

英大中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证 券投资基金 2025 年中期报告

2025 年 6 月 30 日

基金管理人：英大基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

送出日期：2025 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、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 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 2025 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

| | |
|---|-----------|
| § 1 重要提示及目录 | 2 |
| 1.1 重要提示 | 2 |
| 1.2 目录 | 3 |
| § 2 基金简介 | 5 |
| 2.1 基金基本情况 | 5 |
| 2.2 基金产品说明 | 5 |
| 2.3 基金管理人和基金托管人 | 5 |
| 2.4 信息披露方式 | 6 |
| 2.5 其他相关资料 | 6 |
| § 3 主要财务指标和基金净值表现 | 6 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标 | 6 |
| 3.2 基金净值表现 | 7 |
| 3.3 其他指标 | 8 |
| § 4 管理人报告 | 8 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况 | 8 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 | 10 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 | 10 |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 | 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 | 12 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 | 12 |
| 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 | 12 |
| § 5 托管人报告 | 13 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 | 13 |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 | 13 |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见 | 13 |
| § 6 半年度财务会计报告（未经审计） | 13 |
| 6.1 资产负债表 | 13 |
| 6.2 利润表 | 15 |
| 6.3 净资产变动表 | 16 |
| 6.4 报表附注 | 18 |
| § 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 | 39 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 | 39 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 | 39 |

| | |
|---|-----------|
| 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 | 40 |
| 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 | 40 |
| 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 | 40 |
| 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 | 40 |
| 7.10 本基金投资股指期货的投资政策 | 40 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 | 40 |
| 7.12 投资组合报告附注 | 40 |
| § 8 基金份额持有人信息 | 42 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 42 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 42 |
| 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 | 42 |
| § 9 开放式基金份额变动 | 42 |
| § 10 重大事件揭示 | 42 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 | 42 |
| 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 | 43 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 43 |
| 10.4 基金投资策略的改变 | 43 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 | 43 |
| 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 | 43 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 | 43 |
| 10.8 其他重大事件 | 44 |
| § 11 影响投资者决策的其他重要信息 | 45 |
| 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 | 45 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 | 46 |
| § 12 备查文件目录 | 46 |
| 12.1 备查文件目录 | 46 |
| 12.2 存放地点 | 46 |
| 12.3 查阅方式 | 46 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|------------------------------|
| 基金名称 | 英大中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金 |
| 基金简称 | 英大中证同业存单 AAA 指数 7 天持有 |
| 基金主代码 | 016066 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2022 年 7 月 13 日 |
| 基金管理人 | 英大基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 交通银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 67,244,185.69 份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|--|
| 投资目标 | 本基金采用指数化投资，力争在扣除各项费用前获得与标的指数相似的总回报，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。 |
| 投资策略 | <p>本基金主要采用抽样复制和动态最优化的方法，投资于标的指数中具有代表性和流动性的成份券和备选成份券，或选择非成份券作为替代，构造与标的指数风险收益特征相似的资产组合，以实现对标指数的有效跟踪。</p> <p>在正常市场情况下，本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。</p> <p>本基金参与非指数成份券投资的，应当坚守产品定位，符合投资目标、投资策略、跟踪误差等要求，具有充分的投资依据，并履行基金管理人内部决策程序。</p> <p>本基金运作过程中，如果标的指数成份券发生明显负面事件面临退市或违约风险，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人将按照基金份额持有人利益优先的原则，履行内部决策程序后及时对相关成份券进行调整。</p> <p>主要投资策略有：1、优化抽样复制策略；2、替代性策略；3、债券投资策略。</p> |
| 业绩比较基准 | 中证同业存单 AAA 指数收益率 \times 95%+银行人民币一年定期存款利率（税后） \times 5% |
| 风险收益特征 | 本基金风险与收益低于股票型基金、偏股混合型基金，高于货币市场基金。主要投资于标的指数成份券及备选成份券，具有与标的指数以及标的指数所代表的市场相似的风险收益特征。 |

2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目 | | 基金管理人 | 基金托管人 |
|------|----|------------|------------|
| 名称 | | 英大基金管理有限公司 | 交通银行股份有限公司 |
| 信息披露 | 姓名 | 刘康喜 | 方圆 |

| | | | |
|--------|------|-----------------------------------|-------------------------|
| 负责人 | 联系电话 | 010-59112026 | 95559 |
| | 电子邮箱 | liukx@ydamc.com | fangy_20@bankcomm.com |
| 客户服务电话 | | 400-890-5288 | 95559 |
| 传真 | | 010-59112222 | 021-62701216 |
| 注册地址 | | 北京市朝阳区东三环中路 1 号环球金融中心西塔 22 楼 2201 | 中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号 |
| 办公地址 | | 北京市朝阳区东三环中路 1 号环球金融中心西塔 22 楼 2201 | 中国（上海）长宁区仙霞路 18 号 |
| 邮政编码 | | 100020 | 200336 |
| 法定代表人 | | 范育晖 | 任德奇 |

2.4 信息披露方式

| | |
|---------------------|---|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 中国证券报 |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | http://www.ydamc.com |
| 基金中期报告备置地点 | 基金管理人和基金托管人的住所 |

2.5 其他相关资料

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|--------|---------------------|-----------------------------------|
| 注册登记机构 | 英大基金管理有限公司 | 北京市朝阳区东三环中路 1 号环球金融中心西塔 22 楼 2201 |
| 会计师事务所 | 毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙） | 北京市东长安街 1 号东方广场东 2 座办公楼 8 层 |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2025 年 1 月 1 日-2025 年 6 月 30 日) |
|---------------|-------------------------------------|
| 本期已实现收益 | 538,169.70 |
| 本期利润 | 415,617.07 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0039 |
| 本期加权平均净值利润率 | 0.38% |
| 本期基金份额净值增长率 | 0.47% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2025 年 6 月 30 日) |
| 期末可供分配利润 | 1,396,613.93 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0208 |
| 期末基金资产净值 | 68,812,693.74 |
| 期末基金份额净值 | 1.0233 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2025 年 6 月 30 日) |
| 基金份额累计净值增长率 | 2.33% |

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

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3、净值相关数据计算中涉及天数的，包括所有交易日以及季末最后一自然日（如非交易日）。

4、期末可供分配利润采用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。

3.2 基金净值表现

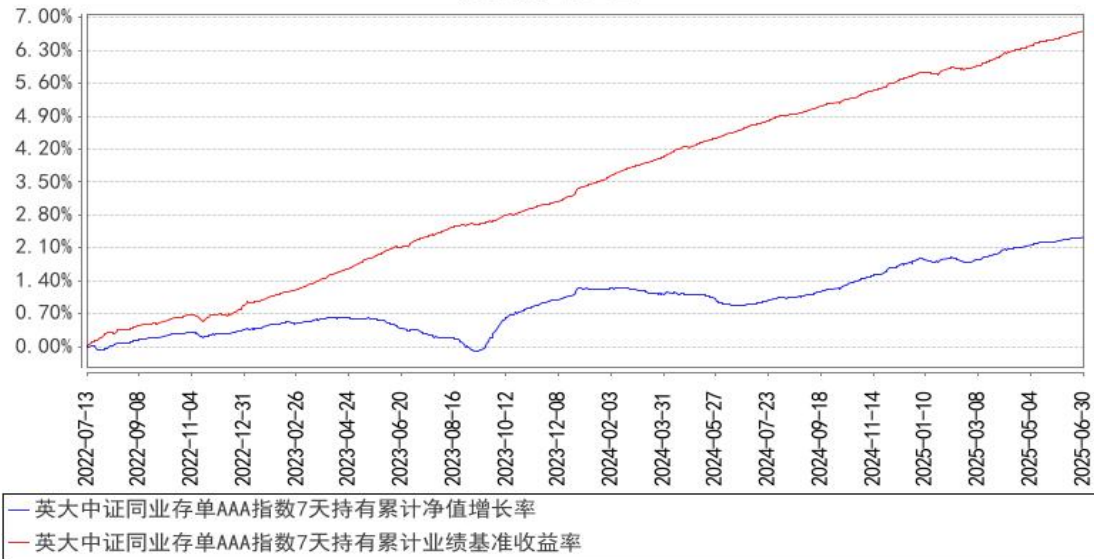
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 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 | 0.10% | 0.01% | 0.16% | 0.01% | -0.06% | 0.00% |
| 过去三个月 | 0.33% | 0.01% | 0.52% | 0.01% | -0.19% | 0.00% |
| 过去六个月 | 0.47% | 0.01% | 0.86% | 0.01% | -0.39% | 0.00% |
| 过去一年 | 1.42% | 0.01% | 1.96% | 0.01% | -0.54% | 0.00% |
| 自基金合同生效起至今 | 2.33% | 0.02% | 6.71% | 0.01% | -4.38% | 0.01% |

注：同期业绩比较基准为中证同业存单 AAA 指数收益率×95%+银行人民币一年定期存款利率（税后）×5%。

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

英大中证同业存单AAA指数7天持有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：本基金的业绩比较基准为：中证同业存单 AAA 指数收益率×95%+银行人民币一年定期存款利率（税后）×5%。

3.3 其他指标

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

英大基金管理有限公司（以下简称“英大基金”或“公司”）成立于 2012 年 8 月 17 日，注册资本金 11.46 亿元。作为央企控股的公募基金公司，英大基金长期以来积极践行金融为民的服务宗旨，坚持服务实体经济的发展定位，坚持服务主责主业、服务产融结合、服务国家发展大局，持续拓宽科技金融、绿色金融、普惠金融、养老金融和数字金融的广度和深度，积极推进高质量、差异化、可持续发展，致力于为客户提供卓越的资产管理服务。公司始终坚持把党的政治建设摆在首位，坚持聚焦高质量发展，推动党建与经营发展深度融合，以高质量党建引领保障公司业务高质量发展。依托高效的决策机制、专业的投研团队、严谨的风控体系，公司多次荣获新浪财经“最具成长潜力基金公司”、新华网金融企业社会责任优秀案例等奖项。2024 年，荣获天天基金“年度优质投资者陪伴基金公司”奖和“年度潜力电商团队”奖，服务质效获行业普遍认可。

截至 2025 年 6 月 30 日，本公司管理英大纯债债券型证券投资基金、英大领先回报混合型发起式证券投资基金、英大现金宝货币市场基金、英大国企改革主题股票型证券投资基金、英大灵活配置混合型发起式证券投资基金、英大策略优选混合型证券投资基金、英大睿鑫灵活配置混合型证券投资基金、英大睿盛灵活配置混合型证券投资基金、英大通盈纯债债券型证券投资基金、英大安惠纯债债券型证券投资基金、英大安鑫 66 个月定期开放债券型证券投资基金、英大智享债券型证券投资基金、英大通惠多利债券型证券投资基金、英大稳固增强核心一年持有期混合型证券投资基金、英大中证 ESG120 策略指数证券投资基金、英大安盈 30 天滚动持有债券型发起式证券投资基金、英大安益中短债债券型证券投资基金、英大安悦纯债债券型证券投资基金、英大中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、英大通佑纯债一年定期开放债券型证券投资基金、英大延福养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、英大安旻纯债债券型证券投资基金、英大碳中和混合型证券投资基金、英大延福养老目标日期 2035 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、英大延福养老目标日期 2055 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、英大延福养老目标日期 2060 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、英大延福养老目标日期 2045 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、英大延福养老目标日期 2050 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、英大安华纯债债券型证券投资基金、英大 CFETS0-3 年期政策性金融

债指数证券投资基金、英大福鑫稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）31 只开放式证券投资基金，同时，管理多个特定客户资产投资组合。

基金管理人与股东之间实行业务隔离制度，股东并不直接参与基金财产的投资运作。

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 | | |
| 吕一楠 | 本基金的基金经理 | 2022 年 7 月 13 日 | — | 14 年 | 双硕士学位，研究生学历。历任北京易初莲花连锁超市有限公司信息技术部职员，香港大新保险服务有限公司投资部投资分析师，中国人寿养老保险股份有限公司投资管理中心投资经理助理，交银施罗德基金管理有限公司固定收益部基金经理助理、专户投资部（固收）投资经理，北信瑞丰基金管理有限公司固定收益部基金经理（拟任）。2020 年 12 月加入英大基金管理有限公司，历任公司固定收益部基金经理（拟任）。现任公司固定收益部基金经理，管理英大现金宝货币市场基金、英大安盈 30 天滚动持有债券型发起式证券投资基金、英大安益中短债债券型证券投资基金、英大安悦纯债债券型证券投资基金、英大中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、英大通佑纯债一年定期开放债券型证券投资基金、英大安旻纯债债券型证券投资基金、英大安华纯债债券型证券投资基金、英大 CFETS0-3 年期政策性金融债指数证券投资基金。 |
| 赵济民 | 本基金的基金经理 | 2024 年 7 月 8 日 | — | 9 年 | 硕士学位，研究生学历，历任建信信托有限责任公司证券市场事业部信托经理、投资经理。2020 年 12 月加入英大基金，历任固定收益部基金经理助理。现任公司固定收益部基金经理，管理英大现金宝货币市场基金、英大中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、英大安旻纯债债券型证券投资基金。 |
| 孙莹贺 | 本基金的基金经理 | 2024 年 8 月 30 日 | — | 10 年 | 硕士学位，研究生学历，FRM、CFP 持证人。历任友利银行（中国）有限公司风险管理部，大连银行股份有限公司计划财务部，北京农村商业银行股份有限公司金融市场部投资经理，国海证券股份有限公司金融市场委员会销售交易部总经理助理。2024 |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|--|
| | | | | | 年 5 月加入英大基金管理有限公司，现任固定收益部副总经理、基金经理，管理英大中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、英大安华纯债债券型证券投资基金。 |
|--|--|--|--|--|--|

注：1. 上述“任职日期”和“离任日期”为根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。首任基金经理的，其“任职日期”为基金合同生效日。

2. 证券从业的含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》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

无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及《英大中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金基金合同》《英大中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金招募说明书》等有关基金法律文件的规定，以取信于市场和社会投资公众为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金管理人通过不断完善法人治理结构和内部控制制度，加强内部管理，规范基金运作。本报告期内，基金运作合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

为确保公司所管理的不同投资组合得到公平对待，保护投资者合法权益，根据《证券投资基金法》《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》等国家法律法规和监管部门的规定，公司已经制定了《英大基金管理有限公司公平交易管理办法》，适用于公司所管理的全部公募基金、私募资产管理计划等。

公司保障投资决策公平的控制方法包括：实行投资决策委员会领导下的基金经理/投资经理负责制，明确各自的投资权限，保证不同投资组合经理之间投资决策的独立性，交易执行部门与投资决策部门严格分离，业绩与风险评估以数量分析为基础，对投资组合进行事后监控。公司建立了规范的投资流程，明确投资各环节的业务职责，防范投资风险。所有投资组合共享统一的投资研究平台，投资研究团队使用同一研究报告系统，确保公募基金、私募资产管理计划等不同的投资组合在获得投资信息、投资建议方面享有公平的机会。

公司保障交易分配公平的控制方法包括：建立交易分配公平的内部控制流程，将投资管理职

能和交易执行职能相隔离，实行包括所有投资品种的集中交易制度，并确保公平交易可操作、可稽核、可持续。公司在交易系统中设置公平交易功能并严格执行，以技术措施保障公平交易的实现。

风险管理部定期对不同投资组合（尤其是同一位投资经理管理的不同投资组合）在连续四个季度期间内、不同时间窗下（1 日内、3 日内、5 日内等）的同向交易以及反向交易的交易时机和交易价差进行事后合理性分析。

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及《英大基金管理有限公司公平交易管理办法》的规定，从研究分析、投资决策、交易执行、事后监控等环节严格把关，通过系统和人工等方式在各个环节严格控制交易公平执行，未发现不同投资组合之间存在违反公平交易原则的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金不存在参与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的 5% 的情况，且不存在其他可能导致非公平交易和利益输送的异常交易行为。

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

2025 年上半年，经济基本面处于低位企稳状态，生产端表现向好，但外需因关税问题压力逐渐显现。债券市场延续上年末震荡偏强格局，但随着资金面持续收紧，市场收益率与资金利率倒挂，股债跷跷板效应显著增强，债券收益率震荡上行。1 月中旬，受缴税及春节前现金需求影响，资金利率大幅走高，推动债市回调。2 月资金面压力加剧，隔夜利率维持高位，债市表现疲软。3 月初资金利率短暂缓解，债市迎来阶段性修复，但两会关键指标与市场预期一致，长端缺乏下行动力。3 月下旬，多空因素交织，债市横盘震荡，货币政策宽松预期弱化。二季度，债券市场在内外因素交织下呈现出较为复杂的走势。美国关税政策的不确定性，引发全球市场巨震，使得国内经济基本上出现内外分化。出口增长边际下滑，而社会消费品零售金额在以旧换新等政策的推动下维持强劲增长，但通胀、金融数据以及房地产市场仍处于低位徘徊状态。在此背景下，央行实施了降准降息措施，并通过买断式逆回购和 MLF 等工具向市场释放大量流动性，使得资金面相较于一季度有了显著改善且整体保持平稳。从收益率走势来看，4 月初债市收益率因美方关税政策超预期大幅下行，债券市场步入牛市；之后一直到 6 月，债市多空拉锯，震荡行情拉长。央行维持适度宽松的货币政策格局，跨半年资金面保持宽松。

报告期内，本基金严格按照中证同业存单 AAA 指数范围优选存单配置，加强对指数的跟踪，

保持稳健投资风格。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.0233 元；本报告期基金份额净值增长率为 0.47%，业绩比较基准收益率为 0.86%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2025 年下半年，债市或在“弱复苏+外需回落”的宏观格局中运行。二季度 GDP 同比增长 5.2%，增速超市场预期，但全年目标 5%仍需有一定的政策托底。中美关税拉锯导致出口前高后低，房地产量价未稳，工业品通缩压力加大，消费与投资内生动能不足。财政政策方面，逆周期政策持续加码，消费刺激、城市更新与稳外贸持续推动，育儿补贴的发放极大增加居民信心。货币政策方面，宽松仍是主基调。未来仍有一定的降准降息空间，结构性工具扩容，流动性保持宽松。产业政策方面，反内卷仍会持续推动，对通胀预期可能会形成一定的扰动。

投资策略方面，本基金将更多关注交易机会，密切跟踪市场动态，及时调整投资组合。将严格按照中证同业存单 AAA 指数范围优选存单配置，加强对指数的跟踪，保持稳健投资风格。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，基金日常估值由基金管理人进行。基金份额净值由基金管理人完成估值后，将估值结果以电子形式报给基金托管人，基金托管人按基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核，基金托管人复核无误后以电子签名形式返回给基金管理人，由基金管理人依据本基金合同和有关法律法规的规定进行披露。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

本基金管理人设立估值委员会。估值委员会主任由公司总经理担任；成员包括督察长、投资总监、运营分管领导、各基金经理、研究部、交易部、监察稽核部、风险管理部、基金运营部的主要负责人；委员会秘书由基金运营部负责人担任。基金管理人估值委员和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经历。报告期内，基金经理参加估值委员会会议，但不介入基金日常估值业务。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期本基金未进行利润分配，本基金的利润分配符合相关法规及基金合同的规定。

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

本基金在报告期内没有触及 2014 年 8 月 8 日生效的《公开募集证券投资基金运作管理办法》

第四十一条规定的条件。

§ 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，基金托管人在英大中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《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、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，英大基金管理有限公司在英大中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

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

本报告期内，由英大基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关英大中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：英大中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资 产 | 附注号 | 本期末 2025 年 6 月 30 日 | 上年度末 2024 年 12 月 31 日 |
|----------|---------|------------------------|--------------------------|
| 资 产： | | | |
| 货币资金 | 6.4.7.1 | 8,195,850.30 | 2,072,903.90 |
| 结算备付金 | | - | - |
| 存出保证金 | | - | - |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 60,747,683.46 | 155,121,196.44 |
| 其中：股票投资 | | - | - |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 60,747,683.46 | 155,121,196.44 |
| 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 | - | 10,000,704.76 |
| 债权投资 | 6.4.7.5 | - | - |
| 其中：债券投资 | | - | - |
| 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 | | - | 652,821.32 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.8 | - | - |
| 资产总计 | | 68,943,533.76 | 167,847,626.42 |
| 负债和净资产 | 附注号 | 本期末 2025 年 6 月 30 日 | 上年度末 2024 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 | | - | - |
| 应付清算款 | | - | - |
| 应付赎回款 | | - | - |
| 应付管理人报酬 | | 10,316.76 | 26,089.60 |
| 应付托管费 | | 2,579.18 | 6,522.37 |
| 应付销售服务费 | | 10,316.76 | 26,089.60 |
| 应付投资顾问费 | | - | - |
| 应交税费 | | 238.22 | 2,813.66 |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.9 | 107,389.10 | 31,211.98 |
| 负债合计 | | 130,840.02 | 92,727.21 |
| 净资产： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.10 | 67,244,185.69 | 164,711,937.88 |
| 其他综合收益 | 6.4.7.11 | - | - |
| 未分配利润 | 6.4.7.12 | 1,568,508.05 | 3,042,961.33 |
| 净资产合计 | | 68,812,693.74 | 167,754,899.21 |
| 负债和净资产总计 | | 68,943,533.76 | 167,847,626.42 |

注：报告截止日 2025 年 06 月 30 日，英大中证同业存单 AAA 指数 7 天持有基金份额净值 1.0233 元，基金份额总额 67,244,185.69 份。

6.2 利润表

会计主体：英大中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目 | 附注号 | 本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |
|------------------------|------------|--|---|
| 一、营业总收入 | | 807,423.21 | 108,256.72 |
| 1. 利息收入 | | 39,290.37 | 39,887.58 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.13 | 13,406.86 | 14,023.29 |
| 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 | | 25,883.51 | 25,864.29 |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | | 890,685.47 | 80,477.36 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.14 | - | - |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.15 | 890,685.47 | 80,477.36 |
| 资产支持证券投资 | 6.4.7.16 | - | - |
| 收益 | | | |
| 贵金属投资收益 | 6.4.7.17 | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.18 | - | - |
| 股利收益 | 6.4.7.19 | - | - |
| 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） | 6.4.7.20 | -122,552.63 | -12,108.22 |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - | - |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列） | 6.4.7.21 | - | - |
| 减：二、营业总支出 | | 391,806.14 | 93,737.06 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 109,689.72 | 13,494.50 |
| 其中：暂估管理人报酬 | | - | - |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 27,422.41 | 3,373.69 |
| 3. 销售服务费 | 6.4.10.2.3 | 109,689.72 | 13,494.50 |
| 4. 投资顾问费 | | - | - |
| 5. 利息支出 | | 28,216.14 | 8,573.74 |

| | | | |
|---------------------|----------|------------|-----------|
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 28,216.14 | 8,573.74 |
| 6. 信用减值损失 | 6.4.7.22 | - | - |
| 7. 税金及附加 | | 149.11 | - |
| 8. 其他费用 | 6.4.7.23 | 116,639.04 | 54,800.63 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 415,617.07 | 14,519.66 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 415,617.07 | 14,519.66 |
| 五、其他综合收益的税后净额 | | - | - |
| 六、综合收益总额 | | 415,617.07 | 14,519.66 |

6.3 净资产变动表

会计主体：英大中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 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 | 164,711,937.88 | - | 3,042,961.33 | 167,754,899.21 |
| 加：会计政策变更 | - | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 二、本期期初净资产 | 164,711,937.88 | - | 3,042,961.33 | 167,754,899.21 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | -97,467,752.19 | - | -1,474,453.28 | -98,942,205.47 |
| （一）、综合收益总额 | - | - | 415,617.07 | 415,617.07 |
| （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） | -97,467,752.19 | - | -1,890,070.35 | -99,357,822.54 |
| 其中：1. 基金申购款 | 75,887,878.24 | - | 1,578,531.58 | 77,466,409.82 |

| | | | | |
|--|--|--------|---------------|-----------------|
| 2. 基金赎回款 | -173,355,630.43 | - | -3,468,601.93 | -176,824,232.36 |
| (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 | 67,244,185.69 | - | 1,568,508.05 | 68,812,693.74 |
| 项目 | 上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 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 | 23,144,087.73 | - | 288,237.53 | 23,432,325.26 |
| 加：会计政策变更 | - | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 二、本期期初净资产 | 23,144,087.73 | - | 288,237.53 | 23,432,325.26 |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列) | 32,869,039.32 | - | 215,843.76 | 33,084,883.08 |
| (一)、综合收益总额 | - | - | 14,519.66 | 14,519.66 |
| (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) | 32,869,039.32 | - | 201,324.10 | 33,070,363.42 |
| 其中：1. 基金申购款 | 156,902,612.11 | - | 1,673,356.82 | 158,575,968.93 |
| 2. 基金赎回款 | -124,033,572.79 | - | -1,472,032.72 | -125,505,605.51 |
| (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 | 56,013,127.05 | - | 504,081.29 | 56,517,208.34 |

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>范育晖</u> | <u>张大铮</u> | <u>李婷</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

英大中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2022]第 1199 号《关于准予英大中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金注册的批复》核准，由英大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《英大中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期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 1,022,096,145.89 元，经毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《英大中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金基金合同》于 2022 年 7 月 13 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额（含利息转份额）为 1,022,149,080.38 份基金份额。本基金的基金管理人为英大基金管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《英大中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于标的指数成份券及备选成份券。为更好地实现投资目标，本基金还可以投资于非属成份券及备选成份券的其他同业存单、债券（含国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、次级债券、政府支持债券、政府支持机构债券、地方政府债券、可分离交易可转债的纯债部分及其他经中国证监会允许投资的债券）、短期融资券（含超短期融资券）、中期票据等非金融企业债务融资工具、资产支持证券、债券回购、银行存款（包含协议存款、定期存款及其他银行存款）、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）。本基金不投资于股票，也不投资于可转换

债券（可分离交易可转债的纯债部分除外）、可交换债券。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。

本基金投资于同业存单的比例不低于基金资产的 80%；本基金投资于标的指数成份券及备选成份券的比例不低于本基金非现金基金资产的 80%。每个交易日日终，本基金持有的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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》（以下合称“企业会计准则”）的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会（以下简称“基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》及中国证监会、基金业协会发布的其他有关基金行业实务操作的规定编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 6.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定要求，真实、完整地反映了本基金 2025 年 06 月 30 日的财务状况及 2025 年 1 月 1 日起至 2025 年 6 月 30 日止期间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

本基金报告期所采用的会计政策、其他会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

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

本基金于本报告期内未发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金于本报告期内未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金于本报告期内未发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部税务总局公告2024年第8号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

a) 资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

c) 对基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。

d) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

| 项目 | | 本期末 2025 年 6 月 30 日 |
|----------------|--|------------------------|
| 活期存款 | | 8,195,850.30 |
| 等于：本金 | | 8,194,822.49 |
| 加：应计利息 | | 1,027.81 |
| 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 | | 8,195,850.30 |

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | | 本期末 2025 年 6 月 30 日 | | | |
|---------------|-------|------------------------|------------|---------------|-----------|
| | | 成本 | 应计利息 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | | - | - | - | - |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | | - | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | - | - | - | - |
| | 银行间市场 | 60,095,941.19 | 622,683.46 | 60,747,683.46 | 29,058.81 |
| | 合计 | 60,095,941.19 | 622,683.46 | 60,747,683.46 | 29,058.81 |

| | | | | |
|--------|---------------|------------|---------------|-----------|
| 资产支持证券 | - | - | - | - |
| 基金 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 合计 | 60,095,941.19 | 622,683.46 | 60,747,683.46 | 29,058.81 |

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

本基金于本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

本基金于本报告期末未持有期货合约。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本基金于本报告期末未持有黄金衍生品。

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

本基金于本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金于本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

本基金于本报告期末计提减值准备。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

本基金于本报告期末未持有债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

本基金于报告期内未发生债权投资减值准备计提情况。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

本基金于本报告期末未持有其他债权投资。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

本基金于报告期内未发生其他债权投资减值准备计提情况。

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

本基金于本报告期末未持有其他权益工具投资。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

本基金于本报告期末未持有其他权益工具投资。

6.4.7.8 其他资产

本基金于本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2025 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | - |
| 应付证券出借违约金 | - |
| 应付交易费用 | 6,649.25 |
| 其中：交易所市场 | - |
| 银行间市场 | 6,649.25 |
| 应付利息 | - |
| 预提信息披露费 | 59,507.37 |
| 预提审计费 | 32,232.48 |
| 预提上清所账户维护费 | 4,500.00 |
| 预提中债登账户维护费 | 4,500.00 |
| 合计 | 107,389.10 |

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 | |
|---------------|---------------------------------------|-----------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 164,711,937.88 | 164,711,937.88 |
| 本期申购 | 75,887,878.24 | 75,887,878.24 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -173,355,630.43 | -173,355,630.43 |
| 基金拆分/份额折算前 | - | - |
| 基金拆分/份额折算调整 | - | - |
| 本期申购 | - | - |
| 本期赎回（以“-”号填列） | - | - |
| 本期末 | 67,244,185.69 | 67,244,185.69 |

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

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 | 2,709,033.34 | 333,927.99 | 3,042,961.33 |
| 加：会计政策变更 | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - |
| 其他 | - | - | - |
| 本期期初 | 2,709,033.34 | 333,927.99 | 3,042,961.33 |
| 本期利润 | 538,169.70 | -122,552.63 | 415,617.07 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -1,850,589.11 | -39,481.24 | -1,890,070.35 |
| 其中：基金申购款 | 1,439,478.78 | 139,052.80 | 1,578,531.58 |
| 基金赎回款 | -3,290,067.89 | -178,534.04 | -3,468,601.93 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 1,396,613.93 | 171,894.12 | 1,568,508.05 |

注：本表涉及报告期内未分配利润的变动项目中，如为利润减少或亏损，以“-”号填列。

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 活期存款利息收入 | 7,779.81 |
| 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 | 5,627.05 |
| 合计 | 13,406.86 |

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

本基金于本报告期内无股票投资收益。

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金于本报告期内无股票投资收益——买卖股票差价收入。

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金于本报告期内无股票投资收益——证券出借差价收入。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2025年1月1日至2025年6月30日 |
|------------------------------|----------------------------|
| 债券投资收益——利息收入 | 1,024,166.47 |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | -133,481.00 |
| 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 | 890,685.47 |

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2025年1月1日至2025年6月30日 |
|------------------------|----------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额 | 241,606,058.02 |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 239,641,360.96 |
| 减：应计利息总额 | 2,091,333.81 |
| 减：交易费用 | 6,844.25 |
| 买卖债券差价收入 | -133,481.00 |

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金于本报告期内无债券投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金于本报告期内无债券投资收益——申购差价收入。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金于本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金于本报告期间无资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

本基金于本报告期内无资产支持证券投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

本基金于本报告期内无资产支持证券投资收益——申购差价收入。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

本基金于本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金于本报告期内无贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金于本报告期内无贵金属投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金于本报告期内无贵金属投资收益——申购差价收入。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金于本报告期内无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金于本报告期内无衍生工具收益——其他投资收益。

6.4.7.19 股利收益

本基金于本报告期内无股利收益。

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |
|------------|---------------------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | -122,552.63 |
| 股票投资 | - |
| 债券投资 | -122,552.63 |
| 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 | -122,552.63 |

注：当期发生的公允价值变动损失以“－”号填列。

6.4.7.21 其他收入

本基金于本报告期内无其他收入。

6.4.7.22 信用减值损失

本基金于本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |
|---------|---------------------------------------|
| 审计费用 | 32,232.48 |
| 信息披露费 | 59,507.37 |
| 证券出借违约金 | - |
| 银行费用 | 6,299.19 |
| 账户维护费 | 18,000.00 |
| 其他费用 | 600.00 |
| 合计 | 116,639.04 |

6.4.7.24 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部。本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

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

6.4.9 关联方关系

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 |
|-------|---------|
|-------|---------|

| | |
|------------|-----------------------|
| 英大基金管理有限公司 | 基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构 |
| 交通银行股份有限公司 | 基金托管人、基金销售机构 |
| 英大证券有限责任公司 | 受国家电网有限公司控制的企业 |

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

本基金于本报告期内及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

本基金于本报告期内及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 | | 上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 | |
|----------------|---------------------------------------|-------------------------------|--|-------------------------------|
| | 成交金额 | 占当期债券回 购 成交总额的比 例（%） | 成交金额 | 占当期债券回 购 成交总额的比 例（%） |
| 英大证券有限责任 公司 | - | - | 12,000,000.00 | 100.00 |

6.4.10.1.4 权证交易

本基金于本报告期内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。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金于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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |
|----------------------|--|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 109,689.72 | 13,494.50 |
| 其中：应支付销售机构的客户维护 费 | 9,440.97 | 3,817.18 |
| 应支付基金管理人的净管理费 | 100,248.75 | 9,677.32 |

注：①支付基金管理人英大基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值 0.20%的年费

率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

②日基金管理费=前一日基金资产净值×0.20%/当年天数。

③客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |
|----------------|---------------------------------------|--|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 27,422.41 | 3,373.69 |

注：①支付基金托管人交通银行股份有限公司的基金托管费按前一日基金资产净值 0.05%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

②基金托管费计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.05%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期 2025 年 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 |
| | 英大中证同业存单 AAA 指数 7 天持有 |
| 英大基金管理有限公司 | 81,525.76 |
| 交通银行股份有限公司 | 1,200.71 |
| 英大证券有限责任公司 | 25.47 |
| 合计 | 82,751.94 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 |
| | 英大中证同业存单 AAA 指数 7 天持有 |
| 英大基金管理有限公司 | 2,684.11 |
| 交通银行股份有限公司 | 1,517.79 |
| 英大证券有限责任公司 | 12.74 |
| 合计 | 4,214.64 |

注：支付销售机构的基金销售服务费按前一日基金资产净值的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

英大中证同业存单指数基金日基金销售服务费=前一日基金资产净值×0.20%/当年天数

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金于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

本基金于本报告期内及上年度可比期间均未发生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

本基金于本报告期内及上年度可比期间均未发生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。

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

本报告期及上年度可比期间，基金管理人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

本基金本报告期末及上年度末，其他关联方未持有本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 | | 上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 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 |
| 交通银行股份有限公司 | 8,195,850.30 | 7,779.81 | 3,293,438.60 | 14,023.29 |

注：本基金通过“交通银行股份有限公司基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金和存出保证金，于 2025 年 06 月 30 日的相关余额为人民币 0 元。（2024 年 06 月 30 日，人民币 0 元。）

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于本报告期内及上年度可比期间均未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金于本报告期末未持有基金管理人所管理的公开募集证券投资基金。

6.4.11 利润分配情况

本基金于本报告期内未进行过利润分配。

6.4.12 期末（2025 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

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金于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

于 2025 年 6 月 30 日，本基金未持有因债券正回购交易而作为抵押的银行间债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

于 2025 年 6 月 30 日，本基金未持有因债券正回购交易而作为抵押的交易所债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金于本报告期内未参与转融通证券出借业务。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金管理人主要通过定性分析和定量分析的方法，估测各种金融工具风险可能产生的损失。本基金管理人从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重性；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、模型和日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时对各种风险进行监督、检查和评估，并制定相应决策，将风险控制在预期可承受的范围内。

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常活动中面临各种金融工具的风险，主要包括：信用风险、流动性风险、市场风险。

本基金一贯的风险管理政策是使基金投资风险可测、可控、可承担。本基金管理人建立了由风险控制委员会、督察长、风险管理部和相关业务部门构成的多层次风险管理架构体系。风险管理团队在识别、衡量投资风险后，通过正式报告的方式，将分析结果及时传达给基金经理、投资

总监、投资决策委员会和风险控制委员会，协助制定风险控制决策，实现风险管理目标。

本基金管理人主要通过定性分析和定量分析的方法，估测各种金融工具风险可能产生的损失。本基金管理人从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重性；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、模型和日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时对各种风险进行监督、检查和评估，并制定相应决策，将风险控制在预期可承受的范围之内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的银行存款存放在本基金的托管行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金管理人通过信用分析团队建立了内部评级体系，对发行人及债券投资进行内部评级，建立债券投资库，同时追踪持仓债券发行人的相关风险事件，以控制可能出现的信用风险。

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末 2025 年 6 月 30 日 | 上年度末 2024 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| A-1 | - | - |
| A-1 以下 | - | - |
| 未评级 | 4,061,568.55 | - |
| 合计 | 4,061,568.55 | - |

- 注：1. 信用评级取自第三方评级机构的债项评级。
2. 以上按短期信用评级的债券投资不包括国债、政策性金融债及央行票据等。
3. 表中列示的未评级债券为无第三方机构评级的超短期融资券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本报告期末及上年度末均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

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末 | 上年度末 |
|--------|-----|------|
|--------|-----|------|

| | 2025 年 6 月 30 日 | 2024 年 12 月 31 日 |
|--------|-----------------|------------------|
| A-1 | - | - |
| A-1 以下 | - | - |
| AAA | 53,648,988.88 | 139,589,711.66 |
| 未评级 | - | - |
| 合计 | 53,648,988.88 | 139,589,711.66 |

注：1. 短期信用评级（同业存单的主体评级）由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。

2. 同业存单无短期信用评级，评级取自第三方评级机构的主体评级。

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 2025 年 6 月 30 日 | 上年度末 2024 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| AAA | - | - |
| AAA 以下 | - | - |
| 未评级 | - | 4,014,481.10 |
| 合计 | - | 4,014,481.10 |

注：1. 长期信用评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 以上按长期信用评级的债券投资不包括国债、政策性金融债及央行票据等。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本报告期末及上年度末均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

本基金于本报告期末及上年度末均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匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性

比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

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》等有关法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理。

本基金的基金管理人采用监控基金流动性受限资产比例、持仓集中度等指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%，完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的基金品种可以不受此条款限制。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 10%。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让外（如有），其余均能以合理价格适时变现。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。

本基金在本报告期内流动性情况良好。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2025 年 6 月 | 1 个月以内 | 1-3 个月 | 3 个月-1 年 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
|-------------------|--------|--------|----------|-------|-------|-----|----|
|-------------------|--------|--------|----------|-------|-------|-----|----|

| 30 日 | | | | | | | |
|--------------------------|---------------|---------------|----------------|-------|-------|-------------|----------------|
| 资产 | | | | | | | |
| 货币资金 | 8,195,850.30 | - | - | - | - | - | 8,195,850.30 |
| 交易性金融资产 | 9,993,070.27 | 16,071,294.73 | 34,683,318.46 | - | - | - | 60,747,683.46 |
| 资产总计 | 18,188,920.57 | 16,071,294.73 | 34,683,318.46 | - | - | - | 68,943,533.76 |
| 负债 | | | | | | | |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | 10,316.76 | 10,316.76 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 2,579.18 | 2,579.18 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | - | 10,316.76 | 10,316.76 |
| 应交税费 | - | - | - | - | - | 238.22 | 238.22 |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 107,389.10 | 107,389.10 |
| 负债总计 | - | - | - | - | - | 130,840.02 | 130,840.02 |
| 利率敏感度缺口 | 18,188,920.57 | 16,071,294.73 | 34,683,318.46 | - | - | -130,840.02 | 68,812,693.74 |
| 上年度末 2024 年 12 月 31 日 | 1 个月以内 | 1-3 个月 | 3 个月-1 年 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
| 资产 | | | | | | | |
| 货币资金 | 2,072,903.90 | - | - | - | - | - | 2,072,903.90 |
| 交易性金融资产 | 10,296,435.42 | 14,282,681.47 | 130,542,079.55 | - | - | - | 155,121,196.44 |
| 买入返售金融资产 | 10,000,704.76 | - | - | - | - | - | 10,000,704.76 |
| 应收申购款 | - | - | - | - | - | 652,821.32 | 652,821.32 |
| 资产总计 | 22,370,044.08 | 14,282,681.47 | 130,542,079.55 | - | - | 652,821.32 | 167,847,626.42 |
| 负债 | | | | | | | |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | 26,089.60 | 26,089.60 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 6,522.37 | 6,522.37 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | - | 26,089.60 | 26,089.60 |
| 应交税费 | - | - | - | - | - | 2,813.66 | 2,813.66 |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 31,211.98 | 31,211.98 |
| 负债总计 | - | - | - | - | - | 92,727.21 | 92,727.21 |
| 利率敏感度缺口 | 22,370,044.08 | 14,282,681.47 | 130,542,079.55 | - | - | -560,094.11 | 167,754,899.21 |

注：本表所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率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 | 除市场利率以外的其他市场变量保持不变 | | |
|----|--------------------|-----------------------------|------------------------|
| 分析 | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） | |
| | | 本期末（2025 年 6 月 30 日） | 上年度末（2024 年 12 月 31 日） |
| | 市场利率平行下降 25 个基点 | 56,063.82 | 212,606.96 |
| | 市场利率平行上升 25 个基点 | -55,759.66 | -211,106.84 |

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。本基金主要投资于银行间同业市场交易的债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于 5%。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，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 2025 年 6 月 30 日 | 上年度末 2024 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 | — | — | — | — |
| 交易性金融资产—基金投资 | — | — | — | — |
| 交易性金融资产—债券投资 | 60,747,683.46 | 88.28 | 155,121,196.44 | 92.47 |
| 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 | 60,747,683.46 | 88.28 | 155,121,196.44 | 92.47 |

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

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

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

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

- 第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；
- 第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；
- 第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

| 公允价值计量结果所属的层次 | 本期末 2025 年 6 月 30 日 | 上年度末 2024 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------------------|--------------------------|
|---------------|------------------------|--------------------------|

| | | |
|------|---------------|----------------|
| 第一层次 | - | - |
| 第二层次 | 60,747,683.46 | 155,121,196.44 |
| 第三层次 | - | - |
| 合计 | 60,747,683.46 | 155,121,196.44 |

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

于本报告期间，本基金无公允价值所属层次间的重大变动。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本报告期末，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|---------------|---------------|
| 1 | 权益投资 | - | - |
| | 其中：股票 | - | - |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 60,747,683.46 | 88.11 |
| | 其中：债券 | 60,747,683.46 | 88.11 |
| | 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 | 8,195,850.30 | 11.89 |
| 8 | 其他各项资产 | - | - |
| 9 | 合计 | 68,943,533.76 | 100.00 |

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

本基金不投资于股票。

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

本基金不投资于股票。

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金不投资于股票。

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

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金不投资于股票。

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金不投资于股票。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金不投资于股票。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金不投资于股票。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金不投资于股票。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种 | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|---------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 3,037,126.03 | 4.41 |
| | 其中：政策性金融债 | 3,037,126.03 | 4.41 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | 4,061,568.55 | 5.90 |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债（可交换债） | - | - |
| 8 | 同业存单 | 53,648,988.88 | 77.96 |

| | | | |
|----|----|---------------|-------|
| 9 | 其他 | — | — |
| 10 | 合计 | 60,747,683.46 | 88.28 |

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 | 112410201 | 24 兴业银行 CD201 | 50,000 | 4,996,704.79 | 7.26 |
| 2 | 112409196 | 24 浦发银行 CD196 | 50,000 | 4,996,365.48 | 7.26 |
| 3 | 112470245 | 24 贵州银行 CD155 | 50,000 | 4,987,848.02 | 7.25 |
| 4 | 112415368 | 24 民生银行 CD368 | 50,000 | 4,975,029.81 | 7.23 |
| 5 | 112508042 | 25 中信银行 CD042 | 50,000 | 4,969,601.76 | 7.22 |

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

本基金于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

本基金于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

本基金于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

本基金于本报告期末无股指期货投资。

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

本基金于本报告期末无国债期货投资。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金于报告期内未参与国债期货投资，报告期末无国债期货持仓。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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

经查询上海证券交易所、深圳证券交易所、中国货币网等公开信息披露平台，本基金投资的

前十名证券的发行主体本期，除以下情形外，未出现被监管部门立案调查，或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

24 兴业银行 CD201：2024 年 7 月 17 日，兴业银行股份有限公司因未严格按照公布的收费价目名录收费、向小微企业贷款客户转嫁抵押评估费及企业划型管理不到位被国家金融监督管理总局福建监管局罚款；2024 年 10 月 25 日，兴业银行因未按期申报税款被国家税务总局上海市静安区税务局第十八税务所责令改正；2025 年 1 月 16 日，兴业银行因未按期申报税款被国家税务总局上海市静安区税务局第十八税务所责令改正。

24 民生银行 CD368：2024 年 12 月 30 日，中国民生银行因违反账户管理规定等八项违法行为被中国人民银行警告，没收违法所得并罚款。

25 江苏银行 CD084：2025 年 1 月 24 日，江苏银行因基金托管业务存在内部控制、人员管理、投资监督、估值核算和信息报送方面的问题被江苏证监局责令改正。

25 南京银行 CD065：2025 年 1 月 24 日，南京银行因基金托管业务存在内部控制、人员管理、投资监督和信息报送方面的问题被江苏证监局出具警示函。

25 平安银行 CD045：2025 年 3 月 12 日披露，平安银行因并购贷款管理、理财业务投资管理和固定资产管理严重违反审慎经营规则被国家金融监督管理总局上海监管局责令改正并罚款。

基金管理人通过对上述发行人进一步了解分析后，认为以上处罚不会对所持有证券的投资价值构成实质性影响。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金不投资于股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

本基金于本报告期末未持有其他资产。

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金于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

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金不投资于股票。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金不投资于股票。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数 (户) | 户均持有的 基金份额 | 持有人结构 | | | |
|--------------|---------------|---------------|---------------|--------------|---------------|
| | | 机构投资者 | | 个人投资者 | |
| | | 持有份额 | 占总份额比例 (%) | 持有份额 | 占总份额比例 (%) |
| 701 | 95,926.09 | 64,859,098.58 | 96.45 | 2,385,087.11 | 3.55 |

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 | 251,496.02 | 0.3740 |

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 | 10~50 |
| 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 (2022 年 7 月 13 日) 基金份额总额 | 1,022,149,080.38 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 164,711,937.88 |
| 本报告期基金总申购份额 | 75,887,878.24 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 173,355,630.43 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 67,244,185.69 |

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

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人于 2025 年 4 月 22 日聘任岳喜伟先生兼任公司首席信息官，并于 2025 年 4 月 24 日发布公告。

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，本基金未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

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

报告期内本基金的审计机构为毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)，本报告期内会计师事务所未发生改变。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金未发生管理人及其高级管理人员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

本报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

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(%) | |
| 英大证券 | 2 | - | - | - | - | - |

注：根据中国证监会的有关规定，公司在综合考量证券经营机构的财务状况、经营状况、研究能力、客户服务质量的基础上，选择基金专用交易席位。

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

本基金报告期内租用证券公司交易单元未进行其他证券投资。

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 | 英大基金管理有限公司关于旗下部分基金的销售机构由北京中植基金销售有限公司变更为华源证券股份有限公司的公告 | 中国证监会规定媒介 | 2025 年 1 月 3 日 |
| 2 | 英大基金管理有限公司旗下基金 2024 年第 4 季度报告提示性公告 | 中国证监会规定媒介 | 2025 年 1 月 21 日 |
| 3 | 英大中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金 2024 年第四季度报告 | 中国证监会规定媒介 | 2025 年 1 月 21 日 |
| 4 | 关于英大中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金调整销售对象及申购业务限额并修订招募说明书等文件的公告 | 中国证监会规定媒介 | 2025 年 2 月 10 日 |
| 5 | 英大基金管理有限公司关于旗下基金更新招募说明书及基金产品资料概要的提示性公告 | 中国证监会规定媒介 | 2025 年 2 月 10 日 |
| 6 | 英大中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金基金产品资料概要（更新） | 中国证监会规定媒介 | 2025 年 2 月 10 日 |
| 7 | 英大中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金招募说明书（更新）（2025 年第 1 号） | 中国证监会规定媒介 | 2025 年 2 月 10 日 |
| 8 | 英大基金管理有限公司关于增加国泰君安证券股份有限公司为旗下部分开放式基金销售机构的公告 | 中国证监会规定媒介 | 2025 年 3 月 17 日 |
| 9 | 英大基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加华创证券有限责任公司为销售机构的公告 | 中国证监会规定媒介 | 2025 年 3 月 21 日 |
| 10 | 英大基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司交易及佣金支付情况公告 | 中国证监会规定媒介 | 2025 年 3 月 31 日 |
| 11 | 英大基金管理有限公司旗下基金 2024 年年报提示性公告 | 中国证监会规定媒介 | 2025 年 3 月 31 日 |
| 12 | 英大中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金 2024 年年度报告 | 中国证监会规定媒介 | 2025 年 3 月 31 日 |
| 13 | 英大基金管理有限公司旗下基金 2025 年第一季度报告提示性公告 | 中国证监会规定媒介 | 2025 年 4 月 22 日 |
| 14 | 英大中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金 2025 年第一季度报告 | 中国证监会规定媒介 | 2025 年 4 月 22 日 |
| 15 | 英大基金管理有限公司高级管理人员变更的公告 | 中国证监会规定媒介 | 2025 年 4 月 24 日 |

| | | | |
|----|---|-----------|-----------------|
| 16 | 英大基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增中国民生银行股份有限公司为销售机构的公告 | 中国证监会规定媒介 | 2025 年 4 月 24 日 |
| 17 | 英大基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加北京济安基金销售有限公司为销售机构的公告 | 中国证监会规定媒介 | 2025 年 5 月 8 日 |
| 18 | 英大基金管理有限公司关于增加广发银行股份有限公司为旗下部分开放式基金销售机构的公告 | 中国证监会规定媒介 | 2025 年 5 月 26 日 |
| 19 | 英大基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加北京加和基金销售有限公司为销售机构的公告 | 中国证监会规定媒介 | 2025 年 6 月 26 日 |
| 20 | 英大基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加深圳市前海排排网基金销售有限责任公司为销售机构的公告 | 中国证监会规定媒介 | 2025 年 6 月 26 日 |
| 21 | 英大基金管理有限公司公募基金风险等级评价说明（2025 年 6 月） | 中国证监会规定媒介 | 2025 年 6 月 30 日 |

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

| 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 | 20250321-20250630 | 24,737,971.40 | - | - | 24,737,971.40 | 36.79 |
| 产品 | 1 | 20250320-20250410;20250416-20250416 | 29,413,889.84 | - | 29,413,889.84 | - | - |
| | 2 | 20250311-20250318;20250320-20250320 | 29,553,885.16 | - | 29,553,885.16 | - | - |
| | 3 | 20250311-20250318;20250320-20250416 | 29,553,885.16 | - | 29,553,885.16 | - | - |
| | 4 | 20250418-20250420 | - | 9,794,319.29 | 9,794,319.29 | - | - |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| (1) 赎回申请延期办理的风险 | | | | | | | |
| 持有份额比例较高的投资者（“高比例投资者”）大额赎回时易使本基金发生巨额赎回或连续巨额赎回 | | | | | | | |

回，中小投资者可能面临赎回申请需要与高比例投资者按同比例部分延期办理的风险。

（2）基金净值大幅波动的风险

当高比例投资者大量赎回本基金时，基金为支付赎回款项而卖出所持有的证券，可能造成证券价格波动，导致本基金资产净值发生波动。若高比例投资者赎回的基金份额收取赎回费，相应的赎回费用按约定将部分或全部归入基金资产，可能对基金资产净值造成较大波动。若高比例投资者大量赎回本基金，计算基金份额净值时进行四舍五入也可能引起基金份额净值发生波动。

（3）基金规模较小导致的风险

高比例投资者赎回后，可能导致基金规模较小，从而使得基金投资及运作管理的难度增加。

（4）提前终止基金合同的风险

高比例投资者赎回后，可能出现连续六十个工作日基金资产净值低于 5000 万元而面临的转换基金运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等风险。

（5）对重大事项进行投票表决时面临的风险

当基金份额集中度较高时，少数基金份额持有人所持有的基金份额占比较高，其在召开持有人大会并对重大事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。

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

中国证监会批准英大中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金设立的文件

《英大中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金基金合同》

《英大中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金托管协议》

《英大中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金招募说明书》

《英大中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金产品资料概要》

基金管理人业务资格批件和营业执照

报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告

12.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所。

12.3 查阅方式

投资者可到基金管理人的住所或网站或基金托管人的住所免费查阅备查文件，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

公司网站：<http://www.ydamc.com/>

英大基金管理有限公司

2025 年 8 月 30 日