

贝莱德安泽60天持有期债券型证券投资基金

2026年中期报告

2026年6月30日

基金管理人：贝莱德基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2026年8月31日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2026年8月28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2026年1月1日起至06月30日止。

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	9
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	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	12
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
§ 5 托管人报告	12
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	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	14
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	35
7.1 期末基金资产组合情况	35
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	36
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	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	36
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	36
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	37
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	37
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	37

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	37
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	37
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	37
7.12 投资组合报告附注	37
§ 8 基金份额持有人信息.....	38
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	38
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	39
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	39
§ 9 开放式基金份额变动.....	39
§ 10 重大事件揭示.....	40
10.1 基金份额持有人大会决议	40
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	40
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	40
10.4 基金投资策略的改变	40
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	40
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	40
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	40
10.8 其他重大事件	41
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	42
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	42
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	42
§ 12 备查文件目录.....	42
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	贝莱德安泽60天持有期债券型证券投资基金	
基金简称	贝莱德安泽60天持有债券	
基金主代码	022634	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025年6月17日	
基金管理人	贝莱德基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	48,279,081.76 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	贝莱德安泽60天持有债券A	贝莱德安泽60天持有债券C
下属分级基金的交易代码	022634	022635
报告期末下属分级基金的份额总额	9,074,075.75份	39,205,006.01份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制投资组合风险的前提下，力争长期内实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金为债券型基金。投资策略主要包括资产配置策略、债券投资策略以及金融衍生品投资策略。 1、资产配置策略 本基金将采用“自上而下”的分析方法，综合分析和持续跟踪基本面、政策面、市场面等多方面因素，结合全球宏观经济形势，研判国内外经济的发展趋势，并在严格控制投资组合风险的前提下，对组合中各类资产的投资比例进行战略配置和动态调整，以规避或分散市场风险，力争实现基金资产的中长期稳健增值。 2、债券投资策略 本基金采用的债券投资策略包括：久期策略、信用策略、互换策略、息差策略以及个券挖掘策略等。 3、金融衍生品投资策略
业绩比较基准	中债-总全价(总值)指数收益率 $\times 80\%$ +一年期定期存款利率(税后) $\times 20\%$
风险收益特征	本基金为债券型基金，在通常情况下其预期风险和收益低于股票型基金和混合型基金，高于货币市场基金。

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		贝莱德基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露	姓名	谢超	王小飞

露负责人	联系电话	021-80225188	021-60637103
	电子邮箱	Compliance_FMC@blackrock.com.cn	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		400-002-6655	021-60637228
传真		021-80225288	021-60635778
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1233 号汇亚大厦 7 楼 702 室	北京市西城区金融大街25号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1233 号汇亚大厦 7 楼 702 室	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		200120	100033
法定代表人		郁蓓华	张金良

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.blackrock.com.cn
基金中期报告置备地点	基金管理人和基金托管人的办公地址

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国建设银行股份有限公司	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

§ 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(2026年1月1日 - 2026年6月30日)	
	贝莱德安泽60天持有债券A	贝莱德安泽60天持有债券C
本期已实现收益	97,341.88	309,622.34
本期利润	224,347.10	662,141.46
加权平均基金份 额本期利润	0.0142	0.0131
本期加权平均净 值利润率	1.41%	1.30%
本期基金份额净 值增长率	1.41%	1.29%
3.1.2 期末数 据和指标	报告期末(2026年6月30日)	

期末可供分配利润	122, 209. 46	443, 101. 62
期末可供分配基金份额利润	0. 0135	0. 0113
期末基金资产净值	9, 275, 258. 85	39, 986, 883. 88
期末基金份额净值	1. 0222	1. 0199
3. 1. 3 累计期末指标	报告期末(2026年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	2. 22%	1. 99%

注：1、上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

贝莱德安泽60天持有债券A

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
过去三个月	0. 72%	0. 02%	0. 47%	0. 04%	0. 25%	-0. 02%
过去六个月	1. 41%	0. 02%	0. 65%	0. 04%	0. 76%	-0. 02%
过去一年	2. 25%	0. 02%	-0. 56%	0. 06%	2. 81%	-0. 04%
自基金合同生效日起至今	2. 22%	0. 02%	-0. 51%	0. 06%	2. 73%	-0. 04%

贝莱德安泽60天持有债券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
过去三个月	0. 66%	0. 02%	0. 47%	0. 04%	0. 19%	-0. 02%
过去六个月	1. 29%	0. 02%	0. 65%	0. 04%	0. 64%	-0. 02%

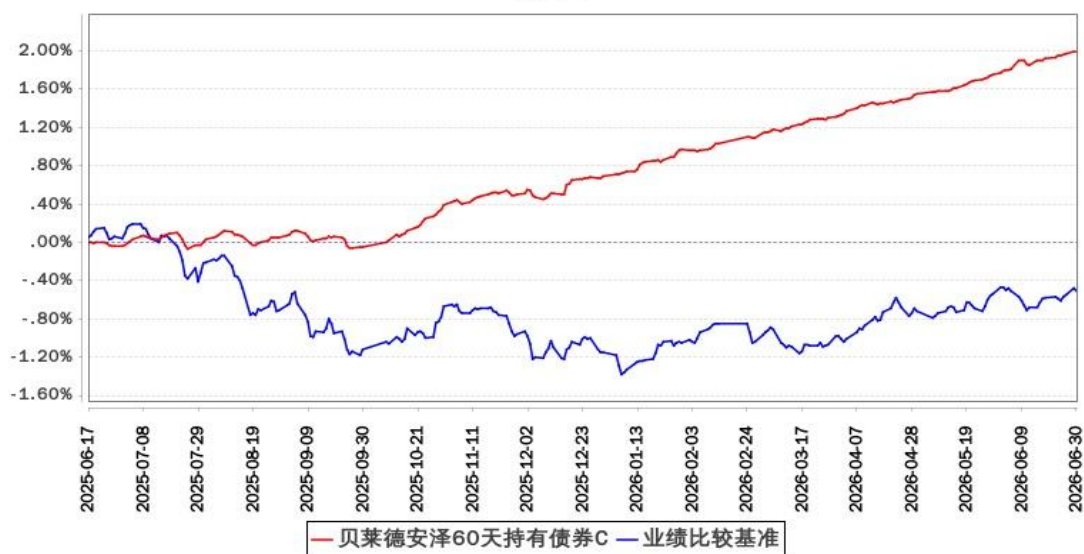
过去一年	2.03%	0.02%	-0.56%	0.06%	2.59%	-0.04%
自基金合同生效 日起至今	1.99%	0.02%	-0.51%	0.06%	2.50%	-0.04%

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

贝莱德安泽60天持有债券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



贝莱德安泽60天持有债券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



注：本基金的基金合同于2025年06月17日生效，本基金自基金合同生效日起6个月内为建仓期，本基金建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

§ 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

贝莱德基金管理有限公司成立于2020年9月10日，是国内首家外资全资控股的公募基金管理公司。公司经中国证券监督管理委员会《关于核准设立贝莱德基金管理有限公司的批复》（证监许可[2020]1917号）批准，由贝莱德金融管理公司（BlackRock Financial Management, Inc.）出资成立。截至报告期末，公司旗下发行并管理了19只公开募集证券投资基金：贝莱德中国新视野混合型证券投资基金、贝莱德港股通远景视野混合型证券投资基金、贝莱德先进制造一年持有期混合型证券投资基金、贝莱德浦悦丰利混合型证券投资基金、贝莱德欣悦丰利债券型证券投资基金、贝莱德行业优选混合型证券投资基金、贝莱德安睿30天持有期债券型证券投资基金、贝莱德卓越远航混合型证券投资基金、贝莱德中债0-3年政策性金融债指数证券投资基金、贝莱德安裕90天持有期债券型证券投资基金、贝莱德沪深300指数增强型证券投资基金、贝莱德中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金、贝莱德和悦利率债债券型证券投资基金、贝莱德中证A500指数增强型证券投资基金、贝莱德富元添益债券型证券投资基金、贝莱德安泽60天持有期债券型证券投资基金、贝莱德中债投资优选绿色债券指数证券投资基金、贝莱德中证500指数增强型证券投资基金、贝莱德富元金利混合型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王洋 /WANG YANG	本基金的基金经理、固定收益部负责人	2025年6月27日		17年	王洋/WANG YANG先生，固定收益部负责人、基金经理，历任贝莱德伦敦基金经理，贝莱德新加坡指数研究员以及利率/外汇交易员，美国资管公司股票研究员。王洋/WANG YANG先生是金融风险管理师（FRM）持证人，并拥有美国伊利诺伊大学厄巴纳-香槟分校金融硕士学位、新加坡国立大学电子工程学士学位。
刘鑫 /LIU XIN	曾任本基金的基金经理、首席固定收益投资官	2025年6月17日	2026年4月10日	21年	刘鑫/LIU XIN先生，已离任首席固定收益投资官、基金经理。曾于贝莱德新加坡固定收益部担任负责人及基金经理职务，并曾任安本资产管理公司基金经理、三菱日联金融集团投资经理、新加坡科技资产管理公司基金经理等职务。刘鑫/LIU XIN先生是特许金融分析师（CFA）、金融风险管理师（FRM）持证

					人，拥有欧洲工商管理学院工商管理硕士学位、南洋理工大学电子工程学士学位。
邹立波	本基金的基金经理助理	2025年6月17日		9年	邹立波先生，基金经理及基金经理助理，曾任专户投资部投资经理。曾就职于信银理财有限责任公司、中信银行总行资产管理业务中心、中信银行上海分行、南瑞集团有限公司。邹立波先生拥有新西兰奥克兰理工大学硕士学位、奥克兰大学学士学位。

注：1、此处的任职日期和离任日期均指公司决定生效之日，首任基金经理，任职日期为基金合同生效日。

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》及行业协会的相关规定。

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

截至本报告期末，本基金的基金经理不存在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遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和本基金基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金无重大违法、违规行为，本基金投资运作符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有投资组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部相关公平交易制度等规定。

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。

报告期内，未出现涉及本基金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

2026年上半年国内GDP同比增长4.7%，增速处于年度预期4.5-5.0%的目标区间，节奏上来

看，一季度经济实现“开门红”，二季度受投资走弱和内需修复偏慢等因素影响，增长动能有所回落。

具体来看，上半年外贸保持较快增长，出口同比增长13.4%，为上半年经济运行提供了重要支撑。上半年的工业生产保持韧性，继续稳定经济基本盘，新动能增长较快，产业升级趋势延续，规模以上装备制造业和高技术制造业增加值分别同比增长9.3%和13.3%，分别快于全部规模以上工业3.9和7.9个百分点。然而，国内仍面临投资表现下行、消费修复偏弱的结构性问题：上半年，全国固定资产投资同比下降5.7%，较一季度增长1.7%明显回落；扣除房地产开发投资后仍下降2.7%，投资下滑是二季度经济动能减弱的重要原因，后续仍期待重大项目和政策性资金对有效投资的带动作用；社会消费品零售总额上半年同比增长1.3%，居民需求修复仍显不足。

价格方面，中东地缘冲突影响，油价和输入性通胀抬升，物价的回升带动了企业盈利环境有所改善：全国居民消费价格同比上涨1.0%，扣除食品和能源价格后的核心CPI上涨1.2%，居民消费领域价格总体保持温和，工业品价格改善更为明显，上半年PPI同比上涨1.5%，价格回升逐步向企业经营端传导，1-6月规模以上工业企业利润同比增长18.7%，带动企业收入和盈利状况较前期有所修复。

在货币政策方面，央行维持适度宽松的货币政策，1月15日央行进行结构性降息——下调再贷款、再贴现利率0.25个百分点；且在2月春节期间通胀买断式逆回购和MLF操作净投放，维护资金面平稳。银行间隔夜回购利率在3-4月的大多数时间都低于央行政策利率，央行在二季度开始通过买断式逆回购和MLF等工具逐步回笼市场上的冗余资金，从5月下旬开始，资金面出现边际收紧。

回顾上半年，利率在方向上整体震荡下行，利率曲线走陡：长端国债利率由于配置需求和二季度基本面走弱带动利率从年初的1.85%逐步下行至1.75%，海外地缘冲突和输入性通胀并未引发央行调整货币政策，短端利率受益于宽松的资金面——1年期国债利率从1.30%逐步下行至1.10%。

信用债方面，上半年资产荒特征显著，收益率震荡下行，信用风险整体收敛。一级市场供给结构分化，产业债成为核心供给增量，高端制造、科创类央企发债需求旺盛，发行利率下行为主，认购热度持续；城投债受全域化债政策约束持续压降净融资，银行二永债集中放量带来阶段性供给压力，中长期品种发行占比提升。一季度各等级信用利差整体收窄，产业低等级、地产债估值修复力度明显，二季度受评级监管加强影响，弱资质发行人评级取消与下调数量抬升，带动季末信用利差有所走阔，弱城投、弱产业债仍面临再融资压力和利差抬升风险。理财、保险配置资金充裕，机构前期增持优质产业债、精选相对利差优势品种获取超额收益，季末缩短久期避

险。整体来看，上半年信用债票息与利差压缩行情兼具，短期资金波动和评级监管压力带来阶段性扰动，配置环境整体平稳。

从配置思路来讲，虑到利率收益率处于相对低位及宏观环境变化，本基金一季度下调整体久期仓位，并在二季度维持较低久期仓位。债券方面优选高等级高流动性的信用债券，均衡配置于金融，城投及产业债，同时也增配一定比例的高收益短期限城投债以增厚票息收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金A类份额净值1.0222元，本报告期内净值增长率1.41%，同期业绩比较基准收益率0.65%。截至本报告期末，本基金C类份额净值1.0199元，本报告期内净值增长率1.29%，同期业绩比较基准收益率0.65%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

对未来半年，K型经济分化可能持续，伴随海外经济下行国内出口阶段性转弱，投资和消费环境阻力增加，下半年经济有可能弱于前半年。我们认为央行在下半年底有一定降准降息的可能，同时预计资金利率保持平稳。债券市场有望在振幅中看到长端收益率继续下行的机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，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，委托基金服务机构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。基金管理人及委托的基金服务机构严格执行基金估值控制流程，定期评估估值技术的合理性，基金份额净值经基金托管人复核无误后由基金管理人对外披露。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规、本基金基金合同的约定以及基金的实际运作情况，本报告期内本基金未进行收益分配。本基金将严格按照法律法规及基金合同约定进行收益分配。

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

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行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，本基金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。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

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： 贝莱德安泽60天持有期债券型证券投资基金

报告截止日：2026年6月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026年6月30日	上年度末 2025年12月31日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	3,132,859.22	4,429,427.09
结算备付金		1,249,038.21	1,303,628.32
存出保证金		39,812.50	224,276.00
交易性金融资产	6.4.7.2	51,897,282.74	158,527,089.41
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		51,897,282.74	158,527,089.41
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		12,512.36	309.98
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		56,331,505.03	164,484,730.80
负债和净资产	附注号	本期末 2026年6月30日	上年度末 2025年12月31日
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		6,899,931.00	33,822,291.08
应付清算款		-	-
应付赎回款		59,089.51	4,354,170.70
应付管理人报酬		9,390.43	36,062.16
应付托管费		3,756.17	14,424.84
应付销售服务费		5,942.16	18,664.45
应付投资顾问费		-	-
应交税费		4,612.55	16,246.99
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	86,640.48	49,960.15
负债合计		7,069,362.30	38,311,820.37
净资产:			
实收基金	6.4.7.7	48,279,081.76	125,261,401.70
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	983,060.97	911,508.73
净资产合计		49,262,142.73	126,172,910.43
负债和净资产总计		56,331,505.03	164,484,730.80

注： 报告截止日2026年06月30日，基金份额总额48,279,081.76份，其中A类基金份额净值1.0222元，基金份额9,074,075.75份；C类基金份额净值1.0199元，基金份额39,205,006.01份。

6.2 利润表

会计主体：贝莱德安泽60天持有期债券型证券投资基金

本报告期：2026年1月1日至2026年6月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026年1月1日至2026年6 月30日	上年度可比期间 2025年6月17日（基金合 同生效日）至2025年6月 30日
一、营业总收入		1,189,751.76	-151,859.66
1. 利息收入		17,677.46	226,035.33

其中：存款利息收入	6.4.7.9	15,527.81	144,905.09
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		2,149.65	81,130.24
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		692,549.96	200,200.67
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	701,763.52	200,200.67
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	-9,213.56	-
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	479,524.34	-578,095.66
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		303,263.20	154,948.69
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	84,157.29	74,185.25
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	33,662.93	29,674.09
3. 销售服务费		51,176.15	41,658.48
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		29,917.89	-
其中：卖出回购金融资产支出		29,917.89	-
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		3,651.69	808.57
8. 其他费用	6.4.7.16	100,697.25	8,622.30
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		886,488.56	-306,808.35
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		886,488.56	-306,808.35

五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		886,488.56	-306,808.35

6.3 净资产变动表

会计主体：贝莱德安泽60天持有期债券型证券投资基金

本报告期：2026年1月1日至2026年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026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	125,261,401.70	-	911,508.73	126,172,910.43
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	125,261,401.70	-	911,508.73	126,172,910.43
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-76,982,319.94	-	71,552.24	-76,910,767.70
（一）、综合收益总额	-	-	886,488.56	886,488.56
（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）	-76,982,319.94	-	-814,936.32	-77,797,256.26
其中：1. 基金申购款	27,103,394.23	-	425,412.13	27,528,806.36
2. 基金赎回款	-104,085,714.17	-	-1,240,348.45	-105,326,062.62
（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	48,279,081.76	-	983,060.97	49,262,142.73
项目	上年度可比期间 2025年6月17日（基金合同生效日）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	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	833,270,340.31	-	-	833,270,340.31
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-	-	-306,808.35	-306,808.35
（一）、综合收益总额	-	-	-306,808.35	-306,808.35
（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	833,270,340.31	-	-306,808.35	832,963,531.96

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：

郁蓓华杨怡徐菱莲

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

贝莱德安泽60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[2024]1538号《关于准予贝莱德安泽60天持有期债券型证券投资基金注册的批复》准予注册,由贝莱德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《贝莱德安泽60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基金,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832,938,910.37元,业经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)德师报(验)字(25)第00180号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《贝莱德安泽60天持有期债券型证券投资基金基金合同》于2025年6月17日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为833,270,340.31份基金份额,其中认购资金利息折合331,429.94份基金份额。本基金的基金管理人为贝莱德基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《贝莱德安泽60天持有期债券型证券投资基金基金合同》和《贝莱德安泽60天持有期债券型证券投资基金招募说明书》,本基金根据认购/申购费用、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。其中:在投资者认购、申购时收取认购、申购费用,在赎回时根据持有期限收取赎回费用,但不从本类别基金资产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而不收取认购/申购费用、在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额,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《贝莱德安泽60天持有期债券型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金投资于流动性良好的金融工具,包括债券(国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府支持债券、政府支持机构债券、地方政府债券、可分离交易可转债的纯债部分及其他经中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款(包含协议存款、定期存款及其他银行存款)、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投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金不投资于股票资产,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。基金的投资组合比例为：本基金对债券的投资比例不低于基金资产的80%；本基金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，持有现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准：中债-总全价(总值)指数收益率 $\times$ 80%+一年期定期存款利率(税后) $\times$ 20%。

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《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称“企业会计准则”)、中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金2026年6月30日的财务状况以及2026年上半年度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

本基金本报告期无需说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无需说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[2008]1号《财政部、国家税务总局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[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[2025]4号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、国务院令826号《中华人民共和国

增值税法实施条例》、财税[2026]10号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》[JS20.1]、财税[2026]12号《关于明确增值税应税交易销售额计算口径的公告》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

- (1)对公募证券投资基金(封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖债券取得的收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；2027年12月31日前，公开募集证券投资基金管理人运营契约资管产品过程中发生的增值税应税行为，以基金管理人为增值税纳税人，可以选择适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。
- (2)对证券投资基金取得的自2025年8月8日之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复缴纳增值税；取得的在2025年8月8日之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(包含在2025年8月8日之后续发行的部分)的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。
- (3)对证券投资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。
- (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 2026年6月30日
活期存款	3,127,751.33
等于：本金	3,127,670.91
加：应计利息	80.42
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	5,107.89
等于：本金	5,106.08
加：应计利息	1.81
减：坏账准备	-
合计	3,132,859.22

注：其他存款为存放在证券经纪商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 2026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	19,032,167.58	74,718.58	19,076,968.58	-29,917.58
	银行间市场	32,380,800.09	455,454.16	32,820,314.16	-15,940.09
	合计	51,412,967.67	530,172.74	51,897,282.74	-45,857.67
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		51,412,967.67	530,172.74	51,897,282.74	-45,857.67

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 2026年6月30日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-1,137,700.00	-	-	-
其中： 国债期货	-1,137,700.00	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-1,137,700.00	-	-	-

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
TL2609	TL2609	-1.00	-1,137,500.00	200.00
合计				200.00

减：可抵销 期货暂收款				200.00
净额				-

注：1、买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

2、衍生金融资产项下的利率\权益衍生工具为国债\股指期货投资，净额为0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持国债\股指期货投资合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的国债\股指期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为0。

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。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026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	6,108.15
其中：交易所市场	-
银行间市场	6,108.15
应付利息	-
预提费用	80,532.33
合计	86,640.48

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

贝莱德安泽60天持有债券A

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	43,331,944.86	43,331,944.86
本期申购	500,754.62	500,754.62
本期赎回（以“-”号填列）	-34,758,623.73	-34,758,623.73
本期末	9,074,075.75	9,074,075.75

贝莱德安泽60天持有债券C

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	81,929,456.84	81,929,456.84
本期申购	26,602,639.61	26,602,639.61
本期赎回（以“-”号填列）	-69,327,090.44	-69,327,090.44
本期末	39,205,006.01	39,205,006.01

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

贝莱德安泽60天持有债券A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	237,126.32	110,225.96	347,352.28
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	237,126.32	110,225.96	347,352.28
本期利润	97,341.88	127,005.22	224,347.10
本期基金份额交易产生的变动数	-212,258.74	-158,257.54	-370,516.28
其中：基金申购款	4,325.62	3,292.00	7,617.62
基金赎回款	-216,584.36	-161,549.54	-378,133.90
本期已分配利润	-	-	-
本期末	122,209.46	78,973.64	201,183.10

贝莱德安泽60天持有债券C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	356,382.03	207,774.42	564,156.45
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	356,382.03	207,774.42	564,156.45
本期利润	309,622.34	352,519.12	662,141.46
本期基金份额交易产生的变动数	-222,902.75	-221,517.29	-444,420.04
其中：基金申购款	230,026.34	187,768.17	417,794.51
基金赎回款	-452,929.09	-409,285.46	-862,214.55
本期已分配利润	-	-	-
本期末	443,101.62	338,776.25	781,877.87

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
活期存款利息收入	1,372.98
定期存款利息收入	—
其他存款利息收入	153.69
结算备付金利息收入	14,001.14
其他	—
合计	15,527.81

注：其他存款利息收入为存放在证券经纪商的证券交易结算资金的利息收入。

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

本基金本报告期内无股票投资收益。

6.4.7.10.2 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收益-买卖股票差价收入。

6.4.7.10.3 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收益-证券出借差价收入。

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 2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	1,083,594.17
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-381,830.65
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	701,763.52

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 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	259,593,462.22
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	256,410,559.67
减：应计利息总额	3,554,263.46
减：交易费用	10,469.74
买卖债券差价收入	-381,830.65

6.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无债券投资收益-赎回差价收入。

6.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无债券投资收益-申购差价收入。

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

本基金本报告期内无衍生工具收益-买卖权证差价收入。

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 2026年1月1日至2026年6月30日
国债期货投资收益	-9,213.56

6.4.7.13 股利收益

本基金本报告期内无股利收益。

6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
1. 交易性金融资产	492,142.11
股票投资	-
债券投资	492,142.11
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-13,050.00
权证投资	-
国债期货	-13,050.00
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-432.23
合计	479,524.34

6.4.7.15 其他收入

本基金本报告期内无其他收入。

6.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
----	----------------------------

审计费用	21,024.96
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
上清所账户维护费	9,600.00
中债账户维护费	9,000.00
汇划手续费	1,564.92
合计	100,697.25

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，本基金无需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无需要披露的重大资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
贝莱德基金管理有限公司（“贝莱德基金”）	基金管理人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人、注册登记机构、基金代销机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日	上年度可比期间 2025年6月17日（基金合同生效日）至2025年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	84,157.29	74,185.25
其中：应支付销售机构的客户维护费	41,623.52	35,419.82
应支付基金管理人的净管理费	42,533.77	38,765.43

注：支付基金管理人贝莱德基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值0.25%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：日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×0.25%÷当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日	上年度可比期间 2025年6月17日（基金合同生效日）至2025年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	33,662.93	29,674.09

注：支付基金托管人中国建设银行的基金托管费按前一日基金资产净值0.10%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：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.10%÷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 2026年1月1日至2026年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	贝莱德安泽60天持有 债券A	贝莱德安泽60天持有 债券C	合计
中国建设银行	-	50,622.01	50,622.01
合计	-	50,622.01	50,622.01
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2025年6月17日（基金合同生效日）至2025年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		

	贝莱德安泽60天持有 债券A	贝莱德安泽60天持有 债券C	合计
中国建设银行	-	41,124.42	41,124.42
合计	-	41,124.42	41,124.42

注：本基金实行销售服务费分级收费方式，分设A、C两类基金份额。本基金A类基金份额不收取销售服务费；C类基金的销售服务费按前一日C类基金份额对应的资产净值0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日销售服务费=前一日C类基金份额对应的资产净值×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

本基金本报告期内及上年度可比期间均无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

本基金本报告期内及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

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

本基金本报告期内及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

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

本基金本报告期内及上年度可比期间均无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

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

本基金本报告期末及上年度末均无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

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 2026年1月1日至2026年6月30日		上年度可比期间 2025年6月17日（基金合同生效日）至 2025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
中国建设银行	3,127,751.33	1,372.98	154,339.94	10,847.41

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率或协议利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间均未发生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

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2026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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

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

本基金本报告期末无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。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2026年06月30日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额6,899,931.00元，于2026年07月01日(先后)到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.12.4 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因参与转融通证券出借业务而出借的证券。

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

本基金为债券型基金，在通常情况下其预期风险和收益低于股票型基金和混合型基金，高于货币市场基金。本基金在日常投资管理中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建立，建立了由董事会、公司管理层、风险管理部门和业务职能部门构成的四级风险管理组织架构，并明确了相应的风险管理职能。董事会对风险管理的责任包括制定业务战略和风险管理目标、审阅重大事件和决策的风险评估等；管理层

负责风险管理政策、风险控制措施的制定和落实，确保有效管理所有重大风险，下设风险管理委员会，根据董事会和管理层的授权开展风险管理工作；风险管理部门负责风险评估、报告、监控和管理，主要职责包括制定公司风险管理制度和程序、实施定量和定性的风险评估等；业务职能部门从经营管理的各业务环节上贯彻落实风险管理措施。在业务操作层面，各部门积极配合风险管理部门完成运作风险管理，其他中后台部门包括但不限于财务、合规稽核和运营等部门在各自职能范围内支持或监督公司风险管理。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要通过定性和定量相结合的分析方法去评估各种相关风险可能造成的影响。从定性分析的角度出发，判断风险的种类、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的金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型和日常风险报告等，确定基金资产的风险状态及其是否符合基金的风险特征，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。

本基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用评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。本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算，对手为中国证券登记结算有限责任公司；在银行间同业市场根据交易类型采取白名单和黑名单相结合的方式防范交易对手风险。

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固定收益品种占基金资产净值的比例为85.59%(上年度末：108.96%)。

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 2026年6月30日	上年度末 2025年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	12,294,379.74	18,241,016.21
合计	12,294,379.74	18,241,016.21

注：本报告期末，未评级短期信用债券为证券公司短期公司债券、超短期融资券及其他企业短期融资债；上年度末，未评级短期信用债券为超短期融资券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度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 2026年6月30日	上年度末 2025年12月31日
AAA	16,466,848.45	71,083,671.61
AAA以下	—	8,236,361.64
未评级	13,404,131.40	39,915,121.70
合计	29,870,979.85	119,235,154.95

注：本报告期末，未评级长期信用债券为公司债和中期票据；上年度末，未评级长期信用债券主要包括公司债和中期票据。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度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在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可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。

于本报告期末，除本基金的卖出回购金融资产款余额（计息且利息金额不重大）外，本基金所承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（净资产）无固定到期日且不计息，该部分账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

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》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%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的30%（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%。于本报告期末，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例符合法律法规的相关要求。

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。于本报告期末，本基金组合资产中7个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

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。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具

还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人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。

本基金投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种比重较大，此外本期还持有银行存款和国债期货等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026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	3,132,859.22	-	-	-	3,132,859.22
结算备付金	1,249,038.21	-	-	-	1,249,038.21
存出保证金	-	-	-	39,812.50	39,812.50
交易性金融资产	31,216,604.81	13,346,336.93	7,334,341.00	-	51,897,282.74
应收申购款	-	-	-	12,512.36	12,512.36
资产总计	35,598,502.24	13,346,336.93	7,334,341.00	52,324.86	56,331,505.03
负债					
应付赎回款	-	-	-	59,089.51	59,089.51
应付管理人报酬	-	-	-	9,390.43	9,390.43
应付托管费	-	-	-	3,756.17	3,756.17
卖出回购金融资产款	6,899,931.00	-	-	-	6,899,931.00
应付销售服务费	-	-	-	5,942.16	5,942.16
应交税费	-	-	-	4,612.55	4,612.55
其他负债	-	-	-	86,640.48	86,640.48
负债总计	6,899,931.00	-	-	169,431.30	7,069,362.30
利率敏感度缺口	28,698,571.24	13,346,336.93	7,334,341.00	-117,106.44	49,262,142.73
上年度末 2025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	4,429,427.09	-	-	-	4,429,427.09
结算备付金	1,303,628.32	-	-	-	1,303,628.32
存出保证金	-	-	-	224,276.00	224,276.00
交易性金融资产	44,467,222.13	86,023,255.22	28,036,612.06	-	158,527,089.41
应收申购款	-	-	-	309.98	309.98
资产总计	50,200,277.54	86,023,255.22	28,036,612.06	224,585.98	164,484,730.80
负债					
应付赎回款	-	-	-	4,354,170.70	4,354,170.70
应付管理人报酬	-	-	-	36,062.16	36,062.16
应付托管费	-	-	-	14,424.84	14,424.84
卖出回购金融资产款	33,822,291.08	-	-	-	33,822,291.08
应付销售服务费	-	-	-	18,664.45	18,664.45

应交税费	-	-	-	16,246.99	16,246.99
其他负债	-	-	-	49,960.15	49,960.15
负债总计	33,822,291.08	-	-	4,489,529.29	38,311,820.37
利率敏感度缺口	16,377,986.46	86,023,255.22	28,036,612.06	-4,264,943.31	126,172,910.43

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的到期日予以分类。

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（2026年6月30日）	上年度末（2025年12月31日）
	利率上升25bp	-103,362.69	-469,267.79
	利率下降25bp	102,330.97	473,003.26

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 2026年6月30日	上年度末 2025年12月31日
---------------	-------------------	---------------------

第一层次	-	-
第二层次	51,897,282.74	158,527,089.41
第三层次	-	-
合计	51,897,282.74	158,527,089.41

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

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

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括货币资金、应收款项和其他金融负债，其公允价值和账面价值相等。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截止资产负债表日，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	51,897,282.74	92.13
	其中：债券	51,897,282.74	92.13
	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	4,381,897.43	7.78
8	其他各项资产	52,324.86	0.09
9	合计	56,331,505.03	100.00

注：1、本基金本报告期末未持有通过港股通交易机制投资的港股。

2、本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

3、本基金本报告期末未持有全国中小企业股份转让系统挂牌股票。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有境内股票。

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金本报告期内未持有股票。

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	9,731,923.15	19.76
2	央行票据	-	-
3	金融债券	7,552,955.86	15.33
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	6,125,417.42	12.43
5	企业短期融资券	9,074,751.73	18.42
6	中期票据	19,412,234.58	39.41
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-

10	合计	51,897,282.74	105.35
----	----	---------------	--------

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

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	019827	26国债01	33,000	3,321,390.33	6.74
2	2128028	21邮储银行二级01	32,000	3,303,116.62	6.71
3	244637	26光证S3	32,000	3,219,628.01	6.54
4	019835	26国债09	32,000	3,205,266.41	6.51
5	102334	国债2609	32,000	3,205,266.41	6.51

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

本基金本报告期内未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金投资国债期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场定性和定量的分析，对国债期货和现货基差、国债期货的流动性、波动水平等指标进行跟踪监控。

7.11.2 本期国债期货投资评价

2026上半年本基金在信用超配的情况时进行了国债期货套保交易控制整体组合久期风险敞口，适当适时降低基金久期风险，并且在信用债减持时结束套保交易。

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中，中国邮政储蓄银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到处罚。上述证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

7.12.2

本基金本报告期末未持有股票。

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	39,812.50
2	应收清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	12,512.36
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	52,324.86

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，投资组合报告中市值占净值比例的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

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
贝莱德安泽60天持有债券A	119	76,252.74	3,092.87	0.03 %	9,070,982.88	99.97 %
贝莱德安泽60天持有债券C	359	109,206.14	1,000,443.06	2.55 %	38,204,562.95	97.45 %
合计	478	101,002.26	1,003,535.93	2.08 %	47,275,545.83	97.92 %

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）。

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	贝莱德安泽60天持有债券A	0.00	0.0000 %
	贝莱德安泽60天持有债券C	0.00	0.0000 %
	合计	0.00	0.0000 %

注：从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，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）。

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	贝莱德安泽60天持有债券A	0
	贝莱德安泽60天持有债券C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	贝莱德安泽60天持有债券A	0
	贝莱德安泽60天持有债券C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	贝莱德安泽60天持有债券A	贝莱德安泽60天持有债券C
基金合同生效日 （2025年6月17日） 基金份额总额	248,364,243.14	584,906,097.17
本报告期期初基金 份额总额	43,331,944.86	81,929,456.84
本报告期基金总申 购份额	500,754.62	26,602,639.61
减：本报告期基金 总赎回份额	34,758,623.73	69,327,090.44
本报告期基金拆分 变动份额	-	-
本报告期期末基金 份额总额	9,074,075.75	39,205,006.01

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 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

基金管理人：2026年上半年，基金管理人未发生重大人事变动。

基金托管人：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

本报告期无涉及影响基金管理人经营或基金运营业务，或与基金财产相关的诉讼。

本报告期无涉及基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，为本基金进行审计的机构未发生变化，为德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内管理人无受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内托管人无受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内托管人相关人员无受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)	佣金	占当期佣金总量的比例(%)	

中信证券 (山东) 有限责任 公司	2	-	-	5,344.86	100.00	-
----------------------------	---	---	---	----------	--------	---

注：1、此处的佣金指通过单一券商的交易单元进行股票、债券、债券回购、权证等交易（如有）而合计支付该券商的佣金合计，不单指股票交易佣金。

2、本基金采用券商交易模式。根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，基金管理人管理的采用券商交易模式的基金，不适用有关交易佣金集中度限制的规定。

3、本基金管理人选择财务状况良好、经营行为规范、研究实力较强、能满足公募基金采用券商交易模式进行证券交易和结算需要的证券公司作为本基金的证券经纪商。

4、本基金管理人与选择的证券经纪商、本基金的托管人签订证券经纪服务协议，对账户管理、资金存管、交易执行、交易管理、佣金收取、清算交收、违约责任等作出约定。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	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(%)
中信证券(山东)有限责任公司	215,883,797.07	100.00	338,062,000.00	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	贝莱德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（2025年度）	中国证监会规定媒介	2026年3月31日
2	贝莱德安泽 60 天持有期债券型证券投资基金基金经理变更公告	中国证监会规定媒介	2026年4月11日
3	贝莱德安泽60天持有期债券型证券投资基金(A类份额)基金产品资料概要更新（2026年第1号）	中国证监会规定媒介	2026年4月11日
4	贝莱德安泽60天持有期债券型证券投资基金(C类份额)基金产品资料概要更新（2026年第1号）	中国证监会规定媒介	2026年4月11日
5	贝莱德安泽60天持有期债券型证券	中国证监会规定媒介	2026年4月11日

	投资基金招募说明书更新（2026年第1号）		
6	贝莱德安泽60天持有期债券型证券投资基金2026年第1季度报告	中国证监会规定媒介	2026年4月22日
7	贝莱德安泽60天持有期债券型证券投资基金(A类份额)基金产品资料概要更新（2026年第2号）	中国证监会规定媒介	2026年4月30日
8	贝莱德安泽60天持有期债券型证券投资基金(C类份额)基金产品资料概要更新（2026年第2号）	中国证监会规定媒介	2026年4月30日
9	贝莱德安泽60天持有期债券型证券投资基金招募说明书更新（2026年第2号）	中国证监会规定媒介	2026年4月30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

本基金本报告期内未发生单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

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、本基金的中国证监会批准募集文件
- 2、本基金的基金合同
- 3、本基金的招募说明书
- 4、本基金的托管协议
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、本基金的公告
- 7、中国证监会要求的其他文件

12.2 存放地点

基金管理人的办公场所：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1233 号汇亚大厦 7 楼 702室。

12.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人网站（www.blackrock.com.cn）查阅，或在营业时间内至基金管理人办公场所免费查阅。

贝莱德基金管理有限公司

2026年8月31日