

华安鼎津一年定期开放债券型发起式证券  
投资基金  
2025 年中期报告

2025 年 6 月 30 日

基金管理人：华安基金管理有限公司

基金托管人：渤海银行股份有限公司

送出日期：2025 年 8 月 30 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，并由董事长签发。

基金托管人渤海银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2025 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

|                                         |           |
|-----------------------------------------|-----------|
| <b>§ 1 重要提示及目录</b>                      | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示                                | 2         |
| 1.2 目录                                  | 3         |
| <b>§ 2 基金简介</b>                         | <b>5</b>  |
| 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         |
| <b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>                | <b>6</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 6         |
| 3.2 基金净值表现                              | 7         |
| <b>§ 4 管理人报告</b>                        | <b>7</b>  |
| 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合规守信情况的说明              | 8         |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 8         |
| 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             | 9         |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 10        |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 10        |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 11        |
| 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明       | 11        |
| <b>§ 5 托管人报告</b>                        | <b>11</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 11        |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 | 11        |
| 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       | 11        |
| <b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>              | <b>12</b> |
| 6.1 资产负债表                               | 12        |
| 6.2 利润表                                 | 13        |
| 6.3 净资产变动表                              | 14        |
| 6.4 报表附注                                | 16        |
| <b>§ 7 投资组合报告</b>                       | <b>34</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况                          | 34        |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合                    | 35        |
| 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       | 35        |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动                     | 35        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 35        |
| 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细      | 36        |
| 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细   | 36        |
| 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细   | 36        |

|                                          |           |
|------------------------------------------|-----------|
| 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 ..... | 36        |
| 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....          | 36        |
| 7.11 投资组合报告附注 .....                      | 37        |
| <b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>               | <b>37</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....              | 37        |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....           | 38        |
| 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 .....   | 38        |
| 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况 .....                | 38        |
| <b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>               | <b>38</b> |
| <b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>                 | <b>39</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 .....                   | 39        |
| 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 .....   | 39        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....        | 39        |
| 10.4 基金投资策略的改变 .....                     | 39        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....              | 39        |
| 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....      | 39        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....             | 39        |
| 10.8 其他重大事件 .....                        | 41        |
| <b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>         | <b>41</b> |
| 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 ..... | 41        |
| <b>§ 12 备查文件目录 .....</b>                 | <b>42</b> |
| 12.1 备查文件目录 .....                        | 42        |
| 12.2 存放地点 .....                          | 42        |
| 12.3 查阅方式 .....                          | 42        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                        |
|------------|------------------------|
| 基金名称       | 华安鼎津一年定期开放债券型发起式证券投资基金 |
| 基金简称       | 华安鼎津一年定开债发起式           |
| 基金主代码      | 016673                 |
| 基金运作方式     | 契约型开放式                 |
| 基金合同生效日    | 2022 年 12 月 21 日       |
| 基金管理人      | 华安基金管理有限公司             |
| 基金托管人      | 渤海银行股份有限公司             |
| 报告期末基金份额总额 | 2,000,001,139.10 份     |
| 基金合同存续期    | 不定期                    |

### 2.2 基金产品说明

|        |                                                                                                                                                                              |
|--------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标   | 本基金在严格控制风险和保持较高流动性的基础上，通过积极主动的资产配置，力求获得超越业绩比较基准的投资回报。                                                                                                                        |
| 投资策略   | <p>1、封闭期投资策略</p> <p>（1）资产配置策略</p> <p>（2）债券投资策略</p> <p>（3）国债期货投资策略</p> <p>2、开放期投资策略</p> <p>开放期内，本基金为保持较高的组合流动性，方便投资人安排投资，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，将主要投资于高流动性的投资品种，减小基金净值的波动。</p> |
| 业绩比较基准 | 中债综合全价指数收益率                                                                                                                                                                  |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，但低于混合型基金、股票型基金。                                                                                                                                  |

### 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目          |      | 基金管理人                                    | 基金托管人               |
|-------------|------|------------------------------------------|---------------------|
| 名称          |      | 华安基金管理有限公司                               | 渤海银行股份有限公司          |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名   | 杨牧云                                      | 丁晓光                 |
|             | 联系电话 | 021-38969999                             | 022-58314940        |
|             | 电子邮箱 | service@huanan.com.cn                    | xg.ding@cbhb.com.cn |
| 客户服务电话      |      | 4008850099                               | 95541               |
| 传真          |      | 021-68863414                             | 022-58314791        |
| 注册地址        |      | 中国（上海）自由贸易试验区临港新片区环湖西二路 888 号 B 楼 2118 室 | 天津市河东区海河东路 218 号    |
| 办公地址        |      | 中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号国金中心二期 31 - 32 层    | 天津市河东区海河东路 218 号    |
| 邮政编码        |      | 200120                                   | 300012              |

|       |     |     |
|-------|-----|-----|
| 法定代表人 | 朱学华 | 王锦虹 |
|-------|-----|-----|

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                                 |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | www.huaan.com.cn                      |
| 基金中期报告备置地点          | 中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号国金中心二期 31 - 32 层 |

2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称         | 办公地址                                  |
|--------|------------|---------------------------------------|
| 注册登记机构 | 华安基金管理有限公司 | 中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号国金中心二期 31 - 32 层 |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2025 年 1 月 1 日-2025 年 6 月 30 日) |
|---------------|-------------------------------------|
| 本期已实现收益       | 26,749,532.78                       |
| 本期利润          | 5,495,050.20                        |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0027                              |
| 本期加权平均净值利润率   | 0.26%                               |
| 本期基金份额净值增长率   | 0.26%                               |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2025 年 6 月 30 日)               |
| 期末可供分配利润      | 115,944,328.18                      |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.0580                              |
| 期末基金资产净值      | 2,136,975,434.96                    |
| 期末基金份额净值      | 1.0685                              |
| 3.1.3 累计期末指标  | 报告期末(2025 年 6 月 30 日)               |
| 基金份额累计净值增长率   | 8.87%                               |

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。

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

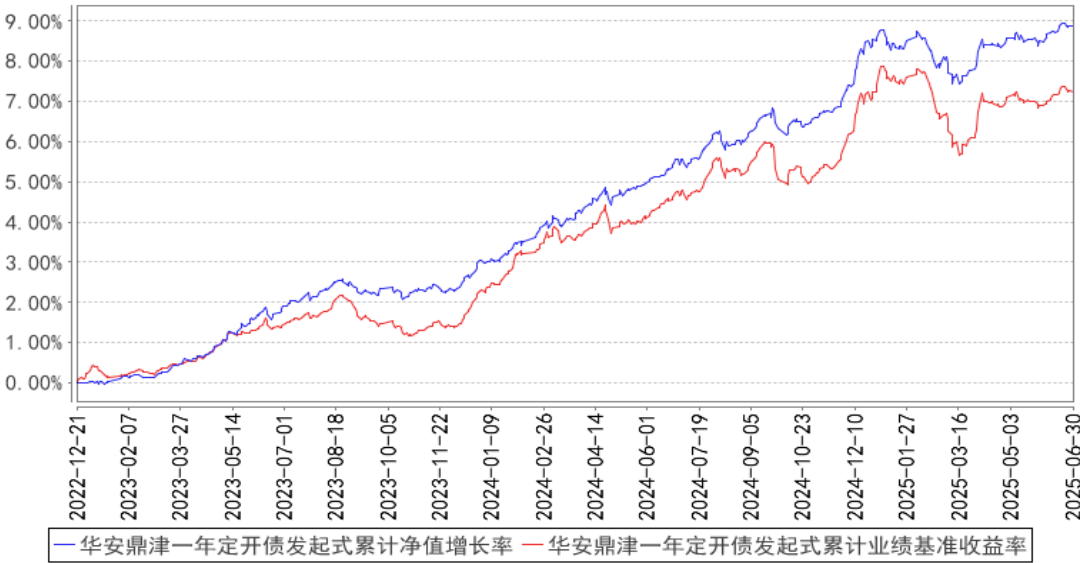
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①－③    | ②－④    |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去一个月      | 0.33%    | 0.04%       | 0.31%      | 0.04%         | 0.02%  | 0.00%  |
| 过去三个月      | 0.97%    | 0.08%       | 1.06%      | 0.10%         | -0.09% | -0.02% |
| 过去六个月      | 0.26%    | 0.09%       | -0.14%     | 0.11%         | 0.40%  | -0.02% |
| 过去一年       | 3.12%    | 0.09%       | 2.36%      | 0.10%         | 0.76%  | -0.01% |
| 过去三年       | -        | -           | -          | -             | -      | -      |
| 自基金合同生效起至今 | 8.87%    | 0.07%       | 7.24%      | 0.08%         | 1.63%  | -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

华安鼎津一年定开债发起式累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



§ 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

华安基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1998]20 号文批准于 1998 年 6 月设立，是国内首批基金管理公司之一，注册资本 1.5 亿元人民币，公司总部设在上海陆家嘴金融贸易区。目前的股东为国泰海通证券股份有限公司、上海上国投资产管理有限公司、上海锦江国际投资管理有限公司、上海工业投资（集团）有限公司和国泰君安投资管理股份有限公司。公司在香港和上海设有子公司——华安资产管理（香港）有限公司、华安未来资产管理（上海）有限公司。截

至 2025 年 6 月 30 日，公司旗下共管理华安创新混合、华安 MSCI 中国 A、华安现金富利货币、华安稳定收益债券、华安黄金易 ETF、华安沪港深外延增长混合、华安全球美元收益债券等 283 只证券投资基金，管理资产规模达到 7,488.16 亿元人民币。

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 |        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
| 鲍越愚 | 本基金的基金经理 | 2022 年 12 月 21 日 | -    | 9 年    | 硕士研究生，9 年证券、基金行业从业经验。曾任联讯证券交易部交易员，2016 年 9 月加入华安基金，历任集中交易部债券交易员、固定收益部基金经理助理。2021 年 5 月起，担任华安安嘉 6 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、华安安逸半年定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。2021 年 9 月起，同时担任华安鼎信 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。2022 年 12 月起，同时担任华安鼎津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 1 月起，同时担任华安锦溶 0-5 年金融债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。2023 年 9 月起，同时担任华安添荣中短债债券型证券投资基金的基金经理。 |

注：此处的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日，即以公告日为准。证券从业的含义遵从行业协会《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、招募说明书等有关基金法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益，不存在违法违规或未履行基金合同承诺的情形。

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

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《华安基金管理有限公司公平交易管理制度》，将各投资组合在研究分析、投资决策、交易执行等方面全部纳入公平交易管理中。控制措施包括：在研究环节，研究员在为公司管理的各类投资组合提供研究信息、投资建议过程中，使用晨会发言、邮件发送、登录在研究报告管理系统中等方式来确保各类



投资组合经理可以公平享有信息获取机会。在投资环节，公司各投资组合经理根据投资组合的风格和投资策略，制定并严格执行交易决策规则，以保证各投资组合交易决策的客观性和独立性。同时严格执行投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体授权机制，投资组合经理在授权范围内自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易环节，公司实行强制公平交易机制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。（1）交易所二级市场业务，遵循价格优先、时间优先、比例分配、综合平衡的控制原则，实现同一时间下达指令的投资组合在交易时机上的公平性。（2）交易所一级市场业务，投资组合经理按意愿独立进行业务申报，由集中交易部对外进行申报。若该业务以公司名义进行申报与中签，则按实际中签情况以比例分配原则进行分配。（3）银行间市场业务遵循指令时间优先原则，先到先询价的控制原则。交易监控、分析与评估环节，公司风险管理部对公司旗下的各投资组合投资境内证券市场上交易的投资品种、进行场外的非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购、不同投资组合合同日和临近交易日的反向交易以及可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控，根据市场公认的第三方信息（如：中债登的债券估值），定期对各投资组合与交易对手之间议价交易的交易价格公允性进行审查，对不同投资组合临近交易日的同向交易的交易时机和交易价差进行分析。

本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

本基金管理人通过统计检验的方法对管理的不同投资组合，在不同时间窗下（日内、3 日内、5 日内）的本年度同向交易价差进行了专项分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

#### 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》，公司风险管理部会同基金投资、交易部门讨论制定了各类投资组合针对股票、债券、回购等投资品种在交易所及银行间的同日反向交易控制规则，并在投资系统中进行了设置，实现了完全的系统控制。同时加强了对各类投资组合间的同日反向交易的监控与隔日反向交易的检查；风险管理部开发了同向交易分析系统，对相关同向交易指标进行持续监控，并定期对组合间的同向交易行为进行了重点分析。

本报告期内，因组合流动性管理或投资策略调整需要，除指数基金以外的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的次数为 0 次，未出现异常交易。

### 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

2025 年上半年，债券市场正式告别单边牛市格局，在政策预期差、外部事件冲击以及资金面

松紧快速切换的共同作用下，整体呈现出高波动的震荡特征。尽管利率绝对水平仍处于历史低位，但敏锐把握市场节奏的结构性机会依然存在，这主要体现在二季度避险行情驱动的波段操作收益，以及贯穿上半年的信用利差持续压缩带来的超额回报上。

具体来看，市场运行呈现明显的两阶段特征：年初至三月中旬，随着央行暂停国债买入操作，市场期待的降准降息也未能兑现，导致流动性预期转向收紧，资金利率中枢显著抬升。在此环境下，收益率曲线经历了一轮“熊平”变化，短端利率上行幅度尤为明显。然而，市场转折点出现在四月之后。中美关税博弈意外升级，显著推升了市场避险情绪；与此同时，货币政策迎来实质性宽松，资金面由紧转松。受此驱动，收益率整体震荡下行，曲线形态也随之转向“牛平”。

面对市场的剧烈波动，我们的投资组合积极应对：一方面，主动调整组合久期以灵活适应利率走势的阶段性变化，例如在收益率上行阶段适度防御，并在政策转向宽松、利率下行趋势确立时捕捉资本利得机会。另一方面，积极调入具有较好骑乘效应的个券，尤其是在收益率曲线形态变化过程中，精选那些期限结构上能提供更优滚动收益的品种，力求在波动的市场环境中增厚组合收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2025 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.0685 元，本报告期份额净值增长率为 0.26%，同期业绩比较基准增长率为-0.14%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

三季度财政政策仍为内需核心支撑，专项债及超长期特别国债资金逐步到位，有望提振基建与消费补贴，但外需受中美关税博弈扰动，出口不确定性较高。国内通胀压力温和，CPI 同比或继续承压，PPI 降幅虽收窄但仍处于通缩区间，经济基本面整体偏弱，为债市提供支撑。货币政策维持宽松基调，资金面整体充裕。

资金宽松或推动短端利率进一步下行，长端利率受制于政府债供给放量和潜在政策调整，可能呈震荡走势，中枢小幅下移。若权益市场降温，债市流动性回流或增强支撑，10 年期国债收益率有望阶段性突破前低，但中长期走势仍取决于四季度稳增长政策力度。

#### 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，负责在证券发行机构发生了严重影响证券价格的重大事件时，评估重大事件对投资品种价值的影响程度、评估对基金估值的影响程度、确定采用的估值方法、确定该证券的公允价值；同时将采用的估值方法以及采用该方法对相关证券的估值与基金的托管

银行进行沟通。估值委员会成员由首席投资官、公司分管运营、专户的领导、指数与量化投资部负责人、固定收益部门负责人、投资研究部负责人、基金组合投资部负责人、基金运营部负责人、产品部负责人、风险管理部负责人、全球投资部负责人等人员组成，具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备行业研究、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。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央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供银行间同业市场及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

本报告期不进行收益分配。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金为发起式证券投资基金。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，渤海银行股份有限公司（以下称“本基金托管人”）在对华安鼎津一年定期开放债券型发起式证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本基金托管人根据《证券投资基金法》等有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内，本基金未实施利润分配。

### 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

本基金托管人对本报告中财务指标、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、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：华安鼎津一年定期开放债券型发起式证券投资基金

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资 产         | 附注号     | 本期末<br>2025 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2024 年 12 月 31 日 |
|-------------|---------|------------------------|--------------------------|
| 资 产：        |         |                        |                          |
| 货币资金        | 6.4.7.1 | 4,404,255.95           | 4,899,673.14             |
| 结算备付金       |         | 7,229,753.05           | 7,312,342.82             |
| 存出保证金       |         | 574,142.30             | -                        |
| 交易性金融资产     | 6.4.7.2 | 3,165,986,098.73       | 2,910,405,236.00         |
| 其中：股票投资     |         | -                      | -                        |
| 基金投资        |         | -                      | -                        |
| 债券投资        |         | 3,165,986,098.73       | 2,910,405,236.00         |
| 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 | -                      | -                        |
| 债权投资        |         | -                      | -                        |
| 其中：债券投资     |         | -                      | -                        |
| 资产支持证券投资    |         | -                      | -                        |
| 其他投资        |         | -                      | -                        |
| 其他债权投资      |         | -                      | -                        |
| 其他权益工具投资    |         | -                      | -                        |
| 应收清算款       |         | -                      | -                        |
| 应收股利        |         | -                      | -                        |
| 应收申购款       |         | -                      | -                        |
| 递延所得税资产     |         | -                      | -                        |
| 其他资产        | 6.4.7.5 | -                      | -                        |
| 资产总计        |         | 3,178,194,250.03       | 2,922,617,251.96         |
| 负 债 和 净 资 产 |         |                        |                          |
| 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   |         | 1,040,367,081.53       | 790,302,247.34           |
| 应付清算款       |         | -                      | -                        |
| 应付赎回款       |         | -                      | -                        |

|             |         |                  |                  |
|-------------|---------|------------------|------------------|
| 应付管理人报酬     |         | 526,384.58       | 538,514.00       |
| 应付托管费       |         | 175,461.55       | 179,504.67       |
| 应付销售服务费     |         | -                | -                |
| 应付投资顾问费     |         | -                | -                |
| 应交税费        |         | -                | 17,638.37        |
| 应付利润        |         | -                | -                |
| 递延所得税负债     |         | -                | -                |
| 其他负债        | 6.4.7.6 | 149,887.41       | 98,962.82        |
| 负债合计        |         | 1,041,218,815.07 | 791,136,867.20   |
| <b>净资产：</b> |         |                  |                  |
| 实收基金        | 6.4.7.7 | 2,000,001,139.10 | 2,000,001,139.10 |
| 其他综合收益      |         | -                | -                |
| 未分配利润       | 6.4.7.8 | 136,974,295.86   | 131,479,245.66   |
| 净资产合计       |         | 2,136,975,434.96 | 2,131,480,384.76 |
| 负债和净资产总计    |         | 3,178,194,250.03 | 2,922,617,251.96 |

注：报告截止日 2025 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.0685 元，基金份额总额 2,000,001,139.10 份。

6.2 利润表

会计主体：华安鼎津一年定期开放债券型发起式证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目                   | 附注号      | 本期<br>2025 年 1 月 1 日至 2025<br>年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2024 年 1 月 1 日至 2024<br>年 6 月 30 日 |
|-----------------------|----------|------------------------------------------|-----------------------------------------------|
| <b>一、营业总收入</b>        |          | 13,747,666.31                            | 59,821,319.15                                 |
| 1. 利息收入               |          | 1,100,040.42                             | 73,400.58                                     |
| 其中：存款利息收入             | 6.4.7.9  | 75,781.75                                | 62,774.07                                     |
| 债券利息收入                |          | -                                        | -                                             |
| 资产支持证券利<br>息收入        |          | -                                        | -                                             |
| 买入返售金融资<br>产收入        |          | 1,024,258.67                             | 10,626.51                                     |
| 其他利息收入                |          | -                                        | -                                             |
| 2. 投资收益（损失以<br>“-”填列） |          | 33,902,108.47                            | 41,920,507.91                                 |
| 其中：股票投资收益             | 6.4.7.10 | -                                        | -                                             |
| 基金投资收益                |          | -                                        | -                                             |
| 债券投资收益                | 6.4.7.11 | 34,951,004.88                            | 42,280,087.20                                 |
| 资产支持证券投<br>资收益        |          | -                                        | -                                             |
| 贵金属投资收益               |          | -                                        | -                                             |

|                        |            |                |               |
|------------------------|------------|----------------|---------------|
| 衍生工具收益                 | 6.4.7.12   | -1,048,896.41  | -359,579.29   |
| 股利收益                   | 6.4.7.13   | -              | -             |
| 以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益  |            | -              | -             |
| 其他投资收益                 |            | -              | -             |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.14   | -21,254,482.58 | 17,827,410.66 |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）     |            | -              | -             |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）     | 6.4.7.15   | -              | -             |
| 减：二、营业总支出              |            | 8,252,616.11   | 10,391,313.05 |
| 1. 管理人报酬               | 6.4.10.2.1 | 3,164,729.51   | 3,051,871.60  |
| 其中：暂估管理人报酬             |            | -              | -             |
| 2. 托管费                 | 6.4.10.2.2 | 1,054,909.93   | 1,017,290.54  |
| 3. 销售服务费               | 6.4.10.2.3 | -              | -             |
| 4. 投资顾问费               |            | -              | -             |
| 5. 利息支出                |            | 3,929,940.80   | 6,200,270.53  |
| 其中：卖出回购金融资产支出          |            | 3,929,940.80   | 6,200,270.53  |
| 6. 信用减值损失              | 6.4.7.16   | -              | -             |
| 7. 税金及附加               |            | 133.31         | 1,256.86      |
| 8. 其他费用                | 6.4.7.17   | 102,902.56     | 120,623.52    |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）    |            | 5,495,050.20   | 49,430,006.10 |
| 减：所得税费用                |            | -              | -             |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列）      |            | 5,495,050.20   | 49,430,006.10 |
| 五、其他综合收益的税后净额          |            | -              | -             |
| 六、综合收益总额               |            | 5,495,050.20   | 49,430,006.10 |

6.3 净资产变动表

会计主体：华安鼎津一年定期开放债券型发起式证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |        |                |                  |
|-----------|---------------------------------------|--------|----------------|------------------|
|           | 实收基金                                  | 其他综合收益 | 未分配利润          | 净资产合计            |
| 一、上期期末净资产 | 2,000,001,139.10                      | -      | 131,479,245.66 | 2,131,480,384.76 |

|                                          |                                            |        |                |                  |
|------------------------------------------|--------------------------------------------|--------|----------------|------------------|
| 加：会计政策变更                                 | -                                          | -      | -              | -                |
| 前期差错更正                                   | -                                          | -      | -              | -                |
| 其他                                       | -                                          | -      | -              | -                |
| 二、本期期初净资产                                | 2,000,001,139.10                           | -      | 131,479,245.66 | 2,131,480,384.76 |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)                     | -                                          | -      | 5,495,050.20   | 5,495,050.20     |
| (一)、综合收益总额                               | -                                          | -      | 5,495,050.20   | 5,495,050.20     |
| (二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数<br>(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)、其他综合收益结转留存收益                         | -                                          | -      | -              | -                |
| 四、本期期末净资产                                | 2,000,001,139.10                           | -      | 136,974,295.86 | 2,136,975,434.96 |
| 项目                                       | 上年度可比期间<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |        |                |                  |
|                                          | 实收基金                                       | 其他综合收益 | 未分配利润          | 净资产合计            |
| 一、上期期末净资产                                | 2,000,001,139.10                           | -      | 23,002,247.23  | 2,023,003,386.33 |
| 加：会计政策变更                                 | -                                          | -      | -              | -                |
| 前期差错更正                                   | -                                          | -      | -              | -                |

|                                          |                  |   |               |                  |
|------------------------------------------|------------------|---|---------------|------------------|
| 其他                                       | -                | - | -             | -                |
| 二、本期期初净资产                                | 2,000,001,139.10 | - | 23,002,247.23 | 2,023,003,386.33 |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)                     | -                | - | 49,430,006.10 | 49,430,006.10    |
| (一)、综合收益总额                               | -                | - | 49,430,006.10 | 49,430,006.10    |
| (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)、其他综合收益结转留存收益                         | -                | - | -             | -                |
| 四、本期期末净资产                                | 2,000,001,139.10 | - | 72,432,253.33 | 2,072,433,392.43 |

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：

|            |            |            |
|------------|------------|------------|
| <u>朱学华</u> | <u>朱学华</u> | <u>陈松一</u> |
| 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

华安鼎津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]1943 号《关于准予华安鼎津一年定期开放债



券型发起式证券投资基金注册的批复》注册，由华安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《华安鼎津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。

本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集共募集人民币 1,999,999,000.00 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 1062 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华安鼎津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 12 月 21 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 2,000,001,139.10 元份基金份额，认购资金利息折合基金份额为 2,139.10 元份基金份额。本基金的基金管理人为华安基金管理有限公司，基金托管人为渤海银行股份有限公司。

本基金为发起式基金，发起资金认购部分为 10,000,000.00 份基金份额，发起资金认购方承诺使用发起资金认购的基金份额持有期限不少于 3 年。

本基金的封闭期为自基金合同生效之日(含)起或自每一开放期结束之日次日(含)起满 1 年的期间。本基金第一个封闭期的起始之日为基金合同生效日(含)，结束之日为基金合同生效日所对应的下一个年度对日的前一日(含)。第二个封闭期的起始之日为第一个开放期结束之日次日(含)，结束之日为第二个封闭期起始之日所对应的下一个年度对日的前一日(含)，依此类推。本基金在封闭期内不办理申购和赎回业务，也不上市交易。本基金每个开放期不少于 1 个工作日且不超过 20 个工作日，具体时间由基金管理人在当期封闭期结束前公告。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安鼎津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，包括债券(国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可分离交易可转债的纯债部分、中期票据、短期融资券、超短期融资券)、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、国债期货、货币市场工具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。基金投资组合比例为：本基金对债券的投资比例不低于基金资产的 80%；但因开放期流动性需要，为保护基金份额持有人利益，在每个开放期开始前 1 个月、开放期以及开放期结束后 1 个月内，本基金债券资产的投资不受上述比例限制。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，本基金持有的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；封闭期内本基金不受上述 5%的限制，但每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金，本基金所指的现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如法律法规或监管机构以后允许基金变更投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以相应调整本基金

投资比例的规定。本基金业绩比较基准为：中债综合全价指数收益率。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 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》、《华安鼎津一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》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。

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定，发起式基金的基金合同生效三年后，若基金资产净值低于人民币两亿元的，基金合同自动终止。于 2024 年 12 月 31 日，本基金的基金资产净值为 2,131,480,384.76 元，且本基金的基金合同将于未来 12 个月内生效满三年，本基金的管理人预计基金资产净值届时将高于人民币两亿元，故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于 2025 年 06 月 30 日的财务状况以及 2025 年 01 月 01 日起至 2025 年 06 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期末发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末发生会计估计变更。

##### 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[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税

[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

- 1、资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。
- 对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以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，由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 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>2025 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款           | 4,404,255.95           |
| 等于：本金          | 4,400,573.41           |
| 加：应计利息         | 3,682.54               |
| 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             | 4,404,255.95           |

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            |       | 本期末<br>2025 年 6 月 30 日 |               |                  |               |
|---------------|-------|------------------------|---------------|------------------|---------------|
|               |       | 成本                     | 应计利息          | 公允价值             | 公允价值变动        |
| 股票            |       | -                      | -             | -                | -             |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 |       | -                      | -             | -                | -             |
| 债券            | 交易所市场 | -                      | -             | -                | -             |
|               | 银行间市场 | 3,106,603,532.32       | 38,350,098.73 | 3,165,986,098.73 | 21,032,467.68 |
|               | 合计    | 3,106,603,532.32       | 38,350,098.73 | 3,165,986,098.73 | 21,032,467.68 |
| 资产支持证券        |       | -                      | -             | -                | -             |
| 基金            |       | -                      | -             | -                | -             |
| 其他            |       | -                      | -             | -                | -             |
| 合计            |       | 3,106,603,532.32       | 38,350,098.73 | 3,165,986,098.73 | 21,032,467.68 |

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<br>2025 年 6 月 30 日 |      |    |    |
|-----------|------------------------|------|----|----|
|           | 合同/名义<br>金额            | 公允价值 |    | 备注 |
|           |                        | 资产   | 负债 |    |
| 利率衍生工具    | 47,767,750.00          | -    | -  | -  |
| 其中：国债期货投资 | 47,767,750.00          | -    | -  | -  |
| 货币衍生工具    | -                      | -    | -  | -  |
| 权益衍生工具    | -                      | -    | -  | -  |
| 其他衍生工具    | -                      | -    | -  | -  |
| 合计        | 47,767,750.00          | -    | -  | -  |

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/卖） | 合约市值          | 公允价值变动    |
|--------|--------|----------|---------------|-----------|
| TF2509 | TF2509 | 45.00    | 47,765,250.00 | -2,500.00 |
| 合计     |        |          |               | -2,500.00 |

|                |  |  |  |           |
|----------------|--|--|--|-----------|
| 减:可抵销期货<br>暂收款 |  |  |  | -2,500.00 |
| 净额             |  |  |  | 0.00      |

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

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

无余额。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

6.4.7.5 其他资产

无余额。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2025 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                      |
| 应付赎回费       | -                      |
| 应付证券出借违约金   | -                      |
| 应付交易费用      | 65,584.85              |
| 其中：交易所市场    | -                      |
| 银行间市场       | 65,584.85              |
| 应付利息        | -                      |
| 预提审计费       | 24,795.19              |
| 预提信息披露费     | 59,507.37              |
| 合计          | 149,887.41             |

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |                  |
|---------------|---------------------------------------|------------------|
|               | 基金份额（份）                               | 账面金额             |
| 上年度末          | 2,000,001,139.10                      | 2,000,001,139.10 |
| 本期申购          | -                                     | -                |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -                                     | -                |
| 基金拆分/份额折算前    | -                                     | -                |
| 基金拆分/份额折算调整   | -                                     | -                |
| 本期申购          | -                                     | -                |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -                                     | -                |
| 本期末           | 2,000,001,139.10                      | 2,000,001,139.10 |

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

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           | 89,194,795.40  | 42,284,450.26  | 131,479,245.66 |
| 加：会计政策变更       | -              | -              | -              |
| 前期差错更正         | -              | -              | -              |
| 其他             | -              | -              | -              |
| 本期期初           | 89,194,795.40  | 42,284,450.26  | 131,479,245.66 |
| 本期利润           | 26,749,532.78  | -21,254,482.58 | 5,495,050.20   |
| 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        | -              | -              | -              |
| 本期末            | 115,944,328.18 | 21,029,967.68  | 136,974,295.86 |

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 34,894.21                             |
| 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 | 40,886.45                             |
| 其他        | 1.09                                  |
| 合计        | 75,781.75                             |

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

无。

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

无。

#### 6.4.7.11 债券投资收益

##### 6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目                           | 本期<br>2025年1月1日至2025年6月30日 |
|------------------------------|----------------------------|
| 债券投资收益——利息收入                 | 31,007,829.31              |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | 3,943,175.57               |
| 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                           | 34,951,004.88              |

##### 6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                     | 本期<br>2025年1月1日至2025年6月30日 |
|------------------------|----------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额   | 2,633,095,182.44           |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 2,600,096,328.42           |
| 减：应计利息总额               | 29,021,813.45              |
| 减：交易费用                 | 33,865.00                  |
| 买卖债券差价收入               | 3,943,175.57               |

#### 6.4.7.12 衍生工具收益

##### 6.4.7.12.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

##### 6.4.7.12.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

| 项目       | 本期<br>2025年1月1日至2025年6月30日 |
|----------|----------------------------|
| 国债期货投资收益 | -1,048,896.41              |

#### 6.4.7.13 股利收益

无。

#### 6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称       | 本期<br>2025年1月1日至2025年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | -21,251,982.58             |
| 股票投资       | -                          |
| 债券投资       | -21,251,982.58             |

|                            |                |
|----------------------------|----------------|
| 资产支持证券投资                   | -              |
| 基金投资                       | -              |
| 贵金属投资                      | -              |
| 其他                         | -              |
| 2. 衍生工具                    | -2,500.00      |
| 权证投资                       | -              |
| 期货投资                       | -2,500.00      |
| 3. 其他                      | -              |
| 减：应税金融商品公允价值变动<br>产生的预估增值税 | -              |
| 合计                         | -21,254,482.58 |

6.4.7.15 其他收入

无。

6.4.7.16 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |
|---------|---------------------------------------|
| 审计费用    | 24,795.19                             |
| 信息披露费   | 59,507.37                             |
| 证券出借违约金 | -                                     |
| 账户维护费   | 18,000.00                             |
| 其他      | 600.00                                |
| 合计      | 102,902.56                            |

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

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

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

经中国证监会于 2025 年 1 月 17 日批复核准，国泰君安证券股份有限公司（以下简称“国泰君安”）吸收合并海通证券股份有限公司（以下简称“海通证券”）。自吸收合并交割日（即 2025 年 3 月 14 日）起，合并后的国泰君安承继及承接海通证券的全部资产、负债、业务、人员、合同、资质及其他一切权利与义务。



根据国泰海通证券股份有限公司于 2025 年 4 月 4 日发布《国泰海通证券股份有限公司关于完成公司名称变更、注册资本变更、公司章程修订及相应市场主体变更登记的公告》，本公司股东的公司名称“国泰君安证券股份有限公司”变更为“国泰海通证券股份有限公司”。

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             |
|------------------------|---------------------|
| 华安基金管理有限公司（“华安基金”）     | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |
| 渤海银行股份有限公司（“渤海银行”）     | 基金托管人               |
| 国泰海通证券股份有限公司（“国泰海通证券”） | 基金管理人的股东            |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称            | 本期<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年<br>6 月 30 日 |                         | 上年度可比期间<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |                     |
|------------------|------------------------------------------|-------------------------|--------------------------------------------|---------------------|
|                  | 成交金额                                     | 占当期债券<br>成交总额的<br>比例（%） | 成交金额                                       | 占当期债券<br>成交总额的比例（%） |
| 国泰君安证券股份<br>有限公司 | 4,700,939.00                             | 100.00                  | -                                          | -                   |
| 国泰海通证券股份<br>有限公司 | -                                        | -                       | -                                          | -                   |

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 权证交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

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>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |
|------------------|---------------------------------------|--------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费   | 3,164,729.51                          | 3,051,871.60                               |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | -                                     | -                                          |
| 应支付基金管理人的净管理费    | 3,164,729.51                          | 3,051,871.60                               |

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.30% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{基金管理费年费率} / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |
|----------------|---------------------------------------|--------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 1,054,909.93                          | 1,017,290.54                               |

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{基金托管费年费率} / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.2.3 销售服务费

无。

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

单位：人民币元

| 本期<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日      |        |      |       |      |          |          |
|--------------------------------------------|--------|------|-------|------|----------|----------|
| 银行间市场交易的<br>各关联方名称                         | 债券交易金额 |      | 基金逆回购 |      | 基金正回购    |          |
|                                            | 基金买入   | 基金卖出 | 交易金额  | 利息收入 | 交易金额     | 利息支出     |
| -                                          | -      | -    | -     | -    | -        | -        |
| 上年度可比期间<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |        |      |       |      |          |          |
| 银行间市场交易的<br>各关联方名称                         | 债券交易金额 |      | 基金逆回购 |      | 基金正回购    |          |
|                                            | 基金买入   | 基金卖出 | 交易金额  | 利息收入 | 交易金额     | 利息支出     |
| 渤海银行                                       | -      | -    | -     | -    | 365,180, | 39,328.2 |

|  |  |  |  |  |        |   |
|--|--|--|--|--|--------|---|
|  |  |  |  |  | 000.00 | 9 |
|--|--|--|--|--|--------|---|

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

无。

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

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

| 项目                               | 本期<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |
|----------------------------------|---------------------------------------|--------------------------------------------|
| 基金合同生效日（2022 年 12 月 21 日）持有的基金份额 | -                                     | -                                          |
| 报告期初持有的基金份额                      | 10,002,139.10                         | 10,002,139.10                              |
| 报告期间申购/买入总份额                     | -                                     | 0.00                                       |
| 报告期间因拆分变动份额                      | -                                     | 0.00                                       |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额                   | -                                     | 0.00                                       |
| 报告期末持有的基金份额                      | 10,002,139.10                         | 10,002,139.10                              |
| 报告期末持有的基金份额<br>占基金总份额比例          | 0.50%                                 | 0.50%                                      |

注：基金管理人投资本基金相关的费用符合基金招募书和相关公告的规定。

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

份额单位：份

| 关联方名称          | 本期末<br>2025 年 6 月 30 日 |                                     | 上年度末<br>2024 年 12 月 31 日 |                                     |
|----------------|------------------------|-------------------------------------|--------------------------|-------------------------------------|
|                | 持有的<br>基金份额            | 持有的基金份<br>额<br>占基金总份<br>额<br>的比例（%） | 持有的<br>基金份额              | 持有的基金份<br>额<br>占基金总份<br>额<br>的比例（%） |
| 渤海银行股<br>份有限公司 | 1,989,999,000.00       | 99.50                               | 1,989,999,000.00         | 99.50                               |

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<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月<br>30 日 |           | 上年度可比期间<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |           |
|-------|------------------------------------------|-----------|--------------------------------------------|-----------|
|       | 期末余额                                     | 当期利息收入    | 期末余额                                       | 当期利息收入    |
| 渤海银行  | 4,404,255.95                             | 34,894.21 | 3,106,482.11                               | 24,155.26 |

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

无。

6.4.12 期末（2025 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

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 2025 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人民币 1,040,367,081.53 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<br>单价 | 数量（张）   | 期末估值总额        |
|--------|----------|-------------------|------------|---------|---------------|
| 140217 | 14 国开 17 | 2025 年 7 月<br>1 日 | 118.91     | 700,000 | 83,234,852.05 |
| 160213 | 16 国开 13 | 2025 年 7 月<br>1 日 | 104.31     | 400,000 | 41,724,164.39 |
| 170215 | 17 国开 15 | 2025 年 7 月<br>1 日 | 109.19     | 700,000 | 76,434,898.63 |
| 190310 | 19 进出 10 | 2025 年 7 月<br>1 日 | 108.67     | 132,000 | 14,344,989.70 |
| 210205 | 21 国开 05 | 2025 年 7 月<br>1 日 | 111.75     | 700,000 | 78,227,339.73 |
| 210215 | 21 国开 15 | 2025 年 7 月<br>1 日 | 110.66     | 278,000 | 30,762,771.67 |
| 220407 | 22 农发 07 | 2025 年 7 月<br>1 日 | 104.08     | 600,000 | 62,448,082.19 |

|        |          |                   |        |            |                  |
|--------|----------|-------------------|--------|------------|------------------|
| 220407 | 22 农发 07 | 2025 年 7 月<br>1 日 | 104.08 | 600,000    | 62,448,082.19    |
| 230315 | 23 进出 15 | 2025 年 7 月<br>1 日 | 104.95 | 800,000    | 83,957,698.63    |
| 230407 | 23 农发 07 | 2025 年 7 月<br>1 日 | 103.13 | 800,000    | 82,506,345.21    |
| 230407 | 23 农发 07 | 2025 年 7 月<br>1 日 | 103.13 | 800,000    | 82,506,345.21    |
| 230413 | 23 农发 13 | 2025 年 7 月<br>1 日 | 102.85 | 278,000    | 28,592,909.31    |
| 240210 | 24 国开 10 | 2025 年 7 月<br>1 日 | 105.11 | 500,000    | 52,555,273.97    |
| 240210 | 24 国开 10 | 2025 年 7 月<br>1 日 | 105.11 | 1,000,000  | 105,110,547.95   |
| 240312 | 24 进出 12 | 2025 年 7 月<br>1 日 | 101.30 | 900,000    | 91,168,224.66    |
| 240315 | 24 进出 15 | 2025 年 7 月<br>1 日 | 102.07 | 500,000    | 51,033,767.12    |
| 240315 | 24 进出 15 | 2025 年 7 月<br>1 日 | 102.07 | 1,000,000  | 102,067,534.25   |
| 240403 | 24 农发 03 | 2025 年 7 月<br>1 日 | 101.56 | 646,000    | 65,610,804.17    |
| 250403 | 25 农发 03 | 2025 年 7 月<br>1 日 | 99.99  | 225,000    | 22,498,397.26    |
| 合计     |          |                   |        | 11,559,000 | 1,217,233,028.29 |

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

本基金为债券型基金，其预期的风险及预期的收益水平低于股票型基金和混合型基金，高于货币市场基金。本基金投资的金融工具主要为债券投资。本基金在日常经营活动中面临的与这些净值波动率的前提下，力争长期内实现超越业绩比较基准的投资回报。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。本基金在谨慎控制组合净值波动率的前提下，力争长期内实现超越业绩比较基准的投资回报。

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人建立了董事会、监事会、管理层、合规与风险管理委员会、督察长、合规监察稽核部、风险管理部与部门风险合规员各负其责的多层次的风险管理体系，形成高效运转、

有效制衡的监督约束机制，保证风险管理的贯彻执行。本基金的基金管理人在董事会下设立风险控制委员会，负责制订公司的风险管理政策，颁布统一的风险定义和风险评估标准；在管理层层面设立合规与风险管理委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由合规监察稽核部和风险管理部负责，协调并与各部门合作完成风险管理各项工作。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。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，通过特定的风险量化指标、模型，形成常规的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在经中国人民银行和中国证券监督管理委员会所批准的具有基金托管资格和基金代销资格的银行，并根据本基金的基金管理人管理交易对手的经验进行筛选，因而与这些银行存款相关的信用风险不重大。本基金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；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。

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

#### 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。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人于开放期内每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》且于基金开放期内按照《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理,通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金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的证券不得超过该证券的 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)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市,其余亦可在银行间同业市场交易,部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外,本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求,其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

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

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

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施,本基金在本报告期内流动性情况良好。

#### 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的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对于未来现金流影响的风险。

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

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2025 年 6 月 30 日   | 1 年以内            | 1-5 年             | 5 年以上          | 不计息         | 合计               |
|--------------------------|------------------|-------------------|----------------|-------------|------------------|
| 资产                       |                  |                   |                |             |                  |
| 货币资金                     | 4,404,255.95     | -                 | -              | -           | 4,404,255.95     |
| 结算备付金                    | 7,229,753.05     | -                 | -              | -           | 7,229,753.05     |
| 存出保证金                    | 959.30           | -                 | -              | 573,183.00  | 574,142.30       |
| 交易性金融资产                  | 395,488,017.80   | 1,929,951,410.77  | 840,546,670.16 | -           | 3,165,986,098.73 |
| 资产总计                     | 407,122,986.10   | 1,929,951,410.77  | 840,546,670.16 | 573,183.00  | 3,178,194,250.03 |
| 负债                       |                  |                   |                |             |                  |
| 应付管理人报酬                  | -                | -                 | -              | 526,384.58  | 526,384.58       |
| 应付托管费                    | -                | -                 | -              | 175,461.55  | 175,461.55       |
| 卖出回购金融资产款                | 1,040,367,081.53 | -                 | -              | -           | 1,040,367,081.53 |
| 其他负债                     | -                | -                 | -              | 149,887.41  | 149,887.41       |
| 负债总计                     | 1,040,367,081.53 | -                 | -              | 851,733.54  | 1,041,218,815.07 |
| 利率敏感度缺口                  | -633,244,095.43  | -1,929,951,410.77 | 840,546,670.16 | -278,550.54 | 2,136,975,434.96 |
| 上年度末<br>2024 年 12 月 31 日 | 1 年以内            | 1-5 年             | 5 年以上          | 不计息         | 合计               |
| 资产                       |                  |                   |                |             |                  |
| 货币资金                     | 4,899,673.14     | -                 | -              | -           | 4,899,673.14     |
| 结算备付金                    | 7,312,342.82     | -                 | -              | -           | 7,312,342.82     |
| 交易性金融资产                  | 192,794,926.02   | 2,202,770,378.46  | 514,839,931.52 | -           | 2,910,405,236.00 |
| 资产总计                     | 205,006,941.98   | 2,202,770,378.46  | 514,839,931.52 | -           | 2,922,617,251.96 |
| 负债                       |                  |                   |                |             |                  |
| 应付管理人报酬                  | -                | -                 | -              | 538,514.00  | 538,514.00       |
| 应付托管费                    | -                | -                 | -              | 179,504.67  | 179,504.67       |
| 卖出回购金融资产款                | 790,302,247.34   | -                 | -              | -           | 790,302,247.34   |
| 应交税费                     | -                | -                 | -              | 17,638.37   | 17,638.37        |



|         |                               |    |                |             |                  |
|---------|-------------------------------|----|----------------|-------------|------------------|
| 其他负债    | -                             | -  | -              | 98,962.82   | 98,962.82        |
| 负债总计    | 790,302,247.34                | -  | -              | 834,619.86  | 791,136,867.20   |
| 利率敏感度缺口 | -2,202,770,378.585,295,305.36 | 46 | 514,839,931.52 | -834,619.86 | 2,131,480,384.76 |

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

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（2025 年 6 月 30 日）        | 上年度末（2024 年 12 月 31 日） |  |
|    | 市场利率下降 25 个基点      | 30,169,893.18               | 20,988,274.43          |  |
|    | 市场利率上升 25 个基点      | -29,521,768.35              | -20,529,502.42         |  |

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

6.4.14 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>2025 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2024 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------------------|--------------------------|
| 第一层次          | –                      | –                        |
| 第二层次          | 3,165,986,098.73       | 2,910,405,236.00         |
| 第三层次          | –                      | –                        |
| 合计            | 3,165,986,098.73       | 2,910,405,236.00         |

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。<br>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

|                                    |
|------------------------------------|
| 本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。 |
|------------------------------------|

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

|                                                                      |
|----------------------------------------------------------------------|
| 本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。 |
|----------------------------------------------------------------------|

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.15.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

6.4.15.2 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。

6.4.15.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2025 年 08 月 27 日经本基金的基金管理人批准。

§ 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<br>(%) |
|----|----|----|------------------|
|----|----|----|------------------|

|   |                   |                  |        |
|---|-------------------|------------------|--------|
| 1 | 权益投资              | -                | -      |
|   | 其中：股票             | -                | -      |
| 2 | 基金投资              | -                | -      |
| 3 | 固定收益投资            | 3,165,986,098.73 | 99.62  |
|   | 其中：债券             | 3,165,986,098.73 | 99.62  |
|   | 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      | 11,634,009.00    | 0.37   |
| 8 | 其他各项资产            | 574,142.30       | 0.02   |
| 9 | 合计                | 3,178,194,250.03 | 100.00 |

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

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

本基金本报告期末未持有股票投资。

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

无。

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      | 401,751,382.29   | 18.80        |
| 2  | 央行票据      | -                | -            |
| 3  | 金融债券      | 2,368,746,698.64 | 110.85       |
|    | 其中：政策性金融债 | 2,368,746,698.64 | 110.85       |
| 4  | 企业债券      | -                | -            |

|    |           |                  |        |
|----|-----------|------------------|--------|
| 5  | 企业短期融资券   | -                | -      |
| 6  | 中期票据      | -                | -      |
| 7  | 可转债（可交换债） | -                | -      |
| 8  | 同业存单      | 395,488,017.80   | 18.51  |
| 9  | 其他        | -                | -      |
| 10 | 合计        | 3,165,986,098.73 | 148.15 |

## 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<br>(张) | 公允价值           | 占基金资产净值比例<br>(%) |
|----|----------|---------------|-----------|----------------|------------------|
| 1  | 240315   | 24 进出 15      | 2,000,000 | 204,135,068.49 | 9.55             |
| 2  | 230407   | 23 农发 07      | 1,600,000 | 165,012,690.41 | 7.72             |
| 3  | 09240422 | 24 农发清发<br>22 | 1,600,000 | 162,818,323.29 | 7.62             |
| 4  | 240210   | 24 国开 10      | 1,500,000 | 157,665,821.92 | 7.38             |
| 5  | 210205   | 21 国开 05      | 1,400,000 | 156,454,679.45 | 7.32             |

## 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

本基金本报告期末未持有权证投资。

## 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

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的国债期货合约进行交易。本基金按照相关法律法规的规定，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析，对国债期货和现货基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，在追求基金资产安全的基础上，力求实现基金资产的中长期稳定增值。

### 7.10.2 本期国债期货投资评价

本基金对国债期货的投资符合基金的投资政策和投资目标，在整体操作上相对谨慎，对基金总体风险影响可控。

7.11 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国进出口银行在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚；国家开发银行在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局北京监管局的处罚；中国建设银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行的处罚。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

报告期内，本基金投资的前十名其他证券的发行主体没有被监管部门立案调查的，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

7.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

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 | 574,142.30 |
| 2  | 应收清算款 | -          |
| 3  | 应收股利  | -          |
| 4  | 应收利息  | -          |
| 5  | 应收申购款 | -          |
| 6  | 其他应收款 | -          |
| 7  | 待摊费用  | -          |
| 8  | 其他    | -          |
| 9  | 合计    | 574,142.30 |

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 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（%） |
| 2        | 1,000,000,569.55 | 2,000,001,139.10 | 100.00    | 0.00  | 0.00      |

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，对下属两级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属两级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

无。

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

无。

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

| 项目          | 持有份额总数        | 持有份额占基金总份额比例 (%) | 发起份额总数        | 发起份额占基金总份额比例 (%) | 发起份额承诺持有期限 |
|-------------|---------------|------------------|---------------|------------------|------------|
| 基金管理人固有资金   | 10,002,139.10 | 0.50             | 10,000,000.00 | 0.50             | 三年         |
| 基金管理人高级管理人员 | —             | —                | —             | —                | —          |
| 基金经理等人员     | —             | —                | —             | —                | —          |
| 基金管理人股东     | —             | —                | —             | —                | —          |
| 其他          | —             | —                | —             | —                | —          |
| 合计          | 10,002,139.10 | 0.50             | 10,000,000.00 | 0.50             | —          |

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

|                                  |                  |
|----------------------------------|------------------|
| 基金合同生效日(2022 年 12 月 21 日) 基金份额总额 | 2,000,001,139.10 |
| 本报告期期初基金份额总额                     | 2,000,001,139.10 |
| 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                     | 2,000,001,139.10 |

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本报告期内本基金管理人重大人事变动如下：

无。

2、本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动如下：

无。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金财产、基金托管业务的诉讼。报告期内基金管理人无涉及本基金财产的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内无基金投资策略的改变。

### 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改聘为基金审计的会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内无管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内无托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用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 (%) |    |
| 国泰君安 | 2      | -    | -                | -         | -              | -  |
| 国泰海通 | 2      | -    | -                | -         | -              | -  |

注：1、选择证券公司参与证券交易的标准：

基金管理人负责选择证券公司，租用证券公司交易单元进行证券投资，或委托证券公司办理证券投资，选择标准为：

- （1）财务状况良好，经营行为规范，合规风控能力较强，内部管理规范，具备健全的内控制度；
- （2）提供研究服务的证券公司应当具备较好的研究能力和行业分析能力，有专门的研究服务团队，提供高质量的研究报告和较为全面的投研服务与支持（被动股票型基金不适用）；
- （3）交易服务能力较强，具备证券交易所需的高效、安全的通讯条件，满足基金进行证券交易或结算的需要。

2、选择证券公司参与证券交易的程序：

（1）候选证券公司的尽职调查

根据证券公司选择标准及相关内控制度要求，对证券公司进行甄选并对其开展尽职调查。

（2）候选证券公司的准入评估

对候选证券公司的财务状况、经营行为、合规风控能力、交易、研究等服务能力进行综合评估，并经公司相关内部审批程序后完成证券公司准入。

（3）候选证券公司的审批程序

依据各候选证券公司的综合评估结果，择优选出拟新增证券公司，公司领导对新增证券公司综合评估的结果进行审核，并签署审批意见。

（4）协议签署及通知托管人

基金管理人与入选的证券公司签订相关协议，并通知基金托管人。

3、报告期内基金使用证券公司交易单元的变更情况：

新增交易单元的证券公司：无。

撤销交易单元的证券公司：无。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 |                 | 债券回购交易 |                   | 权证交易 |                 |
|------|------|-----------------|--------|-------------------|------|-----------------|
|      | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例(%) | 成交金额   | 占当期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(%) |



|      |              |        |   |   |   |   |
|------|--------------|--------|---|---|---|---|
| 国泰君安 | 4,700,939.00 | 100.00 | - | - | - | - |
| 国泰海通 | -            | -      | - | - | - | - |

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  | 华安鼎津一年定期开放债券型发起式证券投资基金 2024 年第 4 季度报告    | 中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2025 年 1 月 22 日 |
| 2  | 华安基金管理有限公司旗下部分基金 2024 年第 4 季度报告的提示性公告    | 中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2025 年 1 月 22 日 |
| 3  | 华安基金管理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（2024 年度） | 中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2025 年 3 月 29 日 |
| 4  | 华安鼎津一年定期开放债券型发起式证券投资基金 2024 年年度报告        | 中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2025 年 3 月 31 日 |
| 5  | 华安基金管理有限公司旗下部分基金 2024 年年度报告的提示性公告        | 中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2025 年 3 月 31 日 |
| 6  | 华安鼎津一年定期开放债券型发起式证券投资基金 2025 年第 1 季度报告    | 中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2025 年 4 月 22 日 |
| 7  | 华安基金管理有限公司旗下部分基金 2025 年第 1 季度报告的提示性公告    | 中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站 | 2025 年 4 月 22 日 |

注：前款所涉重大事件已作为临时报告在指定媒介上披露。

§ 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              | 20250101~20250630       | 1,989,999,000.00 | 0.00 | 0.00 | 1,989,999,000.00 | 99.50   |
| 产品特有风险                                                                       |                |                         |                  |      |      |                  |         |
| 本基金报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情形。如该单一投资者大额赎回将可能导致基金份额净值波动风险、基金流动性风险等特定风险。 |                |                         |                  |      |      |                  |         |

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、《华安鼎津一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》
- 2、《华安鼎津一年定期开放债券型发起式证券投资基金招募说明书》
- 3、《华安鼎津一年定期开放债券型发起式证券投资基金托管协议》
- 4、中国证监会批准华安鼎津一年定期开放债券型发起式证券投资基金设立的文件；
- 5、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告原件；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
- 7、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 8、华安基金管理有限公司开放式基金业务规则；

### 12.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所，并登载于基金管理人互联网站 <http://www.huaan.com.cn>。

### 12.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站查阅，或在营业时间内至基金管理人或基金托管人的住所免费查阅。

华安基金管理有限公司

2025 年 8 月 30 日