

易米中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金
2026年第二季度报告
2026年06月30日

基金管理人:易米基金管理有限公司

基金托管人:江苏银行股份有限公司

报告送出日期:2026年07月21日

§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。

基金托管人江苏银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2026年7月20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2026年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	易米中证同业存单AAA指数7天持有期
基金主代码	021592
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2024年09月19日
报告期末基金份额总额	44,488,186.10份
投资目标	本基金采用指数化投资，密切跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金为指数基金，主要采用抽样复制和动态最优化的方法，投资于标的指数中具有代表性和流动性的成份券和备选成份券，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。在正常市场情况下，力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%，年跟踪误差不超过2%。
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。
基金管理人	易米基金管理有限公司
基金托管人	江苏银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2026年04月01日 - 2026年06月30日）
1.本期已实现收益	89,605.58
2.本期利润	85,363.42
3.加权平均基金份额本期利润	0.0017
4.期末基金资产净值	45,340,655.27
5.期末基金份额净值	1.0192

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.本报告所列示的基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 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	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.17%	0.01%	0.37%	0.00%	-0.20%	0.01%
过去六个月	0.41%	0.01%	0.80%	0.01%	-0.39%	0.00%
过去一年	0.90%	0.01%	1.64%	0.01%	-0.74%	0.00%
自基金合同生效起至今	1.92%	0.01%	3.19%	0.01%	-1.27%	0.00%

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



§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
杜雨楠	本基金基金经理	2026-01-13	-	10	杜雨楠先生，毕业于英国帝国理工大学，硕士研究生。曾任华泰证券股份有限公司上海分公司营业部业务支持岗，中海基金管理有限公司助理债券研究员，汇丰晋信基金管理有限公司债券研究员、投资经理，光大证券股份有限公司资金管理岗，现任易米基金管理有限公司基金经理。

注：1.上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

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。

3.本基金无基金经理助理。

4.本基金本报告期内没有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

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》及其各项实施准则、《易米中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，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，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。

本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定，无违法、违规行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理人公平交易制度指导意见》、《易米基金管理有限公司公平交易制度》和《易米基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》。本基金管理人通过建立科学的公平交易体系，将公平交易理念贯彻投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评价等环节，确保各个投资组合享有公平的投资决策机会。

报告期内，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（1日内、3日内、5日内）的本季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

报告期内，本基金管理人旗下管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量不存在超过该证券当日成交量的5%的情形。

报告期内，本基金管理人未发现可能导致不公平交易和利益输送的异常交易情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

二季度，同业存单发行规模合计9.59万亿元，环比增加2.89万亿元，净融资额在连续四个季度为负后，首度转正至5182亿元。受资金面宽松延续及银行同业存单再融资需求回落的双重驱动，发行利率进一步下行。其中，1年期AAA级同业存单利率较一季度末回落4bp至1.46%附近。

本季度，本基金主要采用抽样复制指数与动态优化相结合的方法，主要投资于中证AAA同业存单指数的成份券和备选成份券，并结合负债端和市场资金利率的情况，灵活调整组合杠杆和久期水平。展望后市，边际走弱的经济基本面仍将为债券市场提供底部支撑，但资金面阶段性扰动，以及7月政治局会议对下半年经济与宏观政策的定调，或将成为主导债市行情的核心博弈变量。后续，我们将根据市场情况，综合运用久期策略、骑乘策略、票息策略和杠杆策略等来增厚投资组合的收益，力争为持有人带来稳定的投资收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末易米中证同业存单AAA指数7天持有期基金份额净值为1.0192元，本报告期内，基金份额净值增长率为0.17%，同期业绩比较基准收益率为0.37%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内，本基金自2026年5月7日至2026年6月30日期间存在基金资产净值低于五千万的情形。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	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	43,022,011.95	94.68
	其中：债券	43,022,011.95	94.68
	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	1,800,000.00	3.96
	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	617,884.28	1.36
8	其他资产	11.00	0.00
9	合计	45,439,907.23	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	2,003,291.51	4.42

2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
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	41,018,720.44	90.47
9	其他	-	-
10	合计	43,022,011.95	94.89

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值(元)	占基金资产 净值比例（%）
1	112502253	25工商银行CD253	45,000	4,486,976.06	9.90
2	112503337	25农业银行CD337	45,000	4,484,756.86	9.89
3	112609049	26浦发银行CD049	45,000	4,476,618.79	9.87
4	112517144	25光大银行CD144	40,000	3,994,628.28	8.81
5	112620014	26广发银行CD014	40,000	3,968,250.49	8.75

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.10 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 25工商银行CD253（代码：112502253）为本基金前五大持仓债券之一。2026年7月2日，国家金融监督管理总局河北监管局对工商银行石家庄分行违规发放贷款的违规行为，罚款60万元。2026年7月1日，国家金融监督管理总局延边监管分局对工商银行汪清支行、图们支行贷款“三查”不到位的违规行为，合计罚款70万元；对延吉海兰江支行违规办理信用卡汽车专项分期付款业务的违规行为，罚款30万元。2026年6月26日，国家金融监督管理总局新余监管分局对工商银行新余分行、相关分支机构违规办理信用卡汽车分期业务等违规行为，合计罚款50万元。2026年6月25日，国家金融监督管理总局榆林监管分局对工商银行榆林分行贷款阶段划分不审慎等违规行为，罚款36万元。2026年6月12日，国家金融监督管理总局内蒙古监管局对工商银行内蒙古自治区分行授信审批不审慎的违规行为，罚款30万元。2026年5月29日，国家金融监督管理总局宁波监管局对工商银行宁波市分行内控管理不规范等违规行为，罚款380万元；对工商银行广州分行、广州同福中路支行内部控制和风险管理不到位的违规行为，合计罚款70万元。2026年5月11日，国家金融监督管理总局对工商银行重要信息系统投产变更风险管控不到位等违规行为，罚款105万元。2026年5月9日，国家金融监督管理总局晋中监管分局对工商银行晋中分行违规发放个人经营性贷款的违规行为，罚款30万元。2026年2月5日，国家金融监督管理总局广东监管局对工商银行广东省分行及相关分支机构内部控制、贷款业务严重违反审慎经营规则的违规行为，合计420万元。2026年1月21日，国家金融监督管理总局西藏监管局对工商银行西藏自治区分行受理不符合条件的固定资产贷款申请并发放贷款等违规行为，罚款30万元。2025年12月29日，国家金融监督管理总局广东监管局对工商银行广东省分行内部控制失效的违规行为，罚款35万元；国家金融监督管理总局海南监管局对工商银行海南省分行汽车分期业务管理不到位的违规行为，对工商银行海南省分行罚款40万元，对工商银行海南省分行营业部罚款35万元，对工商银行三亚分行罚款30万元，合计罚款105万元。2025年10月30日，国家金融监督管理总局河南监管局对工商银行河南省分行贷款审查不尽职的违规行为，罚款30万元。2025年10月11日，国家金融监督管理总局深圳监管局对工商银行深圳市分行贷款业务、保函业务三查违规等违规行为，罚款1150万元。2025年9月30日，国家金融监督管理总局贵州监管局对工商银行贵州省分行违规办理信用卡汽车专项分期业务的违规行为，罚款45万元。2025年9月23日，国家金融监督管理总局北京监管局对工商银行北京市分行贷款“三查”失职的违规行为，罚款35万元。

25农业银行CD337（代码：112503337）为本基金前五大持仓债券之一。2026年7月7日，国家金融监督管理总局陕西监管局对农业银行榆林分行隐瞒与保险合同有关的重要情况等违规行为，罚款22.5万元。2026年6月29日，国家金融监督管理总局喀什金融监管分局对农业银行代销业务管理不规范的违规行为，罚款30万元。2026年6月23日，国家金融监督管理总局新疆金融监管局对农业银行新疆维吾尔自治区分行员工行为管理不到位的违规行为，罚款30万元。2026年6月22日，中国人民银行青岛市分行对农业银行青岛市分行违反金融统计相关规定等违规行为，罚款127.76万元。2026年6月15日，国家金融监督管理总局烟台监管分局对农业银行烟台分行贷前调查不到位的违规行为，罚款35万元。2026年6月8日，国家金融监督管理总局吉林金融监管局对工商银行长春分行

冲时点发放贷款虚增存贷款规模的违规行为，罚款30万元。2026年5月22日，国家金融监督管理总局深圳金融监管局对农业银行深圳市分行银行承兑汇票保证金来源不合规等违规行为，没收违法所得31,683元，并罚款205万元。2026年5月15日，国家金融监督管理总局天津监管局对农业银行天津武清支行员工管理不到位等违规行为，罚款60万元；国家金融监督管理总局宜春监管分局对农业银行宜春分行银行承兑汇票业务管理不尽职等违规行为，罚款105万元。2026年5月14日，中国人民银行佛山市分行对农业银行佛山分行违反金融统计等违规行为，罚款180.32万元。2026年5月9日，国家金融监督管理总局晋中监管分局对农业银行晋中市分行违规发放固定资产贷款的违规行为，罚款45万元。2026年4月22日，中国人民银行辽宁省分行对农业银行辽宁省分行违反金融统计相关规定等违规行为，罚款327.05万元。2026年4月17日，国家金融监督管理总局黄山监管分局对农业银行歙县支行贷前调查不审慎的违规行为，罚款30万元。2026年3月26日，中国人民银行阿克苏地区分行对农业银行阿克苏分行违反金融统计管理规定等违规行为，罚款60万元。2026年3月20日，国家金融监督管理总局青海监管局对农业银行西宁市城西支行、西宁市城中支行保险销售误导的违规行为，合计罚款24万元；对农业银行青海省分行保险执业登记管理不到位等违规行为，罚款30.5万元。2026年3月17日，中国人民银行博尔塔拉蒙古自治州分行对农业银行双河兵团分行违反支付结算管理规定等违规行为，罚款27.6万元。2026年3月12日，中国人民银行河南省分行对农业银行河南省分行违反金融统计相关规定等违规行为，罚款441.1万元；中国人民银行衡阳市分行对农业银行衡阳分行违反账户管理规定等违规行为，罚款52.9万元。2026年3月5日，中国人民银行平顶山市分行对农业银行平顶山分行违反金融统计相关规定等违规行为，罚款130.5万元。2026年3月4日，中国人民银行新疆维吾尔自治区分行对农业银行新疆维吾尔自治区分行违反金融统计管理规定的违规行为，罚款150万元。2026年3月3日，中国人民银行莱芜分行对农业银行莱芜分行违反账户管理规定等违规行为，罚款11.4万元；中国人民银行鹤岗市分行对农业银行鹤岗分行未按照规定开展客户尽职调查的违规行为，罚款25.05万元。2026年2月13日，国家金融监督管理总局舟山监管分局对农业银行舟山分行信贷管理不审慎的违规行为，罚款385万元。2026年1月27日，国家金融监督管理总局大连监管局对农业银行大连市分行、大连金州支行虚增存贷款规模等违规行为，合计罚款60万元。2026年1月21日，国家金融监督管理总局浙江监管局对农业银行浙江省分行个人贷款管理不审慎等违规行为，罚款880万元。2026年1月15日，国家金融监督管理总局海南监管局对农业银行海南省分行及相关分支机构贷款相关业务不尽职等违规行为，合计罚款235万元。2025年12月31日，国家金融监督管理总局福建金融监管局对农业银行福州台江支行违规办理银行卡业务的违规行为，罚款80万元。2025年12月30日，中国人民银行上海市分行对农业银行上海市分行违反金融统计管理规定的违规行为，罚款49万元。2025年10月31日，国家金融监督管理总局对农业银行相关产品销售、服务收费不合规等违规行为，罚款2720万元。2025年10月24日，国家金融监督管理总局海东监管分局对农业银行民和回族土族自治县支行违反信用风险监管规定的违规行为，罚款25万元。2025年10月24日，国家金融监督管理总局安徽监管局对农业银行合肥瑶海区支行、合肥庐阳区支行贷前调查不尽职的违规行为，合计罚款60万元。2025年10月23日，国家

金融监督管理总局阜阳监管分局对农业银行阜阳分行贷款三查不尽职的违规行为，罚款60万元。2025年10月21日，国家金融监督管理总局福建金融监管局对农业银行福州长乐支行贷后管理不到位等违规行为，罚款95万元。2025年10月15日，国家金融监督管理总局六安监管分局对农业银行六安金安区支行贷前调查不审慎的违规行为，罚款30万元。2025年10月11日，国家金融监督管理总局北京监管局对农业银行北京市分行涉企收费不规范等违规行为，罚款380万元。2025年9月16日，国家金融监督管理总局贵州监管局对农业银行贵州省分行银行承兑汇票业务风险管理不力的违规行为，罚款30万元。2025年9月10日，国家金融监督管理总局贵州金融监管局对农业银行修文县支行收费质价不符的违规行为，罚款30万元。2025年8月13日，国家金融监督管理总局大理金融监管分局对农业银行大理分行流动资金贷款“三查”不审慎等违规行为，合计罚款55万元。2025年8月8日，国家金融监管总局濮阳金融监管分局对农业银行濮阳分行，信贷资金管控不到位等违规行为，罚款50万元。2025年8月7日，国家金融监督管理总局迪庆金融监管分局对农业银行贷款“三查”不到位等违规行为，罚款55万元。

26浦发银行CD049（代码：112609049）为本基金前五大持仓债券之一。2026年6月29日，国家金融监督管理总局淮安监管分局对浦发银行淮安分行员工行为管理不到位的违规行为，罚款45万元。2026年6月8日，国家金融监督管理总局吉林金融监管局对浦发银行长春分行及旗下支行汽车金融业务严重违反审慎经营规则等违规行为，合计罚款230万元。2026年4月27日，国家金融监督管理总局晋中监管分局对浦发银行晋中分行违规发放贷款用途不真实的流动资金贷款的违规行为，罚款20万元。2026年3月10日，国家金融监督管理总局楚雄金融监管分局对浦发银行楚雄分行个人贷款管理不审慎的违规行为，罚款30万元。2026年2月12日，中国人民银行对浦发银行违反账户管理规定等违规行为，收违法所得27.545608万元，罚款4222.89万元。2026年1月21日，国家金融监督管理总局浙江监管局对浦发银行杭州分行流动资金贷款“三查”不到位等违规行为，罚款475万元。2026年1月5日，国家金融监督管理总局苏州监管分局对浦发银行苏州分行票据业务审核不严等违规行为，罚款110万元。2025年12月26日，国家金融监督管理总局惠州监管分局对浦发银行惠州分行信贷业务严重违反审慎经营规则的违规行为，罚款35万元。2025年12月19日，国家金融监督管理总局对浦发银行相关理财、代销等业务管理不审慎等违规行为，罚款1560万元。2025年12月15日，国家金融监督管理总局云南金融监管局对浦发银行昆明分行贷款“三查”严重不尽职的违规行为，合计罚款120万元。2025年11月21日，国家金融监督管理总局宜昌监管分局对浦发银行宜昌分行贷后管理不尽职等违规行为，罚款32万元。2025年10月31日，国家金融监督管理总局对浦发银行相关互联网贷款、代销等业务管理不审慎的违规行为，罚款1270万元。2025年9月19日，中国人民银行安徽省分行对浦发银行合肥分行违反金融统计相关规定等违规行为，罚款87.6万元；国家金融监督管理总局青岛金融监管局对浦发银行青岛市南支行、青岛自贸区支行贷后管理不尽职等违规行为，合计罚款65万元。2025年8月26日，国家金融监督管理总局江西监管局对浦发银行南昌分行违规发放贷款的违规行为，罚款30万元。

25光大银行CD144（代码：112517144）为本基金前五大持仓债券之一。2026年4月8日，中国人民银行重庆市分行对光大银行重庆分行违反金融统计管理规定等违规行为，

罚款208.6万元。2026年4月7日，中国人民银行安徽省分行对光大银行合肥分行违反金融统计相关规定等违规行为，罚款225.57万元。2026年3月27日，国家金融监督管理总局深圳金融监管局对光大银行深圳分行滚动开立银行承兑汇票的违规行为，没收违法所得6万元，罚款120万元。2026年1月29日，国家金融监督管理总局大庆监管分局对光大银行大庆分行贷款“三查”不到位的违规行为，罚款20万元。2026年1月23日，国家金融监督管理总局焦作监管分局对光大银行焦作分行贷后管理不到位等违规行为，罚款60万元。2026年1月12日，国家金融监督管理总局泰州监管分局对光大银行泰州分行项目贷款“三查”不到位等违规行为，罚款115万元。2026年1月6日，国家金融监督管理总局泉州金融监管分局对光大银行泉州分行个人经营性贷款贷前调查不尽职等违规行为，罚款120万元；国家金融监督管理总局沧州监管分局对光大银行沧州分行贷中审查不到位的违规行为，罚款35万元。2026年1月5日，国家金融监督管理总局威海监管分局对光大银行威海分行流动资金贷款贷后管理不到位的违规行为，罚款35万元。2025年12月30日，国家金融监督管理总局大同监管分局对光大银行大同分行贷后管理不到位等违规行为，罚款40万元。2025年12月29日，国家金融监督管理总局龙岩金融监管分局对光大银行龙岩分行个人经营性贷款贷前调查不尽职等违规行为，罚款115万元。2025年10月20日，国家金融监督管理总局镇江监管分局对光大银行镇江分行票据业务管理不到位的违规行为，罚款35万元。2025年10月17日，国家金融监督管理总局宁波监管局对光大银行宁波分行授信业务管理不审慎等违规行为，罚款171万元。2025年10月13日，中国人民银行北海市分行对光大银行北海分行未按规定履行客户身份识别义务的违规行为，罚款21.72万元。2025年9月30日，国家金融监督管理总局盐城监管分局对光大银行盐城分行员工行为管理不到位等违规行为，罚款100万元。2025年9月28日，国家金融监督管理总局丹东金融监管分局对光大银行丹东分行贷款“三查”严重不到位的违规行为，罚款50万元；中国人民银行浙江省分行对光大银行杭州分行违反金融统计管理规定等违规行为，罚款391.75万元。2025年9月12日，国家金融监督管理总局对光大银行信息科技外包管理存在不足等违规行为，罚款430万元。2025年8月20日，国家金融监督管理总局重庆监管局对光大银行重庆分行贴现后管理不到位的违规行为，罚款30万元。

26广发银行CD014（代码：112620014）为本基金前五大持仓债券之一。2026年6月22日，国家外汇局山东省分局对广发银行济南分行办理经常项目资金收付、因未对交易单证的真实性及其与外汇收支的一致性进行合理审查的违规行为，罚没41.44万元。2026年4月7日，中国人民银行本溪市分行对广发银行本溪分行违反账户管理规定等违规行为，罚款48.5万元。2026年3月16日，中国人民银行洛阳市分行对广发银行洛阳分行违反金融统计管理规定等违规行为，罚款86.16万元。2026年3月13日，中国人民银行巴南分行对广发银行重庆巴南支行违反金融统计管理规定的违规行为，罚款50万元。2026年1月30日，中国人民银行常德市分行对广发银行常德分行未按照规定开展客户尽职调查的违规行为，罚款17.2万元。2026年1月6日，国家金融监督管理总局广东监管局对广发银行广州分行、相关分支机构贷款业务严重违反审慎经营规则等违规行为，合计罚款185万元。2026年1月5日，国家金融监督管理总局江门监管分局对广发银行新会支行贷款业务严重违反审慎经营规则的违规行为，罚款31万元。2025年12月30日，国家金融监督管

理总局吉林金融监管局对广发银行长春分行及其分支机构贷款资金回流存保证金等违规行为，合计罚款110万元。2025年12月25日，中国人民银行南充市分行对广发银行南充分行违反账户管理规定的违规行为，罚款380万元。2025年12月9日，国家金融监督管理总局广东监管局对广发银行惠州分行贷款业务严重违反审慎经营规则的违规行为，罚款20万元。2025年11月28日，中国人民银行深圳市分行对广发银行深圳分行违反反假货币业务管理规定等违规行为，罚款204.25万元。2025年11月27日，国家外汇管理局广东省分局对广发银行逃汇、违反规定办理资本项目资金收付等违规行为，罚没1537.83万元。2025年11月21日，国家金融监督管理总局湖北监管局对广发银行武汉分行流动资金贷款贷前调查和贷后管理不尽职的违规行为，罚款35万元。2025年11月5日，国家金融监督管理总局中山监管分局对广发银行中山分行流动资金贷款业务严重违反审慎经营规则的违规行为，罚款154万元。2025年9月12日，国家金融监督管理总局对广发银行相关贷款、票据、保理等业务管理不审慎等违规行为，罚款6670万元。2025年9月5日，国家金融监督管理总局陕西监管局对广发银行西安分行、榆林分行贷款管理不审慎等违规行为，罚款146万元。2025年7月24日，中国人民银行阳江市分行对广发银行阳江分行违反反假货币业务管理规定等违规行为，罚款21.65万元。

本基金投资上述证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除上述证券外，未发现本基金投资的前五名证券的发行主体本期存在被监管部门立案调查，或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 本基金本报告期内未持有股票，故不存在所投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库的情况。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	11.00
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	11.00

5.11.4 报告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可转换债券。

5.11.5 报告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流通受限的股票。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	56,068,437.99
报告期期间基金总申购份额	3,798,259.68
减：报告期期间基金总赎回份额	15,378,511.57
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-
报告期期末基金份额总额	44,488,186.10

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内，基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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	20260401-20260630	15,000,450.00	-	5,000,000.00	10,000,450.00	22.48%
产品特有风险							
1.净值大幅波动的风险 由于本基金份额净值的计算保留到小数点后4位，小数点后第5位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。因此该投资者大额赎回时，有可能导致基金份额净值大幅波动，剩余的持有人存在大幅亏损的风险。 2.出现巨额赎回的风险 该投资者在开放日大额赎回时可能导致本基金发生巨额赎回，当基金出现巨额赎回时，根据基金当时资产组合状况，基金管理人有可能对部分赎回申请延期办理或对已确认的赎回进行部分延期支付。其他投资者的赎回申请也可能同时面临部分延期办理的风险或对已确认的赎回进行部分延期支付的风险。当连续2个开放日以上(含本数)发生巨额赎回，本基金管理人有可能暂停接受赎回申请，已接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过20个工作日。投资者可能面临赎回申请无法确认或者无法及时收到赎回款项的风险。 3.基金规模过小的风险							

根据基金合同的约定，基金合同生效后，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5,000万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续60个工作日出现前述情形的，基金管理人应当在10个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案。该投资者在开放日大额赎回后，可能出现本基金的基金资产净值连续60个工作日低于5,000万元情形。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金不存在影响投资者决策的其他重要信息。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1.中国证监会准予易米中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金募集注册的文件；

2.《易米中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金基金合同》；

3.《易米中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金托管协议》；

4.法律意见书；

5.基金管理人业务资格批件、营业执照；

6.基金托管人业务资格批件、营业执照；

7.中国证监会要求的其他文件。

9.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人及基金托管人的办公场所。

9.3 查阅方式

投资者可在营业时间到基金管理人和/或基金托管人的办公场所免费查阅备查文件，或通过基金管理人、基金托管人、其他基金销售机构的网站查询。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

易米基金管理有限公司

2026年07月21日