

# 明亚久安 90 天持有期债券型证券投资基金 2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：明亚基金管理有限责任公司

基金托管人：招商证券股份有限公司

送出日期：2024 年 8 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及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责任。

基金托管人招商证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 8 月 17 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 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>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	13
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>13</b>
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	16
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>38</b>
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	39
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	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	39
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	40

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 .....	40
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 .....	40
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 .....	40
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	40
7.11 投资组合报告附注 .....	40
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>41</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	41
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	42
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 .....	42
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>42</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>43</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	43
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 .....	43
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	43
10.4 基金投资策略的改变 .....	43
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	43
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 .....	43
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	44
10.8 其他重大事件 .....	45
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>45</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 .....	45
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	46
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>46</b>
12.1 备查文件目录 .....	46
12.2 存放地点 .....	46
12.3 查阅方式 .....	47

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	明亚久安 90 天持有期债券型证券投资基金	
基金简称	明亚久安 90 天持有期债券型	
基金主代码	019568	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023 年 10 月 24 日	
基金管理人	明亚基金管理有限责任公司	
基金托管人	招商证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	55,542,055.39 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	明亚久安 90 天持有期债券 A	明亚久安 90 天持有期债券 C
下属分级基金的交易代码	019568	019569
报告期末下属分级基金的份额总额	55,388,862.71 份	153,192.68 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险并保持资产流动性的基础上，通过积极主动的投资管理，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	1、资产配置策略；2、债券投资策略：（1）类属配置策略（2）久期策略（3）期限结构配置策略（4）信用债投资策略；3、国债期货交易策略；4、杠杆投资策略；5、信用衍生品投资策略；6、资产支持证券投资策略。
业绩比较基准	中债综合全价(总值)指数收益率*90%+一年定期存款利率(税后)*10%。
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期收益和风险高于货币市场基金，但低于股票型基金和混合型基金。

### 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		明亚基金管理有限责任公司	招商证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吴建炜	韩鑫普
	联系电话	0755-23626585	0755-82943666

	电子邮箱	compliance@mingyafunds.com	tgb@cmschina.com.cn
客户服务电话		4008-785-795	95565
传真		0755-23626574	0755-82960794
注册地址		深圳市前海深港合作区南山街道前海大道前海嘉里商务中心四期 T1 写字楼 1804、1803B	深圳市福田区福田街道福华一路 111 号
办公地址		深圳市前海深港合作区南山街道前海大道前海嘉里商务中心四期 T1 写字楼 1804、1803B	深圳市福田区福田街道福华一路 111 号
邮政编码		518000	518000
法定代表人		丁玥	霍达

## 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
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.mingyafunds.com
基金中期报告备置地点	深圳市前海深港合作区南山街道前海大道前海嘉里商务中心四期 T1 写字楼 1804、1803B

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	明亚基金管理有限责任公司	深圳市前海深港合作区南山街道前海大道前海嘉里商务中心四期 T1 写字楼 1804、1803B

## § 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	报告期(2024年1月1日-2024年6月30日)
-----------	---------------------------

据和指标	明亚久安 90 天持有期债券 A	明亚久安 90 天持有期债券 C
本期已实现收益	3,622,822.45	5,138.38
本期利润	1,859,622.70	5,036.57
加权平均基金份额本期利润	0.0449	0.0353
本期加权平均净值利润率	2.82%	1.36%
本期基金份额净值增长率	155.33%	160.35%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024年6月30日)	
期末可供分配利润	85,971,692.62	245,435.11
期末可供分配基金份额利润	1.5521	1.6021
期末基金资产净值	141,360,555.33	398,627.79
期末基金份额净值	2.5521	2.6021
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	159.34%	164.34%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、对期末可供分配利润，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、以上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（例如基金申购赎回费、基金转换费等），计入费用后实际利润水平要低于所列数字。”

### 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

明亚久安 90 天持有期债券 A

阶段	份额净值增长	份额净值增长率标	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差	①—③	②—④
----	--------	----------	------------	--------------	-----	-----

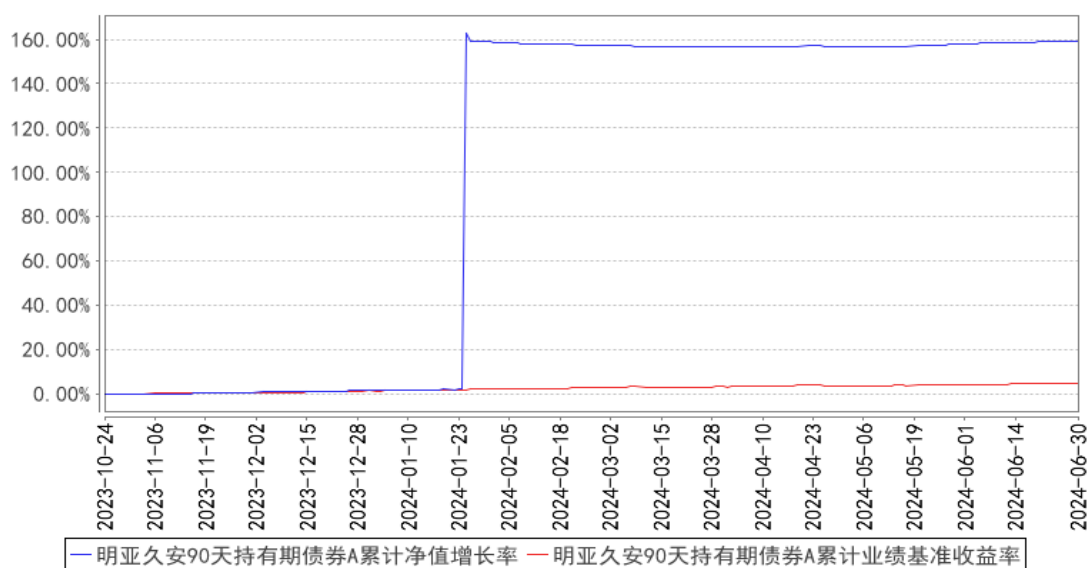
	率①	准差②		④		
过去一个月	0.53%	0.02%	0.79%	0.03%	-0.26%	-0.01%
过去三个月	1.05%	0.04%	1.60%	0.06%	-0.55%	-0.02%
过去六个月	155.33%	14.32%	3.45%	0.06%	151.88%	14.26%
自基金合同生效起至今	159.34%	12.02%	4.91%	0.05%	154.43%	11.97%

明亚久安 90 天持有期债券 C

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	0.53%	0.02%	0.79%	0.03%	-0.26%	-0.01%
过去三个月	1.02%	0.03%	1.60%	0.06%	-0.58%	-0.03%
过去六个月	160.35%	14.81%	3.45%	0.06%	156.90%	14.75%
自基金合同生效起至今	164.34%	12.42%	4.91%	0.05%	159.43%	12.37%

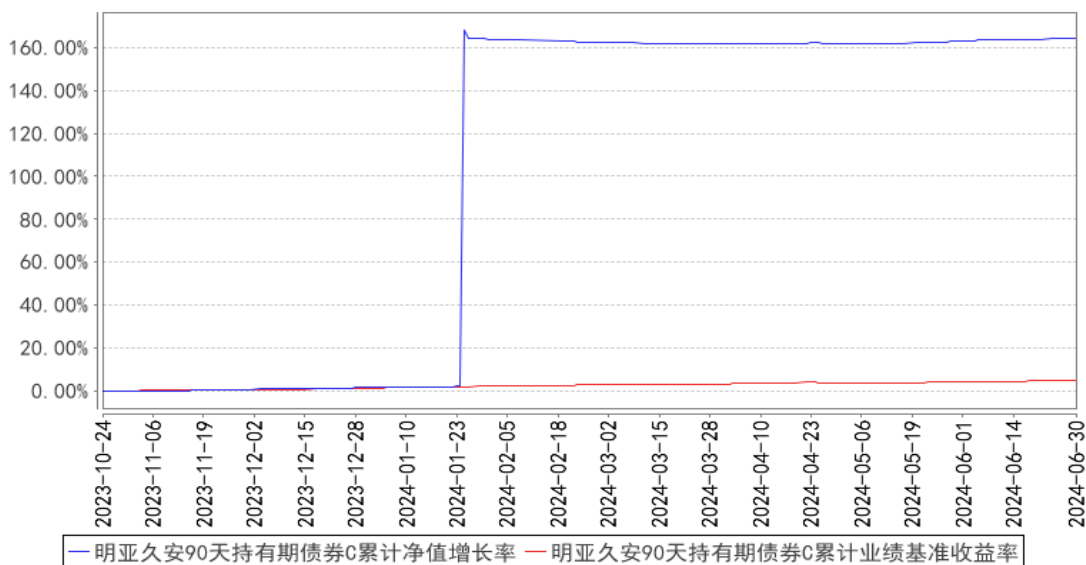
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

明亚久安90天持有期债券A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





明亚久安90天持有期债券C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

基金管理人：明亚基金管理有限责任公司于 2019 年 2 月 11 日获得中国证监会核准设立，2019 年 11 月 18 日取得中华人民共和国经营证券期货业务许可证，实缴资本 10980 万元人民币，注册地为深圳前海。明亚基金管理有限责任公司目前管理明亚价值长青混合型证券投资基金以及明亚中证 1000 指数增强型证券投资基金。明亚基金管理有限责任公司股东均为资产管理业专业人士，核心管理团队拥有二十多年的管理经验，将“基本面研究”和“量化策略”有效结合，秉持为投资者创造价值的坚定信念，致力于为投资者的长期利益服务。

#### 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		
何明	基金经理、研究部总监	2023 年 10 月 24 日	-	23 年	武汉大学国际金融硕士、英国巴斯大学 MBA，曾任国投瑞银基金管理有限公司研究部研究员、研究部总监、基金经理，2020 年 7 月加入明亚基金，现任研究部总监、权益投资部基金经理。
赵鑫岱	基金经理	2023 年 12 月 8 日	-	14 年	北京理工大学硕士，曾任职于北京银行股份有限公司、国海证券股份有限公司、万

					家基金管理有限公司、太平洋证券资产管理部、浦银安盛基金管理有限公司、中融基金管理有限公司、格林基金管理有限公司、大同证券上海资产管理分公司，2023 年 3 月加入于明亚基金，现任固收投资部基金经理。
--	--	--	--	--	--

注：

- 1、本处基金经理的“任职日期”指中国证券投资基金业协会核准任职注册的日期；
- 2、证券从业年限计算标准遵从《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

报告期内，不存在基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的情况。基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》和《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则的规定以及《明亚久安 90 天持有期债券型证券投资基金基金合同》等基金法律文件的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理运用基金财产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司内部相关制度等规定，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合，未发现违反公平交易原则的情况。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，未发现本基金存在异常交易行为，未出现基金参与的交易所公开竞价同日反向交

易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2024 年上半年债券市场整体呈现波澜壮阔的牛市，市场的主题是资产荒以及收益率不断创新低，而且 30 年国债领涨债券市场。

从基本面看，一季度 GDP 增长 5.3%，表现尚可；但是二季度 GDP 增速回落到 4.7%，显著低于市场预期的 5~5.1%，同时，4.7% 的增速是最近 5 个季度的最低值，并拖累上半年整体增速回落至 5%，也低于市场预期。

中国经济当前的一个特征，就是生产强、需求弱。譬如，6 月的社零总额仅仅增长 2%，其中，商品零售总额同比增速为 0%，餐饮服务勉强增长 5.4%。需求走弱的原因较多，其中很重要的一个原因是多数城市的房价持续调整，使得居民感受到资产负债表的受损，而由于房价表现不好和权益市场表现欠佳，居民当下更愿意去提前偿还房贷，而不是去消费。现在出现了居民存款增加、消费走弱的情形，即居民都愿意存款而不愿意消费，这可能是出于对未来经济不确定性的考虑。

本基金在年初建仓，并在上半年不断提高组合仓位，结合经济基本面和债券不同品种之间的信用利差，依旧以利率债为底仓和主要配置，适当增加配置高等级信用债，组合久期适中，获取息票和债券的资本利得。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，明亚久安 90 天持有期债券 A 类份额净值增长率为 155.33%，业绩比较基准收益率为 3.45%；明亚久安 90 天持有期债券 C 类份额净值增长率为 160.35%，业绩比较基准收益率为 3.45%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们对债券市场仍保持乐观，当然也要观察政策的一些扰动。在地产行业尚未完全出清，海外需求可能下滑的背景下，债券仍然是比较好的配置选择之一。

利率债仍然是我们投资的底仓和主力品种之一。流动性相对宽松的政策背景下，同时考虑到地产销售仍旧看不到拐点出现的迹象，银行尤其是很多农商行在资产端可以选择的品种不多，利率债仍然是优质资产，预计国企信用债也同样会有好的表现。

本基金将持续根据经济基本面、流动性等多种因素，合理控制组合仓位，根据市场变动而调节组合久期、杠杆等，争取为持有人获取较为稳定的投资收益。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人按照《企业会计准则》、中国证券监督管理委员会相关规定、中国证券投资基金基金业协会相关指引和基金合同的约定，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。

本基金管理人由总经理和投资部门、研究部、交易部、基金运营部、合规风控部负责人组成了估值委员会，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。估值委员会成员均为公司各部门人员，均具有基金从业资格、专业胜任能力和相关工作经历。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值价格的最终决策。

本基金本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金收益分配原则：本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资，且基金份额持有人可对 A 类、C 类基金份额分别选择不同的分红方式；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金收益分配后任一类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的任一类基金份额净值减去该类别的每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

本基金本报告期内共实施了 1 次利润分配：

于 2024 年 5 月 20 日（权益登记日、除息日）对明亚久安 90 天持有期债券 A 每 10 份基金份额派发红利 0.409 元，对明亚久安 90 天持有期债券 C 每 10 份基金份额派发红利 0.409 元。

#### 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，本基金存在连续二十个工作日基金资产净值持续低于 5000 万元的情形，不存在连续六十个工作日基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元的情形。

## § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，招商证券股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

### 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

本托管人复核审查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。

## § 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：明亚久安 90 天持有期债券型证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	6,263,431.16	3,450,147.09
结算备付金		10,716,392.17	26,226,492.16
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	124,860,233.30	173,596,677.56
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		124,860,233.30	173,596,677.56
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	-	-205.29
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		210.00	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		141,840,266.63	203,273,111.52
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2023 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		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		25,957.48	51,537.64
应付托管费		4,326.26	8,589.61

应付销售服务费		75.38	1.86
应付投资顾问费		-	-
应交税费		3,937.82	14,761.89
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	46,786.57	46,040.00
负债合计		81,083.51	120,931.00
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	55,542,055.39	200,008,198.79
未分配利润	6.4.7.12	86,217,127.73	3,143,981.73
净资产合计		141,759,183.12	203,152,180.52
负债和净资产总计		141,840,266.63	203,273,111.52

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，基金份额总额 55,542,055.39 份，其中明亚久安 90 天持有期债券 A 基金份额净值 2.5521 元，份额总额 55,388,862.71 份；明亚久安 90 天持有期债券 C 基金份额净值 2.6021 元，份额总额 153,192.68 份。

## 6.2 利润表

会计主体：明亚久安 90 天持有期债券型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		2,033,242.36
1. 利息收入		148,186.95
其中：存款利息收入	6.4.7.13	120,480.30
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		27,706.65
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		3,648,356.97
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.15	3,648,356.97
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-
股利收益	6.4.7.19	-
其他投资收益		-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	-1,763,301.56
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-

5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6. 4. 7. 21	-
<b>减：二、营业总支出</b>		168, 583. 09
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	96, 510. 29
其中：暂估管理人报酬		-
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	16, 085. 07
3. 销售服务费	6. 4. 10. 2. 3	364. 12
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		1, 985. 03
其中：卖出回购金融资产支出		1, 985. 03
6. 信用减值损失	6. 4. 7. 22	-
7. 税金及附加		1, 921. 66
8. 其他费用	6. 4. 7. 23	51, 716. 92
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		1, 864, 659. 27
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		1, 864, 659. 27
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-
<b>六、综合收益总额</b>		1, 864, 659. 27

### 6.3 净资产变动表

会计主体：明亚久安 90 天持有期债券型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 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	200, 008, 198. 79	-	3, 143, 981. 73	203, 152, 180. 52
二、本期期初净资产	200, 008, 198. 79	-	3, 143, 981. 73	203, 152, 180. 52
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-144, 466, 143. 4 0	-	83, 073, 146. 00	-61, 392, 997. 40
（一）、综合收益总额	-	-	1, 864, 659. 27	1, 864, 659. 27
（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）	-144, 466, 143. 4 0	-	82, 203, 728. 22	-62, 262, 415. 18
其中：1. 基金申购款	55, 987, 454. 07	-	87, 064, 604. 18	143, 052, 058. 25
2. 基金赎回款	-200, 453, 597. 4	-	-4, 860, 875. 96	-205, 314, 473. 43

	7			
(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）	-	-	-995,241.49	-995,241.49
四、本期期末净资产	55,542,055.39	-	86,217,127.73	141,759,183.12

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>丁玥</u>	<u>屠建宗</u>	<u>李晓妹</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

明亚久安 90 天持有期债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2023]2029 号《关于准予明亚久安 90 天持有期债券型证券投资基金注册的批复》核准,由明亚基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《明亚久安 90 天持有期债券型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,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 200,008,198.53 元,已经上会会计师事务所(特殊普通合伙)上会师报验字(2023)第 13293 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《明亚久安 90 天持有期债券型证券投资基金基金合同》于 2023 年 10 月 24 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 200,008,198.79 份基金份额,其中认购资金利息折合 0.26 份基金份额。本基金的基金管理人为明亚基金管理有限责任公司,基金托管人为招商证券股份有限公司。

本基金根据认购/申购费用与销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取前端认购/申购费用,且不从本类别基金资产净值中计提销售服务费的基金份额,称为 A 类基金份额;从本类别基金资产中计提销售服务费,且不收取认购/申购费用的基金份额,称为 C 类基金份额。本基金 A 类和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同,本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值,计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。根据《中华人民共和国证券投资基金



法》和《明亚久安 90 天持有期债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的债券（包括国债、金融债、地方政府债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、政府支持机构债券、政府支持债券、次级债、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、定期存款以及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具、国债期货、信用衍生品以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

本基金不投资于股票等权益类资产，也不投资于可转换债券（可分离交易可转债的纯债部分除外）、可交换债券。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券。现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则-基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度和中期报告>》、其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 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 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 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

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、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]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》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股票、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，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(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。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印

花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(5) 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 2024 年 6 月 30 日
活期存款	5,289,991.32
等于：本金	5,286,953.17
加：应计利息	3,038.15
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	973,439.84
等于：本金	973,290.75
加：应计利息	149.09
减：坏账准备	-
合计	6,263,431.16

注：本基金持有的其他存款为存放在证券经纪商资金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 2024 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	15,947,464.11	202,102.06	16,278,162.06	128,595.89
	银行间市场	107,571,517.89	650,171.24	108,582,071.24	360,382.11
	合计	123,518,982.00	852,273.30	124,860,233.30	488,978.00
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	

合计	123,518,982.00	852,273.30	124,860,233.30	488,978.00
----	----------------	------------	----------------	------------

#### 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

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

##### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

本基金本报告期末未持有期货合约。

##### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无各项买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

##### 6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

#### 6.4.7.5 债权投资

##### 6.4.7.5.1 债权投资情况

本基金本报告期末无债权投资。

##### 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末无债权投资。

#### 6.4.7.6 其他债权投资

##### 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

本基金本报告期末无其他债权投资。

##### 6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末无其他债权投资。

#### 6.4.7.7 其他权益工具投资

##### 6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

本基金本报告期末无其他权益工具投资。

##### 6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

本基金本报告期末无其他权益工具投资。

## 6.4.7.8 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

## 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 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	4,469.65
其中：交易所市场	-
银行间市场	4,469.65
应付利息	-
预提审计费	8,453.90
预提信息披露费	24,863.02
预提账户维护费	9,000.00
合计	46,786.57

## 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

## 明亚久安 90 天持有期债券 A

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	199,997,715.77	199,997,715.77
本期申购	55,646,378.82	55,646,378.82
本期赎回（以“-”号填列）	-200,255,231.88	-200,255,231.88
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	55,388,862.71	55,388,862.71

## 明亚久安 90 天持有期债券 C

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	10,483.02	10,483.02
本期申购	341,075.25	341,075.25
本期赎回（以“-”号填列）	-198,365.59	-198,365.59
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	153,192.68	153,192.68
-----	------------	------------

#### 6.4.7.11 其他综合收益

无。

#### 6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

明亚久安 90 天持有期债券 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	891,659.45	2,252,161.58	3,143,821.03
本期期初	891,659.45	2,252,161.58	3,143,821.03
本期利润	3,622,822.45	-1,763,199.75	1,859,622.70
本期基金份额交易产生的变动数	415,558,283.78	-333,604,728.52	81,953,555.26
其中：基金申购款	421,667,712.74	-335,154,319.64	86,513,393.10
基金赎回款	-6,109,428.96	1,549,591.12	-4,559,837.84
本期已分配利润	-985,306.37	-	-985,306.37
本期末	419,087,459.31	-333,115,766.69	85,971,692.62

明亚久安 90 天持有期债券 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	42.72	117.98	160.70
本期期初	42.72	117.98	160.70
本期利润	5,138.38	-101.81	5,036.57
本期基金份额交易产生的变动数	1,189,795.32	-939,622.36	250,172.96
其中：基金申购款	2,647,613.63	-2,096,402.55	551,211.08
基金赎回款	-1,457,818.31	1,156,780.19	-301,038.12
本期已分配利润	-9,935.12	-	-9,935.12
本期末	1,185,041.30	-939,606.19	245,435.11

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	64,367.70
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	5,604.81
结算备付金利息收入	50,507.79
其他	-
合计	120,480.30

#### 6.4.7.14 股票投资收益

##### 6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

本基金本报告期内无股票投资。

#### 6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金本报告期内无股票投资。

#### 6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期内无股票投资。

#### 6.4.7.15 债券投资收益

##### 6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	747,383.47
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	2,900,973.50
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	3,648,356.97

##### 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	292,231,561.40
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	285,082,389.61
减：应计利息总额	4,237,295.52
减：交易费用	10,902.77
买卖债券差价收入	2,900,973.50

##### 6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

##### 6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

#### 6.4.7.16 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

##### 6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

## 6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

## 6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

## 6.4.7.17 贵金属投资收益

## 6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

## 6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

## 6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

## 6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

## 6.4.7.18 衍生工具收益

## 6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

## 6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

## 6.4.7.19 股利收益

无。

## 6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
1. 交易性金融资产	-1,763,301.56
股票投资	-
债券投资	-1,763,301.56
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动	-



产生的预估增值税	
合计	-1,763,301.56

#### 6.4.7.21 其他收入

无。

#### 6.4.7.22 信用减值损失

无。

#### 6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
审计费用	8,453.90
信息披露费	24,863.02
证券出借违约金	-
账户维护费	18,400.00
合计	51,716.92

#### 6.4.7.24 分部报告

无。

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

#### 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

无

##### 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
明亚基金管理有限责任公司（“明亚基金”）	基金管理人
招商证券股份有限公司（“招商证券”）	基金托管人

注：

以下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

无

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 2024年1月1日至2024年6月30日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例 (%)
招商证券	223,643,137.72	100.00

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 (%)
招商证券	284,469,000.00	100.00

6.4.10.1.4 权证交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
招商证券	7,825.90	100.00	-	-

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 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	96,510.29
其中：应支付销售机构的客户维护 费	12,798.50
应支付基金管理人的净管理费	83,711.79

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.30% 年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支

付。其计算公式如下：日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.30%/当年天数。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	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	16,085.07

注：付基金托管人招商证券的托管费按前一日基金资产净值的 0.05%的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值×0.05%/当年天数。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	明亚久安 90 天持有期 债券 A	明亚久安 90 天持有期 债券 C	合计
明亚直销	-	0.72	0.72
合计	-	0.72	0.72

注：支付给基金销售机构的销售服务费按 C 类基金份额前一日基金资产净值 0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给明亚基金管理有限责任公司，再由明亚基金管理有限责任公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：日 C 类基金份额销售服务费=前一日 C 类基金份额基金资产净值×0.20%/当年天数。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

#### 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自有资金投资本基金的情况

本基金本报告期内基金管理人未运用自有资金投资本基金。

## 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末除管理人以外的其他关联方未投资本基金。

## 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期	
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
招商证券	5,286,953.17	64,367.70

## 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

## 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

## 6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

明亚久安 90 天持有期债券 A								
序号	权益 登记日	除息日		每 10 份基 金份额分 红数	现金形 式 发放总 额	再投资形 式 发放总额	本期利 润分配 合计	备注
		场内	场外					
1	2024 年 5 月 20 日	-	2024 年 5 月 20 日	0.4090	978,763.3 4	6,543.03	985,306.3 7	-
合计	-	-	-	0.4090	978,763.3 4	6,543.03	985,306.3 7	-
明亚久安 90 天持有期债券 C								
序号	权益 登记日	除息日		每 10 份基 金份额分 红数	现金形 式 发放总 额	再投资形 式 发放总额	本期利 润分配 合计	备注
		场内	场外					
1	2024 年 5 月 20 日	-	2024 年 5 月 20 日	0.4090	8,037.88	1,897.24	9,935.12	-
合计	-	-	-	0.4090	8,037.88	1,897.24	9,935.12	-

## 6.4.12 期末（2024 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

无。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无因交易所市场债券正回购交易而抵押的债券。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险等。基金成立以来，本基金管理人坚持一切从规范运作、防范风险、保护基金持有人利益出发，依照公司内部控制的整体要求，致力于内控机制的建立和完善，公司内部管理制度及业务规范流程的制定和完善，加强内部风险的控制与有效防范，以保证各项法规和管理制度的落实，保证基金合同得到严格履行。

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为债券型基金，其预期收益和风险高于货币市场基金，但低于股票型基金和混合型基金。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的债券（包括国债、金融债、地方政府债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、政府支持机构债券、政府支持债券、次级债、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、定期存款以及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具、国债期货、信用衍生品以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金不投资于股票等权益类资产，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。

本基金对于每份基金份额设定锁定持有期，锁定持有期为 90 天。基金份额在锁定持有期内不办理赎回及转换转出业务。自锁定持有期结束后可以办理赎回或转换转出业务。因此基金份额持有人将面临锁定持有期内无法赎回或转换转出基金份额的风险。

本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人秉承全面风险管理的理念，将风险管理融入业务中，公司风险管理架构由风控

合规委员会、督察长、合规风控部、以及各个业务部门组成。各业务部门负责人为其所在部门的风险管理第一责任人，对本部门业务范围内的风险负有管控和及时报告的义务。员工在其岗位职责范围内承担相应风险管理责任。本基金管理人配备的风险管理人员对投资风险进行独立的监控并及时向管理层汇报。

#### 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。本基金与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对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。

于本报告期末，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和资产支持证券占基金资产净值的比例为 34.43%。

##### 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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	34,054,877.20	48,414,641.09
合计	34,054,877.20	48,414,641.09

注：（1）债券评级取自第三方评级机构的债项评级；

（2）未评级债券包括债券期限在一年以内的国债、政策性金融债、央行票据和部分短期融资券等。

##### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本期末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券。

**6.4.13.2.3 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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	-	9,853,633.33
合计	-	9,853,633.33

注：本基金于本期末未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

**6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
AAA	14,213,109.19	67,730,102.74
AAA 以下	-	9,043,930.14
未评级	76,592,246.91	38,554,370.26
合计	90,805,356.10	115,328,403.14

注：（1）债券评级取自第三方评级机构的债项评级；

（2）未评级债券包括债券期限在一年到五年的国债、政策性金融债、央行票据和部分中期票据等。

**6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

本基金于本期末未持有按长期信用评级列示的资产支持证券。

**6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

本基金于本期末未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

**6.4.13.3 流动性风险**

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

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

### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金组合的流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金主要投资于上市交易的证券，报告期末本基金所持的证券均能及时变现，资产变现能力强。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的 15%。本基金持有的其他资产主要为银行存款等期限短、流动性强的品种。本基金的负债水平也严格按照基金合同及中国证监会相关规定进行管理。

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

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

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。

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、债券投资和买入返售金融资产等。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本	1 个月以内	1-	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
---	--------	----	----------	-------	-------	-----	----



期末 2024年 6月 30日		3 个月					
资产							
货币资金	6,263,431.16	-	-	-	-	-	6,263,431.16
结算备付金	10,716,392.17	-	-	-	-	-	10,716,392.17
交易性金融资产	14,160,915.67	-	40,150,038.03	66,046,444.70	4,502,834.90	-	124,860,233.30
应收申购款	-	-	-	-	-	210.00	210.00
资产总计	31,140,739.00	-	40,150,038.03	66,046,444.70	4,502,834.90	210.00	141,840,266.63
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	25,957.48	25,957.48
应付	-	-	-	-	-	4,326.26	4,326.26

托管费							
应付销售服务费						75.38	75.38
应交税费						3,937.82	3,937.82
其他负债						46,786.57	46,786.57
负债总计						81,083.51	81,083.51
利率敏感度缺口	31,140,739.00		40,150,038.03	66,046,444.70	4,502,834.90	-80,873.51	141,759,183.12
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	3,450,147.09						3,450,147.09

结算备付金	26,226,492.16	-	-	-	-	-	26,226,492.16
交易性金融资产	-	-	58,268,274.42	105,042,347.25	10,286,055.89	-	173,596,677.56
买入返售金融资产	-205.29	-	-	-	-	-	-205.29
资产总计	29,676,433.96	-	58,268,274.42	105,042,347.25	10,286,055.89	-	203,273,111.52
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	51,537.64	51,537.64
应付托管费	-	-	-	-	-	8,589.61	8,589.61
应付销售服务费	-	-	-	-	-	1.86	1.86

应交税费						14,761.89	14,761.89
其他负债						1,040.00	1,040.00
负债总计						75,931.00	75,931.00
利率敏感度缺口	29,676,433.96	58,268,274.42	105,042,347.25	10,286,055.89	-75,931.00	203,197,180.52	

#### 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（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	市场利率下降 25 个基点	-33,042,695.51	656,778.88
	市场利率上升 25 个基点	33,301,827.92	-649,915.97

#### 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。

本基金未持有不以记账本位币计价的资产，因此不存在相应的外汇风险。

#### 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。本基金投资于基金合同和相关法律法规及监管机构允许范围内的投资品种，主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券，所面临的最大其他价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并由本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

本期末本基金未持有交易性权益类投资，因此除市场利率外汇利率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日		上年度末 2023年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	-	-	-	-
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	124,860,233.30	88.08	173,596,677.56	85.45
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	124,860,233.30	88.08	173,596,677.56	85.45

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

本期末本基金未持有交易性权益类资产，因此除市场利率、外汇利率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

#### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

##### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	-	-
第二层次	124,860,233.30	173,596,677.56
第三层次	-	-
合计	124,860,233.30	173,596,677.56

##### 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。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

##### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

2024 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。

##### 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应收款项和其他金融负债，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	124,860,233.30	88.03

	其中：债券	124,860,233.30	88.03
	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	16,979,823.33	11.97
8	其他各项资产	210.00	0.00
9	合计	141,840,266.63	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

本基金本报告期末无股票投资。

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末无港股通投资。

## 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

本基金本报告期末无股票投资。

## 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

本基金本报告期内无股票投资。

### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期内无股票投资。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内无股票投资。

## 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	55,347,995.56	39.04
2	央行票据	-	-
3	金融债券	20,702,986.30	14.60
	其中：政策性金融债	20,702,986.30	14.60
4	企业债券	11,200,086.72	7.90
5	企业短期融资券	9,082,840.33	6.41
6	中期票据	28,526,324.39	20.12
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-

9	其他	-	-
10	合计	124,860,233.30	88.08

## 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	210203	21 国开 03	200,000	20,702,986.30	14.60
2	220004	22 付息国债 04	200,000	20,256,076.50	14.29
3	240005	24 付息国债 05	100,000	10,119,882.19	7.14
4	249921	24 贴现国债 21	100,000	9,954,346.15	7.02
5	249932	24 贴现国债 32	100,000	9,939,615.38	7.01

## 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

本基金本报告期内无资产支持证券投资。

## 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期内无贵金属投资。

## 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

本基金本报告期末无权证投资。

## 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原则，以套期保值为主要目的，适度运用国债期货提高投资组合运作效率。

### 7.10.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 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

本报告期内，本基金投资前十名证券的发行主体没有被中国证监会及其派出机构、证券交易所立案调查，或在报告编制日前一年受到公开谴责、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没有超出基金合同规定的备选股票库。



## 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	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	210.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	210.00

## 7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末无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

本基金本报告期末无股票投资。

## 7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于计算结果四舍五入，分项之和与合计可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

## 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
明亚久安 90 天持有期债券 A	100	553,888.63	54,808,006.34	98.95	580,856.37	1.05
明亚久安 90 天持有期债券 C	153	1,001.26	0.00	0.00	153,192.68	100.00
合计	253	219,533.82	54,808,006.34	98.68	734,049.05	1.32

注：机构投资者/个人投资者持有份额占总份额比例计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额），  
 户均持有的基金份额的合计数=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	明亚久安 90 天持有期债券 A	292.92	0.0005
	明亚久安 90 天持有期债券 C	123.02	0.0803
	合计	415.94	0.0007

注：（1）前述“明亚久安 90 天持有期债券 A”项下，占基金总份额比例，系基金管理人所有从业人员持有明亚久安 90 天持有期债券 A 的份额占明亚久安 90 天持有期债券 A 总份额比例；（2）前述“明亚久安 90 天持有期债券 C”项下，占基金总份额比例，系基金管理人所有从业人员持有明亚久安 90 天持有期债券 C 的份额占明亚久安 90 天持有期债券 C 总份额比例；（3）前述“合计”项下，占基金总份额比例=（基金管理人所有从业人员持有明亚久安 90 天持有期债券 A 的总份额数+基金管理人所有从业人员持有明亚久安 90 天持有期债券 C 的总份额数）/（明亚久安 90 天持有期债券 A 总份额数+明亚久安 90 天持有期债券 C 总份额数）。

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	明亚久安 90 天持有期债券 A	0
	明亚久安 90 天持有期债券 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	明亚久安 90 天持有期债券 A	0
	明亚久安 90 天持有期债券 C	0
	合计	0

注：本基金本报告期末管理人未有高级管理人员、基金投资和研究部门负责人、基金经理持有本基金份额。

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	明亚久安 90 天持有期债券 A	明亚久安 90 天持有期债券 C
基金合同生效日 （2023 年 10 月 24 日）基金份额总额	199,997,715.77	10,483.02
本报告期期初基金份额总额	199,997,715.77	10,483.02

本报告期基金总申购份额	55,646,378.82	341,075.25
减：本报告期基金总赎回份额	200,255,231.88	198,365.59
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	55,388,862.71	153,192.68

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未进行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

无

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、公募基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内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

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

### 10.6 管理人、托管人及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

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	明亚基金管理有限责任公司

受到稽查或处罚等措施的时间	2024 年 4 月 9 日
采取稽查或处罚等措施的机构	深圳证监局
受到的具体措施类型	采取责令改正并暂停新增私募资管产品备案 3 个月的行政监管措施
受到稽查或处罚等措施的原因	单一资管计划产品由委托人推荐投资顾问，根据投资顾问的建议进行投资，存在“由委托人或其指定第三方下达投资指令或者提供具体投资标的等实质性投资建议”的情形；集合资产管理计划 B 成立于 2021 年 12 月，委托人为两只私募证券投资基金。经核查，两只私募基金穿透后的资金来源方与资管计划投资债券的发行人具有关联关系，基金公司未对两只私募基金的真实资金来源情况予以关注；未按时向监管部门报备高管变更。
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	目前公司已按监管要求完成整改
其他	-

### 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，托管人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

## 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 (%)	
招商证券	2	-	-	7,825.90	100.00	-

注：1. 本基金采用券商交易结算模式，可豁免单个券商的交易佣金比例限制。

2. 本基金管理人负责选择证券经纪商，使用其交易单元作为本基金的交易单元。基金证券经纪商的选择标准主要包括公司的财务状况、经营状况、研究实力、信息服务的全面性和及时性。

## 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(%)
招商证券	223,643,137.72	100.00	284,469,000.00	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	明亚久安 90 天持有期债券型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告	证监会指定网站、规定报刊、公司官网	2024 年 01 月 17 日
2	明亚久安 90 天持有期债券型证券投资基金基金产品资料概要更新更正公告	证监会指定网站	2024 年 01 月 17 日
3	明亚久安 90 天持有期债券型证券投资基金 2023 年第 4 季度报告	证监会指定网站、规定报刊、公司官网	2024 年 01 月 19 日
4	明亚基金管理有限责任公司关于旗下部分基金增加烟台银行股份有限公司为代销机构的公告	公司官网	2024 年 01 月 31 日
5	明亚久安 90 天持有期债券型证券投资基金 2023 年年度报告	证监会指定网站、规定报刊、公司官网	2024 年 03 月 27 日
6	明亚久安 90 天持有期债券型证券投资基金 2024 年第一季度报告	证监会指定网站、规定报刊、公司官网	2024 年 04 月 18 日
7	明亚久安 90 天持有期债券型证券投资基金 2024 年第一次收益分配公告	证监会指定网站、规定报刊、公司官网	2024 年 05 月 16 日
8	明亚久安 90 天持有期债券型证券投资基金基金产品资料概要更新	证监会指定网站、规定报刊、公司官网	2024 年 06 月 27 日

## § 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	20240329-20240630	0.00	11,689,592.02	0.00	11,689,592.02	21.05
	2	20240329-20240630	0.00	27,394,300.79	0.00	27,394,300.79	49.32

	3	20240607-20240630	0.00	15,724,113.53	0.00	15,724,113.53	28.31
产品特有风险							
<p>1、大额赎回风险</p> <p>本基金如果出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金份额总份额的 20%，则面临大额赎回的情况，可能导致：</p> <p>（1）基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险；如果持有基金份额比例达到或超过基金份额总额的 20% 的单一投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定决定部分延期赎回，如果连续 2 个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响；</p> <p>（2）基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，则可能是基金资产净值收到不利影响，影响基金的投资运作和收益水平；</p> <p>（3）因基金净值精度计算问题，或因赎回费收入归基金资产，导致基金净值出现较大波动；</p> <p>（4）基金资产规模过小，可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略；</p> <p>（5）大额赎回导致基金资产规模过小，不能满足存续的条件，基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。</p> <p>2、大额申购风险</p> <p>若投资者大额申购，基金所投资的标的资产未及时准备，导致净值涨幅可能会因此降低。</p>							

## 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、中国证监会准予明亚久安 90 天持有期债券型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《明亚久安 90 天持有期债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《明亚久安 90 天持有期债券型证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、报告期内明亚久安 90 天持有期债券型证券投资基金在规定报刊上披露的各项公告。

### 12.2 存放地点

深圳市前海深港合作区南山街道前海大道前海嘉里商务中心四期 T1 写字楼 1804、1803B

### 12.3 查阅方式

投资者可在营业时间内至基金管理人办公场所或登陆基金管理人网站：[www.mingyafunds.com](http://www.mingyafunds.com) 免费查阅，也可按工本费购买复印件。

投资者对本报告如有疑问，可致电基金管理人全国统一客户服务电话：4008-785-795。

明亚基金管理有限责任公司

2024 年 8 月 28 日