

# 国融中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金

## 2025 年中期报告

2025 年 06 月 30 日

基金管理人:国融基金管理有限公司

基金托管人:浙商银行股份有限公司

送出日期:2025 年 08 月 29 日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人浙商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3月27日起至6月30日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
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	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	17
§7 投资组合报告	42
7.1 期末基金资产组合情况	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	43
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	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	43
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	44
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	44
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	44
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	44
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	44
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	45
7.12 投资组合报告附注	45
§8 基金份额持有人信息	45
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	45
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	46

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	46
§9 开放式基金份额变动 .....	46
§10 重大事件揭示 .....	46
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	46
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	46
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	47
10.4 基金投资策略的改变 .....	47
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	47
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	47
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	47
10.8 其他重大事件 .....	48
§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....	50
11.1 影响投资者决策的其他重要信息 .....	50
§12 备查文件目录 .....	50
12.1 备查文件目录 .....	50
12.2 存放地点 .....	50
12.3 查阅方式 .....	50

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	国融中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金
基金简称	国融中证同业存单AAA指数7天持有期
基金主代码	023257
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2025年03月27日
基金管理人	国融基金管理有限公司
基金托管人	浙商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	171,803,189.95份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过指数化投资，争取在扣除各项费用之前获得与标的指数相似的总回报，追求跟踪偏离度及跟踪误差最小化。
投资策略	本基金为被动式指数基金，采用抽样复制和动态最优化的方法，选取标的指数成份券和备选成份券中流动性较好的同业存单，或选择非成份券作为替代，构造与标的指数风险收益特征相似的资产组合，以实现对标的指数的有效跟踪。
业绩比较基准	中证同业存单AAA指数收益率×95%+银行人民币一年定期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金风险与收益低于股票型基金、偏股混合型基金，高于货币市场基金。 本基金主要投资于标的指数成份券及备选成份券，具有与标的指数相似的风险收益特征。

### 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		国融基金管理有限公司	浙商银行股份有限公司
信息披露	姓名	张圆辉	林彬

露负责人	联系电话	010-68779026	0571-88269636
	电子邮箱	zhangyuanhui@gowinamc.com	zsyhzctgb@czbank.com
客户服务电话		4008190098	95527
传真		010-68779103	0571-88268688
注册地址		上海市虹口区溧阳路735号4幢4210室	杭州市萧山区鸿宁路1788号
办公地址		北京市西城区闹市口大街1号院4号楼2层2D	杭州市拱墅区环城西路76号
邮政编码		100031	310006
法定代表人		侯守法	陈海强（代为履行法定代表人职责）

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.gowinamc.com
基金中期报告备置地点	北京市西城区闹市口大街1号院4号楼2层2D

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	国融基金管理有限公司	北京市西城区闹市口大街1号院4号楼2层2D

## §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03月27日（基金合同生效日） -

	2025年06月30日)
本期已实现收益	930,980.53
本期利润	918,476.13
加权平均基金份额本期利润	0.0042
本期加权平均净值利润率	0.41%
本期基金份额净值增长率	0.40%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	报告期末 (2025年06月30日)
期末可供分配利润	694,861.78
期末可供分配基金份额利润	0.0040
期末基金资产净值	172,498,051.73
期末基金份额净值	1.0040
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	报告期末 (2025年06月30日)
基金份额累计净值增长率	0.40%

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）。表中的"期末"均指本报告期最后一日，即6月30日。

4、本基金合同于2025年3月27日生效，报告期的相关数据和指标按实际存续期计算。

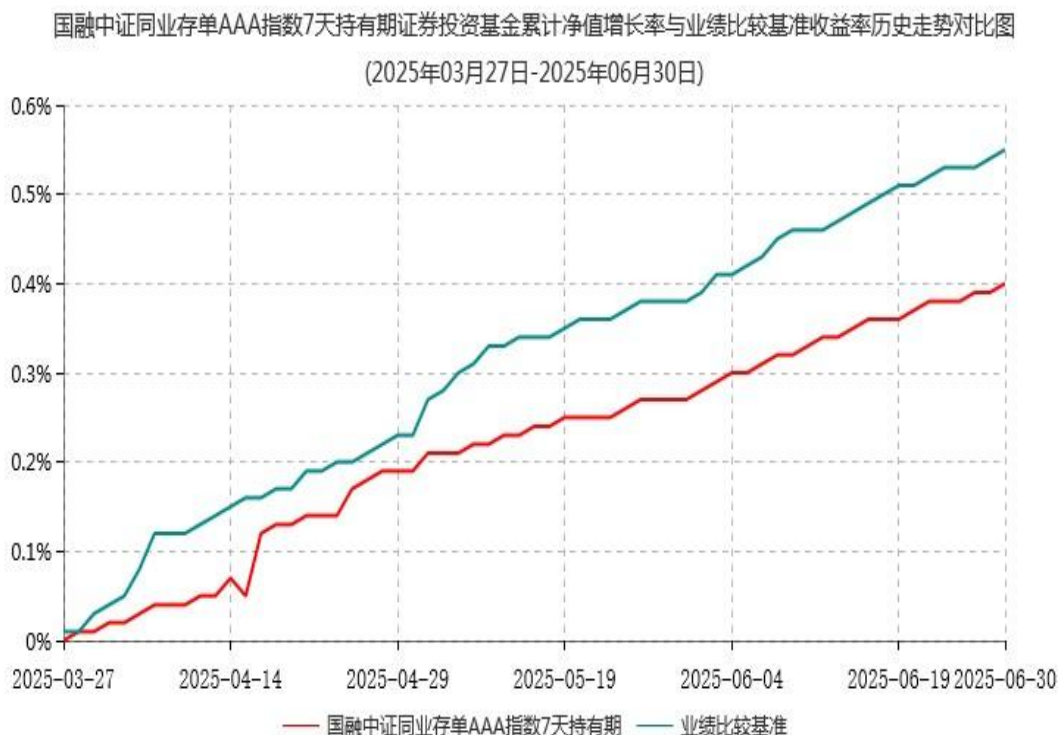
### 3.2 基金净值表现

#### 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	0.12%	0.01%	0.16%	0.01%	-0.04%	0.00%

过去三个月	0.39%	0.01%	0.52%	0.01%	-0.13%	0.00%
自基金合同生效起至今	0.40%	0.01%	0.55%	0.01%	-0.15%	0.00%

### 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



注：1、本基金合同于2025年3月27日生效，自基金合同生效日起到本报告期末不满一年。  
2、根据国融中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金基金合同的规定，本基金自基金合同生效之日起的6个月建仓期内使基金的投资组合比例符合本基金合同第十二部分之“二、投资范围”及“四、投资限制”的有关约定。截至本报告期末，本基金尚处于建仓期。

## §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

国融基金管理有限公司经中国证监会证监许可【2017】821号文批准，于2017年6月20日成立，是国融证券发起的公募基金管理公司。公司注册地上海，总部设在北京。公司于2017年7月17日取得中国证券监督管理委员会核发的《经营证券期货业务许可证》。



截止本报告期末（2025年6月30日），基金管理人共管理10只公开募集证券投资基金，基金规模为27.98亿元。

#### 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		
顾喆彬	本基金的基金经理、基金管理人固收投资部助理总监	2025-03-27	-	11年	顾喆彬先生，澳大利亚阿德莱德大学会计学硕士。具备11年证券从业经验。历任联合信用管理有限公司北京分公司信用评级分析师、研究员，联合资信评估有限公司信用评级分析师。

注：1、基金经理任职日期是基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从《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合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、本基金《基金合同》等法律文件和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，力争为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定，无损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

公平交易程序包括：建立统一的研究平台和公共信息平台，保证各投资组合公平获得投资资讯；公平对待不同投资组合，禁止各投资组合之间进行以利益输送为目的的投资交易活动；在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时，严格执行授权审批程序；实行集中交易制度和公平交易分配制度；建立不同投资组合投资信息的管理及保密制度，保证不同投资组合经理之间的重大非公开投资信息的相互隔离；加强对投资交易行为的监察稽核力度，建立有效的异常交易行为日常监控和分析评估体系等。

本基金管理人对旗下各投资组合的投资交易行为进行监控和分析，对各投资组合不同时间窗口（1日、3日、5日）内的同向交易的溢价金额与溢价率进行T检验，未发现违反公平交易程序的交易。

本报告期内本基金管理人公平交易程序运作良好，旗下各投资组合不存在因不公平交易等导致的利益输送行为，未出现违反公平交易程序的情况。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

为规范投资行为，公平对待投资组合，本基金管理人制定《国融基金管理有限公司投资交易风险管理规定》对可能显著影响市场价格、可能导致不公平交易、可能涉嫌利益输送等交易行为异常和交易价格异常的情形进行界定，拟定相应的监控、分析和防控措施。

本报告期内，本基金管理人严格控制同一基金或不同基金组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易，未发生同一投资组合或不同投资组合之间在同一交易日内进行反向交易及其他可能导致不公平交易或利益输送的异常交易。

### 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

从全球基本面看，2025年上半年，全球通胀滞胀压力基本稳定。美国通胀指标已经显著回落，美联储继续处于降息周期。欧元区和英国通胀压力亦显著回调，海外宏观经济在过去长期高息因素的影响下陷入衰退的可能性继续维持。

从国内基本面看，2025年上半年我国宏观经济基本面仍处于缓步复苏阶段。上半年官方制造业PMI下行至荣枯线以下，官方非制造业PMI波动中略有下行；社会消费品零售总额同比增速高位回落；固定资产投资同比增速受地产投资拖累较为明显；出口增速受关税事件影响有所波动；社会融资规模增量和结构均有待改善。2025年初《政府工作报告》对我国全年经济增速目标定调合理适中，同时强调“我国经济持续回升向好基础还不稳固，有效需求不足，特别是消费不振。部分企业生产经营困难，账款拖欠问题仍较突出”。因此，未来一段时期我国货币政策走向及实施力度仍有望对我国下一阶段的经济复苏进度和力度发挥显著影响。

从货币政策看，2025年上半年，以美联储为代表的西方发达国家央行继续处于降息周期中，而中国人民银行货币政策委员会2025年上半年最后一次例会继续强调“加大货币政策调控强度，提高货币政策调控前瞻性、针对性、有效性”，彰显出我国货币政策将继续基于我国当前阶段所处的经济周期而表现出“以我为主”的坚定态度。

从资金面看，今年上半年，我国持续科学地管理货币投放规模，使我国货币政策继续保持撬动经济稳步增长的底线。总体看，2025年上半年，中国人民银行在党中央、国

务院的领导下继续实施正确、有效的货币政策，在我国经济复苏阶段为维护我国资本市场流动性继续发挥极为重要的作用，DR007多数时期处于2.1%及以下的中性合理水平。总体看，2025年上半年我国金融市场整体流动性整体走松，整体显现出合理偏宽松的货币市场环境。

整体看，上半年债市整体走强，市场表现在相当程度上受到资金面、基本面和事件性因素的影响。2025年上半年，中债国债及政策性银行债指数（总值）财富指数上涨0.59%、中债信用债总指数（总值）财富指数上涨1.22%、中债高信用等级债券指数（总值）财富指数上涨1.31%。

基于对经济基本面和债券市场的总体判断，产品上半年资产配置包括中短期限同业存单、利率债和信用债，后续将根据基本面、资金面、政策预期及市场情况有序调整组合久期及资产轮动，辅以一定的杠杆操作推动业绩表现。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末国融中证同业存单AAA指数7天持有期基金份额净值为1.0040元，本报告期内，基金份额净值增长率为0.40%，同期业绩比较基准收益率为0.55%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

基于对当前全球宏观环境的判断，发达经济体整体仍处于降息周期。从国内经济形势看，当前我国经济复苏力度有待进一步提升，虽然受到一系列政策的托底扶持，但仍面临内需偏弱，以及外部经贸和地缘政治等方面的问题。

下半年，推动内需增长和防范外部不确定性仍然是央行现阶段的重要货币政策目标，内需和融资需求偏弱导致央行货币政策或仍然延续中性偏宽松。此外，城投债发行受到的政策端约束仍然存在，银行理财和公募基金规模有望继续上行，因此需求端力量整体仍然较强。在基本面整体表现一般、资金面有望均衡偏松、债券需求端继续保持强势、供给端资产荒现象仍然存在、发达经济体处于降息周期等因素的影响下，债市下半年整体风险可控。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及本基金合同约定，本基金管理人严格按照《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，对基金所持投资品种进行估值。本基金管理人制定了基金估值和份额净值计价的业务管理制度，明确了基金估值的程序和技术，建立了估值委员会，健全了估值决策体系。本基金管理人在具体的基金估值业务执行上，在遵守中国证监会相关规定和基金合同的同时，参考了行业协会估值意见和独立第三方机构估值数据，以确保基金估值的公平、合理。

本基金管理人制定的证券投资基金估值政策与估值程序确定了估值目的、估值日、估值对象、估值程序、估值方法以及估值差错处理、暂停估值和特殊情形处理等事项。对下属管理的不同基金持有的具有相同特征的同一投资品种的估值原则、程序及技术保持一致（中国证监会规定的特殊品种除外）。

本基金管理人由公司总经理、分管运营支持部高管、分管投资高管、运营支持部负责人、基金运营部负责人、合规风控部负责人、相关基金经理/投资经理及其所处部门负责人组成的基金估值委员会，负责制定或完善估值政策、估值程序，定期复核和审阅估值程序和技术适用性，以确保相关估值程序和技术不存在重大缺陷。委员会成员均具有多年证券、基金从业经验，具备基金估值运作、行业研究、风险管理或法律合规等领域的专业胜任能力。

基金经理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。

参与估值流程的各方还包括本基金托管人和负责本基金审计业务的会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任。托管人在复核、审查基金资产净值和基金份额申购、赎回价格之前，应认真审阅基金管理人采用的估值原则及技术。当对估值原则及技术有异议时，托管人有义务要求基金管理公司作出合理解释，通过积极商讨达成一致意见。本基金管理人当发生改变估值技术，导致基金资产净值的变化在0.25%以上的情况时，将所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性等咨询会计师事务所的专业意见。此外，会计师事务所出具审计报告时，对报告期间基金的估值技术及其重大变化，特别是对估值的适当性，采用外部信息进行估值的客观性和可靠性程度，以及相关披露的充分性和及时性等发表意见。上述参与估值流程的各方之间不存在任何重大利益冲突。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的规定以及本基金基金合同第十六部分中对基金利润分配原则的约定，本报告期内未实施利润分配。

本基金截至2025年6月30日的期末未分配利润为694,861.78元，其中未分配利润已实现部分为705,955.27元，未分配利润未实现部分为-11,093.49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

1、本报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形；

2、本报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形。

## §5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，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

本报告期内，本基金的管理人--国融基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对国融基金管理有限公司编制和披露的国融中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金2025年中期报告中财务指标、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进行了复核，以上内容真实、准确和完整。

## §6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：国融中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金

报告截止日：2025年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025年06月30日
<b>资产：</b>		
货币资金	6.4.7.1	3,248,940.56
结算备付金		-
存出保证金		-
交易性金融资产	6.4.7.2	173,872,151.88
其中：股票投资		-
基金投资		-
债券投资		173,872,151.88
资产支持证券投资		-

贵金属投资		-
其他投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-
应收清算款		-
应收股利		-
应收申购款		538,353.10
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.5	-
资产总计		177,659,445.54
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2025年06月30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		5,001,041.26
应付清算款		-
应付赎回款		-
应付管理人报酬		31,699.88
应付托管费		7,924.96
应付销售服务费		31,699.88
应付投资顾问费		-
应交税费		24,787.36
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.6	64,240.47
负债合计		5,161,393.81
<b>净资产：</b>		
实收基金	6.4.7.7	171,803,189.95
未分配利润	6.4.7.8	694,861.78

净资产合计		172,498,051.73
负债和净资产总计		177,659,445.54

注：1、报告截止日2025年6月30日，本基金份额净值人民币1.0040元，基金份额总额171,803,189.95份。

2、本基金基金合同于2025年3月27日生效，本报告期为2025年3月27日（基金合同生效日）至2025年6月30日。

## 6.2 利润表

会计主体：国融中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金

本报告期：2025年03月27日（基金合同生效日）至2025年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025年03月27日（基金合同 生效日）至2025年06月30 日
<b>一、营业总收入</b>		1,267,914.00
1.利息收入		313,503.72
其中：存款利息收入	6.4.7.9	155,533.04
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		157,970.68
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		966,914.68
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	966,914.68
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.12	-
股利收益		-
其他投资收益		-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号	6.4.7.13	-12,504.40

填列)		
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.14	-
<b>减：二、营业总支出</b>		349,437.87
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	114,753.99
2.托管费	6.4.10.2.2	28,688.51
3.销售服务费	6.4.10.2.3	114,753.99
4.投资顾问费		-
5.利息支出		34,916.46
其中：卖出回购金融资产支出		34,916.46
6.信用减值损失	6.4.7.15	-
7.税金及附加		8,782.20
8.其他费用	6.4.7.16	47,542.72
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		918,476.13
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		918,476.13
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-
<b>六、综合收益总额</b>		918,476.13

注：本基金基金合同生效日为2025年3月27日，截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的利润表及报表附注均无同期对比数据。

### 6.3 净资产变动表

会计主体：国融中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金

本报告期：2025年03月27日（基金合同生效日）至2025年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2025年03月27日（基金合同生效日）至2025年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-
二、本期期初净资产	265,500,730.04	-	265,500,730.04



产			
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-93,697,540.09	694,861.78	-93,002,678.31
（一）、综合收益总额	-	918,476.13	918,476.13
（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）	-93,697,540.09	-223,614.35	-93,921,154.44
其中：1.基金申购款	101,825,452.59	263,708.01	102,089,160.60
2.基金赎回款	-195,522,992.68	-487,322.36	-196,010,315.04
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	171,803,189.95	694,861.78	172,498,051.73

注：本基金基金合同生效日为2025年3月27日，截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的净资产（基金净值）变动表及报表附注均无同期对比数据。

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：

毛灵俊

陈建伟

陈建伟

-----

-----

-----

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

国融中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金（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”）《关于准予国融中证同业存单AAA指数

7天持有期证券投资基金注册的批复》(证监许可[2024]1941号)批准,由国融基金管理有限公司(以下简称“国融基金”)依照《中华人民共和国证券投资基金法》等法律法规以及《国融中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)发售,基金合同于2025年3月27日生效。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集规模为265,500,730.04份基金份额。本基金的基金管理人为国融基金,基金托管人为浙商银行股份有限公司(以下简称“浙商银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、基金合同和《国融中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金主要投资于标的指数成份券及其备选成份券。为了更好地实现投资目标,本基金还可以投资于非属成份券及备选成份券的其他同业存单、债券(包括国债、央行票据、金融债、政策性金融债、企业债、公司债、地方政府债券、政府支持机构债券、可分离交易可转债的纯债部分、次级债及其他经证监会允许投资的债券)、短期融资券(含超短期融资券)、中期票据等非金融企业债务融资工具、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括定期存款、协议存款、通知存款等)、现金等货币市场工具等以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。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)、可交换债券及其他带有权益属性的金融工具。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:本基金投资于同业存单的比例不低于基金资产的80%;本基金投资于标的指数成份券及其备选成份券的比例不低于本基金非现金基金资产的80%;本基金应当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,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如法律法规或监管机构变更上述投资标的品种的比例限制,在履行适当程序后,以变更后的比例为准,本基金投资比例会做相应调整。本基金业绩比较基准为:中证同业存单AAA指数收益率 $\times$ 95%+银行人民币一年定期存款利率(税后) $\times$ 5%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》(以下合称“企业会计准则”)的要求,同时亦按照中国证监会颁布的《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>》以及中国证券投资基金业协会于2012年11月16日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注6.4.2中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定要求，真实、完整地反映了本基金2025年6月30日的财务状况、自2025年3月27日（基金合同生效日）至2025年6月30日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

## 6.4.4 重要会计政策和会计估计

### 6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为自2025年3月27日（基金合同生效日）至2025年6月30日止。

### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币，编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

#### (a) 金融资产的分类

本基金的金融工具包括债券投资、买入返售金融资产等。

本基金通常根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征，在初始确认时将金融资产分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以摊余成本计量的金融资产。

除非本基金改变管理金融资产的业务模式，在此情形下，所有受影响的相关金融资产在业务模式发生变更后的首个报告期间的第一天进行重分类，否则金融资产在初始确认后不得进行重分类。

本基金将同时符合下列条件且未被指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，分类为以摊余成本计量的金融资产：

- 本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标；
- 该金融资产的合同条款规定，在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。

除上述以摊余成本计量的金融资产外，本基金将其余所有的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。本基金现无分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

管理金融资产的业务模式，是指本基金如何管理金融资产以产生现金流量。业务模式决定本基金所管理金融资产现金流量的来源是收取合同现金流量、出售金融资产还是两者兼有。本基金以客观事实为依据、以关键管理人员决定的对金融资产进行管理的特定业务目标为基础，确定管理金融资产的业务模式。

本基金对金融资产的合同现金流量特征进行评估，以确定相关金融资产在特定日期产生的合同现金流量是否仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。其中，本金是指金融资产在初始确认时的公允价值；利息包括对货币时间价值、与特定时期未偿付本金金额相关的信用风险、以及其他基本借贷风险、成本和利润的对价。此外，本基金对可能导致金融资产合同现金流量的时间分布或金额发生变更的合同条款进行评估，以确定其是否满足上述合同现金流量特征的要求。

#### (b)金融负债的分类

本基金将金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及以摊余成本计量的金融负债。

##### -以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

该类金融负债包括交易性金融负债(含属于金融负债的衍生工具)和指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

##### -以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

本基金现无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

#### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

##### (a)金融工具的初始确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

##### (b)金融工具的后续计量

##### -以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产以公允价值进行后续计量，产生的利得或损失(包括利息和股利收入)计入当期损益，除非该金融资产属于套期关系的一部分。

##### -以摊余成本计量的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产采用实际利率法以摊余成本计量。以摊余成本计量且不属于任何套期关系的一部分的金融资产所产生的利得或损失，在终止确认、重分类、按照实际利率法摊销或确认减值时，计入当期损益。

##### -以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债以公允价值进行后续计量，除与套期会计有关外，产生的利得或损失(包括利息费用)计入当期损益。

##### -以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

**(c)金融工具的终止确认**

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

-收取该金融资产现金流量的合同权利终止；

-该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；

-该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

-所转移金融资产在终止确认日的账面价值；

-因转移金融资产而收到的对价。

金融负债(或其一部分)的现时义务已经解除的，本基金终止确认该金融负债(或该部分金融负债)。

**(d)金融工具的减值**

本基金以预期信用损失为基础，对下列项目进行减值会计处理并确认损失准备：

-以摊余成本计量的金融资产

本基金持有的其他以公允价值计量的金融资产不适用预期信用损失模型。

**预期信用损失的计量**

预期信用损失，是指以发生违约的风险为权重的金融工具信用损失的加权平均值。信用损失，是指本基金按照原实际利率折现的、根据合同应收的所有合同现金流量与预期收取的所有现金流量之间的差额，即全部现金短缺的现值。

在计量预期信用损失时，本基金需考虑的最长期限为面临信用风险的最长合同期限(包括考虑续约选择权)。

整个存续期预期信用损失，是指因金融工具整个预计存续期内所有可能发生的违约事件而导致的预期信用损失。

未来12个月内预期信用损失，是指因资产负债表日后12个月内(若金融工具的预计存续期少于12个月，则为预计存续期)可能发生的金融工具违约事件而导致的预期信用损失，是整个存续期预期信用损失的一部分。

本基金对满足下列情形的金融工具按照相当于未来12个月内预期信用损失的金额计量其损失准备，对其他金融工具按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备：

-该金融工具在资产负债表日只具有较低的信用风险；或

-该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加。

预期信用损失准备的列报

为反映金融工具的信用风险自初始确认后的变化，本基金在每个资产负债表日重新计量预期信用损失，由此形成的损失准备的增加或转回金额，应当作为减值损失或利得计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融资产，损失准备抵减该金融资产在资产负债表中列示的账面价值。

#### 核销

如果本基金不再合理预期金融资产合同现金流量能够全部或部分收回，则直接减记该金融资产的账面余额。这种减记构成相关金融资产的终止确认。这种情况通常发生在本基金确定债务人没有资产或收入来源可产生足够的现金流量以偿还将被减记的金额。但是，被减记的金融资产仍可能受到本基金催收到期款项相关执行活动的影响。

已减记的金融资产以后又收回的，作为减值损失的转回计入收回当期的损益。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，根据企业会计准则的规定采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术。

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

对不存在活跃市场的金融工具，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似金融工具的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整并确定公允价值。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；
- 本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量，并于会计期末全额转入未分配利润。

#### 6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

##### 利息收入

存款利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认为利息收入。

##### 投资收益

债券投资收益按相关金融资产于处置日成交金额与其初始计量金额的差额确认，处置时产生的交易费用计入投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资，在其持有期间，按票面金额和票面利率计算的利息计入投资收益。

##### 公允价值变动收益

公允价值变动收益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、衍生工具、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。不包括本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资在持有期间按票面利率计算的利息。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算。

#### **6.4.4.11 基金的收益分配政策**

在符合有关基金分红条件的前提下，本基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；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；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该类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；由于基金费用不同，不同类别的基金份额在收益分配数额方面可能有所不同，基金管理人可对各类别基金份额分别定制收益分配方案，本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### **6.4.4.12 分部报告**

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### **6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计**

编制财务报表时，本基金需要运用估计和假设，这些估计和假设会对会计政策的应用及资产、负债、收入和支出的金额产生影响。实际情况可能与这些估计不同。本基金对估计涉及的关键假设和不确定因素的判断进行持续评估，会计估计变更的影响在变更当期和未来期间予以确认。

根据《关于固定收益品种的估值处理标准》在银行间债券市场、上海证券交易所、深圳证券交易所、北京证券交易所及中国证券监督管理委员会认可的其他交易场所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外)，采用第三方估值基准服务机构提供的价格数据进行估值。

### **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**

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

#### **6.4.5.2 会计估计变更的说明**



本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

#### 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[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号文《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[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》、财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《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号文《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号文《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》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部税务总局公告2024年第8号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(a)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，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。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。

(b)对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(c)对基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）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。

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。

(d)对基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

## 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 2025年06月30日
活期存款	3,247,926.94
等于：本金	3,245,846.59
加：应计利息	2,080.35
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	1,013.62
等于：本金	1,013.61
加：应计利息	0.01
减：坏账准备	-
合计	3,248,940.56

注：其他存款为本基金存放在开立于基金结算机构的证券账户内的存款。

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025年06月30日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		-	-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	170,891,754.40	2,992,901.88	173,872,151.88	-12,504.40
	合计	170,891,754.40	2,992,901.88	173,872,151.88	-12,504.40
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		170,891,754.40	2,992,901.88	173,872,151.88	-12,504.40

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于本报告期末未持有任何衍生金融资产/负债。

#### 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

本基金于本报告期末无买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金于本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 其他资产

本基金于本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025年06月30日
应付券商交易单元保证金	-

应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	17,097.75
其中：交易所市场	-
银行间市场	17,097.75
应付利息	-
预提审计费用	10,285.44
预提信息披露费	30,857.28
预提账户维护费	6,000.00
合计	64,240.47

#### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2025年03月27日（基金合同生效日）至2025年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	265,500,730.04	265,500,730.04
本期申购	101,825,452.59	101,825,452.59
本期赎回（以“-”号填列）	-195,522,992.68	-195,522,992.68
本期末	171,803,189.95	171,803,189.95

注：申购含转换入份额；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	-	-	-
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	930,980.53	-12,504.40	918,476.13
本期基金份额交易产生的变动数	-225,025.26	1,410.91	-223,614.35
其中：基金申购款	267,593.51	-3,885.50	263,708.01

基金赎回款	-492,618.77	5,296.41	-487,322.36
本期已分配利润	-	-	-
本期末	705,955.27	-11,093.49	694,861.78

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年03月27日（基金合同生效日）至2025年06月30日
活期存款利息收入	94,404.14
定期存款利息收入	60,115.28
其他存款利息收入	1,013.62
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	155,533.04

#### 6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金在本报告期内无股票投资收益。

#### 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 2025年03月27日（基金合同生效日）至2025年06月30日
债券投资收益——利息收入	2,481,168.14
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-1,514,253.46
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	966,914.68

##### 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
	2025年03月27日（基金合同生效日）至2025年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	671,395,490.55
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	661,463,097.69
减：应计利息总额	11,433,387.48
减：交易费用	13,258.84
买卖债券差价收入	-1,514,253.46

#### 6.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金在本报告期无债券赎回差价收入。

#### 6.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金在本报告期无债券申购差价收入。

#### 6.4.7.12 衍生工具收益

本基金在本报告期内无衍生工具收益。

#### 6.4.7.13 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2025年03月27日（基金合同生效日）至2025年06月30日
1.交易性金融资产	-12,504.40
——股票投资	-
——债券投资	-12,504.40
——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	-12,504.40

#### 6.4.7.14 其他收入

本基金在本报告期内无其他收入。

#### 6.4.7.15 信用减值损失

本基金在本报告期内无信用减值损失。

#### 6.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025年03月27日（基金合同生效日）至2025年06月30日
审计费用	10,285.44
信息披露费	30,857.28
证券出借违约金	-
银行间账户维护费	6,000.00
证券账户开户费	400.00
合计	47,542.72

### 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，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的资产负债表日后事项。

### 6.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
国融证券股份有限公司	基金管理人股东、基金销售机构
上海谷若投资中心（有限合伙）	基金管理人股东
国融基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
浙商银行股份有限公司	基金托管人

注：本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

本基金于本报告期没有通过关联方的交易单元进行过股票交易。

##### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金于本报告期没有通过关联方的交易单元进行过权证交易。

##### 6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年03月27日（基金合同生效日）至2025年06月30日	
	成交金额	占当期债券买卖成交总额的比例
国融证券股份有限公司	93,383,882.18	100.00%

##### 6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年03月27日（基金合同生效日）至2025年06月30日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
国融证券股份有限	212,284,000.00	100.00%



公司		
----	--	--

**6.4.10.1.5 基金交易**

本基金于本报告期没有通过关联方的交易单元进行过基金交易。

**6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年03月27日（基金合同生效日）至2025年06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
国融证券股份有限公司	3,056.68	100.00%	-	-

注：上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

**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 2025年03月27日（基金合同生效日）至2025年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	114,753.99
其中：应支付销售机构的客户维护费	34,588.81
应支付基金管理人的净管理费	80,165.18

注：支付基金管理人国融基金的基金管理费按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。计算公式为：

日基金管理费=前一日基金资产净值×0.20%/当年天数

**6.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期
	2025年03月27日（基金合同生效日）至2025年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	28,688.51

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

日基金托管费=前一日基金资产净值×0.05%/当年天数

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期
	2025年03月27日（基金合同生效日）至2025年06月30日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
国融证券股份有限公司	113,920.01
合计	113,920.01

注：支付销售机构的基金销售服务费按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。计算公式为：

日基金销售服务费=前一日基金资产净值×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

本基金在本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金在本报告期末未与关联方进行过转融通证券出借业务。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的管理人在本报告期内未持有过本基金。

##### 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

除基金管理人之外的其他关联方在本报告期末持有过本基金。

**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 2025年03月27日（基金合同生效日）至2025年06月30日	
	期末余额	当期利息收入
浙商银行股份有限公司	3,247,926.94	94,404.14

**6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金在本报告期内未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

**6.4.10.8 其他关联交易事项的说明**

本基金在本报告期内无其他关联交易事项的说明。

**6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金**

本基金在本报告期内未进行过利润分配。

**6.4.12 期末（2025年06月30日）本基金持有的流通受限证券**

**6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

截止2025年6月30日，本基金未持有因认购新发/增发而于期末持有的流通受限证券。

**6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

截止2025年6月30日，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

**6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**

**6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

截至本报告期末2025年6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5,001,041.26元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
102483911	24昆明交通MTN002	2025-07-04	102.95	56,000	5,765,442.41

合计				56,000	5,765,442.41
----	--	--	--	--------	--------------

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

于2025年6月30日，本基金未持有证券交易所因债券正回购交易而作为抵押的债券。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

于2025年6月30日，本基金未持有参与转融通证券出借业务的证券。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、合规风控部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立审计合规委员会，负责对公司经营的合法合规性进行监督检查，对经营活动进行审计；在管理层层面设立风险控制委员会，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，由合规风控部负责协调并与各部门合作完成运作风险管理，由风险管理人员负责投资风险管理及绩效评估。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，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，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的银行存款存放在本基金的信用良好的金融机构，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，本基金投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。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%。

本基金投资于信用级别评级为AAA以上(含AAA)的资产支持证券；本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估并采用券款对付交割方式以控制相应的信用风险。

**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 2025年06月30日
A-1	-
A-1以下	-
未评级	71,105,340.83
合计	71,105,340.83

**6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的同业存单投资**

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2025年06月30日
A-1	-
A-1以下	-
未评级	9,999,634.62
合计	9,999,634.62

**6.4.13.2.3 按长期信用评级列示的债券投资**

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2025年06月30日
AAA	10,434,191.78
AAA以下	-
未评级	82,332,984.65
合计	92,767,176.43

**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。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短期内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。

于本报告期末，本基金承担的金融负债的合同约定到期日均为一年以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

#### **6.4.13.1 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》及《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期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。

本基金持有一家公司发行的证券，市值不超过基金资产净值的10%；本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的10%；基金管理人管理的全部公募基金投资于一家企业发行的单期中期票据合计不超过该期证券的10%。

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，除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(如有)外，本基金未持有其他重大流动性风险的投资品种。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%。

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。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025年0 6月30日	6个月以内	6个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产						
货币资金	3,248,940.56	-	-	-	-	3,248,940.56
交易性金融资产	153,580,868.04	20,291,283.84	-	-	-	173,872,151.88
应收申购款	538,353.10	-	-	-	-	538,353.10
资产总计	157,368,161.70	20,291,283.84	-	-	-	177,659,445.54
负债						
卖出回购金融资产款	5,001,041.26	-	-	-	-	5,001,041.26
应付管理人报酬	-	-	-	-	31,699.88	31,699.88
应付托管费	-	-	-	-	7,924.96	7,924.96
应付销售服务费	-	-	-	-	31,699.88	31,699.88
应交税费	-	-	-	-	24,787.36	24,787.36
其他负债	-	-	-	-	64,240.47	64,240.47
负债总计	5,001,041.26	-	-	-	160,352.55	5,161,393.81
利率敏感度缺	152,367,120.44	20,291,283.84	-	-	-160,352.55	172,498,051.73

□						
---	--	--	--	--	--	--

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

**6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析**

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末 2025年06月30日
	市场利率下降25个基点	75,061.65
	市场利率上升25个基点	-74,907.59

**6.4.13.4.2 外汇风险**

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

**6.4.13.4.3 其他价格风险**

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用"自上而下"的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

**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 2025年06月30日	
	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	173,872,151.88	100.80
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	173,872,151.88	100.80

#### 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层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；

第三层次输入值：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 2025年06月30日
第一层次	-
第二层次	173,872,151.88
第三层次	-
合计	173,872,151.88

###### 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。

对于本基金投资的证券交易所上市的证券，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时，本基金不会于停牌期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次。本基金综合考虑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，确定相关证券公允价值的层次。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2025年6月30日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融工具主要包括以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

于2025年6月30日，本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

## §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	173,872,151.88	97.87
	其中：债券	173,872,151.88	97.87
	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	3,248,940.56	1.83
8	其他各项资产	538,353.10	0.30
9	合计	177,659,445.54	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投资股票。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金本报告期内未持有股票。

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

本基金本报告期内未持有股票。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内未持有股票。

## 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,235,476.71	5.93
	其中：政策性金融债	10,235,476.71	5.93
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	71,105,340.83	41.22

6	中期票据	82,531,699.72	47.85
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	9,999,634.62	5.80
9	其他	-	-
10	合计	173,872,151.88	100.80

### 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	102001359	20龙湖拓展MTN001 B	100,000	10,434,191.78	6.05
2	102381978	23开滦MTN002(科创票据)	100,000	10,377,534.79	6.02
3	102281543	22粤珠江MTN004	100,000	10,342,794.52	6.00
4	102281520	22电建地产MTN002	100,000	10,341,009.86	5.99
5	102381813	23渝高建投MTN002	100,000	10,308,701.37	5.98

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

**7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

本基金本报告期末未持有国债期货。

**7.12 投资组合报告附注**

**7.12.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未出现被监管部门立案调查或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。**

**7.12.2 本基金本报告期内未投资股票。**

**7.12.3 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	538,353.10
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	538,353.10

**7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

**7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末未持有股票。

**7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分**

由于四舍五入的原因，各分项之和与合计项之间可能存在尾差。

**§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

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
810	212,102.70	40,294,907.34	23.45%	131,508,282.61	76.55%

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本报告期末基金管理人的从业人员未持有本基金。

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

本报告期末基金管理人的从业人员未持有本基金。

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2025年03月27日)基金份额总额	265,500,730.04
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	101,825,452.59
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	195,522,992.68
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	171,803,189.95

注：总申购份额含转换转入份额；总赎回份额含转换转出份额。

## §10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，根据基金管理人第三届董事会第十二次会议决议，聘任陈建伟先生担任基金管理人首席信息官，同时仍兼任运营支持部总监和信息技术部总监，分管信息技术板块、基金运营板块，自2025年1月2日起开始履职。

根据基金管理人第三届董事会第十八次会议决议，陈祎杰女士辞去基金管理人副总经理兼财务负责人职务，履职时间截至到2025年6月30日。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，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

为本基金进行审计的是毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙），本报告期内未发生变更。

### 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

本报告期内，管理人及其高级管理人员未发生受到稽查或处罚的情况。

#### 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，本基金托管人及其高级管理人员无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	
国融证券	2	-	-	3,056.68	100.00%	新增

注：1、本基金管理人负责选择证券经纪服务商，使用其专用的交易单元作为本基金的交易单元。基金管理人选择证券经纪服务商的标准和程序如下：

（1）公司在证券经纪服务商的选择与管理中，严格遵循监管要求及市场化原则，建立规范化的全流程管理机制。

（2）公司选择财务状况良好，经营行为规范，合规风控能力和交易、研究等服务能力

较强的证券公司参与证券交易，由投研部门根据业务需求提出申请，公司经纪服务商小组会议评审，经审议后与提供证券交易服务的证券公司签署协议约定双方的权利义务，明确服务内容、收取交易佣金的价格标准与计算方式。合作过程中，公司通过定期评价机制动态跟踪服务表现，并基于评价结果调整证券经纪服务商。

2、报告期内使用证券公司交易单元的变更情况：

- (1) 本基金报告期内新增交易单元情况：2个；
- (2) 本基金报告期内停止使用交易单元情况：无。

3、本基金的交易佣金按照《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》执行。

### 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		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
国融证券	93,383,882.18	100.00%	212,284,000.00	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	国融中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金基金份额发售公告	中国证监会指定的媒介	2025-03-07
2	国融中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金基金产品资料概要	中国证监会指定的媒介	2025-03-07
3	国融中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金基金合同及招募说明书提示性公告	中国证监会指定的媒介	2025-03-07
4	国融中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金招募说明书	中国证监会指定的媒介	2025-03-07
5	国融中证同业存单AAA指数	中国证监会指定的媒介	2025-03-07



	7天持有期证券投资基金基金合同		
6	国融中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金托管协议	中国证监会指定的媒介	2025-03-07
7	国融基金管理有限公司关于国融中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金提前结束部分代销机构募集的公告	中国证监会指定的媒介	2025-03-25
8	国融基金管理有限公司关于国融中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金提前结束募集的公告	中国证监会指定的媒介	2025-03-27
9	国融中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金基金合同生效公告	中国证监会指定的媒介	2025-03-28
10	国融基金管理有限公司关于提请投资者及时更新已过期身份证件及其他身份基本信息的公告	中国证监会指定的媒介	2025-04-11
11	国融基金管理有限公司关于增加宁波银行股份有限公司为旗下基金销售机构的公告	中国证监会指定的媒介	2025-04-15
12	国融基金管理有限公司关于增加麦高证券有限责任公司为旗下基金销售机构的公告	中国证监会指定的媒介	2025-04-18
13	国融中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金开放日常申购、赎回、转换、定期定额投资业务的公告	中国证监会指定的媒介	2025-04-23
14	国融基金管理有限公司关于增加华宝证券股份有限公司	中国证监会指定的媒介	2025-05-15

	为旗下部分基金销售机构的公告		
15	国融基金管理有限公司关于增加甬兴证券有限公司为旗下全部基金销售机构的公告	中国证监会指定的媒介	2025-05-22

## §11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金未有影响投资者决策的其他重要信息。

## §12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

(一) 中国证监会准予国融中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金募集注册的文件

(二) 《国融中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金基金合同》

(三) 《国融中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金托管协议》

(四) 法律意见书

(五) 基金管理人业务资格批件、营业执照

(六) 基金托管人业务资格批件、营业执照

(七) 中国证监会要求的其他文件

### 12.2 存放地点

《基金合同》《托管协议》存放在基金管理人和基金托管人处；其余备查文件存放在基金管理人处。

### 12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费到存放地点查阅，也可按工本费购买复印件。

国融基金管理有限公司  
二〇二五年八月二十九日