

# 蜂巢添跃 66 个月定期开放债券型证券投资基金

## 2023 年中期报告

2023 年 06 月 30 日

基金管理人:蜂巢基金管理有限公司

基金托管人:兴业银行股份有限公司

报告送出日期:2023 年 08 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会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的法律责任。本年度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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2023年08月23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2023年01月01日起至2023年06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                              | 6         |
| 3.3 其他指标                                | 7         |
| <b>§ 4 管理人报告</b>                        | <b>8</b>  |
| 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             | 9         |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 10        |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 11        |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 11        |
| 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明       | 11        |
| <b>§ 5 托管人报告</b>                        | <b>11</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 11        |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 | 12        |
| 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       | 12        |
| <b>§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)</b>              | <b>12</b> |
| 6.1 资产负债表                               | 12        |
| 6.2 利润表                                 | 13        |
| 6.3 净资产(基金净值)变动表                        | 15        |
| 6.4 报表附注                                | 16        |
| <b>§ 7 投资组合报告</b>                       | <b>41</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况                          | 41        |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合                    | 41        |
| 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       | 42        |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动                     | 42        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 42        |
| 7.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细      | 42        |

|   |           |
|---|-----------|
| 7.7 期末按摊余成本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 ..... | 43        |
| 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 ..... | 43        |
| 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 .....    | 43        |
| 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....             | 43        |
| 7.11 投资组合报告附注 .....                         | 43        |
| <b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>                  | <b>44</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                 | 44        |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....              | 44        |
| 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 .....      | 44        |
| <b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>                  | <b>44</b> |
| <b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>                    | <b>45</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 .....                      | 45        |
| 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 .....      | 45        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....           | 45        |
| 10.4 基金投资策略的改变 .....                        | 45        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....                 | 45        |
| 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 .....         | 45        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....                | 45        |
| 10.8 其他重大事件 .....                           | 47        |
| <b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>            | <b>47</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 .....    | 47        |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....                   | 48        |
| <b>§ 12 备查文件目录 .....</b>                    | <b>48</b> |
| 12.1 备查文件目录 .....                           | 48        |
| 12.2 存放地点 .....                             | 48        |
| 12.3 查阅方式 .....                             | 48        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                         |
|------------|-------------------------|
| 基金名称       | 蜂巢添跃 66 个月定期开放债券型证券投资基金 |
| 基金简称       | 蜂巢添跃 66 个月定开债券          |
| 基金主代码      | 008316                  |
| 基金运作方式     | 契约型、定期开放式               |
| 基金合同生效日    | 2020 年 12 月 10 日        |
| 基金管理人      | 蜂巢基金管理有限公司              |
| 基金托管人      | 兴业银行股份有限公司              |
| 报告期末基金份额总额 | 7,990,034,597.05 份      |
| 基金合同存续期    | 不定期                     |

### 2.2 基金产品说明

|        |  |
|--------|--|
| 投资目标   | 本基金采取严格的买入持有到期策略，投资于剩余期限（或回售期限）不超过基金剩余封闭期的固定收益类工具，在控制组合净值波动率的前提下，力求实现基金资产的稳健增值。  |
| 投资策略   | 本基金在合同约定的投资范围内，在遵守投资限制的基础上，通过对经济、市场的研究，在封闭期运用资产配置策略、信用债投资策略、封闭期现金管理策略、资产支持证券投资策略、证券公司短期公司债投资策略、杠杆投资策略等，在开放期注重流动性管理，在有效管理风险的基础上，达成投资目标。 |
| 业绩比较基准 | 本基金每个封闭期的业绩比较基准为该封闭期起始日的三年期定期存款利率（税后）+1%   |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，其风险和预期收益水平低于股票型基金、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      |      | 蜂巢基金管理有限公司                       | 兴业银行股份有限公司                 |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 杨铁军                              | 龚小武                        |
|         | 联系电话 | 021-68886277                     | 021-52629999-212056        |
|         | 电子邮箱 | service@hexaamc.com              | gongxiaowu@cib.com.cn      |
| 客户服务电话  |      | 400-100-3783                     | 95561                      |
| 传真      |      | 021-58800802                     | 021-62159217               |
| 注册地址    |      | 中国（上海）自由贸易试验区张杨路 707 号二层西区 226 室 | 福建省福州市台江区江滨中大道 398 号兴业银行大厦 |
| 办公地址    |      | 上海市浦东新区竹林路 101 号陆家嘴基金大厦 10 层     | 上海市浦东新区银城路 167 号 4 楼       |
| 邮政编码    |      | 200122                           | 200120                     |

|       |    |     |
|-------|----|-----|
| 法定代表人 | 唐煌 | 吕家进 |
|-------|----|-----|

## 2.4 信息披露方式

|                     |                        |
|---------------------|------------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称      | 《上海证券报》                |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | http://www.hexaamc.com |
| 基金中期报告备置地点          | 基金管理人和基金托管人办公地址        |

注：基金中期报告同步登载于中国证监会基金电子披露网站（http://eid.csrc.gov.cn/fund）。

## 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称               | 办公地址                         |
|--------|------------------|------------------------------|
| 注册登记机构 | 蜂巢基金管理有限公司       | 上海市浦东新区竹林路 101 号陆家嘴基金大厦 10 层 |
| 会计师事务所 | 立信会计师事务所（特殊普通合伙） | 上海市黄浦区南京东路 61 号四楼            |

## § 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（2023 年 01 月 01 日-2023 年 06 月 30 日） |
|---------------|--|
| 本期已实现收益       | 157,799,767.52                         |
| 本期利润          | 157,799,767.52                         |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0197                                 |
| 本期加权平均净值利润率   | 1.96%                                  |
| 本期基金份额净值增长率   | 1.99%                                  |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末（2023 年 06 月 30 日）                 |
| 期末可供分配利润      | 34,861,596.13                          |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.0044                                 |
| 期末基金资产净值      | 8,024,896,193.18                       |
| 期末基金份额净值      | 1.0044                                 |
| 3.1.3 累计期末指标  | 报告期末（2023 年 06 月 30 日）                 |
| 基金份额累计净值增长率   | 10.39%                                 |

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，由于本基金按摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

### 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      | 0.34%    | 0.01%       | 0.31%      | 0.01%         | 0.03% | 0.00% |
| 过去三个月      | 1.04%    | 0.01%       | 0.95%      | 0.01%         | 0.09% | 0.00% |
| 过去六个月      | 1.99%    | 0.01%       | 1.90%      | 0.01%         | 0.09% | 0.00% |
| 过去一年       | 4.21%    | 0.01%       | 3.87%      | 0.01%         | 0.34% | 0.00% |
| 自基金合同生效起至今 | 10.39%   | 0.01%       | 10.21%     | 0.01%         | 0.18% | 0.00% |

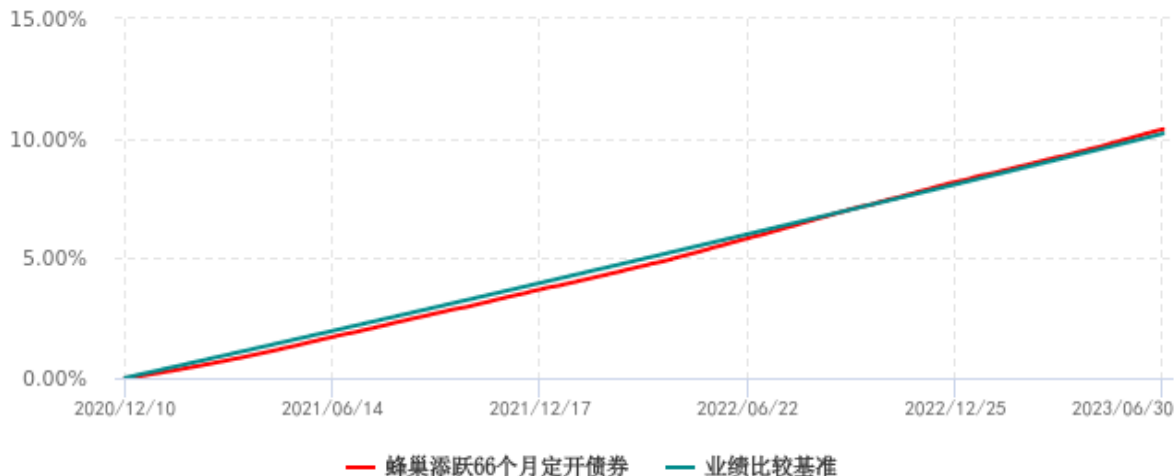
注：（1）上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；

（2）本基金成立于 2020 年 12 月 10 日；

（3）本基金业绩比较基准为：本基金每个封闭期的业绩比较基准为该封闭期起始日的三年期定存利率（税后）+1%。

### 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

蜂巢添跃66个月定期开放债券型证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2020年12月10日-2023年06月30日)



注：本基金合同生效日为 2020 年 12 月 10 日，根据基金合同规定，自基金合同生效之日起 6 个月内，基金各项资产配置比例需符合基金合同要求。截至建仓期末和本报告期末，基金的资产配置符合基金合同的相关要求。

### 3.3 其他指标

注：无。

## § 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

蜂巢基金管理有限公司经中国证券监督管理委员会核准设立，于 2018 年 5 月 18 日在上海成立，注册资本 1 亿元人民币。作为由银行业资产管理领域资深专业人士发起设立的公募基金管理机构，蜂巢基金积极顺应资管行业改革趋势，抓住行业变革契机，坚持对资产管理核心能力的不断追求，努力为投资人提供长期稳健的投资回报。

截至 2023 年 06 月 30 日，公司旗下共管理 24 只公开募集证券投资基金，分别为蜂巢卓睿灵活配置混合型证券投资基金、蜂巢添鑫纯债债券型证券投资基金、蜂巢添汇纯债债券型证券投资基金、蜂巢添幂中短债债券型证券投资基金、蜂巢丰业纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金、蜂巢添盈纯债债券型证券投资基金、蜂巢丰鑫纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金、蜂巢添禧 87 个月定期开放债券型证券投资基金、蜂巢添益纯债债券型证券投资基金、蜂巢恒利债券型证券投资基金、蜂巢添元纯债债券型证券投资基金、蜂巢添跃 66 个月定期开放债券型证券投资基金、蜂巢丰瑞债券型证券投资基金、蜂巢丰远债券型证券投资基金、蜂巢丰华债券型证券投资基金、蜂巢丰吉纯债债券型证券投资基金、蜂巢丰颐债券型证券投资基金、蜂巢丰和债券型证券投资基金、蜂巢润和六个月持有期混合型证券投资基金、蜂巢丰泰三个月定期开放债券型证券投资基金、蜂巢中债 1-5 年政策性金融债指数证券投资基金、蜂巢丰裕债券型证券投资基金、蜂巢丰嘉债券型证券投资基金和蜂巢丰启一年定期开放债券型发起式证券投资基金，管理的基金净资产规模共计 429.32 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 |        |   |
| 金之洁 | 本基金基金经理 | 2020-12-10      | -    | 10 年   | 金之洁先生，美国马里兰大学金融学硕士，2013 年加入广发银行股份有限公司金融市场部从事债券投资交易工作，曾担任初级和中级交易员，2018 年加入蜂巢基金管理有限公司，任交易部副总监，现任基金投资部副总监。金之洁先生现担任蜂巢丰业纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金、蜂巢添益纯债债券型证券投资 |



|  |  |  |  |  |  |
|--|--|--|--|--|--|
|  |  |  |  |  | 基金、蜂巢添禧 87 个月定期开放债券型证券投资基金、蜂巢添元纯债债券型证券投资基金、蜂巢添跃 66 个月定期开放债券型证券投资基金、蜂巢丰华债券型证券投资基金和蜂巢丰吉纯债债券型证券投资基金的基金经理。 |
|--|--|--|--|--|--|

注：（1）基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，其“离职日期”为根据公司决议确定的解聘日期；

（2）非首任基金经理，其“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决议确定的聘任日期和解聘日期。

#### 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

注：无。

### 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销售机构监督管理办法》《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》、基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在认真控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有发生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

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司公平交易方面的相关制度。本报告期内，不存在损害投资者利益的不公平交易行为。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金管理人严格执行公司异常交易监控与报告相关制度，未发现本基金存在异常交易情况。本报告期内，基金管理人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均未出现超过该证券当日交易量的 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

2023 年以来，债券收益率先上后下。进入 1 月，随着北京上海等地疫情高峰过去，复工复产加快，市场开始交易疫后复苏，尤其是权益市场在开年后持续上涨，带动市场风险偏好不断抬升。

在此情况下，现券收益率逐步回升。春节后，市场博弈复苏斜率不及预期，现券收益率小幅下行。但随着节后货币市场利率逐步走高，尤其是在税期期间，流动性一度非常紧张，而 1Y 存单利率也在 2 月不断提价，压制了短端利率的下行空间。市场开始意识到基础货币在大量信贷投放下消耗较大，而央行通过 OMO 等短期资金平稳流动性的做法也让市场对流动性整体偏谨慎。进入 3 月，市场的交易主线变为政策面的重新定价，海外银行风险事件导致的风险偏好扭转及加息预期降温，以及下旬的超预期降准。月初市场关注两会的政府工作报告，在 GDP 增长目标未超预期的情况下，市场对政策进一步加码的担忧减弱，债券收益率也在 3 月上旬止住了上行势头，转为小幅下行。而 3 月中旬硅谷银行暴雷，海外市场风声鹤唳，美债收益率大幅下行，美联储的加息预期急转直下。这也带动国内债券收益率继续下行。而进入到 3 月下旬，央行在月中超量续作 MLF 后又超预期宣布降准，短端利率应声下行。

二季度以来，债券收益率加速下行。4-5 月市场的交易主线变为对通胀及基本面走弱的重新定价。首先，流动性在 4-5 月进一步宽松，货币市场利率重新回落至政策利率之下。而进入 4 月下旬后，股市开始大幅调整，而国内定价的黑色商品持续走弱，国债期货在此阶段大幅上涨，各类资产的走势开始定价基本面走弱的事实。4 月末公布的 PMI 则确认了需求重新走弱的事实。进入 5 月，市场对基本面的观点从分歧走向一致，经济数据和金融数据均弱于预期，市场在 5 月下旬开始交易降息预期。而 6 月 13 日央行的超预期降息将债券行情推向极致，但随着 10 年国债利率下破 2.6%，收益率在止盈盘的推动下小幅反弹。

本基金在上半年维持了较高的杠杆水平。产品在缴税、跨月等时点通过合理安排杠杆融资策略，降低融资成本，以求实现较高的套息收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末蜂巢添跃 66 个月定开债券基金份额净值为 1.0044 元，本报告期内，基金份额净值增长率为 1.99%，同期业绩比较基准收益率为 1.90%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从 6 月公布的经济数据来看，需求不足的矛盾尚未缓和。地产投资的持续下滑仍旧是需求的重要拖累项。而居民端过去三年因疫情导致的资产负债表受损也需要较长的时间来修复。外需方面，虽然我国强大的工业链有着较强的生产优势，出口韧性较强，但主要出口目的国持续收紧货币政策，海外需求的逐步下滑将对我国的出口增长形成较大压力。最后，基建作为逆周期调节的重要抓手，在一季度有力拉动了投资增速，但目前地方政府财力受限，且受制于债务约束，地方政府加杠杆的能力较弱，财政扩张较慢。

近期召开的中央经济工作会议针对需求不足的矛盾提出一系列新的政策举措，特别是关于地产，强调房地产的供需已发生深刻变化，各地方要因城施策，满足刚需和改善住房需求。同时，针对地方债务，将会推出一整套化债措施。我们预计后续地产政策将有明显调整，而能否带动需求企稳回升则要看具体政策及实施效果。而地方债务问题的化解，则将利好城投资产。货币政策方面，我们认为大概率将继续维持宽松。在需求止跌回升之前，债券市场会在政策预期下有所波动，但大幅调整的风险较小。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，负责在证券发行机构发生了严重影响证券价格的重大事件时，评估重大事件对投资品种价值的影响程度、评估对基金估值的影响程度、确定采用的估值方法、确定该证券的公允价值；同时将采用的估值方法以及采用该方法对相关证券的估值与基金托管人进行沟通。估值委员会成员由总经理、分管投资研究工作的副总经理、督察长、投资总监、基金投资部、资产管理部、研究部、监察稽核部、运营管理部负责人以及基金事务负责人、基金会计、投资组合经理等相关业务人员组成，具备行业研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供银行间同业市场及交易所交易的债券品种的估值数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》约定，本基金的收益分配原则如下：

（1）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；

（2）基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

（3）每一基金份额享有同等分配权；

（4）法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在符合法律法规及基金合同约定，并对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可对基金收益分配原则和支付方式进行调整，不需召开基金份额持有人大会。

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，本基金本报告期内共进行 2 次利润分配，符合基金合同规定。

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

本基金本报告期内未出现连续 20 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

本报告期内，本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律、法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

## 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

本报告期内，本基金托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，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

本基金托管人认真复核了蜂巢添跃 66 个月定期开放债券型证券投资基金 2023 年中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 6 半年度财务会计报告(未经审计)

### 6.1 资产负债表

会计主体：蜂巢添跃 66 个月定期开放债券型证券投资基金

报告截止日：2023 年 06 月 30 日

单位：人民币元

| 资产         | 附注号     | 本期末 2023 年 06 月 30 日 | 上年度末 2022 年 12 月 31 日 |
|------------|---------|----------------------|-----------------------|
| <b>资产：</b> |         |                      |                       |
| 银行存款       | 6.4.7.1 | 3,214,554.26         | 4,282,710.37          |
| 结算备付金      |         | 6,007.83             | 91,496.93             |
| 存出保证金      |         | -                    | -                     |
| 交易性金融资产    | 6.4.7.2 | -                    | -                     |
| 其中：股票投资    |         | -                    | -                     |
| 基金投资       |         | -                    | -                     |
| 债券投资       |         | -                    | -                     |
| 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          | 6.4.7.5    | 14,431,590,136.10           | 14,603,743,059.71            |
| 其中：债券投资       |            | 14,431,590,136.10           | 14,603,743,059.71            |
| 资产支持证券投资      |            | -                           | -                            |
| 其他投资          |            | -                           | -                            |
| 其他债权投资        | 6.4.7.6    | -                           | -                            |
| 其他权益工具投资      | 6.4.7.7    | -                           | -                            |
| 应收清算款         |            | -                           | -                            |
| 应收股利          |            | -                           | -                            |
| 应收申购款         |            | -                           | -                            |
| 递延所得税资产       |            | -                           | -                            |
| 其他资产          | 6.4.7.8    | -                           | -                            |
| 资产总计          |            | 14,434,810,698.19           | 14,608,117,267.01            |
| <b>负债和净资产</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末 2023 年 06 月 30 日</b> | <b>上年度末 2022 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     |            | 6,407,999,591.26            | 6,579,349,094.22             |
| 应付清算款         |            | -                           | -                            |
| 应付赎回款         |            | -                           | -                            |
| 应付管理人报酬       |            | 989,665.11                  | 1,026,181.30                 |
| 应付托管费         |            | 329,888.38                  | 342,060.42                   |
| 应付销售服务费       |            | -                           | -                            |
| 应付投资顾问费       |            | -                           | -                            |
| 应交税费          |            | -                           | -                            |
| 应付利润          |            | -                           | -                            |
| 递延所得税负债       |            | -                           | -                            |
| 其他负债          | 6.4.7.9    | 595,360.26                  | 502,830.35                   |
| 负债合计          |            | 6,409,914,505.01            | 6,581,220,166.29             |
| <b>净资产：</b>   |            |                             |                              |
| 实收基金          | 6.4.7.10   | 7,990,034,597.05            | 7,990,034,580.24             |
| 其他综合收益        | 6.4.7.11   | -                           | -                            |
| 未分配利润         | 6.4.7.12   | 34,861,596.13               | 36,862,520.48                |
| 净资产合计         |            | 8,024,896,193.18            | 8,026,897,100.72             |
| 负债和净资产总计      |            | 14,434,810,698.19           | 14,608,117,267.01            |

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.0044 元，基金份额总额 7,990,034,597.05 份。

## 6.2 利润表

会计主体：蜂巢添跃 66 个月定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                         | 附注号        | 本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日 | 上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日 |
|----------------------------|------------|---------------------------------------|--|
| <b>一、营业总收入</b>             |            | 237,742,437.94                        | 235,991,384.41                             |
| 1. 利息收入                    |            | 237,742,437.94                        | 235,991,384.41                             |
| 其中：存款利息收入                  | 6.4.7.13   | 27,340.83                             | 21,804.36                                  |
| 债券利息收入                     |            | 235,672,695.66                        | 235,719,592.47                             |
| 资产支持证券利息收入                 |            | -                                     | -  |
| 买入返售金融资产收入                 |            | 2,042,401.45                          | 249,987.58                                 |
| 证券出借利息收入                   |            | -                                     | -  |
| 其他利息收入                     |            | -                                     | -  |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）          |            | -                                     | -  |
| 其中：股票投资收益                  | 6.4.7.14   | -                                     | -  |
| 基金投资收益                     | 6.4.7.15   | -                                     | -  |
| 债券投资收益                     | 6.4.7.16   | -                                     | -  |
| 资产支持证券投资收益                 | 6.4.7.17   | -                                     | -  |
| 贵金属投资收益                    | 6.4.7.18   | -                                     | -  |
| 衍生工具收益                     | 6.4.7.19   | -                                     | -  |
| 股利收益                       | 6.4.7.20   | -                                     | -  |
| 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）     | 6.4.7.21   | -                                     | -  |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）         |            | -                                     | -  |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）         | 6.4.7.22   | -                                     | -  |
| <b>减：二、营业总支出</b>           |            | 79,942,670.42                         | 75,242,171.12                              |
| 1. 管理人报酬                   | 6.4.10.2.1 | 5,982,259.84                          | 5,976,928.77                               |
| 2. 托管费                     | 6.4.10.2.2 | 1,994,086.58                          | 1,992,309.64                               |
| 3. 销售服务费                   | 6.4.10.2.3 | -                                     | -  |
| 4. 投资顾问费                   |            | -                                     | -  |
| 5. 利息支出                    |            | 71,819,112.04                         | 67,126,407.30                              |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |            | 71,819,112.04                         | 67,126,407.30                              |
| 6. 信用减值损失                  | 6.4.7.23   | -180.73                               | 11,417.16                                  |
| 7. 税金及附加                   |            | -                                     | -  |
| 8. 其他费用                    | 6.4.7.24   | 147,392.69                            | 135,108.25                                 |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |            | 157,799,767.52                        | 160,749,213.29                             |
| 减：所得税费用                    |            | -                                     | -  |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”</b>       |            | 157,799,767.52                        | 160,749,213.29                             |

|               |  |                |                |
|---------------|--|----------------|----------------|
| 号填列)          |  |                |                |
| 五、其他综合收益的税后净额 |  | -              | -              |
| 六、综合收益总额      |  | 157,799,767.52 | 160,749,213.29 |

注：报表附注为财务报表的组成部分。

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：蜂巢添跃 66 个月定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                                       | 本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 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（基金净值）                          | 7,990,034,580.24                           | -      | 36,862,520.48  | 8,026,897,100.72 |
| 加：会计政策变更                                 | -  | -      | -              | -                |
| 前期差错更正                                   | -  | -      | -              | -                |
| 其他                                       | -  | -      | -              | -                |
| 二、本期期初净资产（基金净值）                          | 7,990,034,580.24                           | -      | 36,862,520.48  | 8,026,897,100.72 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                     | 16.81                                      | -      | -2,000,924.35  | -2,000,907.54    |
| （一）、综合收益总额                               | -  | -      | 157,799,767.52 | 157,799,767.52   |
| （二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）      | 16.81                                      | -      | -              | 16.81            |
| 其中：1. 基金申购款                              | 16.81                                      | -      | -              | 16.81            |
| 2. 基金赎回款                                 | -  | -      | -              | -                |
| （三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | -  | -      | 159,800,691.87 | -159,800,691.87  |
| （四）、其他综合收益结转留存收益                         | -  | -      | -              | -                |
| 四、本期期末净资产（基金净值）                          | 7,990,034,597.05                           | -      | 34,861,596.13  | 8,024,896,193.18 |
| 项目                                       | 上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 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（基金净值）                          | 7,990,034,552.47                           | -      | 14,311,981.51  | 8,004,346,533.98 |
| 加：会计政策变更                                 | -  | -      | -              | -                |

|  |                  |   |                |                  |
|--|------------------|---|----------------|------------------|
| 前期差错更正   | -                | - | -              | -                |
| 其他   | -                | - | -              | -                |
| 二、本期期初净资产<br>(基金净值)                                  | 7,990,034,552.47 | - | 14,311,981.51  | 8,004,346,533.98 |
| 三、本期增减变动额<br>(减少以“-”号填列)                             | 12.70            | - | 8,949,973.94   | 8,949,986.64     |
| (一)、综合收益总额   | -                | - | 160,760,630.45 | 160,760,630.45   |
| (二)、本期基金份额交<br>易产生的基金净值变动<br>数(净值减少以“-”号<br>填列)      | 12.70            | - | -              | 12.70            |
| 其中: 1. 基金申购款   | 12.70            | - | -              | 12.70            |
| 2. 基金赎回款   | -                | - | -              | -                |
| (三)、本期向基金份额<br>持有人分配利润产生的<br>基金净值变动(净值减<br>少以“-”号填列) | -                | - | 151,810,656.51 | -151,810,656.51  |
| (四)、其他综合收益结<br>转留存收益                                 | -                | - | -              | -                |
| 四、本期期末净资产<br>(基金净值)                                  | 7,990,034,565.17 | - | 23,250,538.29  | 8,013,285,103.46 |

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：

|          |           |         |
|----------|-----------|---------|
| 陈世涌      | 陈世涌       | 杨超      |
| -----    | -----     | -----   |
| 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

蜂巢添跃 66 个月定期开放债券型证券投资基金系经中国证券监督管理委员会（下称“中国证监会”）证监许可〔2019〕2253 号文《关于准予蜂巢添跃纯债 2 年定期开放债券型证券投资基金注册的批复》、证券证监许可〔2020〕2786 号文《关于准予蜂巢添跃纯债 2 年定期开放债券型证券投资基金变更注册的批复》的核准，由基金管理人蜂巢基金管理有限公司于 2020 年 11 月 30 日至 2020 年 12 月 9 日向符合法律法规规定的投资者公开发售。募集期结束，经立信会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具信会师报字〔2020〕验字第 ZA31314 号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2020 年 12 月 10 日生效。本基金为契约型定期开放式基金，存续期限为不定期。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 7,990,034,534.33 元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币 2.66 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 7,990,034,536.99 元，折合 7,990,034,536.99 份基金份额。本基金的基金管理人为蜂巢基金管理有限公司，注册登



记机构为蜂巢基金管理有限公司，基金托管人为兴业银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行和上市交易的债券（国债、央行票据、金融债、地方政府债、企业债、公司债、证券公司短期公司债、可分离交易可转债的纯债部分、短期融资券、超短期融资券、中期票据、公开发行的次级债）、资产支持证券、银行存款（包括协议存款、定期存款、通知存款）、同业存单、债券回购等金融工具，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（但须符合中国证监会相关规定）。本基金不参与可转债（可分离交易可转债的纯债部分除外）、可交换债投资，也不进行股票投资。

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，其投资比例遵循届时有效的法律法规或相关规定。

本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%。但应开放期流动性需要，为保护基金份额持有人利益，在每次开放期开始前 3 个月、开放期及开放期结束后 3 个月的期间内，基金投资不受上述比例限制。

本基金在封闭期内持有现金或到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不受限制，但在开放期本基金持有现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）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%。

如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

本基金每个封闭期的业绩比较基准为该封闭期起始日的三年期定存利率（税后）+1%。

#### 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，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《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）》及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。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2023 年 06 月 30 日的财务状况以及 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日期间的经营成果和基金净值变动情况。

#### 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

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

##### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制

期间系自 2023 年 1 月 1 日起至 2023 年 6 月 30 日止。

#### 6.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

#### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

##### 1、金融资产分类

自 2022 年 1 月 1 日起适用

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产和以摊余成本计量的金融资产。金融资产的分类取决于本基金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。本基金现无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及以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

本基金持有的债券投资分类为以摊余成本计量的金融资产。本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即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。以摊余成本计量的金融资产在资产负债表中以债权投资列示。

本基金持有的以摊余成本计量的金融资产，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

2022 年 1 月 1 日前适用

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金无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及可供出售金融资产。

本基金采用买入持有至到期投资策略投资的债券投资分类为持有至到期投资。持有至到期投资是指到期日固定、回收金额固定或可确定，且本基金有明确意图和能力持有至到期的非衍生金融资产。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

##### 2、金融负债分类

自 2022 年 1 月 1 日起适用

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和以摊余成

本计量的金融负债。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。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

2022 年 1 月 1 日前适用

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金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。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### 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

自 2022 年 1 月 1 日起适用

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以摊余成本计量的金融资产和金融负债，取得时发生的相关交易费用计入初始确认金额。对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在债权投资的账面价值中。

对于债权投资、其他金融资产和以摊余成本计量的金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，按照未来 12 个月内（若预期存续期少于 12 个月，则为预期存续期内）的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：（1）收取该金融资产现金流量的合同权利终止；（2）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；或者（3）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。金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差

额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

2022 年 1 月 1 日前适用

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。持有至到期投资、应收款项和其他金融负债，取得时发生的相关交易费用计入初始确认金额；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。

对于持有至到期投资、应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金于资产负债表日对金融资产的账面价值进行检查，如果有客观证据表明某项金融资产发生减值的，计提减值准备。

以摊余成本计量的金融资产发生减值时，按预计未来现金流量(不包括尚未发生的未来信用损失)现值低于账面价值的差额，计提减值准备。相应的资产减值损失在利润表中列示在其他费用科目下。如果有客观证据表明该金融资产价值已恢复，且客观上与确认该损失后发生的事项有关，原确认的减值损失予以转回，计入当期损益。但是，该转回后的账面价值不应当超过假定不计提减值准备情况下该金融资产在转回日的摊余成本。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 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；或者(3) 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。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

不适用。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 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变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。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在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）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确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

#### 6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

自 2022 年 1 月 1 日起适用

债券投资和资产支持证券投资在持有期间按实际利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

债权投资处置时其处置价格扣除相关交易费用后的净额与账面价值之间的差额确认为投资收益。

其他金融资产在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的按直线法近似计算。

2022 年 1 月 1 日前适用

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 债券投资收益于卖出债券成交日确认，并按卖出债券成交金额与其成本、应收利息及相关费用的差额入账；

(6) 资产支持证券投资收益于卖出资产支持证券成交日确认，并按卖出资产支持证券成交金额与其成本、应收利息及相关费用的差额入账；

(7) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

自 2022 年 1 月 1 日起适用

针对基金合同约定费率和计算方法的费用，本基金在费用涵盖期间按合同约定进行确认。

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，实际利率法与直线法差异较小的按直线法近似计算。

2022 年 1 月 1 日前适用

(1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 0.15% 的年费率逐日计提；

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.05% 的年费率逐日计提；

(3) 本基金无销售服务费；

(4) 卖出回购金融资产支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提；

(5) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响每万份基金净收益小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

1、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；

2、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

3、每一基金份额享有同等分配权；

4、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在符合法律法规及基金合同约定，并对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可对基金收益分配原则和支付方式进行调整，不需召开基金份额持有人大会。

#### 6.4.4.12 外币交易

无。

#### 6.4.4.13 分部报告

无。

#### 6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

对于以摊余成本计量的金融资产，其预期信用损失的计量中使用了模型和假设，这些模型和假设涉及未来的宏观经济情况和对手方的信用行为。在预期信用损失的计量中所包含的重大判断和假设主要包括：选择恰当的预期信用损失模型并确定相关参数、减值阶段划分的判断标准以及用于计量预期信用损失的前瞻性信息及其权重的采用等。本基金管理人通过违约风险敞口和预期信用损失率计算预期信用损失，并基于违约概率和违约损失率确定预期信用损失率。在划分减值阶段及确定预期信用损失率时，本基金管理人使用可获取的外部评级、外部报告和外部统计数据等，并定期监控和复核与预期信用损失计算相关的重要宏观经济假设和参数。

#### 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

本基金本报告期无须说明的会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无须说明的会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

##### （一）印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

##### （二）增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（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股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，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。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

### （三）企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（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股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，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。

### （四）个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[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》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按 25% 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；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《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》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。



#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目             | 本期末 2023 年 06 月 30 日 |
|----------------|----------------------|
| 活期存款           | 3,214,554.26         |
| 等于：本金          | 3,214,266.03         |
| 加：应计利息         | 288.23               |
| 减：坏账准备         | -                    |
| 定期存款           | -                    |
| 等于：本金          | -                    |
| 加：应计利息         | -                    |
| 减：坏账准备         | -                    |
| 其中：存款期限 1 个月以内 | -                    |
| 存款期限 1-3 个月    | -                    |
| 存款期限 3 个月以上    | -                    |
| 其他存款           | -                    |
| 等于：本金          | -                    |
| 加：应计利息         | -                    |
| 减：坏账准备         | -                    |
| 合计             | 3,214,554.26         |

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

注：本基金本报告期末无交易性金融资产余额。

##### 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

注：本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

###### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：根据基金合同规定，本基金不投资期货。

###### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：根据基金合同规定，本基金不投资黄金衍生品。

##### 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

注：本基金本报告期末无买入返售金融资产余额。

## 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有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

单位：人民币元

| 项目     | 本期末 2023 年 06 月 30 日 |               |                |           |                   |
|--------|----------------------|---------------|----------------|-----------|-------------------|
|        | 初始成本                 | 利息调整          | 应计利息           | 减值准备      | 账面价值              |
| 交易所市场  | 2,606,815,394.52     | -             | 45,638,689.97  | 11,419.56 | 2,648,936,664.36  |
|        |                      | 3,506,000.57  |                |           |                   |
|        |                      |               |                |           |                   |
| 银行间市场  | 11,671,000,000.00    | 12,397,701.83 | 99,255,769.91  | -         | 11,782,653,471.74 |
| 小计     | 14,277,815,394.52    | 8,891,701.26  | 144,894,459.88 | 11,419.56 | 14,431,590,136.10 |
| 资产支持证券 | -                    | -             | -              | -         | -                 |
| 其他     | -                    | -             | -              | -         | -                 |
| 合计     | 14,277,815,394.52    | 8,891,701.26  | 144,894,459.88 | 11,419.56 | 14,431,590,136.10 |

## 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

单位：人民币元

| 减值准备      | 第一阶段           | 第二阶段                 | 第三阶段                 | 合计        |
|-----------|----------------|----------------------|----------------------|-----------|
|           | 未来 12 个月预期信用损失 | 整个存续期预期信用损失(未发生信用减值) | 整个存续期预期信用损失(已发生信用减值) |           |
| 期初余额      | 11,600.29      | -                    | -                    | 11,600.29 |
| 本期从其他阶段转入 | -              | -                    | -                    | -         |
| 本期转出至其他阶段 | -              | -                    | -                    | -         |

|      |           |   |   |           |
|------|-----------|---|---|-----------|
| 本期新增 | 172.16    | - | - | 172.16    |
| 本期转回 | 352.89    | - | - | 352.89    |
| 其他变动 | -         | - | - | -         |
| 期末余额 | 11,419.56 | - | - | 11,419.56 |

#### 6.4.7.6 其他债权投资

##### 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：本基金本报告期末无其他债权投资情况。

##### 6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：无。

#### 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

注：本基金本报告期末无其他权益工具投资情况。

##### 6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：无。

#### 6.4.7.8 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产余额。

#### 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末 2023 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      | 247,181.31           |
| 其中：交易所市场    | -                    |
| 银行间市场       | 247,181.31           |
| 应付利息        | -                    |
| 预提费用        | 348,178.95           |
| 合计          | 595,360.26           |

#### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日 |      |
|----|---------------------------------------|------|
|    | 基金份额（份）                               | 账面金额 |

|               |                  |                  |
|---------------|------------------|------------------|
| 上年度末          | 7,990,034,580.24 | 7,990,034,580.24 |
| 本期申购          | 16.81            | 16.81            |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -                | -                |
| 本期末           | 7,990,034,597.05 | 7,990,034,597.05 |

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.11 其他综合收益

注：无。

#### 6.4.7.12 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           | 36,873,805.55   | -11,285.07 | 36,862,520.48   |
| 本期利润           | 157,799,767.52  | -          | 157,799,767.52  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -               | -          | -               |
| 其中：基金申购款       | -               | -          | -               |
| 基金赎回款          | -               | -          | -               |
| 本期已分配利润        | -159,800,691.87 | -          | -159,800,691.87 |
| 本期末            | 34,872,881.20   | -11,285.07 | 34,861,596.13   |

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 25,548.21                             |
| 定期存款利息收入  | -                                     |
| 其他存款利息收入  | -                                     |
| 结算备付金利息收入 | -                                     |
| 其他        | 1,792.62                              |
| 合计        | 27,340.83                             |

注：其他为本基金存放在证券经纪商基金专用证券账户内的证券交易结算资金的利息收入。

#### 6.4.7.14 股票投资收益

##### 6.4.7.14.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

注：本基金本报告期无股票投资收益。

##### 6.4.7.14.2 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

#### 6.4.7.15 基金投资收益

注：无。

#### 6.4.7.16 债券投资收益

##### 6.4.7.16.1 债券投资收益项目构成

注：无。

##### 6.4.7.16.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：无。

##### 6.4.7.16.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

##### 6.4.7.16.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

#### 6.4.7.17 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.17.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期末投资资产支持证券，无资产支持证券投资收益。

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

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

##### 6.4.7.17.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：无。

##### 6.4.7.17.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：无。

#### 6.4.7.18 贵金属投资收益

##### 6.4.7.18.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

##### 6.4.7.18.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

##### 6.4.7.18.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

**6.4.7.18.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

注：无。

**6.4.7.19 衍生工具收益****6.4.7.19.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：本基金本报告期末买卖权证。

**6.4.7.19.2 衍生工具收益——其他投资收益**

注：无。

**6.4.7.20 股利收益**

注：本基金本报告期无股利收益。

**6.4.7.21 公允价值变动收益**

注：本基金本报告期无公允价值变动收益。

**6.4.7.22 其他收入**

注：本基金本报告期无其他收入。

**6.4.7.23 信用减值损失**

单位：人民币元

| 项目       | 本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日 |
|----------|---------------------------------------|
| 银行存款     | -                                     |
| 买入返售金融资产 | -                                     |
| 债权投资     | -180.73                               |
| 其他债权投资   | -                                     |
| 其他       | -                                     |
| 合计       | -180.73                               |

注：本基金在计算预期信用损失中使用了模型和假设，这些模型和假设涉及未来的宏观经济情况对手方的信用行为。在预期信用损失的计量中所包含的重大判断和假设主要包括：选择恰当的预期信用损失模型并确定相关参数、减值阶段划分的判断标准以及用于计量预期信用损失的前瞻性信息及其权重的采用等。本基金管理人通过违约风险敞口和预期信用损失率计算预期信用损失，并基于违约概率和违约损失率确定预期信用损失率。在划分减值阶段及确定预期信用损失率时，本基金管理人使用可获取的外部评级、外部报告和外部统计数据等，并定期监控和复核与预期信用损失计算相关的重要宏观经济假设和参数。

**6.4.7.24 其他费用**

单位：人民币元

| 项目       | 本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日 |
|----------|---------------------------------------|
| 审计费用     | 59,671.58                             |
| 信息披露费    | 59,507.37                             |
| 证券出借违约金  | -                                     |
| 银行汇划费    | 9,613.74                              |
| 上清所账户查询费 | 600.00                                |
| 账户维护费    | 18,000.00                             |
| 合计       | 147,392.69                            |

#### 6.4.7.25 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，本基金无须作披露的重大或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金于资产负债表日之后、中期报告批准报出日之前无须作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

本基金本报告期不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。

##### 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             |
|--------------------|---------------------|
| 蜂巢基金管理有限公司（“蜂巢基金”） | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |
| 兴业银行股份有限公司（“兴业银行”） | 基金托管人               |
| 唐煌                 | 基金管理人的股东            |
| 廖新昌                | 基金管理人的股东            |
| 陈世涌                | 基金管理人的股东            |
| 王梦怡                | 基金管理人的股东            |
| 杨铁军                | 基金管理人的股东            |
| 珠海横琴懿辰企业管理中心（有限合伙） | 基金管理人的股东            |
| 珠海横琴懿天企业管理中心（有限合伙） | 基金管理人的股东            |
| 珠海横琴懿嘉企业管理中心（有限合伙） | 基金管理人的股东            |

注：下列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**

注：本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

**6.4.10.1.2 权证交易**

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

**6.4.10.1.3 债券交易**

注：本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

**6.4.10.1.4 债券回购交易**

注：本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

**6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金**

注：本基金本报告期未及上年度可比期间均产生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 2023 年 01 月 01 日至<br>2023 年 06 月 30 日 | 上年度可比期间 2022 年 01 月<br>01 日至 2022 年 06 月 30 日 |
|-----------------|--|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 5,982,259.84                             | 5,976,928.77                                  |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 16.29                                    | 16.29   |

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.15% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。

**6.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

| 项目             | 本期 2023 年 01 月 01 日至<br>2023 年 06 月 30 日 | 上年度可比期间 2022 年 01 月<br>01 日至 2022 年 06 月 30 日 |
|----------------|--|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 1,994,086.58                             | 1,992,309.64                                  |

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.05% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$$



H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

注：本基金不收取销售服务费。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

| 本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日      |          |          |          |          |                  |            |
|--|----------|----------|----------|----------|------------------|------------|
| 银行间市场交易的<br>各关联方名称                         | 债券交易金额   |          | 基金逆回购    |          | 基金正回购            |            |
|  | 基金买<br>入 | 基金卖<br>出 | 交易金<br>额 | 利息收<br>入 | 交易金额             | 利息支出       |
| 兴业银行                                       | -        | -        | -        | -        | 6,573,000,000.00 | 888,842.19 |
| 上年度可比期间 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日 |          |          |          |          |                  |            |
| 银行间市场交易的<br>各关联方名称                         | 债券交易金额   |          | 基金逆回购    |          | 基金正回购            |            |
|  | 基金买<br>入 | 基金卖<br>出 | 交易金<br>额 | 利息收<br>入 | 交易金额             | 利息支出       |
| 兴业银行                                       | -        | -        | -        | -        | 500,000,000.00   | 218,534.25 |

#### 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

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无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。

##### 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

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无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。

#### 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

注：本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

##### 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

份额单位：份

| 关联方名称 | 本期末 2023 年 06 月 30 日 |                         | 上年度末 2022 年 12 月 31 日 |                         |
|-------|----------------------|-------------------------|-----------------------|-------------------------|
|       | 持有的基金份额              | 持有的基金<br>份额占基金<br>总份额的比 | 持有的基金份额               | 持有的基金<br>份额占基金<br>总份额的比 |
|       |                      |                         |                       |                         |

|                |                  | 例          |                  | 例        |
|----------------|------------------|------------|------------------|----------|
| 兴业银行股份有限公司     | 1,719,999,000.00 | 21.526803% | 1,719,999,000.00 | 21.5268% |
| 兴业银行股份有限公司杭州分行 | 999,999,000.00   | 12.515578% | 999,999,000.00   | 12.5156% |
| 陈世涌            | 99.97            | 0.000001%  | 99.97            | 0.0000%  |
| 唐煌             | 10.00            | 0.0000%    | 10.00            | 0.0000%  |
| 廖新昌            | 10.00            | 0.0000%    | 10.00            | 0.0000%  |
| 杨铁军            | 10.00            | 0.0000%    | 10.00            | 0.0000%  |

#### 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 2023 年 01 月 01 日至<br>2023 年 06 月 30 日 |           | 上年度可比期间 2022 年 01 月<br>01 日至 2022 年 06 月 30 日 |           |
|-------|--|-----------|---|-----------|
|       | 期末余额                                     | 当期利息收入    | 期末余额  | 当期利息收入    |
| 兴业银行  | 3,214,554.26                             | 25,548.21 | 2,740,335.25                                  | 20,044.70 |

注：本基金的银行存款由基金托管人兴业银行股份有限公司保管，活期存款按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间均无须作说明的其他关联交易事项。

#### 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

单位：人民币元

| 序号 | 权益<br>登记<br>日  | 除息日           |                            | 每 10 份基<br>金份额分<br>红数 | 现金形式发放总<br>额   | 再投资形<br>式发放总<br>额 | 本期利润分配合<br>计   | 备注 |
|----|----------------|---------------|----------------------------|-----------------------|----------------|-------------------|----------------|----|
| 1  | 2023-<br>03-07 | -<br>(场<br>内) | 2023-<br>03-07<br>(场<br>外) | 0.100                 | 79,900,338.03  | 7.88              | 79,900,345.91  | -  |
| 2  | 2023-<br>06-06 | -<br>(场<br>内) | 2023-<br>06-06<br>(场<br>外) | 0.100                 | 79,900,337.03  | 8.93              | 79,900,345.96  | -  |
| 合计 |                |               |                            | 0.200                 | 159,800,675.06 | 16.81             | 159,800,691.87 | -  |

#### 6.4.12 期末（2023 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

注：本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末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 2023 年 06 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 4954189088.04 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           |
|--------|----------|------------|--------|------------|------------------|
| 160210 | 16 国开 10 | 2023-07-03 | 99.42  | 37,894,000 | 3,767,456,065.87 |
| 160418 | 16 农发 18 | 2023-07-03 | 100.65 | 8,597,000  | 865,275,229.18   |
| 190204 | 19 国开 04 | 2023-07-03 | 100.73 | 2,526,000  | 254,442,242.20   |
| 200315 | 20 进出 15 | 2023-07-03 | 100.09 | 2,105,000  | 210,691,019.82   |
| 210305 | 21 进出 05 | 2023-07-03 | 100.16 | 1,188,000  | 118,993,901.28   |
| 合计     |          |            |        | 52,310,000 | 5,216,858,458.35 |

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2023 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 1453810503.22 元，于 2023 年 06 月 30 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

注：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

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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。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。

本基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的，由督察长、风险管理委员会、监察稽核部、相关职能部门和业务岗位构成的风险管理架构体系，并明确了相应风险管理职能。

##### 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建立了信用风险管理流程，通过对各类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。

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，建立相应的分级别的交易对手库，并分别限定交易额度，同时采取一定的风险缓释措施。本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，其他存款存放于证券经纪商，因而与存款相关的信用风险不大。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、对手授信额度、价格偏离等方面进行限制以控制相应的信用风险。

#### 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。

##### 6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

##### 6.4.13.3.2 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》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。

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，并对基金组合资产中 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超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值，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、组合在短时间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的投资品种比例等。本基金所持大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。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资产的公允价值。

综上所述，本基金本报告期内未发生重大流动性风险。

#### 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、债券投资及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

| 本期末<br>2023<br>年 06<br>月 30<br>日 | 1 年以内            | 1-5 年             | 5 年以<br>上 | 不计息        | 合计                |
|----------------------------------|------------------|-------------------|-----------|------------|-------------------|
| 资产                               |                  |                   |           |            |                   |
| 银行存款                             | 3,214,554.26     | -                 | -         | -          | 3,214,554.26      |
| 结算备付金                            | 6,007.83         | -                 | -         | -          | 6,007.83          |
| 债权投资                             | -                | 14,431,590,136.10 | -         | -          | 14,431,590,136.10 |
| 资产总计                             | 3,220,562.09     | 14,431,590,136.10 | -         | -          | 14,434,810,698.19 |
| 负债                               |                  |                   |           |            |                   |
| 卖出回购金融资产款                        | 6,408,002,498.29 | -                 | -         | -          | 6,408,002,498.29  |
| 应付管理人报酬                          | -                | -                 | -         | 989,665.11 | 989,665.11        |
| 应付托管                             | -                | -                 | -         | 329,888.38 | 329,888.38        |

|                                       |                       |                   |           |                   |                   |
|---------------------------------------|-----------------------|-------------------|-----------|-------------------|-------------------|
| 费                                     |                       |                   |           |                   |                   |
| 其他<br>负债                              | -                     | -                 | -         | 595,360.26        | 595,360.26        |
| 负债<br>总计                              | 6,408,002,498.29      | -                 | -         | 1,914,913.75      | 6,409,917,412.04  |
| 利率<br>敏感<br>度缺<br>口                   | -<br>6,404,781,936.20 | 14,431,590,136.10 | -         | -<br>1,914,913.75 | 8,024,893,286.15  |
| 上年<br>度末<br>2022<br>年 12<br>月 31<br>日 | 1 年以内                 | 1-5 年             | 5 年以<br>上 | 不计息               | 合计                |
| 资产                                    |                       |                   |           |                   |                   |
| 银行<br>存款                              | 4,282,710.37          | -                 | -         | -                 | 4,282,710.37      |
| 结算<br>备付<br>金                         | 91,496.93             | -                 | -         | -                 | 91,496.93         |
| 债权<br>投资                              | -                     | 14,603,743,059.71 | -         | -                 | 14,603,743,059.71 |
| 资产<br>总计                              | 4,374,207.30          | 14,603,743,059.71 | -         | -                 | 14,608,117,267.01 |
| 负债                                    |                       |                   |           |                   |                   |
| 卖出<br>回购<br>金融<br>资产<br>款             | 6,579,349,094.22      | -                 | -         | -                 | 6,579,349,094.22  |
| 应付<br>管理<br>人报<br>酬                   | -                     | -                 | -         | 1,026,181.30      | 1,026,181.30      |
| 应付<br>托管<br>费                         | -                     | -                 | -         | 342,060.42        | 342,060.42        |
| 其他<br>负债                              | -                     | -                 | -         | 502,830.35        | 502,830.35        |
| 负债<br>总计                              | 6,579,349,094.22      | -                 | -         | 1,871,072.07      | 6,581,220,166.29  |
| 利率<br>敏感                              | -<br>6,574,974,886.92 | 14,603,743,059.71 | -         | -<br>1,871,072.07 | 8,026,897,100.72  |

|     |  |  |  |  |  |
|-----|--|--|--|--|--|
| 度缺口 |  |  |  |  |  |
|-----|--|--|--|--|--|

注：各期限分类的标准为按金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

|    |   |                             |                       |
|----|---|-----------------------------|-----------------------|
| 假设 | 市场利率变化主要对基金组合债券类资产的估值产生影响，对其他会计科目的影响可忽略。            |                             |                       |
|    | 基金组合对利率的风险暴露，根据报告期末各只债券的修正久期加权计算得到，债券凸性对组合净值的影响可忽略。 |                             |                       |
|    | 市场即期利率曲线平行变动。                                       |                             |                       |
|    | 基金组合构成和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 2023 年 06 月 30 日        | 上年度末 2022 年 12 月 31 日 |
|    | 利率下降 25 个基点   | 97,229,079.4                | 131,440,155.06        |
|    | 利率上升 25 个基点   | -97,229,079.4               | -131,440,155.06       |

#### 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。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

注：无。

##### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

注：无。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

注：无。

##### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

注：其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于交易所及银行间同业市场交易的固定收益品种，且以摊余成本进行后续计量，因此其他的市场因素对本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：无。

#### 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

注：无。

###### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次均未发生重大变动。

##### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本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、债权投资和其他金融负债等。

除债权投资以外，其他不以公允价值计量的金融资产和金融负债的账面价值与公允价值差异很小。

2023 年 6 月 30 日，债券投资账面价值 14,431,590,136.10 元，公允价值 14,770,623,629.48 元。

2022 年 6 月 30 日，持有至到期投资账面价值 14,434,598,779.36 元，公允价值 14,704,758,364.66 元。

债权投资按如下原则确定公允价值：（1）存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应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。（2）当金融工具不存在活跃市场，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。（3）如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券除外）及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券除外），按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

于2023年06月30日，本基金持有的上述投资的公允价值均属于第二层次。（2022年06月30日：同）。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## § 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            | 14,431,590,136.10 | 99.98        |
|    | 其中：债券             | 14,431,590,136.10 | 99.98        |
|    | 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      | 3,220,562.09      | 0.02         |
| 8  | 其他各项资产            | -                 | -            |
| 9  | 合计                | 14,434,810,698.19 | 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

注：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

注：本基金本报告期末未持有通过港股通机制投资的港股。

### 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

注：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

注：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

注：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

注：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      | 摊余成本              | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|-------------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | -                 | -            |
| 2  | 央行票据      | -                 | -            |
| 3  | 金融债券      | 14,198,549,389.72 | 176.93       |
|    | 其中：政策性金融债 | 14,198,549,389.72 | 176.93       |
| 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      | -                 | -            |
| 9  | 其他        | 233,040,746.38    | 2.90         |
| 10 | 合计        | 14,431,590,136.10 | 179.84       |

### 7.6 期末按摊余成本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)      | 摊余成本             | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|----------|------------|------------------|--------------|
| 1  | 160418 | 16 农发 18 | 50,310,000 | 5,098,073,701.52 | 63.53        |
| 2  | 160210 | 16 国开 10 | 43,600,000 | 4,367,709,105.22 | 54.43        |

|   |        |          |            |                  |       |
|---|--------|----------|------------|------------------|-------|
| 3 | 018063 | 进出 2101  | 10,200,000 | 1,028,228,537.41 | 12.81 |
| 4 | 018083 | 农发 2001  | 9,868,180  | 1,010,469,185.61 | 12.59 |
| 5 | 200315 | 20 进出 15 | 7,400,000  | 758,125,989.84   | 9.45  |

### 7.7 期末按摊余成本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

注：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

注：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

注：本基金本报告期末未持有权证。

### 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

根据基金合同规定，本基金不投资国债期货。

#### 7.10.2 本期国债期货投资评价

根据基金合同规定，本基金不投资国债期货。

### 7.11 投资组合报告附注

#### 7.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到监管部门立案调查或报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形说明

本报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期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。

#### 7.11.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金本报告期内未投资股票。

#### 7.11.3 期末其他各项资产构成

注：无。

#### 7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有可转债。

#### 7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未持有股票。

#### 7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，本报告中涉及比例计算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

| 持有人户数<br>(户) | 户均持有的基<br>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 |
| 1,705        | 4,686,237.30  | 7,989,985,000 | 100%   | 49,597.05 | 0%     |

#### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 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 | 589.93     | 0.000007% |

#### 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                             | 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 | 0~10               |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 0~10               |

### § 9 开放式基金份额变动

单位：份

|                                   |                  |
|-----------------------------------|------------------|
| 基金合同生效日 (2020 年 12 月 10 日) 基金份额总额 | 7,990,034,536.99 |
| 本报告期期初基金份额总额                      | 7,990,034,580.24 |
| 本报告期基金总申购份额                       | 16.81            |
| 减：本报告期基金总赎回份额                     | -                |
| 本报告期基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列)         | -                |
| 本报告期期末基金份额总额                      | 7,990,034,597.05 |

注：(1) 如果本报告期间发生转换入、红利再投业务，则总申购份额中包含该业务；

(2) 如果本报告期间发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务。

## § 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

1、本报告期内，经蜂巢基金管理有限公司董事会审议通过，聘任林勇先生担任公司副总经理；无其他重大人事变动。

2、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

本报告期内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，为立信会计师事务所(特殊普通合伙)。

### 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

注：本报告期内，本基金管理人及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，本基金托管人及其相关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 |    |
| 国海证券 | 2      | -    | -            | 176,387.43 | 100.00%    | -  |
| 广发证券 | 2      | -    | -            | -          | -          | -  |

注：(1) 基金管理人负责选择证券经纪商，使用其经纪服务席位作为本基金的交易单元。基金证券

经纪商选择标准如下：

- ①经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- ②具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施稳定、响应支持及时、能满足公募基金采用券商交易模式进行证券交易和结算的需要；
- ③具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：券商基本面评价（财务状况、经营状况）、券商研究机构评价（报告质量、及时性和数量）、券商每日信息评价（及时性和有效性）和券商协作表现评价等四个方面。

（2）基金交易单元的选择程序如下：

- ①本基金管理人根据上述标准测试并考察后确定选用交易单元的证券经营机构；
- ②本基金管理人和被选中的证券经营机构签订证券经纪服务协议。

### 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 |
| 国海证券 | -    | -            | 171,799,234,000.00 | 100.00%        | -    | -            | -    | -            |
| 广发证券 | -    | -            | -                  | -              | -    | -            | -    | -            |

注：（1）基金管理人负责选择证券经纪商，使用其经纪服务席位作为本基金的交易单元。基金证券经纪商选择标准如下：

- ①经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- ②具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施稳定、响应支持及时、能满足公募基金采用券商交易模式进行证券交易和结算的需要；
- ③具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：券商基本面评价（财务状况、经营状况）、券商研究机构评价（报告质量、及时性和数量）、券商每日信息评价（及时性和有效性）和券商协作表现评价等四个方面。

（2）基金交易单元的选择程序如下：

- ①本基金管理人根据上述标准测试并考察后确定选用交易单元的证券经营机构；  
②本基金管理人和被选中的证券经营机构签订证券经纪服务协议。

## 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  | 《蜂巢基金管理有限公司旗下基金 2022 年年度基金份额净值公告》        | 上海证券报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2023-01-01 |
| 2  | 《蜂巢添跃 66 个月定期开放债券型证券投资基金 2022 年第 4 季度报告》 | 上海证券报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2023-01-19 |
| 3  | 《蜂巢基金管理有限公司高级管理人员变更公告》                   | 上海证券报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2023-02-27 |
| 4  | 《蜂巢添跃 66 个月定期开放债券型证券投资基金分红公告》            | 上海证券报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2023-03-07 |
| 5  | 《蜂巢添跃 66 个月定期开放债券型证券投资基金 2022 年年度报告》     | 上海证券报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2023-03-30 |
| 6  | 《蜂巢添跃 66 个月定期开放债券型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告》 | 上海证券报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2023-04-20 |
| 7  | 《蜂巢添跃 66 个月定期开放债券型证券投资基金分红公告》            | 上海证券报、公司网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2023-06-03 |

## § 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              | 20230101-20230630       | 1,599,999,000 | 0    | 0    | 1,599,999,000 | 20.02% |
|   | 2              | 20230101-20230630       | 1,719,999,000 | 0    | 0    | 1,719,999,000 | 21.53% |
| 产品特有风险  |                |                         |               |      |      |               |        |
| <p>本报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过 20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：</p> <p>1、当基金份额持有人占比过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人巨额赎回而引发基金净值剧烈波动的风险；</p> <p>2、若某单一基金份额持有人巨额赎回有可能引发基金的流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的</p> |                |                         |               |      |      |               |        |

全部基金份额；

3、当基金份额持有人巨额赎回时，可能会导致基金资产净值出现连续六十个工作日低于 5000 万元的风险，基金可能会面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形；

4、当某单一基金份额持有人所持有的基金份额已经达到或超过本基金规模的 50%或者接受某笔或者某些申购或转换转入申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过 50%时，本基金管理人可拒绝该持有人对本基金基金份额提出的申购及转换转入申请；

5、其他可能的风险。

## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期末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

- 1、中国证监会批准设立蜂巢添跃 66 个月定期开放债券型证券投资基金的文件；
- 2、蜂巢添跃 66 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同；
- 3、蜂巢添跃 66 个月定期开放债券型证券投资基金托管协议；
- 4、蜂巢添跃 66 个月定期开放债券型证券投资基金招募说明书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、报告期内披露的各项公告。

### 12.2 存放地点

上海市浦东新区竹林路 101 号陆家嘴基金大厦 10 层。

### 12.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人网站([http:// www.hexaamc.com](http://www.hexaamc.com))查阅，或在营业时间内至基金管理人、基金托管人的办公场所免费查阅。

投资者对本报告如有疑问，可拨打客服电话（400-100-3783）咨询本基金管理人。

蜂巢基金管理有限公司

二〇二三年八月三十日