

贝莱德欣悦丰利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	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	19
§ 7 投资组合报告	38
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	39
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	45
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	46
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	46
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	46

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	46
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	46
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	46
7.12 投资组合报告附注	46
§ 8 基金份额持有人信息	47
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	47
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	48
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	48
§ 9 开放式基金份额变动	48
§ 10 重大事件揭示	49
10.1 基金份额持有人大会决议	49
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	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	49
10.4 基金投资策略的改变	49
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	49
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	49
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	49
10.8 其他重大事件	50
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	51
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	51
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	52
§ 12 备查文件目录	52
12.1 备查文件目录	52
12.2 存放地点	52
12.3 查阅方式	52

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	贝莱德欣悦丰利债券型证券投资基金	
基金简称	贝莱德欣悦丰利债券	
基金主代码	016711	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023年2月28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	415,605,209.21 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	贝莱德欣悦丰利债券A	贝莱德欣悦丰利债券C
下属分级基金的交易代码	016711	016712
报告期末下属分级基金的份额总额	35,475,050.45份	380,130,158.76份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在控制风险的前提下，通过积极主动的投资管理，力争实现组合资产长期稳健的增值。
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，对组合中债券、股票、基金、金融衍生品、货币市场工具和法律法规或中国证监会允许基金投资的其他品种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 3、股票投资策略 4、金融衍生品投资策略 5、基金投资策略
业绩比较基准	中债综合财富（总值）指数收益率×85%+沪深300指数收益率×10%+一年期定期存款利率（税后）×5%
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。 本基金如果投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

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

信息披露负责人	姓名	谢超	王小飞
	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	证券日报
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)	
	贝莱德欣悦丰利债券A	贝莱德欣悦丰利债券C
本期已实现收益	286,372.75	380,649.42
本期利润	331,463.99	517,804.91
加权平均基金份 额本期利润	0.0161	0.0160
本期加权平均净 值利润率	1.53%	1.55%
本期基金份额净 值增长率	1.61%	1.40%
3.1.2 期末数	报告期末(2026年6月30日)	

据和指标		
期末可供分配利润	1, 974, 610. 83	15, 250, 435. 08
期末可供分配基金份额利润	0. 0557	0. 0401
期末基金资产净值	37, 449, 661. 28	395, 380, 593. 84
期末基金份额净值	1. 0557	1. 0401
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	5. 57%	4. 01%

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

贝莱德欣悦丰利债券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	1. 22%	0. 10%	2. 22%	0. 14%	-1. 00%	-0. 04%
过去六个月	1. 61%	0. 09%	2. 57%	0. 12%	-0. 96%	-0. 03%
过去一年	2. 11%	0. 08%	3. 99%	0. 11%	-1. 88%	-0. 03%
过去三年	5. 48%	0. 19%	14. 44%	0. 11%	-8. 96%	0. 08%
自基金合同生效日起至今	5. 57%	0. 18%	16. 06%	0. 11%	-10. 49%	0. 07%

贝莱德欣悦丰利债券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	1.12%	0.10%	2.22%	0.14%	-1.10%	-0.04%
过去六个月	1.40%	0.09%	2.57%	0.12%	-1.17%	-0.03%
过去一年	1.69%	0.08%	3.99%	0.11%	-2.30%	-0.03%
过去三年	4.05%	0.19%	14.44%	0.11%	- 10.39%	0.08%
自基金合同生效 日起至今	4.01%	0.18%	16.06%	0.11%	- 12.05%	0.07%

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

贝莱德欣悦丰利债券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



贝莱德欣悦丰利债券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2023年02月28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机构。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	2023年12月20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。
王晓京	本基金的基金经理，首席权益、多	2026年4月10日		15年	王晓京先生，首席权益、多资产及指数投资官，基金经理，曾受雇于贝莱德英国（BlackRock Investment Management (UK) Limited）以及贝莱德建信理财有

	资产及指数投资官				限责任公司，历任研究员、基金经理等职务。加入贝莱德之前，王晓京先生曾就职于花旗银行（伦敦），任投资银行部分析员。王晓京先生是特许金融分析师（CFA）持证人，拥有清华大学电子信息工程学士学位、英国伯明翰大学电子工程硕士学位、伦敦大学电子工程博士学位。
陈之渊	本基金的基金经理	2026年4月10日		10年	陈之渊先生，基金经理，曾于贝莱德建信理财有限责任公司担任投资经理。加入贝莱德之前，曾任香港千禧年基金（Millennium Capital Management (Hong Kong) Limited）量化研究员和量化交易员，花旗银行（香港）大中华区宏观交易员。陈之渊拥有卡内基梅隆大学计算金融硕士学位以及香港大学经济与金融学学士学位。
刘鑫/LIU XIN	曾任本基金的基金经理、首席固定收益投资官	2023年3月13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。
朱希梓	本基金的基金经理助理	2024年12月6日		7年	朱希梓先生，基金经理助理，曾任投资策略部产品策略师，并曾于贝莱德日本（BlackRock Japan Co., Ltd.）担任债券产品策略师。朱希梓先生拥有康奈尔大学运筹学硕士学位、纽约大学数学经济专业学士学位。
邹立波	本基金的基金经理助理	2025年3月7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》

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

回顾上半年权益市场的表现，指数开年延续了春季躁动后陷入震荡，市场在等待政策及更多经济数据确认的过程中年初的涨幅被部分消化。随后由于中东冲突的爆发，投资者风险偏好剧烈收缩，全球权益资产不同程度受挫，A股市场也经历了较为剧烈的风格切换。4月停火协议初步达成以来，地缘冲突的局势有所缓和，全球风险资产、尤其A股市场的情绪重新升温。在海外映射、产业趋势催化及盈利确定性等多重因素共振下，二季度权益市场进入了科技类行业大幅引领其他行业的结构性牛市态势。市场风格也展现出了强劲的大盘成长偏向，资产间的表现分化显著，其中科创50指数表现亮眼，而中证红利指数仅二季度出现了双位数回撤。

债券市场方面，中国利率市场整体呈现震荡下行的走势，收益率曲线走陡。年初央行维持适度宽松的货币政策，一月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，并在二月春节期间通过买断式逆回购和MLF操作来呵护资金面平稳。随着中东冲突的爆发，地缘波动造成油价快速上升并传导至通胀层面，造成国内PPI有所爬升，CPI则维持在1%附近。在上半年出

口强劲的拉动下，经济增速维持，央行虽然后续未进一步降准降息，但通过7天逆回购、买断式逆回购、中期借贷便利等工具确保资金面充沛，流动性未受季末等季节性阶段性扰动而紧张。从五月下旬开始，资金面出现边际收紧。

产品运作层面，截至2026年6月30日，本基金上半年取得了收益率1.61%（A类）以及1.40%（C类）。上半年，本基金在债券方面配置利率债以及优选高等级高流动性的信用债，久期和信用利差配置均略低于中债新综合指数，对绝对收益贡献为正。在股票配置上，本基金也在市场的波动中采取更为量化的策略选股，在上半年平均权益敞口处于中枢附近。其中，在三月由于中东地缘引起的市场波动中，本基金主动降低了股票仓位，后在四月初地缘缓和后重新加仓权益资产。

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1.0557元，本报告期内净值增长率1.61%，同期业绩比较基准收益率2.57%。截至本报告期末，本基金C类份额净值1.0401元，本报告期内净值增长率1.40%，同期业绩比较基准收益率2.57%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

后市我们仍坚持看好中国资产的观点不变，核心原因如下：

一、宏观经济韧性十足，中国经济在复杂的地缘政治格局和国际油价波动中展现出超预期的抗压能力，未过多受外部冲击拖累。从增长动能来看，出口保持韧性，制造业投资维持高位，为整体经济提供了坚实支撑。上市公司盈利也正式进入兑现阶段：一季度全A整体盈利同比增长7%左右，进入二季度，尽管完整财报尚未披露，但目前已公布的业绩预告和先行指标均指向盈利将进一步改善，市场一致预期二季度同比增速有望继续上行。

二、中国在科技和高端制造业具备全球优势。AI领域中美是全球少数在五层分类上均有显著布局的国家，中国科技企业有望在成本、技术和商业模式上以综合实力参与全球竞争，部分半导体和发电储能企业基于蓝海定位和高门槛，基本面持续向好。近期海内外科技板块短期表现有所波动，但拉长至24-36个月维度，我们认为科技的牛市并未结束。全球科技股动量回调源于前期拥挤度过高和部分市场杠杆过高，而非头部公司基本面减速。AI需求仍在指数级上升，浪潮刚刚兴起，优质资产近期回调后估值吸引力进一步增强，配置价值显现。

三、我们注意到，近年来A股市场在投资者回报机制方面发生了积极的结构性变化，分红率持续提升是最直观的体现。投资者回报和对投资者的保护均有实质性提升，这为中长期资金入市创造了更友好的制度环境。叠加估值层面，无论是和近十年的历史相比还是横向对比其他市场，大中盘股票均有吸引力，共同支撑我们对市场的看好。

四、我们关注出口高增速掩盖的投资和内需的弱复苏，以及政策面或有的刺激投资和内需的

措施。目前市场对此期待值不高，若出台强有力的刺激内需政策，泛消费类股票可能迎来修复性机会，比如现金流充沛的一些服务行业目前估值处于相对较低水平。

五、对于债券市场我们对利率债到期收益率曲线维持稳定看法，不追求整体平移的方向性，在各个关键久期借力量化信号工具进行有限度的低频择时波段操作。在信用债领域我们关注短久期高资质的品种。

六、我们持续关注地缘波动带来的输入性通胀/通胀预期及AI潮流带来的生产力提升，对全球经济以及各经济体货币/财政政策的影响。在中国资产端我们关注到韧性和安全性溢价，会继续关注中长期对国内物价及生产效率的影响，以及对中长期政策决策轨迹和各类资产定价的潜在影响。

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

本基金于2026年1月23日至3月31日，2026年4月20日至6月2日期间出现连续20个工作日资产净值低于五千万万元的情形。

§ 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的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体： 贝莱德欣悦丰利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	161,249.06	101,796.16
结算备付金		3,904,317.05	595,196.71
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	257,547,841.11	86,088,900.39
其中：股票投资		29,351,688.20	6,388,996.50
基金投资		-	-
债券投资		228,196,152.91	79,699,903.89
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	7,031,093.40	-
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		165,611,416.86	101.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		434,255,917.48	86,785,994.26
负债和净资产	附注号	本期末	上年度末

		2026年6月30日	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		-	2,889,260.70
应付清算款		-	-
应付赎回款		1,291,598.18	149,738.33
应付管理人报酬		36,088.47	36,566.72
应付托管费		10,826.56	10,970.01
应付销售服务费		20,179.91	19,192.52
应付投资顾问费		-	-
应交税费		1,719.25	1,901.98
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	65,249.99	123,306.50
负债合计		1,425,662.36	3,230,936.76
净资产:			
实收基金	6.4.7.7	415,605,209.21	81,094,073.06
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	17,225,045.91	2,460,984.44
净资产合计		432,830,255.12	83,555,057.50
负债和净资产总计		434,255,917.48	86,785,994.26

注： 报告截止日2026年06月30日，基金份额总额415,605,209.21份，其中A类基金份额净值1.0557元，基金份额35,475,050.45份；C类基金份额净值1.0401元，基金份额380,130,158.76份。

6.2 利润表

会计主体：贝莱德欣悦丰利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1月1日至2025年6 月30日
一、营业总收入		1,189,470.56	720,106.33
1. 利息收入		19,033.64	10,036.18
其中：存款利息收入	6.4.7.9	15,104.28	3,378.57
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		3,929.36	6,657.61

其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		983,156.88	1,690,050.93
其中：股票投资收益	6.4.7.10	271,187.04	931,570.51
基金投资收益		-	-134.14
债券投资收益	6.4.7.11	659,132.39	677,947.12
资产支持证券投资		-	-
收益			
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.12	-	-
股利收益	6.4.7.13	52,837.45	80,667.44
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	182,246.73	-980,014.82
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	5,033.31	34.04
减：二、营业总支出		340,201.66	399,317.60
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	136,927.92	136,462.00
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	41,078.43	40,938.57
3. 销售服务费		66,570.10	22,343.94
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		14,430.57	118,062.20
其中：卖出回购金融资产支出		14,430.57	118,062.20
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		921.74	1,714.96
8. 其他费用	6.4.7.16	80,272.90	79,795.93
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		849,268.90	320,788.73
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		849,268.90	320,788.73
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		849,268.90	320,788.73

6.3 净资产变动表

会计主体：贝莱德欣悦丰利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	81,094,073.06	-	2,460,984.44	83,555,057.50
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	81,094,073.06	-	2,460,984.44	83,555,057.50
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	334,511,136.15	-	14,764,061.47	349,275,197.62
（一）、综合收益总额	-	-	849,268.90	849,268.90
（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）	334,511,136.15	-	13,914,792.57	348,425,928.72
其中：1. 基金申购款	402,349,935.15	-	16,216,208.13	418,566,143.28
2. 基金赎回款	-67,838,799.00	-	-2,301,415.56	-70,140,214.56
（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	415,605,209.21	-	17,225,045.91	432,830,255.12
项目	上年度可比期间 2025年1月1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	66,260,301.92	-	1,700,911.13	67,961,213.05
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	66,260,301.92	-	1,700,911.13	67,961,213.05
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-17,282,263.38	-	-140,812.18	-17,423,075.56
（一）、综合收益总额	-	-	320,788.73	320,788.73
（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）	-17,282,263.38	-	-461,600.91	-17,743,864.29
其中：1. 基金申购款	7,162,656.19	-	217,271.69	7,379,927.88
2. 基金赎回款	-24,444,919.57	-	-678,872.60	-25,123,792.17
（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	48,978,038.54	-	1,560,098.95	50,538,137.49

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

<u>郁蓓华</u>	<u>杨怡</u>	<u>徐菱莲</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

贝莱德欣悦丰利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[2022]1953号《关于准予贝莱德欣悦丰利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《贝莱德欣悦丰利债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币803,250,730.06元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2023)第0063号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《贝莱德欣悦丰利债券型证券投资基金基金合同》于2023年2月28日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为803,542,546.27份基金份额,其中认购资金利息折合291,816.21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《贝莱德欣悦丰利债券型证券投资基金基金合同》和《贝莱德欣悦丰利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《贝莱德欣悦丰利债券型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括主板、创业板及其他中国证监会允许上市的股票、存托凭证)、港股通标的股票、债券(国债、金融债、企业债、公司债、政府支持债券、政府支持机构债券、可转换债券(含可分离交易可转换债券)、可交换债券、次级债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等)、资产支持证券、金融衍生品(包括国债期货、信用衍生品等)、经中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金(仅包括全市场的境内股票型ETF和本基金基金管理人旗下的权益类基金,不包括QDII基金、香港互认基金、基金中基金、其他可投资公募基金的基金中基金、货币市场基金)、债券回购、银行存款(包括定期存款、协议存款、通知存款等)、同业存单、现金等货币市场工具,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)。本基金所指的权益类基金包括股票型基金、基金合同约定股票(含存托凭证)资产投资比例不低于基金资产60%的混合型基金,以及最近四个季度定期报告中披露的股票(含存托凭证)资产占基金资产比例均不低于60%的混合型基金。本基金的投资组合比例为:本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的80%,本基金对股票(含存托凭证)、权益类基金、可转换债券及可交换债券的投资比例合计不超过基金资产的20%,港股通标的股票的投资比例为股票资产的0%-50%;本基金持有其他基金,其市值不超过基金资产净值的10%;每个交易日日终在扣除国债期货合约所需缴纳的交易保证金后,现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。前述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:中债综合财富(总值)指数收益率 $\times$ 85%+沪深300指数收益率 $\times$ 10%+一年期定期存款利率(税后) $\times$ 5%。

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》、2008

年9月18日上海交易所发布的《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳交易所发布的《关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[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[2021]33号《关于北京证券交易所税收政策适用问题的公告》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财税[2024]8号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、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》、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股票、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制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。

(4)对证券投资基金取得的股票股息红利所得,由上市公司代扣代缴个人所得税;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,股息红利所得暂免征收个人所得税。其中,对基金持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所挂牌交易的上市公司限售股,解禁后取得的股息红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。对基金通过港股通投资香港联交所上市H股取得的股息

红利，H股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向H股公司提供内地个人投资者名册，H股公司按照20%的税率代扣个人所得税。基金通过港股通投资香港联交所上市的非H股取得的股息红利，由中国结算按照20%的税率代扣个人所得税。

(5)对于证券投资基金从事A股买卖，出让方按0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税，受让方不再缴纳印花税；自2023年8月28日起，出让方减按0.05%的税率缴纳证券(股票)交易印花税。对于基金通过港股通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(6)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	10,055.67
等于：本金	10,024.69
加：应计利息	30.98
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	151,193.39
等于：本金	151,126.19
加：应计利息	67.20
减：坏账准备	-
合计	161,249.06

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	29,153,531.42	-	29,351,688.20	198,156.78

贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	32,289,821.43	153,803.73	32,495,453.73	51,828.57
	银行间市场	193,597,768.21	2,025,699.18	195,700,699.18	77,231.79
	合计	225,887,589.64	2,179,502.91	228,196,152.91	129,060.36
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		255,041,121.06	2,179,502.91	257,547,841.11	327,217.14

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2026年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	7,031,093.40	-
银行间市场	-	-
合计	7,031,093.40	-

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	2.45
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	4,551.00
其中：交易所市场	-
银行间市场	4,551.00
应付利息	-
预提费用	60,696.54

合计	65,249.99
----	-----------

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

贝莱德欣悦丰利债券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	28,276,848.14	28,276,848.14
本期申购	24,406,081.14	24,406,081.14
本期赎回（以“-”号填列）	-17,207,878.83	-17,207,878.83
本期末	35,475,050.45	35,475,050.45

贝莱德欣悦丰利债券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	52,817,224.92	52,817,224.92
本期申购	377,943,854.01	377,943,854.01
本期赎回（以“-”号填列）	-50,630,920.17	-50,630,920.17
本期末	380,130,158.76	380,130,158.76

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

贝莱德欣悦丰利债券A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,618,318.87	-515,059.35	1,103,259.52
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	1,618,318.87	-515,059.35	1,103,259.52
本期利润	286,372.75	45,091.24	331,463.99
本期基金份额交易产生的变动数	657,075.90	-117,188.58	539,887.32
其中：基金申购款	1,743,882.34	-413,969.68	1,329,912.66
基金赎回款	-1,086,806.44	296,781.10	-790,025.34
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,561,767.52	-587,156.69	1,974,610.83

贝莱德欣悦丰利债券C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,384,627.68	-1,026,902.76	1,357,724.92
加：会计政策变更	-	-	-

前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	2,384,627.68	-1,026,902.76	1,357,724.92
本期利润	380,649.42	137,155.49	517,804.91
本期基金份额交易产生的变动数	19,252,120.03	-5,877,214.78	13,374,905.25
其中：基金申购款	21,740,444.49	-6,854,149.02	14,886,295.47
基金赎回款	-2,488,324.46	976,934.24	-1,511,390.22
本期已分配利润	-	-	-
本期末	22,017,397.13	-6,766,962.05	15,250,435.08

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	842.06
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	241.88
结算备付金利息收入	14,020.34
其他	-
合计	15,104.28

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

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	271,187.04
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	271,187.04

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出股票成交总额	13,648,959.84
减：卖出股票成本总额	13,344,562.30
减：交易费用	33,210.50
买卖股票差价收入	271,187.04

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	515,597.27
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	143,535.12
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	659,132.39

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	106,014,585.56
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	104,601,595.78
减：应计利息总额	1,252,955.11
减：交易费用	16,499.55
买卖债券差价收入	143,535.12

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

本基金本报告期内无衍生工具收益-其他投资收益。

6.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

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

股票投资产生的股利收益	52,837.45
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	52,837.45

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	182,246.73
股票投资	-28,040.27
债券投资	210,287.00
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	182,246.73

6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
基金赎回费收入	5,033.31
合计	5,033.31

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的50%归入基金资产。

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	39,671.58
证券出借违约金	-
证券组合费	0.42
中债账户维护费	9,000.00
汇划手续费	975.81
存托服务费	0.13
上清所账户维护费	9,600.00
合计	80,272.90

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1月1日至2025年6月30日
----	----------------------------	---------------------------------

当期发生的基金应支付的管理费	136,927.92	136,462.00
其中：应支付销售机构的客户维护费	68,372.93	68,213.27
应支付基金管理人的净管理费	68,554.99	68,248.73

注： 本基金投资于本基金基金管理人所管理的公开募集证券投资基金的部分不收取管理费。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扣除所持有本基金基金管理人管理的其他公开募集证券投资基金的基金份额的资产净值后的余额(若为负数，则取0)的0.50%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扣除所持有本基金基金管理人管理的其他公开募集证券投资基金的基金份额的资产净值后的余额(若为负数，则取0)×0.50%÷当年天数。支付销售机构的客户维护费不因投资于基金管理人所管理的其他基金而调减，因此可能导致应支付基金管理人的净管理费为负。

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1月1日至2025年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	41,078.43	40,938.57

注： 本基金投资于本基金托管人所托管的其他基金部分不收取托管费。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扣除本基金持有的基金托管人托管的其他公开募集证券投资基金的基金份额的资产净值后的余额(若为负数，则取0)的0.15%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扣除本基金持有的基金托管人托管的其他公开募集证券投资基金的基金份额的资产净值后的余额(若为负数，则取0)×0.15%÷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		
	贝莱德欣悦丰利债券 A	贝莱德欣悦丰利债券 C	合计
中国建设银行	-	53,658.75	53,658.75
合计	-	53,658.75	53,658.75

获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	贝莱德欣悦丰利债券 A	贝莱德欣悦丰利债券 C	合计
中国建设银行	-	21,677.57	21,677.57
合计	-	21,677.57	21,677.57

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 0.40%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×0.40%÷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1月1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	10,055.67	842.06	21,862.98	245.83

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

6.4.10.8.1 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

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

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。本基金如果投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。本基金主要投资于依法发行上市的股票、港股通标的股票、债券等金融工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金在日常投资管理中面临的与这些金融工具相关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致力于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率。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同责任，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9.57%（2025年12月31日：25.72%）。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

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债券投资。

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	41,429,323.84	13,345,841.15
AAA以下	—	—
未评级	—	8,142,587.17
合计	41,429,323.84	21,488,428.32

注：本报告期末，基金本报告期末无未评级长期信用评级列示的债券投资；上年度末，未评级长期信用债券为中期票据及公司债。

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，本基金所承担的全部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，因此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时间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发行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，部分基金资产流动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

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	161,249.06	-	-	-	161,249.06
结算备付金	3,904,317.05	-	-	-	3,904,317.05
交易性金融资产	23,885,617.15	146,078,712.98	58,231,822.78	29,351,688.20	257,547,841.11
买入返售金融资产	7,031,093.40	-	-	-	7,031,093.40
应收申购款	-	-	-	165,611,416.86	165,611,416.86
资产总计	34,982,276.66	146,078,712.98	58,231,822.78	194,963,105.06	434,255,917.48
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,291,598.18	1,291,598.18
应付管理人报酬	-	-	-	36,088.47	36,088.47
应付托管费	-	-	-	10,826.56	10,826.56
应付销售服务费	-	-	-	20,179.91	20,179.91
应交税费	-	-	-	1,719.25	1,719.25
其他负债	-	-	-	65,249.99	65,249.99
负债总计	-	-	-	1,425,662.36	1,425,662.36
利率敏感度缺口	34,982,276.66	146,078,712.98	58,231,822.78	193,537,442.70	432,830,255.12
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	101,796.16	-	-	-	101,796.16
结算备付金	595,196.71	-	-	-	595,196.71
交易性金融资产	19,514,172.32	34,494,805.61	25,690,925.96	6,388,996.50	86,088,900.39
应收申购款	-	-	-	101.00	101.00
资产总计	20,211,165.19	34,494,805.61	25,690,925.96	6,389,097.50	86,785,994.26
负债					
应付赎回款	-	-	-	149,738.33	149,738.33
应付管理人报酬	-	-	-	36,566.72	36,566.72
应付托管费	-	-	-	10,970.01	10,970.01
卖出回购金融资产款	2,889,260.70	-	-	-	2,889,260.70
应付销售服务费	-	-	-	19,192.52	19,192.52
应交税费	-	-	-	1,901.98	1,901.98
其他负债	-	-	-	123,306.50	123,306.50
负债总计	2,889,260.70	-	-	341,676.06	3,230,936.76
利率敏感度缺口	17,321,904.49	34,494,805.61	25,690,925.96	6,047,421.44	83,555,057.50

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	-1,733,983.22	-831,806.81
	利率下降25bp	1,757,810.44	852,039.04

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股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在注重严格风险控制的基础上，动态调整资产配置，使风险和预期目标相匹配，并选择符合基金合同约定范围内的投资品种进行投资。同时，本基金充分发挥基金管理人的研究优势，通过对经济发展、社会结构、宏观政策、产业政策和科学技术的跟踪研究，将定性分析和定量模型相结合，根据投资策略或市场环境的变化构建和管理投资组合，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的80%，本基金对股票(含存托凭证)、权益类基金、可转换债券及可交换债券的投资比例合计不超过基金资产的20%，港股通标的股票的投资比例为股票资产的0%-50%；本基金持有其他基金，其市值不超过基金资产净值的10%；每个交易日日终在扣除国债期货合约所需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，以识别和测算本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

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

	公允价值	占基金资产净值 比例（%）	公允价值	占基金资产净值 比例（%）
交易性金融资产—股票投资	29,351,688.20	6.78	6,388,996.50	7.65
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	29,351,688.20	6.78	6,388,996.50	7.65

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准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）
	业绩比较基准上升5%	16,133,067.71	2,192,298.63
	业绩比较基准下降5%	-16,133,067.71	-2,192,298.63

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	29,351,688.20	6,334,452.50
第二层次	228,196,152.91	79,754,447.89
第三层次	—	—
合计	257,547,841.11	86,088,900.39

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；对于定期开放的基金投资，本基金不会于封闭期将相关基金列入第一层次；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，确定相关金融工具的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 and 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	29,351,688.20	6.76
	其中：股票	29,351,688.20	6.76
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	228,196,152.91	52.55
	其中：债券	228,196,152.91	52.55

	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	7,031,093.40	1.62
	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	4,065,566.11	0.94
8	其他各项资产	165,611,416.86	38.14
9	合计	434,255,917.48	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

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	1,402,522.00	0.32
C	制造业	18,120,245.20	4.19
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	52,500.00	0.01
E	建筑业	532,691.00	0.12
F	批发和零售业	78,636.00	0.02
G	交通运输、仓储和邮政业	237,019.00	0.05
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,651,606.00	0.38
J	金融业	6,491,416.00	1.50
K	房地产业	233,669.00	0.05
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	551,384.00	0.13
	合计	29,351,688.20	6.78

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
1	300308	中际旭创	1,700	2,159,000.00	0.50
2	601318	中国平安	31,600	1,508,584.00	0.35
3	300502	新易盛	2,260	1,371,820.00	0.32
4	600176	中国巨石	14,100	1,027,608.00	0.24
5	600036	招商银行	21,800	773,900.00	0.18
6	600585	海螺水泥	40,500	686,475.00	0.16
7	688256	寒武纪	400	638,220.00	0.15
8	601166	兴业银行	30,900	511,704.00	0.12
9	002080	中材科技	5,500	495,000.00	0.11
10	600673	东阳光	13,700	460,046.00	0.11
11	002475	立讯精密	6,500	457,600.00	0.11
12	601398	工商银行	61,500	434,805.00	0.10
13	300394	天孚通信	1,380	417,698.40	0.10
14	601899	紫金矿业	15,700	394,698.00	0.09
15	601288	农业银行	61,500	373,305.00	0.09
16	688041	海光信息	1,000	370,300.00	0.09
17	002384	东山精密	1,300	341,055.00	0.08
18	600487	亨通光电	3,100	338,954.00	0.08
19	000063	中兴通讯	9,100	329,329.00	0.08
20	000786	北新建材	18,200	329,238.00	0.08
21	601138	工业富联	4,400	317,460.00	0.07
22	002271	东方雨虹	25,600	303,872.00	0.07
23	688981	中芯国际	1,900	301,758.00	0.07
24	601328	交通银行	46,000	295,780.00	0.07
25	000651	格力电器	7,500	281,250.00	0.06
26	688012	中微公司	600	281,100.00	0.06
27	688008	澜起科技	900	278,910.00	0.06
28	300476	胜宏科技	800	277,144.00	0.06
29	601668	中国建筑	62,800	272,552.00	0.06
30	600919	江苏银行	25,000	269,500.00	0.06
31	002371	北方华创	300	265,368.00	0.06
32	600522	中天科技	4,200	254,856.00	0.06
33	002594	比亚迪	3,100	247,070.00	0.06
34	603986	兆易创新	300	244,500.00	0.06
35	601728	中国电信	46,600	241,854.00	0.06
36	601857	中国石油	27,700	240,436.00	0.06

37	600941	中国移动	2,700	232,551.00	0.05
38	300059	东方财富	10,400	211,952.00	0.05
39	600030	中信证券	7,000	201,110.00	0.05
40	002463	沪电股份	1,300	198,640.00	0.05
41	688525	佰维存储	400	197,892.00	0.05
42	000725	京东方A	22,700	197,036.00	0.05
43	300442	润泽科技	2,300	191,061.00	0.04
44	002281	光迅科技	700	179,858.00	0.04
45	600050	中国联通	42,800	171,200.00	0.04
46	600016	民生银行	52,300	168,406.00	0.04
47	000408	藏格矿业	2,400	166,368.00	0.04
48	601229	上海银行	19,100	165,788.00	0.04
49	300896	爱美客	1,900	165,680.00	0.04
50	600801	华新建材	10,600	165,360.00	0.04
51	600938	中国海油	6,000	162,900.00	0.04
52	601211	国泰海通	8,500	154,700.00	0.04
53	601658	邮储银行	30,800	151,844.00	0.04
54	603737	三棵树	6,200	149,420.00	0.03
55	601169	北京银行	30,100	147,490.00	0.03
56	000338	潍柴动力	5,400	147,150.00	0.03
57	600028	中国石化	31,200	139,152.00	0.03
58	600183	生益科技	800	138,720.00	0.03
59	601919	中远海控	10,400	137,904.00	0.03
60	300604	长川科技	400	136,568.00	0.03
61	601988	中国银行	23,500	134,420.00	0.03
62	300408	三环集团	800	133,520.00	0.03
63	603605	珀莱雅	2,200	131,824.00	0.03
64	000933	神火股份	6,200	131,440.00	0.03
65	601168	西部矿业	4,800	130,272.00	0.03
66	600498	烽火通信	1,600	117,760.00	0.03
67	603501	豪威集团	1,200	113,820.00	0.03
68	601009	南京银行	11,200	110,768.00	0.03
69	603993	洛阳钼业	6,200	108,810.00	0.03
70	600048	保利发展	22,300	103,249.00	0.02
71	601006	大秦铁路	21,500	99,115.00	0.02
72	300136	信维通信	800	95,400.00	0.02
73	601601	中国太保	3,300	94,116.00	0.02
74	600584	长电科技	900	93,195.00	0.02
75	601818	光大银行	32,000	92,480.00	0.02
76	002916	深南电路	200	91,580.00	0.02
77	000833	粤桂股份	3,900	91,338.00	0.02
78	601825	沪农商行	12,100	90,629.00	0.02
79	002241	歌尔股份	4,000	90,120.00	0.02

80	002372	伟星新材	10,800	88,452.00	0.02
81	300957	贝泰妮	2,800	88,228.00	0.02
82	600111	北方稀土	1,800	86,490.00	0.02
83	688361	中科飞测	200	86,000.00	0.02
84	603296	华勤技术	1,140	84,667.80	0.02
85	000100	TCL科技	14,400	83,808.00	0.02
86	002156	通富微电	1,100	83,457.00	0.02
87	601688	华泰证券	4,000	82,480.00	0.02
88	600660	福耀玻璃	1,600	80,704.00	0.02
89	603799	华友钴业	1,600	77,216.00	0.02
90	601916	浙商银行	29,300	77,059.00	0.02
91	601998	中信银行	10,900	75,537.00	0.02
92	300433	蓝思科技	1,400	75,124.00	0.02
93	688363	华熙生物	2,100	75,117.00	0.02
94	601600	中国铝业	9,100	74,802.00	0.02
95	300223	北京君正	300	74,670.00	0.02
96	300054	鼎龙股份	700	74,179.00	0.02
97	002938	鹏鼎控股	700	73,766.00	0.02
98	600096	云天化	2,400	72,960.00	0.02
99	300383	光环新网	5,800	72,152.00	0.02
100	002460	赣锋锂业	1,100	71,940.00	0.02
101	002049	紫光国微	800	71,000.00	0.02
102	601077	渝农商行	11,600	70,876.00	0.02
103	601838	成都银行	4,000	70,800.00	0.02
104	301308	江波龙	100	70,380.00	0.02
105	001979	招商蛇口	10,800	69,444.00	0.02
106	000157	中联重科	9,900	69,003.00	0.02
107	600315	上海家化	4,100	68,962.00	0.02
108	002600	领益智造	3,900	67,626.00	0.02
109	601127	赛力斯	1,100	67,375.00	0.02
110	600015	华夏银行	10,500	67,095.00	0.02
111	300782	卓胜微	600	65,748.00	0.02
112	688120	华海清科	200	64,436.00	0.01
113	601669	中国电建	13,700	64,390.00	0.01
114	601390	中国中铁	15,400	64,218.00	0.01
115	688047	龙芯中科	400	61,868.00	0.01
116	688099	晶晨股份	600	61,740.00	0.01
117	002436	兴森科技	1,200	61,140.00	0.01
118	000002	万科A	20,600	60,976.00	0.01
119	688387	信科移动-U	2,900	57,536.00	0.01
120	300661	圣邦股份	400	57,392.00	0.01
121	002511	中顺洁柔	8,500	56,525.00	0.01
122	603893	瑞芯微	300	56,508.00	0.01

123	000895	双汇发展	2,500	56,000.00	0.01
124	300888	稳健医疗	2,000	55,980.00	0.01
125	002466	天齐锂业	900	55,188.00	0.01
126	600489	中金黄金	3,000	54,150.00	0.01
127	003031	中瓷电子	300	54,090.00	0.01
128	000807	云铝股份	2,400	53,136.00	0.01
129	600770	综艺股份	7,500	52,500.00	0.01
130	600549	厦门钨业	600	51,120.00	0.01
131	600741	华域汽车	3,200	49,664.00	0.01
132	002601	龙佰集团	3,000	49,440.00	0.01
133	600460	士兰微	900	49,194.00	0.01
134	000776	广发证券	2,100	49,140.00	0.01
135	002185	华天科技	2,200	49,082.00	0.01
136	601868	中国能建	18,300	48,861.00	0.01
137	600104	上汽集团	5,000	48,800.00	0.01
138	600066	宇通客车	1,800	48,258.00	0.01
139	688126	沪硅产业	1,200	47,868.00	0.01
140	600988	赤峰黄金	1,800	47,376.00	0.01
141	300628	亿联网络	1,400	47,348.00	0.01
142	600547	山东黄金	2,000	46,180.00	0.01
143	601628	中国人寿	1,300	45,955.00	0.01
144	002756	永兴材料	800	45,312.00	0.01
145	000625	长安汽车	6,300	45,171.00	0.01
146	000021	深科技	700	44,989.00	0.01
147	002409	雅克科技	200	44,900.00	0.01
148	688469	芯联集成-U	4,200	44,562.00	0.01
149	603228	景旺电子	600	43,446.00	0.01
150	000426	兴业银锡	1,300	42,848.00	0.01
151	688213	思特威	400	42,828.00	0.01
152	601186	中国铁建	7,100	42,245.00	0.01
153	601231	环旭电子	1,300	42,120.00	0.01
154	300866	安克创新	400	41,800.00	0.01
155	300285	国瓷材料	400	41,272.00	0.01
156	688036	传音控股	700	41,265.00	0.01
157	000652	泰达股份	12,000	40,920.00	0.01
158	002532	天山铝业	3,800	40,774.00	0.01
159	601117	中国化学	5,500	40,425.00	0.01
160	002273	水晶光电	1,100	39,028.00	0.01
161	688396	华润微	400	39,020.00	0.01
162	000753	漳州发展	8,400	37,716.00	0.01
163	600881	亚泰集团	24,700	37,297.00	0.01
164	688220	翱捷科技	300	37,296.00	0.01
165	000630	铜陵有色	5,800	36,888.00	0.01

166	002138	顺络电子	500	36,550.00	0.01
167	601717	中创智领	2,600	36,166.00	0.01
168	000975	山金国际	2,100	35,700.00	0.01
169	688385	复旦微电	500	35,645.00	0.01
170	002738	中矿资源	600	35,394.00	0.01
171	688234	天岳先进	200	34,702.00	0.01
172	688172	燕东微	400	33,464.00	0.01
173	300373	扬杰科技	200	31,446.00	0.01
174	601997	贵阳银行	6,100	31,293.00	0.01
175	601216	君正集团	6,900	30,774.00	0.01
176	600901	江苏金租	5,200	29,900.00	0.01

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300308	中际旭创	2,209,334.00	2.64
2	601318	中国平安	1,562,006.00	1.87
3	300502	新易盛	1,361,377.00	1.63
4	600176	中国巨石	1,066,629.00	1.28
5	600036	招商银行	782,066.00	0.94
6	600585	海螺水泥	739,630.00	0.89
7	600673	东阳光	634,788.00	0.76
8	688256	寒武纪	618,420.00	0.74
9	002080	中材科技	528,351.00	0.63
10	601166	兴业银行	518,919.00	0.62
11	300394	天孚通信	517,641.00	0.62
12	002475	立讯精密	462,045.00	0.55
13	601398	工商银行	451,321.00	0.54
14	601899	紫金矿业	419,174.00	0.50
15	000063	中兴通讯	400,832.00	0.48
16	601857	中国石油	393,322.00	0.47
17	601288	农业银行	391,815.00	0.47
18	300476	胜宏科技	371,091.00	0.44
19	000786	北新建材	360,622.00	0.43
20	688041	海光信息	357,754.00	0.43

注：“买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300750	宁德时代	551,465.00	0.66

2	300308	中际旭创	353,096.00	0.42
3	601318	中国平安	333,638.00	0.40
4	600900	长江电力	304,798.00	0.36
5	600519	贵州茅台	262,287.00	0.31
6	000333	美的集团	246,980.00	0.30
7	300502	新易盛	221,089.00	0.26
8	600036	招商银行	218,049.00	0.26
9	601857	中国石油	209,485.00	0.25
10	002714	牧原股份	201,030.00	0.24
11	600276	恒瑞医药	185,476.00	0.22
12	000725	京东方A	165,346.00	0.20
13	600673	东阳光	160,017.00	0.19
14	600941	中国移动	156,206.00	0.19
15	688012	中微公司	152,254.42	0.18
16	300124	汇川技术	145,112.00	0.17
17	601166	兴业银行	142,881.00	0.17
18	300394	天孚通信	142,168.00	0.17
19	600104	上汽集团	141,879.00	0.17
20	601995	中金公司	138,689.00	0.17

注：“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	36,335,294.27
卖出股票收入（成交）总额	13,648,959.84

注：“买入股票成本（成交）总额”和“卖出股票收入（成交）总额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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	32,495,453.73	7.51
2	央行票据	-	-
3	金融债券	195,700,699.18	45.21
	其中：政策性金融债	154,271,375.34	35.64
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	-	-
10	合计	228,196,152.91	52.72

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	240208	24国开08	600,000	61,784,054.79	14.27
2	09260202	26国开清发02	200,000	20,077,517.81	4.64
3	230210	23国开10	100,000	10,786,904.11	2.49
4	232380066	23中行二级资本债03A	100,000	10,649,696.99	2.46
5	220307	22进出07	100,000	10,625,454.79	2.45

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

本基金本报告期内未投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体中，国家开发银行、兴业银行股份有限公司、中国进出口银行、中国银行股份有限公司、浙商银行股份有限公司、中国农业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

本基金投资的前十名股票未超出基金合同约定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	165,611,416.86
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	165,611,416.86

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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
贝莱德欣悦丰利债券A	532	66,682.43	0.00	0.00 %	35,475,050.45	100.00 %
贝莱德欣悦丰利债券C	568	669,243.24	20,674,994.68	5.44 %	359,455,164.08	94.56 %
合计	1,100	377,822.92	20,674,994.68	4.97 %	394,930,214.53	95.03 %

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	贝莱德欣悦丰利债券A	3,273,656.40	9.2281 %
	贝莱德欣悦丰利债券C	11,655,225.92	3.0661 %
	合计	14,928,882.32	3.5921 %

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	贝莱德欣悦丰利债券A	50~100
	贝莱德欣悦丰利债券C	0
	合计	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	贝莱德欣悦丰利债券A	0
	贝莱德欣悦丰利债券C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	贝莱德欣悦丰利债券A	贝莱德欣悦丰利债券C
基金合同生效日 （2023年2月28日） 基金份额总额	432,215,451.18	371,327,095.09
本报告期期初基金 份额总额	28,276,848.14	52,817,224.92
本报告期基金总申 购份额	24,406,081.14	377,943,854.01
减：本报告期基金 总赎回份额	17,207,878.83	50,630,920.17
本报告期基金拆分 变动份额	—	—
本报告期期末基金 份额总额	35,475,050.45	380,130,158.76

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	49,984,254. 24	100.00	36,012.78	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		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 (%)
中信证券 (山东) 有限责任公司	107,220,620.64	100.00	213,919,000.00	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	关于贝莱德欣悦丰利债券型证券投资基金基金资产净值连续低于5000	中国证监会规定媒介	2026年3月14日

	万元的提示性公告		
2	关于贝莱德欣悦丰利债券型证券投资基金基金资产净值连续低于5000万元的提示性公告	中国证监会规定媒介	2026年3月28日
3	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
4	贝莱德欣悦丰利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
5	贝莱德欣悦丰利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
6	贝莱德欣悦丰利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
7	贝莱德欣悦丰利债券型证券投资基金招募说明书更新（2026年第1号）	中国证监会规定媒介	2026年4月11日
8	贝莱德欣悦丰利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
9	贝莱德欣悦丰利债券型证券投资基金（A类份额）产品资料概要更新（2026年第2号）	中国证监会规定媒介	2026年6月27日
10	贝莱德欣悦丰利债券型证券投资基金（C类份额）产品资料概要更新（2026年第2号）	中国证监会规定媒介	2026年6月27日
11	贝莱德欣悦丰利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6月27日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	-	-	-	-	-	-	-%
个人	1	20260331-20260402;20260410-20260608;20260612-20260615	0.00	11,655,225.92	0.00	11,655,225.92	2.80%
产品特有风险							

本基金于本报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过20%的情形。本基金管理人提请投资者注意因单一投资者持有基金份额集中导致的产品流动性风险、大额赎回风险以及净值波动风险等特有风险。

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