 本期末            | 上年度末           |
|  |             | 2026年06月30日    | 2025年12月31日    |
|  | 市场利率上升25个基点 | -17,675,058.76 | -12,497,911.58 |
|  | 市场利率下降25个基点 | 17,949,625.70  | 12,658,939.57  |

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，因此无重大其他价格风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

于2026年6月30日，本基金未持有权益类资产(2025年12月31日：同)。

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<br>2026年06月30日 | 上年度末<br>2025年12月31日 |
|---------------|--------------------|---------------------|
| 第一层次          | -                  | -                   |
| 第二层次          | 2,304,483,112.88   | 1,783,943,099.20    |
| 第三层次          | -                  | -                   |

|    |                  |                  |
|----|------------------|------------------|
| 合计 | 2,304,483,112.88 | 1,783,943,099.20 |
|----|------------------|------------------|

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。  
 本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2026年6月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2025年12月31日：同)。

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、其他各类应收款项和其他各类应付款项，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   | 2,304,483,112.88 | 99.97        |
|    | 其中：债券    | 2,304,483,112.88 | 99.97        |
|    | 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      | 799,827.34       | 0.03   |
| 8 | 其他各项资产            | -                | -      |
| 9 | 合计                | 2,305,282,940.22 | 100.00 |

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有境内股票。

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金本报告期末未买入股票。

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

本基金本报告期末未卖出股票。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期末未买入或卖出股票。

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      | -                | -            |
| 2  | 央行票据      | -                | -            |
| 3  | 金融债券      | 1,018,606,818.09 | 67.33        |
|    | 其中：政策性金融债 | 261,533,457.53   | 17.29        |

|    |           |                  |        |
|----|-----------|------------------|--------|
| 4  | 企业债券      | 1,235,218,322.19 | 81.65  |
| 5  | 企业短期融资券   | 50,657,972.60    | 3.35   |
| 6  | 中期票据      | -                | -      |
| 7  | 可转债(可交换债) | -                | -      |
| 8  | 同业存单      | -                | -      |
| 9  | 其他        | -                | -      |
| 10 | 合计        | 2,304,483,112.88 | 152.33 |

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<br>净值比例(%) |
|----|-----------|---------------|-----------|----------------|------------------|
| 1  | 2522029   | 25国银金租债03     | 1,400,000 | 142,927,419.18 | 9.45             |
| 2  | 210210    | 21国开10        | 1,000,000 | 108,994,219.18 | 7.20             |
| 3  | 232580028 | 25顺德农商二级资本债01 | 1,000,000 | 102,889,534.25 | 6.80             |
| 4  | 212580030 | 25海峡银行小微债02   | 1,000,000 | 102,260,986.30 | 6.76             |
| 5  | 242691    | 25平证11        | 1,000,000 | 102,158,000.00 | 6.75             |

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 7.12 投资组合报告附注

**7.12.1** 本报告期内，本基金投资的前十名证券中除**21国开10（210210.IB）**、**25顺德农商二级资本债01（232580028.IB）**、**25GTHT06（243534.SH）**、**24进出03（240303.IB）**、**26华股02（524644.SZ）**的发行主体外，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。

本基金投资的前十名证券之一的**21国开10（210210.IB）**发行主体国家开发银行因违反金融统计管理规定，于2025年9月22日受到中国人民银行罚款（银罚决字〔2025〕66号）；因违规经营、涉嫌违反相关法律法规等事项，于2025年7月25日受到国家外汇管理局北京市分局处罚（京汇罚〔2025〕30号）。

本基金投资的前十名证券之一的**25顺德农商二级资本债01（232580028.IB）**发行主体广东顺德农村商业银行股份有限公司因贷款管理不审慎等事项，于2026年3月6日受到国家金融监督管理总局佛山监管分局罚款；因违反外汇市场交易管理规定等事项，于2025年8月20日受到国家外汇管理局广东省分局处罚（粤汇处〔2025〕14号）。

本基金投资的前十名证券之一的**25GTHT06（243534.SH）**发行主体国泰海通证券股份有限公司因违规开展期权业务，于2026年4月23日收到中国证券监督管理委员会上海监管局的警示函（沪证监决〔2026〕112号）；因内部制度不完善,涉嫌违反相关法律法规，于2026年3月2日收到中国证券监督管理委员会上海监管局的警示函（沪证监决〔2026〕65号）；因对标的公司提前确认收入事项核查不到位，于2025年12月5日收到深圳证券交易所出具的监管函（深证函〔2025〕1200号）。

本基金投资的前十名证券之一的**24进出03（240303.IB）**发行主体中国进出口银行因违反外汇登记管理规定等事项，于2026年3月5日受到国家外汇管理局北京市分局处罚（京汇罚〔2026〕14号）；因内部制度不完善，于2025年9月12日受到国家金融监督管理总局罚款。

本基金投资的前十名证券之一的**26华股02（524644.SZ）**发行主体华西证券股份有限公司因在承销和受托管理个别债券项目工作中尽职调查不到位等事项，于2026年3月19日被中国证券监督管理委员会四川监管局采取责令改正措施（〔2026〕22号）。

本基金管理人认为，以上监管措施及处罚不会对其投资价值构成实质性影响。

**7.12.2** 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

**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处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，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 |
| 205      | 7,141,045.58 | 1,463,914,344.23 | 100.00% | 0.00  | 0.00%  |

注：1、上述机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对分级份额，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）。

2、持有人户数为有效户数，即存量份额大于零的账户。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本报告期末基金管理人的从业人员未持有本开放式基金。

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   | 500,000.00 | 0.03%        | 10,000,850.00 | 0.68%        | 3年         |
| 基金管理人高级管理人员 | 0.00       | 0.00%        | 0.00          | 0.00%        | -          |
| 基金经理等人员     | 0.00       | 0.00%        | 0.00          | 0.00%        | -          |
| 基金管理人股东     | 0.00       | 0.00%        | 0.00          | 0.00%        | -          |
| 其他          | 0.00       | 0.00%        | 0.00          | 0.00%        | -          |
| 合计          | 500,000.00 | 0.03%        | 10,000,850.00 | 0.68%        | -          |

§9 开放式基金份额变动

单位：份

|                            |                  |
|----------------------------|------------------|
| 基金合同生效日(2022年08月08日)基金份额总额 | 3,510,472,850.00 |
| 本报告期期初基金份额总额               | 1,463,914,344.23 |
| 本报告期基金总申购份额                | -                |
| 减：本报告期基金总赎回份额              | -                |
| 本报告期基金拆分变动份额               | -                |
| 本报告期期末基金份额总额               | 1,463,914,344.23 |

注：总申购份额含红利再投（如有）、转换入份额（如有）；总赎回份额含转换出份额（如有）。

§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，本基金未召开过基金份额持有人大会，无相关决议。

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、基金管理人的重大人事变动

本报告期内，经本基金管理人2026年第一次股东会及第三届董事会第三次会议审议通过，董事长胡隽先生于2026年4月3日离任公司董事及董事长职务，总经理钟鸣远先生代为履行董事长职务。前述事项已按要求完成了监管备案及信息披露公告。

本报告期内，经本基金管理人2026年公司第三届董事会第四次会议审议通过，钟鸣远先生于2026年4月15日任公司财务负责人，同时姜俊先生不再担任公司财务负责人。前述事项已按要求完成了监管备案及信息披露公告。

### 2、基金托管人的重大人事变动

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事项。

## 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，本基金未发生改聘会计师事务所的情况。

## 10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

### 10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，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，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 |    |
| 广发证券 | 2      | -    | -            | -          | -          | -  |
| 兴业证券 | 2      | -    | -            | 139,922.73 | 100.00%    | -  |

- 1、本基金采用委托券商交易模式。
- 2、本基金管理人负责选择提供经纪服务的券商，主要选择标准包括：券商的基本面评价（财务状况稳健、经营行为规范、无重大负面舆情等）、服务评价（交易稳定性、系统及线路稳定性、交易反馈及时性、清算数据准确性等）、研究服务质量评价（即在其他条件相同或相近的情况下，优先选择研究服务更优的券商）等。
- 3、选择程序：公司根据上述选择标准，对拟合作的券商展开综合考察和评估，将经评估符合标准的券商纳入公司结算券商备选库，并每年进行一次回检。与最后选定的券商签订证券经纪服务协议，明确双方的权利和义务。
- 4、报告期内，本基金未有新增及停止使用专用交易单元的情况。

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 |
| 广发证券 | -              | -            | -                 | -              | -    | -            | -    | -            |
| 兴业证券 | 170,225,150.00 | 100.00%      | 32,476,699,000.00 | 100.00%        | -    | -            | -    | -            |

10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项         | 法定披露方式 | 法定披露日期     |
|----|--------------|--------|------------|
| 1  | 博远基金管理有限公司旗下 | 规定媒介   | 2026-01-22 |

|    |                                                  |      |            |
|----|--------------------------------------------------|------|------------|
|    | 基金2025年第4季度报告提示性公告                               |      |            |
| 2  | 博远利兴纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金2025年第4季度报告              | 规定媒介 | 2026-01-22 |
| 3  | 博远利兴纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金2026年第1次分红公告             | 规定媒介 | 2026-03-04 |
| 4  | 博远利兴纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理变更公告                 | 规定媒介 | 2026-03-06 |
| 5  | 关于博远利兴纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金招募说明书和基金产品资料概要更新的提示性公告 | 规定媒介 | 2026-03-07 |
| 6  | 博远利兴纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金招募说明书（更新）2026年第1号        | 规定媒介 | 2026-03-07 |
| 7  | 博远利兴纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金产品资料概要更新               | 规定媒介 | 2026-03-07 |
| 8  | 博远基金管理有限公司关于基金经理因休产假暂停履行职务的公告                    | 规定媒介 | 2026-03-11 |
| 9  | 博远利兴纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金2025年年度报告                | 规定媒介 | 2026-03-31 |
| 10 | 博远基金管理有限公司旗下基金2025年年度报告提示性公告                     | 规定媒介 | 2026-03-31 |
| 11 | 博远基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券                         | 规定媒介 | 2026-03-31 |

|    |                                             |      |            |
|----|---------------------------------------------|------|------------|
|    | 交易及佣金支付情况（2025年度）                           |      |            |
| 12 | 博远基金管理有限公司旗下基金2025年年度报告提示性公告更正公告            | 规定媒介 | 2026-04-01 |
| 13 | 博远基金管理有限公司关于总经理代为履行董事长职务的公告                 | 规定媒介 | 2026-04-04 |
| 14 | 博远基金管理有限公司高级管理人员变更公告                        | 规定媒介 | 2026-04-16 |
| 15 | 博远基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金产品风险等级划分结果的公告       | 规定媒介 | 2026-04-18 |
| 16 | 博远基金管理有限公司旗下基金2026年第1季度报告提示性公告              | 规定媒介 | 2026-04-21 |
| 17 | 博远利兴纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金2026年第1季度报告         | 规定媒介 | 2026-04-21 |
| 18 | 关于提醒投资者防范不法分子冒用“博远基金”名义进行诈骗的风险提示            | 规定媒介 | 2026-04-24 |
| 19 | 2025年度博远基金管理有限公司以股东身份（通过公募基金持股）参与股东大会投票信息披露 | 规定媒介 | 2026-04-30 |
| 20 | 博远基金管理有限公司关于提请投资者及时更新已过期身份证件及完善身份信息资料的公告    | 规定媒介 | 2026-05-14 |

## §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      | 1,463,414,146.34 | -    | -    | 1,463,414,146.34 | 99.97% |
| 产品特有风险                                                                                                                                                                                 |                |                        |                  |      |      |                  |        |
| (1) 不能及时应对赎回的风险<br>持有份额比例较高的基金份额持有人（以下简称"高比例投资者"）大额赎回时，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。                                                                      |                |                        |                  |      |      |                  |        |
| (2) 基金净值大幅波动的风险<br>当高比例投资者大量赎回时，基金管理人为支付赎回款项而变现基金资产，可能造成资产价格波动，导致本基金资产净值发生波动。若高比例投资者赎回的基金份额收取赎回费，相应的赎回费用按约定将部分或全部归入基金资产，可能对基金资产净值造成较大波动。若高比例投资者大量赎回本基金，计算基金份额净值时进行四舍五入也可能引起基金份额净值发生波动。 |                |                        |                  |      |      |                  |        |
| (3) 基金规模较小导致的风险<br>高比例投资者赎回后，可能导致基金规模较小，从而使得基金投资及运作管理的难度增加。                                                                                                                            |                |                        |                  |      |      |                  |        |
| (4) 基金面临转型、合并或提前终止的风险<br>高比例投资者赎回后，可能会导致出现连续六十个工作日基金资产净值低于5000万元而面临的转换基金运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等风险。                                                                                       |                |                        |                  |      |      |                  |        |

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

- 1、中国证监会批准博远利兴纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金注册的文件；
- 2、《博远利兴纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《博远利兴纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金托管协议》；
- 4、《博远利兴纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金招募说明书》及其更新；
- 5、博远基金管理有限公司业务资格批准文件、营业执照；
- 6、本报告期内本基金在符合中国证监会规定条件的全国性报刊上披露的各项公告原件。

12.2 存放地点

深圳市福田区皇岗路5001号深业上城T2栋4301室博远基金管理有限公司

### 12.3 查阅方式

投资者可在营业时间至基金管理人住所免费查询，或登录中国证监会基金电子披露网站（<http://eid.csrc.gov.cn/fund/>）及基金管理人网站（<http://www.boyuanfunds.com>）查阅。

博远基金管理有限公司  
二〇二六年八月二十八日