

# 东财瑞利债券型证券投资基金

## 2026 年中期报告

2026 年 06 月 30 日

基金管理人:东财基金管理有限公司

基金托管人:浙商银行股份有限公司

送出日期:2026 年 08 月 28 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。

基金托管人浙商银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2026年08月27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01月01日起至06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                         | 6  |
| 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              | 12 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 12 |
| 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             | 12 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 13 |
| 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                 | 14 |
| 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       | 14 |
| §5 托管人报告                                | 14 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 14 |
| 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 | 14 |
| 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                                 | 16 |
| 6.3 净资产变动表                              | 18 |
| 6.4 报表附注                                | 20 |
| §7 投资组合报告                               | 42 |
| 7.1 期末基金资产组合情况                          | 42 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合                    | 42 |
| 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       | 43 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动                     | 43 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 43 |
| 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      | 43 |
| 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   | 44 |
| 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   | 44 |
| 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      | 44 |
| 7.10 本基金投资股指期货的投资政策                     | 44 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明               | 44 |
| 7.12 投资组合报告附注                           | 44 |
| §8 基金份额持有人信息                            | 45 |

|                                          |    |
|------------------------------------------|----|
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....              | 45 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....           | 46 |
| 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 .....   | 46 |
| §9 开放式基金份额变动 .....                       | 46 |
| §10 重大事件揭示 .....                         | 47 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 .....                   | 47 |
| 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 .....   | 47 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....        | 47 |
| 10.4 基金投资策略的改变 .....                     | 47 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....              | 47 |
| 10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 .....       | 47 |
| 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 .....   | 48 |
| 10.8 其他重大事件 .....                        | 49 |
| §11 影响投资者决策的其他重要信息 .....                 | 50 |
| 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 ..... | 50 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....                | 50 |
| §12 备查文件目录 .....                         | 50 |
| 12.1 备查文件目录 .....                        | 50 |
| 12.2 存放地点 .....                          | 50 |
| 12.3 查阅方式 .....                          | 50 |

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                    |                 |
|-----------------|--------------------|-----------------|
| 基金名称            | 东财瑞利债券型证券投资基金      |                 |
| 基金简称            | 东财瑞利债券             |                 |
| 基金主代码           | 018444             |                 |
| 基金运作方式          | 契约型开放式             |                 |
| 基金合同生效日         | 2023年08月09日        |                 |
| 基金管理人           | 东财基金管理有限公司         |                 |
| 基金托管人           | 浙商银行股份有限公司         |                 |
| 报告期末基金份额总额      | 18,024,049,687.47份 |                 |
| 基金合同存续期         | 不定期                |                 |
| 下属分级基金的基金简称     | 东财瑞利债券A            | 东财瑞利债券C         |
| 下属分级基金的交易代码     | 018444             | 018445          |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 17,209,960,016.51份 | 814,089,670.96份 |

### 2.2 基金产品说明

|        |                                                                                                                                                                                                      |
|--------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标   | 本基金在严格控制风险和保持较高流动性的前提下，力争实现基金资产的稳健增值。                                                                                                                                                                |
| 投资策略   | <p>本基金通过对国内外宏观经济形势、市场利率走势和债券市场供求关系等因素的分析和判断，运用多种投资策略构建和调整基金投资组合，力争实现基金资产的稳健增值。</p> <p>1、债券投资策略</p> <p>（1）久期配置策略；（2）类属资产配置策略；（3）收益率曲线策略；（4）信用债券（含资产支持证券）投资策略；（5）证券公司短期公司债券投资策略。</p> <p>2、国债期货交易策略</p> |
| 业绩比较基准 | 中证综合债指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%                                                                                                                                                                       |
| 风险收益特征 | 本基金属于债券型基金，其预期的风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。                                                                                                                                                        |

## 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目      |      | 基金管理人                      | 基金托管人                |
|---------|------|----------------------------|----------------------|
| 名称      |      | 东财基金管理有限公司                 | 浙商银行股份有限公司           |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 顾勇                         | 胡燕                   |
|         | 联系电话 | 021-23526999               | 0571-87659392        |
|         | 电子邮箱 | vip@dongcaijijin.com       | zsyhzctgb@czbank.com |
| 客户服务电话  |      | 400-9210-107               | 95527                |
| 传真      |      | 021-23526940               | 0571-88268688        |
| 注册地址    |      | 西藏自治区拉萨市柳梧新区国际总部城10栋楼2层01室 | 杭州市萧山区鸿宁路1788号       |
| 办公地址    |      | 上海市徐汇区宛平南路88号金座5楼          | 杭州市拱墅区环城西路76号        |
| 邮政编码    |      | 200030                     | 310006               |
| 法定代表人   |      | 戴彦                         | 陈海强                  |

## 2.4 信息披露方式

|                   |                      |
|-------------------|----------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称    | 上海证券报                |
| 登载基金中期报告的管理人互联网网址 | www.dongcaijijin.com |
| 基金中期报告置备地点        | 上海市徐汇区宛平南路88号金座5楼    |

## 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称         | 办公地址              |
|--------|------------|-------------------|
| 注册登记机构 | 东财基金管理有限公司 | 上海市徐汇区宛平南路88号金座5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01月01日-2026年06月30日) |                |
|----------------------|---------------------------|----------------|
|                      | 东财瑞利债券A                   | 东财瑞利债券C        |
| 本期已实现收益              | 170,921,862.49            | 7,382,427.72   |
| 本期利润                 | 199,351,606.22            | 8,765,076.32   |
| 加权平均基金份额本期利润         | 0.0137                    | 0.0122         |
| 本期加权平均净值利润率          | 1.24%                     | 1.11%          |
| 本期基金份额净值增长率          | 1.35%                     | 1.25%          |
| <b>3.1.2 期末数据和指标</b> | 报告期末<br>(2026年06月30日)     |                |
| 期末可供分配利润             | 1,654,626,138.87          | 73,063,819.34  |
| 期末可供分配基金份额利润         | 0.0961                    | 0.0897         |
| 期末基金资产净值             | 19,080,221,331.16         | 897,077,558.07 |
| 期末基金份额净值             | 1.1087                    | 1.1019         |
| <b>3.1.3 累计期末指标</b>  | 报告期末<br>(2026年06月30日)     |                |
| 基金份额累计净值增长率          | 10.87%                    | 10.19%         |

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用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。

2、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（例如：基金的申购赎回费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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。

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

东财瑞利债券A

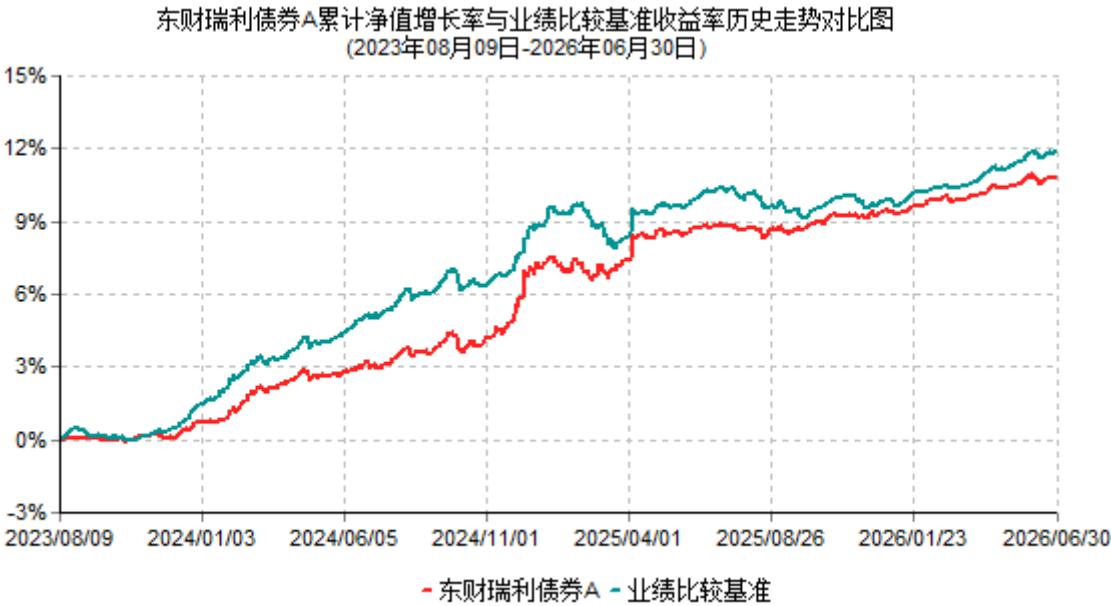
| 阶段    | 份额净值<br>增长率① | 份额净值<br>增长率标<br>准差② | 业绩比较<br>基准收益<br>率③ | 业绩比较<br>基准收益<br>率标准差<br>④ | ①-③    | ②-④   |
|-------|--------------|---------------------|--------------------|---------------------------|--------|-------|
| 过去三个月 | 0.70%        | 0.05%               | 1.14%              | 0.04%                     | -0.44% | 0.01% |

|            |        |       |        |       |        |        |
|------------|--------|-------|--------|-------|--------|--------|
| 过去六个月      | 1.35%  | 0.05% | 1.93%  | 0.04% | -0.58% | 0.01%  |
| 过去一年       | 1.92%  | 0.05% | 1.57%  | 0.06% | 0.35%  | -0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | 10.87% | 0.09% | 11.91% | 0.08% | -1.04% | 0.01%  |

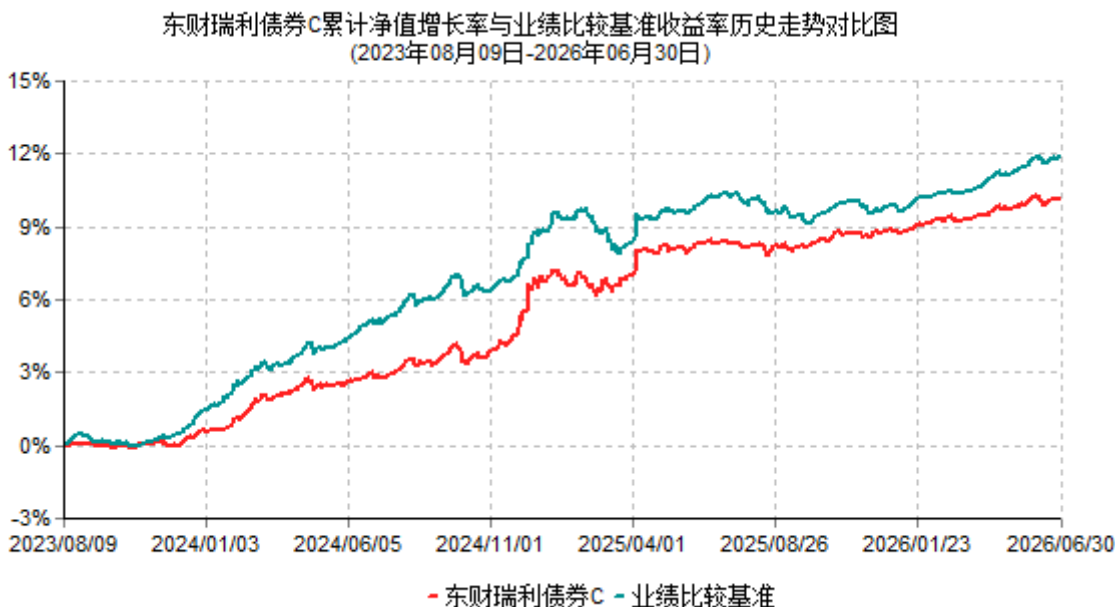
东财瑞利债券C

| 阶段         | 份额净值<br>增长率① | 份额净值<br>增长率标<br>准差② | 业绩比较<br>基准收益<br>率③ | 业绩比较<br>基准收益<br>率标准差<br>④ | ①-③    | ②-④    |
|------------|--------------|---------------------|--------------------|---------------------------|--------|--------|
| 过去三个月      | 0.64%        | 0.05%               | 1.14%              | 0.04%                     | -0.50% | 0.01%  |
| 过去六个月      | 1.25%        | 0.05%               | 1.93%              | 0.04%                     | -0.68% | 0.01%  |
| 过去一年       | 1.71%        | 0.05%               | 1.57%              | 0.06%                     | 0.14%  | -0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | 10.19%       | 0.09%               | 11.91%             | 0.08%                     | -1.72% | 0.01%  |

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







注：1、本基金基金合同于2023年8月9日生效。

2、本基金基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

## §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

东财基金管理有限公司成立于2018年10月26日，是由东方财富证券股份有限公司全资设立的子公司，公司坚持投资人利益优先原则，致力于在合规管理、风险控制的基础上，以市场变化和客户需求为导向，努力发展成为一家有先进经营理念、清晰发展战略、优秀经营团队、前瞻性产品规划、严谨投资流程和强烈使命感的基金管理公司，为投资者提供高品质的专业资产管理服务。

截至2026年6月30日，公司旗下管理62只证券投资基金--东财上证50交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、东财中证通信技术主题指数型发起式证券投资基金、东财创业板交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、东财中证医药卫生指数型发起式证券投资基金、东财量化精选混合型发起式证券投资基金、东财中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、东财中证500交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、东财中证有色金属指数增强型发起式证券投资基金、东财中证高端装备制造指数增强型发起式证券投资基金、东财中证银行指数型发起式证券投资基金、东财中证沪港深互联网交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、东财国证龙头家电指数型发起式证券投资基金、东财中证证券保险领先指数型发起式证券投资

基金、东财中证云计算与大数据主题指数增强型发起式证券投资基金、东财中证芯片产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、东财国证消费电子主题指数增强型发起式证券投资基金、东财中证食品饮料指数增强型发起式证券投资基金、东财中证新能源指数增强型证券投资基金、东财数字经济优选混合型发起式证券投资基金、东财沪深300交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、东财均衡配置三个月持有期混合型发起式基金中基金(FOF)、东财中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金、东财稳健配置六个月持有期混合型发起式基金中基金(FOF)、东财中证证券公司30交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、东财中证沪港深创新药产业交易型开放式指数证券投资基金、东财中证证券公司30交易型开放式指数证券投资基金、东财瑞利债券型证券投资基金、东财中证光伏产业指数型发起式证券投资基金、东财慧心优选混合型发起式证券投资基金、东财上证科创板50成份指数型发起式证券投资基金、东财中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金、东财卓越成长混合型发起式证券投资基金、东财景气驱动混合型发起式证券投资基金、东财中证细分化工产业主题指数型发起式证券投资基金、东财中证芯片产业交易型开放式指数证券投资基金、东财北证50成份指数型发起式证券投资基金、东财沪深300交易型开放式指数证券投资基金、东财中证500交易型开放式指数证券投资基金、东财上证50交易型开放式指数证券投资基金、东财中证1-3年国债交易型开放式指数证券投资基金、东财中证A500交易型开放式指数证券投资基金、东财上证科创板综合价格交易型开放式指数证券投资基金、东财中证A500交易型开放式指数证券投资基金联接基金、东财创业板交易型开放式指数证券投资基金、东财中证沪港深互联网交易型开放式指数证券投资基金、东财30天滚动持有债券型发起式证券投资基金、东财上证科创板50成份交易型开放式指数证券投资基金、东财创业板综合增强策略交易型开放式指数证券投资基金、东财上证科创板50成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金、东财上证科创板综合价格交易型开放式指数证券投资基金联接基金、东财中证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金、东财鑫享30天滚动持有中短债债券型证券投资基金、东财禧悦90天滚动持有中短债债券型证券投资基金、东财启和混合型证券投资基金、东财北证50成份指数增强型发起式证券投资基金、东财上证科创板200交易型开放式指数证券投资基金联接基金、东财中证电池主题交易型开放式指数证券投资基金、东财瑞兴债券型证券投资基金、东财新兴产业锐选混合型发起式证券投资基金、东财上证科创板100指数型证券投资基金、东财上证科创板200交易型开放式指数证券投资基金、东财中证工程机械主题交易型开放式指数证券投资基金。

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 |       |                                                                                                                                           |
|-----|-----------|------------|------|-------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 王宇飞 | 本基金基金经理   | 2023-08-09 | -    | 11年   | 上海财经大学金融学硕士。曾任东方金诚国际信用评估有限公司助理分析师、吉林九台农村商业银行股份有限公司债券分析兼交易员、诺德基金管理有限公司债券交易员、弘收投资管理（上海）有限公司债券执行交易员、江苏江南农村商业银行股份有限公司债券投资经理，现任东财基金管理有限公司基金经理。 |
| 宝音  | 本基金基金经理   | 2024-12-06 | -    | 13年   | 美国哥伦比亚大学统计学硕士。曾任中国金融期货交易所助理经理、江苏昆山农村商业银行股份有限公司投资经理、华福证券有限责任公司高级投资经理、东方财富证券股份有限公司利率交易部负责人，现任东财基金管理有限公司总经理助理、固收投资部总监、基金经理。                  |
| 周婧  | 本基金基金经理   | 2024-12-26 | -    | 10.5年 | 中南财经政法大学金融学硕士。曾任华泰证券股份有限公司交易员、东方财富证券股份有限公司交易员，现任东财基金管理有限公司基金经理。                                                                           |
| 高佳贝 | 本基金基金经理助理 | 2025-12-08 | -    | 8年    | 北京理工大学管理学硕士。曾任西藏东方财富投资管理有限公司投资助理、高级                                                                                                       |

|  |  |  |  |  |                          |
|--|--|--|--|--|--------------------------|
|  |  |  |  |  | 投资经理，现任东财基金管理有限公司基金经理助理。 |
|--|--|--|--|--|--------------------------|

注：1、基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，其“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期。

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

3、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》等相关规定。

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

本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》和其他有关法律法规、基金合同的相关规定，依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产，未发现存在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

报告期内，基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规和基金管理人关于公平交易管理的相关内部制度规定，在投资管理活动中公平对待不同投资组合，严禁直接或者通过与第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。公平交易制度规范的范围包括上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动以及包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

报告期内，基金管理人公平交易制度执行情况良好，未发现存在违反公平交易管理要求的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规和基金管理人关于异常交易管理的相关内部制度规定，对本基金的异常交易行为进行监督检查，未发现本基金存在可能导致不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

2026年上半年债券市场整体上涨，10年国债收益率从1.85%下行12bp至1.73%，收益率曲线有所陡峭化。

1月债券市场先跌后涨，1月上旬权益市场表现强势，央行公开市场国债买入量低于市场预期，债市下跌，中下旬随着配置盘加大买债力度，资金面宽松，央行加大中长期流动性投放力度，债市上涨。2月债券市场震荡微涨，主因1月统计局制造业PMI低于预期、配置盘继续发力、一级国债发行情况持续较好带动市场情绪。2月28日美国和以色列联合对伊朗发起军事打击，中东冲突全面加剧并扩散，成为3月债券市场的交易主题。3月债市微跌，月初地缘政治冲突带来避险买盘，但随着地缘冲突大幅推升油价引发通胀担忧、2月通胀数据超预期、1-2月经济数据整体好于预期，债市下跌。4月债券市场上涨，主因近年来我国融资结构发生深刻变化、银行贷款增速放缓，导致债市资金面持续宽松，匿名隔夜回购利率一度维持在1.2%的低位。此外，4月公布的出口数据偏弱，也利多债市。5月公布的4月经济数据整体偏弱，固定资产投资增速转负、社会消费品零售总额增速疲软，同时资金面仍然宽松，债券市场继续上涨。6月宏观经济数据整体进一步转弱，但资金利率中枢抬升，债券市场震荡微跌。

报告期内，组合紧密跟踪市场动向，灵活调整久期水平、杠杆水平、持仓期限结构及持仓券种结构，同时注意控制回撤风险。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2026年06月30日，东财瑞利债券A份额净值为1.1087元，报告期内基金份额净值增长率为1.35%，同期业绩比较基准收益率为1.93%；东财瑞利债券C份额净值为1.1019元，报告期内基金份额净值增长率为1.25%，同期业绩比较基准收益率为1.93%。

#### 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2026年下半年，我国宏观经济仍面临供强需弱、结构分化、外部冲击等问题和挑战，央行将继续实施适度宽松的货币政策、加大逆周期和跨周期调节力度、更好发挥货币政策工具的总量和结构双重功能。未来重点关注宏观经济和通胀走势、货币政策边际变化、权益市场走势等。组合计划在不断挖掘相对配置机会的同时，继续保持相对灵活的交易节奏与波段操作理念，力争为持有人创造超额收益。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值，保证基金估值的公平、合理，保持估值政策和程序的一贯性。日常估值由基金管理人和基金托管人一同进行，基金份额净值、基金

资产净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布基金份额净值。

本基金基金管理人制定了健全、有效的估值政策和程序，经公司管理层批准后实行，并成立了估值委员会。估值委员会会对估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后，及时召开临时会议进行研究，及时修订估值方法，以保证其持续适用。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末进行利润分配，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

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

### §5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，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

本报告期内，本基金的管理人--东财基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

#### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对东财基金管理有限公司编制和披露的东财瑞利债券型证券投资基金2026年中期报告中财务指标、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进行了复核，以上内容真实、准确和完整。

### §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：东财瑞利债券型证券投资基金

报告截止日：2026年06月30日

单位：人民币元

| 资 产          | 附注号     | 本期末<br>2026年06月30日 | 上年度末<br>2025年12月31日 |
|--------------|---------|--------------------|---------------------|
| 资 产：         |         |                    |                     |
| 货币资金         | 6.4.7.1 | 3,123,339,448.04   | 2,729,566.29        |
| 结算备付金        |         | 200,265,898.49     | 1,000,154,521.21    |
| 存出保证金        |         | -                  | -                   |
| 交易性金融资产      | 6.4.7.2 | 16,548,093,179.06  | 28,913,217,747.00   |
| 其中：股票投资      |         | -                  | -                   |
| 基金投资         |         | -                  | -                   |
| 债券投资         |         | 16,548,093,179.06  | 28,913,217,747.00   |
| 资产支持证券<br>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 | -                  | 5,715,581,205.62    |
| 应收清算款        |         | -                  | -                   |
| 应收股利         |         | -                  | -                   |
| 应收申购款        |         | 223,137,139.28     | 213,196,765.83      |
| 递延所得税资产      |         | -                  | -                   |
| 其他资产         | 6.4.7.5 | -                  | -                   |
| 资产总计         |         | 20,094,835,664.87  | 35,844,879,805.95   |
| 负 债 和 净 资 产  | 附注号     | 本期末<br>2026年06月30日 | 上年度末<br>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    |         | -                  | -                   |

|          |         |                   |                   |
|----------|---------|-------------------|-------------------|
| 应付清算款    |         | 9,376,475.30      | -                 |
| 应付赎回款    |         | 101,361,673.58    | 517,459,453.05    |
| 应付管理人报酬  |         | 3,999,331.72      | 4,388,567.28      |
| 应付托管费    |         | 1,333,110.57      | 1,462,855.74      |
| 应付销售服务费  |         | 134,903.35        | 163,568.67        |
| 应付投资顾问费  |         | -                 | -                 |
| 应交税费     |         | 317,718.81        | 249,275.45        |
| 应付利润     |         | -                 | -                 |
| 递延所得税负债  |         | -                 | -                 |
| 其他负债     | 6.4.7.6 | 1,013,562.31      | 1,041,867.26      |
| 负债合计     |         | 117,536,775.64    | 524,765,587.45    |
| 净资产：     |         |                   |                   |
| 实收基金     | 6.4.7.7 | 18,024,049,687.47 | 32,294,014,387.85 |
| 未分配利润    | 6.4.7.8 | 1,953,249,201.76  | 3,026,099,830.65  |
| 净资产合计    |         | 19,977,298,889.23 | 35,320,114,218.50 |
| 负债和净资产总计 |         | 20,094,835,664.87 | 35,844,879,805.95 |

注：报告截止日2026年6月30日，东财瑞利债券A基金份额净值人民币1.1087元，基金份额总额17,209,960,016.51份；东财瑞利债券C基金份额净值人民币1.1019元，基金份额总额814,089,670.96份。基金份额总额合计为18,024,049,687.47份。

6.2 利润表

会计主体：东财瑞利债券型证券投资基金

本报告期：2026年01月01日至2026年06月30日

单位：人民币元

| 项 目       | 附注号     | 本期<br>2026年01月01日至<br>2026年06月30日 | 上年度可比期间<br>2025年01月01日至202<br>5年06月30日 |
|-----------|---------|-----------------------------------|----------------------------------------|
| 一、营业总收入   |         | 261,163,613.30                    | 126,799,180.72                         |
| 1.利息收入    |         | 4,626,001.75                      | 602,797.07                             |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.9 | 3,134,374.82                      | 145,883.32                             |
| 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            |            | 1,491,626.93   | 456,913.75     |
| 其他利息收入                |            | -              | -              |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）      |            | 226,636,398.29 | 149,364,171.70 |
| 其中：股票投资收益             | 6.4.7.10   | -              | -              |
| 基金投资收益                |            | -              | -              |
| 债券投资收益                | 6.4.7.11   | 226,636,398.29 | 149,364,171.70 |
| 资产支持证券投资              | 6.4.7.12   | -              | -              |
| 收益                    |            |                |                |
| 贵金属投资收益               | 6.4.7.13   | -              | -              |
| 衍生工具收益                | 6.4.7.14   | -              | -              |
| 股利收益                  | 6.4.7.15   | -              | -              |
| 其他投资收益                |            | -              | -              |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.16   | 29,812,392.33  | -23,241,652.85 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）     |            | -              | -              |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）     | 6.4.7.17   | 88,820.93      | 73,864.80      |
| <b>减：二、营业总支出</b>      |            | 53,046,930.76  | 19,671,112.82  |
| 1.管理人报酬               | 6.4.10.2.1 | 25,409,612.30  | 9,311,295.94   |
| 2.托管费                 | 6.4.10.2.2 | 8,469,870.82   | 3,103,765.32   |
| 3.销售服务费               | 6.4.10.2.3 | 781,461.14     | 551,108.64     |
| 4.投资顾问费               |            | -              | -              |
| 5.利息支出                |            | 18,101,240.84  | 6,611,640.36   |
| 其中：卖出回购金融资产支出         |            | 18,101,240.84  | 6,611,640.36   |
| 6.信用减值损失              | 6.4.7.18   | -              | -              |
| 7.税金及附加               |            | 171,926.11     | -              |

|                     |          |                |                |
|---------------------|----------|----------------|----------------|
| 8.其他费用              | 6.4.7.19 | 112,819.55     | 93,302.56      |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） |          | 208,116,682.54 | 107,128,067.90 |
| 减：所得税费用             |          | -              | -              |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列）   |          | 208,116,682.54 | 107,128,067.90 |
| 五、其他综合收益的税后净额       |          | -              | -              |
| 六、综合收益总额            |          | 208,116,682.54 | 107,128,067.90 |

6.3 净资产变动表

会计主体：东财瑞利债券型证券投资基金

本报告期：2026年01月01日至2026年06月30日

单位：人民币元

| 项 目                                 | 本期<br>2026年01月01日至2026年06月30日 |                   |                    |
|-------------------------------------|-------------------------------|-------------------|--------------------|
|                                     | 实收基金                          | 未分配利润             | 净资产合计              |
| 一、上期期末净资产                           | 32,294,014,387.85             | 3,026,099,830.65  | 35,320,114,218.50  |
| 二、本期期初净资产                           | 32,294,014,387.85             | 3,026,099,830.65  | 35,320,114,218.50  |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                | -14,269,964,700.38            | -1,072,850,628.89 | -15,342,815,329.27 |
| （一）、综合收益总额                          | -                             | 208,116,682.54    | 208,116,682.54     |
| （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） | -14,269,964,700.38            | -1,280,967,311.43 | -15,550,932,011.81 |
| 其中：1.基金申购款                          | 21,298,779,073.85             | 2,193,044,629.52  | 23,491,823,703.37  |

|                                          |                                    |                   |                    |
|------------------------------------------|------------------------------------|-------------------|--------------------|
| 2.基金赎回款                                  | -35,568,743,774.23                 | -3,474,011,940.95 | -39,042,755,715.18 |
| (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、本期期末净资产                                | 18,024,049,687.47                  | 1,953,249,201.76  | 19,977,298,889.23  |
| 项 目                                      | 上年度可比期间<br>2025年01月01日至2025年06月30日 |                   |                    |
|                                          | 实收基金                               | 未分配利润             | 净资产合计              |
| 一、上期期末净资产                                | 7,161,946,916.09                   | 522,365,157.29    | 7,684,312,073.38   |
| 二、本期期初净资产                                | 7,161,946,916.09                   | 522,365,157.29    | 7,684,312,073.38   |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)                     | 6,432,593,186.01                   | 668,108,216.61    | 7,100,701,402.62   |
| (一)、综合收益总额                               | -                                  | 107,128,067.90    | 107,128,067.90     |
| (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)      | 6,432,593,186.01                   | 560,980,148.71    | 6,993,573,334.72   |
| 其中：1.基金申购款                               | 15,542,965,357.91                  | 1,273,459,510.86  | 16,816,424,868.77  |
| 2.基金赎回款                                  | -9,110,372,171.90                  | -712,479,362.15   | -9,822,851,534.05  |
| (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、本期期末净资产 | 13,594,540,102.10 | 1,190,473,373.90 | 14,785,013,476.00 |

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:

|          |           |         |
|----------|-----------|---------|
| 顾勇       | 侯福岩       | 陆文澄     |
| _____    | _____     | _____   |
| 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

东财瑞利债券型证券投资基金（原西藏东财瑞利债券型证券投资基金，已于2026年4月3日完成更名，以下简称“本基金”）系由基金管理人东财基金管理有限公司（原西藏东财基金管理有限公司，已于2025年9月15日办理完成工商变更登记）依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律法规以及《西藏东财瑞利债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）、《西藏东财瑞利债券型证券投资基金招募说明书》（以下简称“招募说明书”）的规定，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[2023]823号文准予公开募集注册。本基金为契约型开放式基金，存续期限为不定期。本基金首次设立募集基金份额为367,134,655.52份，经德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）验证，并出具了编号为德师报（验）字（23）第00202号验资报告。经向中国证监会备案，基金合同于2023年8月9日正式生效。本基金的基金管理人为东财基金管理有限公司，基金托管人为浙商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、基金合同及截至报告期末最新公告的招募说明书的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括债券（含国债、央行票据、地方政府债、金融债、公开发行的次级债、企业债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、公司债、可分离交易可转债的纯债部分、证券公司短期公司债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、国债期货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的相关规定）。本基金不投资于股票资产，也不投资于可转换债券（可分离交易可转债的纯债部分除外）、可交换债券。本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%；每个交易日日终，在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值

的5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：中证综合债指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×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、《资产管理产品相关会计处理规定》（财会[2022]14号）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1月1日至2026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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需说明的重大会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需说明的重大会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无需说明的重大会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财税[2008]1号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2025]4号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、国

务院令第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，公募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，以基金管理人作为增值税纳税人，可以选择适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税；

（2）对证券投资基金取得的自2025年8月8日之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复缴纳增值税；取得的在2025年8月8日之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在2025年8月8日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期；

（3）对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税；

（4）本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

| 项目           | 本期末<br>2026年06月30日 |
|--------------|--------------------|
| 活期存款         | 3,123,339,448.03   |
| 等于：本金        | 3,122,693,180.54   |
| 加：应计利息       | 646,267.49         |
| 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         | 0.01               |

|        |                  |
|--------|------------------|
| 等于：本金  | 0.01             |
| 加：应计利息 | -                |
| 减：坏账准备 | -                |
| 合计     | 3,123,339,448.04 |

注：其他存款为存放在证券经纪商基金专用证券账户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<br>2026年06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 | 105,041.00         | 1,155.70       | 118,765.70        | 12,569.00     |
|               | 银行间市场 | 16,408,560,719.46  | 143,550,413.36 | 16,547,974,413.36 | -4,136,719.46 |
|               | 合计    | 16,408,665,760.46  | 143,551,569.06 | 16,548,093,179.06 | -4,124,150.46 |
| 资产支持证券        |       | -                  | -              | -                 | -             |
| 基金            |       | -                  | -              | -                 | -             |
| 其他            |       | -                  | -              | -                 | -             |
| 合计            |       | 16,408,665,760.46  | 143,551,569.06 | 16,548,093,179.06 | -4,124,150.46 |

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产余额。

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余额。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2026年06月30日 |
|-------------|--------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                  |
| 应付赎回费       | 0.18               |
| 应付证券出借违约金   | -                  |
| 应付交易费用      | 910,342.58         |
| 其中：交易所市场    | -                  |
| 银行间市场       | 910,342.58         |
| 应付利息        | -                  |
| 预提费用-审计费    | 34,712.18          |
| 预提费用-信息披露费  | 59,507.37          |
| 预提费用-账户维护费  | 9,000.00           |
| 合计          | 1,013,562.31       |

6.4.7.7 实收基金

6.4.7.7.1 东财瑞利债券A

金额单位：人民币元

| 项目<br>(东财瑞利债券A) | 本期<br>2026年01月01日至2026年06月30日 |                    |
|-----------------|-------------------------------|--------------------|
|                 | 基金份额（份）                       | 账面金额               |
| 上年度末            | 31,442,497,305.96             | 31,442,497,305.96  |
| 本期申购            | 19,995,784,181.25             | 19,995,784,181.25  |
| 本期赎回（以“-”号填列）   | -34,228,321,470.70            | -34,228,321,470.70 |
| 本期末             | 17,209,960,016.51             | 17,209,960,016.51  |

6.4.7.7.2 东财瑞利债券C



金额单位：人民币元

| 项目<br>(东财瑞利债券C) | 本期<br>2026年01月01日至2026年06月30日 |                   |
|-----------------|-------------------------------|-------------------|
|                 | 基金份额（份）                       | 账面金额              |
| 上年度末            | 851,517,081.89                | 851,517,081.89    |
| 本期申购            | 1,302,994,892.60              | 1,302,994,892.60  |
| 本期赎回（以“-”号填列）   | -1,340,422,303.53             | -1,340,422,303.53 |
| 本期末             | 814,089,670.96                | 814,089,670.96    |

注：申购份额含红利再投、转换入份额；赎回份额含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

6.4.7.8.1 东财瑞利债券A

单位：人民币元

| 项目<br>(东财瑞利债券A) | 已实现部分             | 未实现部分           | 未分配利润合计           |
|-----------------|-------------------|-----------------|-------------------|
| 上年度末            | 2,647,340,042.07  | 303,540,837.30  | 2,950,880,879.37  |
| 本期期初            | 2,647,340,042.07  | 303,540,837.30  | 2,950,880,879.37  |
| 本期利润            | 170,921,862.49    | 28,429,743.73   | 199,351,606.22    |
| 本期基金份额交易产生的变动数  | -1,163,635,765.69 | -116,335,405.25 | -1,279,971,170.94 |
| 其中：基金申购款        | 1,821,384,101.76  | 246,686,624.77  | 2,068,070,726.53  |
| 基金赎回款           | -2,985,019,867.45 | -363,022,030.02 | -3,348,041,897.47 |
| 本期已分配利润         | -                 | -               | -                 |
| 本期末             | 1,654,626,138.87  | 215,635,175.78  | 1,870,261,314.65  |

6.4.7.8.2 东财瑞利债券C

单位：人民币元

| 项目<br>(东财瑞利债券C) | 已实现部分         | 未实现部分        | 未分配利润合计       |
|-----------------|---------------|--------------|---------------|
| 上年度末            | 67,278,803.97 | 7,940,147.31 | 75,218,951.28 |
| 本期期初            | 67,278,803.97 | 7,940,147.31 | 75,218,951.28 |
| 本期利润            | 7,382,427.72  | 1,382,648.60 | 8,765,076.32  |

|                |                 |                |                 |
|----------------|-----------------|----------------|-----------------|
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -1,597,412.35   | 601,271.86     | -996,140.49     |
| 其中：基金申购款       | 109,673,270.63  | 15,300,632.36  | 124,973,902.99  |
| 基金赎回款          | -111,270,682.98 | -14,699,360.50 | -125,970,043.48 |
| 本期已分配利润        | -               | -              | -               |
| 本期末            | 73,063,819.34   | 9,924,067.77   | 82,987,887.11   |

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2026年01月01日至2026年06月30日 |
|-----------|-------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 2,594,123.54                  |
| 定期存款利息收入  | -                             |
| 其他存款利息收入  | 0.01                          |
| 结算备付金利息收入 | 470,376.28                    |
| 其他        | 69,874.99                     |
| 合计        | 3,134,374.82                  |

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金本报告期无买卖股票差价收入。

6.4.7.10.2 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期无证券出借差价收入。

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<br>2026年01月01日至2026年06月30日 |
|------------------|-------------------------------|
| 债券投资收益——利息收入     | 193,800,595.62                |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股 | 32,835,802.67                 |

|                |                |
|----------------|----------------|
| 及债券到期兑付) 差价收入  |                |
| 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             | 226,636,398.29 |

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<br>2026年01月01日至2026年06月30日 |
|------------------------|-------------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额   | 130,815,985,561.12            |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 129,848,708,922.33            |
| 减：应计利息总额               | 932,911,101.12                |
| 减：交易费用                 | 1,529,735.00                  |
| 买卖债券差价收入               | 32,835,802.67                 |

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

本基金本报告期无股利收益。

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称                   | 本期                      |
|------------------------|-------------------------|
|                        | 2026年01月01日至2026年06月30日 |
| 1.交易性金融资产              | 29,812,392.33           |
| ——股票投资                 | -                       |
| ——债券投资                 | 29,812,392.33           |
| ——资产支持证券投资             | -                       |
| ——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                     | 29,812,392.33           |

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期                      |
|---------|-------------------------|
|         | 2026年01月01日至2026年06月30日 |
| 基金赎回费收入 | 55,893.60               |
| 转换费收入   | 32,927.33               |
| 合计      | 88,820.93               |

6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期未发生信用减值损失。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

| 项目   | 本期                      |
|------|-------------------------|
|      | 2026年01月01日至2026年06月30日 |
| 审计费用 | 34,712.18               |

|           |            |
|-----------|------------|
| 信息披露费     | 59,507.37  |
| 证券出借违约金   | -          |
| 账户维护费-中债登 | 9,000.00   |
| 账户维护费-上清所 | 9,600.00   |
| 合计        | 112,819.55 |

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

本报告期间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                  |
|------------------------|--------------------------|
| 东财基金管理有限公司             | 基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构    |
| 浙商银行股份有限公司（“浙商银行”）     | 基金托管人、基金销售机构             |
| 东方财富证券股份有限公司（“东方财富证券”） | 基金管理人的股东、基金销售机构、基金证券经纪商  |
| 上海天天基金销售有限公司（“天天基金”）   | 与管理人受同一实际控制人控制的公司、基金销售机构 |
| 东方财富信息股份有限公司           | 基金管理人的实际控制人              |

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

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间未发生应付关联方佣金。

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<br>2026年01月01日至20<br>26年06月30日 | 上年度可比期间<br>2025年01月01日至20<br>25年06月30日 |
|------------------|-----------------------------------|----------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费   | 25,409,612.30                     | 9,311,295.94                           |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 6,147,393.60                      | 2,244,512.27                           |
| 应支付基金管理人的净管理费    | 19,262,218.70                     | 7,066,783.67                           |

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.30%年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。管理费的计算方法如下：

$$H=E\times 0.30\%\div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2026年01月01日至2026<br>年06月30日 | 上年度可比期间<br>2025年01月01日至2025<br>年06月30日 |
|----------------|-----------------------------------|----------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 8,469,870.82                      | 3,103,765.32                           |

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.10%年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。托管费的计算方法如下：

$$H=E\times0.10\%\div\text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售<br>服务费的<br>各关联方<br>名称 | 本期                      |            |            |
|----------------------------|-------------------------|------------|------------|
|                            | 2026年01月01日至2026年06月30日 |            |            |
|                            | 当期发生的基金应支付的销售服务费        |            |            |
|                            | 东财瑞利债券A                 | 东财瑞利债券C    | 合计         |
| 浙商银行                       | 0.00                    | 8,722.63   | 8,722.63   |
| 天天基金                       | 0.00                    | 192,364.52 | 192,364.52 |
| 东财证券                       | 0.00                    | 428,663.07 | 428,663.07 |
| 合计                         | 0.00                    | 629,750.22 | 629,750.22 |
| 获得销售<br>服务费的<br>各关联方<br>名称 | 上年度可比期间                 |            |            |
|                            | 2025年01月01日至2025年06月30日 |            |            |
|                            | 当期发生的基金应支付的销售服务费        |            |            |
|                            | 东财瑞利债券A                 | 东财瑞利债券C    | 合计         |
| 天天基金                       | 0.00                    | 98,267.50  | 98,267.50  |
| 东财证券                       | 0.00                    | 409,067.97 | 409,067.97 |
| 合计                         | 0.00                    | 507,335.47 | 507,335.47 |

注：支付基金销售机构的基金销售服务费按前一日C类基金份额对应的基金资产净值0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付给基金管理人，再由基金管理人计算并支付给各基金销售机构。C类基金份额的销售服务费的计算方法如下：

$$H=E\times0.20\%\div\text{当年天数}$$

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E为C类基金份额前一日的基金资产净值

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

| 本期 |
|----|
|----|

| 2026年01月01日至2026年06月30日            |                |               |       |      |       |      |
|------------------------------------|----------------|---------------|-------|------|-------|------|
| 银行间市场交易的各关联方名称                     | 债券交易金额         |               | 基金逆回购 |      | 基金正回购 |      |
|                                    | 基金买入           | 基金卖出          | 交易金额  | 利息收入 | 交易金额  | 利息支出 |
| 浙商银行                               | 79,486,600.00  | 80,267,748.03 | -     | -    | -     | -    |
| 上年度可比期间<br>2025年01月01日至2025年06月30日 |                |               |       |      |       |      |
| 银行间市场交易的各关联方名称                     | 债券交易金额         |               | 基金逆回购 |      | 基金正回购 |      |
|                                    | 基金买入           | 基金卖出          | 交易金额  | 利息收入 | 交易金额  | 利息支出 |
| 浙商银行                               | 139,513,775.16 | 10,073,089.45 | -     | -    | -     | -    |

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

本基金本报告期及上年度可比期间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

本基金本报告期及上年度可比期间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

东财瑞利债券A

份额单位：份

| 项目           | 本期<br>2026年01月01日至<br>2026年06月30日 | 上年度可比期间<br>2025年01月01日至<br>2025年06月30日 |
|--------------|-----------------------------------|----------------------------------------|
| 报告期初持有的基金份额  | 82,690,187.43                     | -                                      |
| 报告期间申购/买入总份额 | -                                 | 82,690,187.43                          |



|                     |               |               |
|---------------------|---------------|---------------|
| 报告期间因拆分变动份额         | -             | -             |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额      | -             | -             |
| 报告期末持有的基金份额         | 82,690,187.43 | 82,690,187.43 |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 0.48%         | 0.65%         |

东财瑞利债券C

份额单位：份

| 项目                  | 本期<br>2026年01月01日至<br>2026年06月30日 | 上年度可比期间<br>2025年01月01日至<br>2025年06月30日 |
|---------------------|-----------------------------------|----------------------------------------|
| 报告期初持有的基金份额         | -                                 | -                                      |
| 报告期间申购/买入总份额        | -                                 | -                                      |
| 报告期间因拆分变动份额         | -                                 | -                                      |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额      | -                                 | -                                      |
| 报告期末持有的基金份额         | -                                 | -                                      |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | -                                 | -                                      |

注：1、本基金基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及更新的招募说明书的有关规定支付。

2、申购份额含红利再投、转换入份额；赎回份额含转换出份额。

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

东财瑞利债券A

份额单位：份

| 关联方名称 | 本期末<br>2026年06月30日 |                  | 上年度末<br>2025年12月31日 |                  |
|-------|--------------------|------------------|---------------------|------------------|
|       | 持有的基金份额            | 持有的基金份额占基金总份额的比例 | 持有的基金份额             | 持有的基金份额占基金总份额的比例 |
| 东财证券  | 1,368,120,186.32   | 7.95%            | 1,471,287,699.91    | 4.68%            |
| 浙商银行  | 2,711,626,441.51   | 15.76%           | 0.00                | 0.00%            |
| 东方财富  | 0.00               | 0.00%            | 73,697,835.10       | 0.23%            |

|              |  |  |  |  |
|--------------|--|--|--|--|
| 信息股份<br>有限公司 |  |  |  |  |
|--------------|--|--|--|--|

东财瑞利债券C

份额单位：份

| 关联方名称 | 本期末<br>2026年06月30日 |                  | 上年度末<br>2025年12月31日 |                  |
|-------|--------------------|------------------|---------------------|------------------|
|       | 持有的基金份额            | 持有的基金份额占基金总份额的比例 | 持有的基金份额             | 持有的基金份额占基金总份额的比例 |
| -     | -                  | -                | -                   | -                |

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金相关的费用按基金合同及更新的招募说明书的有关规定支付。

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<br>2026年01月01日至2026年06月30日 |              | 上年度可比期间<br>2025年01月01日至2025年06月30日 |           |
|------------|-------------------------------|--------------|------------------------------------|-----------|
|            | 期末余额                          | 当期利息收入       | 期末余额                               | 当期利息收入    |
| 浙商银行-托管户   | 3,123,339,448.03              | 2,594,123.54 | 843,751.40                         | 35,452.42 |
| 东财证券-证券资金户 | 0.01                          | 0.01         | 0.24                               | 5,023.61  |

注：1、本基金的银行存款由基金托管人浙商银行保管，按银行同业利率计息。  
2、本基金证券资金户的存款为本基金存放于东财证券基金专用证券账户中的证券交易结算资金，按协议约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期末未进行利润分配。

#### **6.4.12 期末（2026年06月30日）本基金持有的流通受限证券**

##### **6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

##### **6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### **6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**

###### **6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

本基金本报告期末无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

###### **6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

本基金本报告期末无因从事证券交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

##### **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参与转融通证券出借业务的证券。

#### **6.4.13 金融工具风险及管理**

##### **6.4.13.1 风险管理政策和组织架构**

本基金为债券型基金，其预期的风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。本基金投资的金融工具主要包括债券投资等。本基金在日常经营活动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相对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。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了由董事会、合规审计委员会、风险管理委员会、督察长、合规审计部、风险管理部和相关业务部门构成的四级风险管理架构体系，并明确了相应风险管理职能。

##### **6.4.13.2 信用风险**

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行，与银行存款相关的信用风险不重大。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为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险发生的可能性很小。在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制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

无。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

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<br>2026年06月30日 | 上年度末<br>2025年12月31日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| AAA    | -                  | -                   |
| AAA以下  | -                  | -                   |
| 未评级    | 16,548,093,179.06  | 28,913,217,747.00   |
| 合计     | 16,548,093,179.06  | 28,913,217,747.00   |

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。2.未评级债券为国债、政策性金融债、央票及无第三方机构评级的债券。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指开放式基金未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险主要来源于基金兑付赎回资金的流动性风险，以及因

投资品种交易不活跃而出现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投资。

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约定了巨额赎回条款，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。

#### **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》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。同时，对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。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。本基金所持的所有证券均在银行间同业市场交易，因此，除本基金于期末持有的流通受限证券外，本期末本基金的其他资产均能及时变现。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。

截至本报告期末，本基金无重大流动性风险。

#### **6.4.13.4 市场风险**

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

##### **6.4.13.4.1 利率风险**

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

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，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<br>2026年0<br>6月30日 | 1年以内             | 1-5年             | 5年以上             | 不计息            | 合计                |
|------------------------|------------------|------------------|------------------|----------------|-------------------|
| 资产                     |                  |                  |                  |                |                   |
| 货币资金                   | 3,123,339,448.04 | -                | -                | -              | 3,123,339,448.04  |
| 结算备付金                  | 200,265,898.49   | -                | -                | -              | 200,265,898.49    |
| 交易性金融资产                | 6,093,583,997.26 | 5,924,358,523.25 | 4,530,150,658.55 | -              | 16,548,093,179.06 |
| 应收申购款                  | -                | -                | -                | 223,137,139.28 | 223,137,139.28    |
| 资产总计                   | 9,417,189,343.79 | 5,924,358,523.25 | 4,530,150,658.55 | 223,137,139.28 | 20,094,835,664.87 |
| 负债                     |                  |                  |                  |                |                   |
| 应付清算款                  | -                | -                | -                | 9,376,475.30   | 9,376,475.30      |
| 应付赎回款                  | -                | -                | -                | 101,361,673.58 | 101,361,673.58    |
| 应付管理人报酬                | -                | -                | -                | 3,999,331.72   | 3,999,331.72      |
| 应付托管费                  | -                | -                | -                | 1,333,110.57   | 1,333,110.57      |
| 应付销售服务费                | -                | -                | -                | 134,903.35     | 134,903.35        |
| 应交税费                   | -                | -                | -                | 317,718.81     | 317,718.81        |
| 其他负债                   | -                | -                | -                | 1,013,562.31   | 1,013,562.31      |
| 负债总计                   | -                | -                | -                | 117,536,775.64 | 117,536,775.64    |

|                             |                   |                   |                  |                |                   |
|-----------------------------|-------------------|-------------------|------------------|----------------|-------------------|
| 计                           |                   |                   |                  |                |                   |
| 利率敏<br>感度缺<br>口             | 9,417,189,343.79  | 5,924,358,523.25  | 4,530,150,658.55 | 105,600,363.64 | 19,977,298,889.23 |
| 上年度<br>末<br>2025年1<br>2月31日 | 1年以内              | 1-5年              | 5年以上             | 不计息            | 合计                |
| 资产                          |                   |                   |                  |                |                   |
| 货币资<br>金                    | 2,729,566.29      | -                 | -                | -              | 2,729,566.29      |
| 结算备<br>付金                   | 1,000,154,521.21  | -                 | -                | -              | 1,000,154,521.21  |
| 交易性<br>金融资<br>产             | 8,129,862,290.40  | 19,707,466,745.24 | 1,075,888,711.36 | -              | 28,913,217,747.00 |
| 买入返<br>售金融<br>资产            | 5,715,581,205.62  | -                 | -                | -              | 5,715,581,205.62  |
| 应收申<br>购款                   | -                 | -                 | -                | 213,196,765.83 | 213,196,765.83    |
| 资产总<br>计                    | 14,848,327,583.52 | 19,707,466,745.24 | 1,075,888,711.36 | 213,196,765.83 | 35,844,879,805.95 |
| 负债                          |                   |                   |                  |                |                   |
| 应付赎<br>回款                   | -                 | -                 | -                | 517,459,453.05 | 517,459,453.05    |
| 应付管<br>理人报<br>酬             | -                 | -                 | -                | 4,388,567.28   | 4,388,567.28      |
| 应付托<br>管费                   | -                 | -                 | -                | 1,462,855.74   | 1,462,855.74      |
| 应付销<br>售服务<br>费             | -                 | -                 | -                | 163,568.67     | 163,568.67        |
| 应交税<br>费                    | -                 | -                 | -                | 249,275.45     | 249,275.45        |

|         |                   |                   |                  |                 |                   |
|---------|-------------------|-------------------|------------------|-----------------|-------------------|
| 其他负债    | -                 | -                 | -                | 1,041,867.26    | 1,041,867.26      |
| 负债总计    | -                 | -                 | -                | 524,765,587.45  | 524,765,587.45    |
| 利率敏感度缺口 | 14,848,327,583.52 | 19,707,466,745.24 | 1,075,888,711.36 | -311,568,821.62 | 35,320,114,218.50 |

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合同约定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

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<br>(单位：人民币元) |                     |
|    |                    | 本期末<br>2026年06月30日              | 上年度末<br>2025年12月31日 |
|    | 利率下降25个基点          | 181,137,363.89                  | 174,095,528.62      |
|    | 利率上升25个基点          | -175,322,152.02                 | -172,184,604.33     |

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。

本基金通过对国内外宏观经济形势、市场利率走势和债券市场供求关系等因素的分析和判断，运用多种投资策略构建和调整基金投资组合，力争实现基金资产的稳健增值。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于债券的比例不低于基金资产的80%。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



本基金本报告期末无其他价格风险敞口。

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：

第一层次输入值是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；

第二层次输入值是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；

第三层次输入值是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<br>2026年06月30日 | 上年度末<br>2025年12月31日 |
|---------------|--------------------|---------------------|
| 第一层次          | -                  | -                   |
| 第二层次          | 16,548,093,179.06  | 28,913,217,747.00   |
| 第三层次          | -                  | -                   |
| 合计            | 16,548,093,179.06  | 28,913,217,747.00   |

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关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

于2026年6月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产（2025年12月31日：同）。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

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，本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目                | 金额                | 占基金总资产的比例(%) |
|----|-------------------|-------------------|--------------|
| 1  | 权益投资              | -                 | -            |
|    | 其中：股票             | -                 | -            |
| 2  | 基金投资              | -                 | -            |
| 3  | 固定收益投资            | 16,548,093,179.06 | 82.35        |
|    | 其中：债券             | 16,548,093,179.06 | 82.35        |
|    | 资产支持证券            | -                 | -            |
| 4  | 贵金属投资             | -                 | -            |
| 5  | 金融衍生品投资           | -                 | -            |
| 6  | 买入返售金融资产          | -                 | -            |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -                 | -            |
| 7  | 银行存款和结算备付金合计      | 3,323,605,346.53  | 16.54        |
| 8  | 其他各项资产            | 223,137,139.28    | 1.11         |
| 9  | 合计                | 20,094,835,664.87 | 100.00       |

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有境内股票。

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金本报告期内未进行股票投资。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金本报告期内未进行股票投资。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内未进行股票投资。

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      | 4,508,488,444.84  | 22.57        |
| 2  | 央行票据      | -                 | -            |
| 3  | 金融债券      | 12,039,604,734.22 | 60.27        |
|    | 其中：政策性金融债 | 12,039,604,734.22 | 60.27        |
| 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        | 16,548,093,179.06 | 82.83        |

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 | 260411  | 26农发11   | 19,800,000 | 1,989,617,917.81 | 9.96 |
| 2 | 250211  | 25国开11   | 10,700,000 | 1,083,766,356.16 | 5.42 |
| 3 | 2400002 | 24特别国债02 | 8,700,000  | 920,898,073.37   | 4.61 |
| 4 | 190215  | 19国开15   | 8,000,000  | 871,475,068.49   | 4.36 |
| 5 | 220208  | 22国开08   | 8,400,000  | 851,932,602.74   | 4.26 |

**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投资。

**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**  
本基金本报告期末未持有股指期货。

**7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**  
本基金本报告期末未持有国债期货。

**7.12 投资组合报告附注**

**7.12.1 本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**

2025年8月1日，国家金融监督管理总局对中国农业发展银行处以行政处罚。

2025年9月22日，中国人民银行对国家开发银行处以行政处罚。2025年7月25日，国家外汇管理局北京市分局对国家开发银行处以行政处罚。

基金管理人对上述主体发行的相关证券进行了深入了解和分析，执行了内部严格的投资决策流程，符合相关法律法规及基金合同的要求。除此以外，本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

**7.12.2 本基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库**

本基金投资范围不包括股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称    | 金额             |
|----|-------|----------------|
| 1  | 存出保证金 | -              |
| 2  | 应收清算款 | -              |
| 3  | 应收股利  | -              |
| 4  | 应收利息  | -              |
| 5  | 应收申购款 | 223,137,139.28 |
| 6  | 其他应收款 | -              |
| 7  | 待摊费用  | -              |
| 8  | 其他    | -              |
| 9  | 合计    | 223,137,139.28 |

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，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<br>级别 | 持<br>有<br>人<br>户<br>数<br>(户) | 户均持有的<br>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<br>份额<br>比例 | 持有份额  | 占总份<br>额比例 |

|         |        |              |                   |        |                |        |
|---------|--------|--------------|-------------------|--------|----------------|--------|
| 东财瑞利债券A | 10,719 | 1,605,556.49 | 17,006,764,652.87 | 98.82% | 203,195,363.64 | 1.18%  |
| 东财瑞利债券C | 26,962 | 30,193.96    | 344,051,879.56    | 42.26% | 470,037,791.40 | 57.74% |
| 合计      | 37,284 | 483,425.86   | 17,350,816,532.43 | 96.26% | 673,233,155.04 | 3.74%  |

注：机构投资者/个人投资者持有份额占总份额比例计算中，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），户均持有的基金份额的合计数=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

## 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 | 东财瑞利债券A | 1,689,007.36 | 0.01%    |
|                  | 东财瑞利债券C | 974.28       | 0.00%    |
|                  | 合计      | 1,689,981.64 | 0.01%    |

## 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 | 东财瑞利债券A | 50~100            |
|                                | 东财瑞利债券C | 0                 |
|                                | 合计      | 50~100            |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 东财瑞利债券A | >100              |
|                                | 东财瑞利债券C | 0                 |
|                                | 合计      | >100              |

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

|                            | 东财瑞利债券A           | 东财瑞利债券C          |
|----------------------------|-------------------|------------------|
| 基金合同生效日(2023年08月09日)基金份额总额 | 367,126,399.08    | 8,256.44         |
| 本报告期期初基金份额总额               | 31,442,497,305.96 | 851,517,081.89   |
| 本报告期基金总申购份额                | 19,995,784,181.25 | 1,302,994,892.60 |
| 减：本报告期基金总赎回份额              | 34,228,321,470.70 | 1,340,422,303.53 |
| 本报告期基金拆分变动份额               | -                 | -                |
| 本报告期期末基金份额总额               | 17,209,960,016.51 | 814,089,670.96   |

§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：（1）自2026年2月13日起，倪永彪新任基金管理人督察长，离任总经理助理；沙福贵不再代任督察长。（2）自2026年2月27日起，顾勇新任基金管理人总经理、财务负责人，离任副总经理；沙福贵离任总经理、财务负责人。（3）根据基金管理人2026年2月28日发布的《东财基金管理有限公司关于董事变更情况的公告》，基金管理人近12个月内进行了董事变更。

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

本报告期内，本基金未发生对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的涉及基金财产、基金管理业务的诉讼。本报告期内，无涉及本基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略没有改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金所聘用的会计师事务所未发生改变。

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**

本报告期内基金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**

本报告期内基金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，基金托管人未受到调查或处罚。

**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，基金托管人分管公募基金托管业务的高级管理人员的基金托管业务履职不涉及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 |    |
| 东财证券 | 4      | -    | -            | -         | -          | -  |

- 1、本基金采用证券公司交易结算模式，可豁免单个券商的交易佣金比例限制。
- 2、根据中国证监会的有关规定，我司在综合考量证券经营机构的财务状况、经营状况、研究能力等因素的基础上，选择证券经纪商。
- 3、选择券商的程序：
  - (1) 本基金管理人根据上述标准进行评估并确定选用的券商；
  - (2) 本基金管理人与被选择的券商签订证券经纪服务协议。

**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 | 成交金额   | 占当期债 | 成交金额 | 占当期权 | 成交金额 | 占当期基 |



|          |   |              |   |                    |   |              |   |              |
|----------|---|--------------|---|--------------------|---|--------------|---|--------------|
|          |   | 券成交总<br>额的比例 |   | 券回购成<br>交总额的<br>比例 |   | 证成交总<br>额的比例 |   | 金成交总<br>额的比例 |
| 东财证<br>券 | - | -            | - | -                  | - | -            | - | -            |

### 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  | 西藏东财瑞利债券型证券投资基金2025年第4季度报告                | 证监会规定网站    | 2026-01-22 |
| 2  | 东财基金管理有限公司关于更新旗下基金产品风险等级评价结果的公告           | 证监会规定网站及报刊 | 2026-01-29 |
| 3  | 东财基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告                  | 证监会规定网站及报刊 | 2026-02-14 |
| 4  | 东财基金管理有限公司关于董事变更情况的公告                     | 证监会规定网站及报刊 | 2026-02-28 |
| 5  | 东财基金管理有限公司高级管理人员变更公告                      | 证监会规定网站及报刊 | 2026-02-28 |
| 6  | 东财基金管理有限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） | 证监会规定网站及报刊 | 2026-03-31 |
| 7  | 西藏东财瑞利债券型证券投资基金2025年年度报告                  | 证监会规定网站    | 2026-03-31 |
| 8  | 东财基金管理有限公司关于旗下部分基金变更基金全称的公告               | 证监会规定网站及报刊 | 2026-04-03 |
| 9  | 东财瑞利债券型证券投资基金基金产品资料概要更新                   | 证监会规定网站    | 2026-04-03 |
| 10 | 东财瑞利债券型证券投资基金托管协议                         | 证监会规定网站    | 2026-04-03 |
| 11 | 东财瑞利债券型证券投资基金基金合同                         | 证监会规定网站    | 2026-04-03 |

|    |                                 |            |            |
|----|---------------------------------|------------|------------|
| 12 | 东财瑞利债券型证券投资基金更新招募说明书            | 证监会规定网站    | 2026-04-03 |
| 13 | 东财瑞利债券型证券投资基金2026年第1季度报告        | 证监会规定网站    | 2026-04-21 |
| 14 | 东财基金管理有限公司关于旗下证券投资基金投资资产支持证券的公告 | 证监会规定网站及报刊 | 2026-05-13 |
| 15 | 东财瑞利债券型证券投资基金基金产品资料概要更新         | 证监会规定网站    | 2026-06-27 |
| 16 | 东财瑞利债券型证券投资基金招募说明书更新            | 证监会规定网站    | 2026-06-27 |

## §11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本基金本报告期内不存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金未有影响投资者决策的其他重要信息。

## §12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 一、中国证监会准予东财瑞利债券型证券投资基金募集注册的文件
- 二、《东财瑞利债券型证券投资基金基金合同》
- 三、《东财瑞利债券型证券投资基金托管协议》
- 四、法律意见书
- 五、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 六、基金托管人业务资格批件、营业执照
- 七、中国证监会要求的其他文件

### 12.2 存放地点

基金管理人或基金托管人办公场所。

### 12.3 查阅方式

投资者可以在基金管理人或基金托管人办公场所查阅。

东财基金管理有限公司  
二〇二六年八月二十八日