

东财瑞兴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:苏州银行股份有限公司

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。

基金托管人苏州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03月20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	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
§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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
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	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
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	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	17
6.3 净资产变动表	18
6.4 报表附注	20
§7 投资组合报告	52
7.1 期末基金资产组合情况	52
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	53
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	53
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	55
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	57
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	57
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	58
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	58
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	58
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	58
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	58
7.12 本报告期投资基金情况	58
7.13 投资组合报告附注	59

§8 基金份额持有人信息	61
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	61
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	62
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	62
§9 开放式基金份额变动	62
§10 重大事件揭示	63
10.1 基金份额持有人大会决议	63
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	63
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	63
10.4 基金投资策略的改变	63
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件	63
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况	63
10.7 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	63
10.8 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	64
10.9 其他重大事件	65
§11 影响投资者决策的其他重要信息	65
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	65
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	66
§12 备查文件目录	66
12.1 备查文件目录	66
12.2 存放地点	66
12.3 查阅方式	66

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	东财瑞兴债券型证券投资基金	
基金简称	东财瑞兴债券	
基金主代码	026233	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2026年03月20日	
基金管理人	东财基金管理有限公司	
基金托管人	苏州银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	459,902,788.64份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	东财瑞兴债券A	东财瑞兴债券C
下属分级基金的交易代码	026233	026234
报告期末下属分级基金的份额总额	335,493,266.11份	124,409,522.53份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在控制风险和保持较高流动性的前提下，力求获得高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	1、大类资产配置策略； 2、债券投资策略： （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 （6）可转换债券和可交换债券投资策略 3、股票投资策略： （1）定性分析 （2）定量分析 （3）存托凭证投资策略 4、港股通标的股票投资策略； 5、基金投资策略；

	6、国债期货投资策略。
业绩比较基准	中债综合财富（总值）指数收益率×88%+中证全指指数收益率×10%+中证港股通综合指数收益率×2%
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。 本基金还可投资港股通标的股票。本基金投资港股通标的股票的，除了需要承担与内地证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，还面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		东财基金管理有限公司	苏州银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	顾勇	董平
	联系电话	021-23526999	0512-69868888-91017
	电子邮箱	vip@dongcaijijin.com	custodyacc@suzhoubank.com
客户服务电话		400-9210-107	96067
传真		021-23526940	0512-65135118
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	中国（江苏）自由贸易试验区苏州片区苏州工业园区钟园路728号
办公地址		上海市徐汇区宛平南路88号金座5楼	中国（江苏）自由贸易试验区苏州片区苏州工业园区钟园路728号
邮政编码		200030	215100
法定代表人		戴彦	崔庆军

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
登载基金中期报告的	www.dongcaijijin.com

管理人互联网网址	
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03月20日（基金合同生效日）-2026年06月30日)	
	东财瑞兴债券A	东财瑞兴债券C
本期已实现收益	690,080.05	450,977.85
本期利润	803,482.63	543,672.95
加权平均基金份额本期利润	0.0057	0.0051
本期加权平均净值利润率	0.57%	0.51%
本期基金份额净值增长率	0.55%	0.50%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2026年06月30日)	
	期末可供分配利润	1,828,926.11 608,419.39
	期末可供分配基金份额利润	0.0055 0.0049
	期末基金资产净值	337,351,140.82 125,028,756.04
	期末基金份额净值	1.0055 1.0050
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2026年06月30日)	
	基金份额累计净值增长率	0.55% 0.50%

- 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。
- 4、本基金的基金合同生效日为2026年3月20日，至本报告期末未满半年，因此主要会计数据和财务指标只列示从基金合同生效日至2026年6月30日数据，特此说明。

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

东财瑞兴债券A

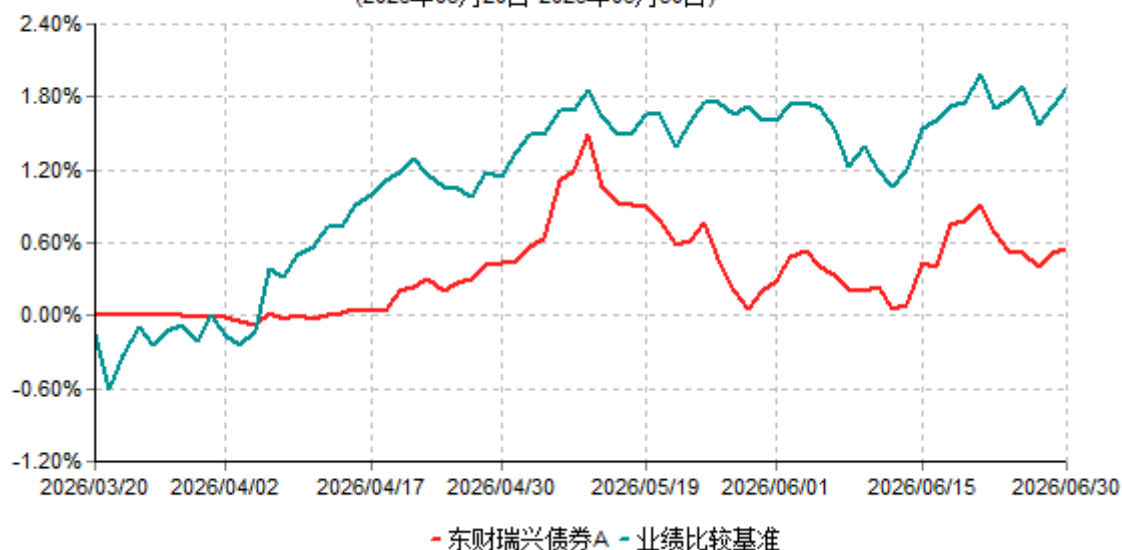
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	0.56%	0.15%	2.08%	0.16%	-1.52%	-0.01%
自基金合同 生效起至今	0.55%	0.14%	1.87%	0.17%	-1.32%	-0.03%

东财瑞兴债券C

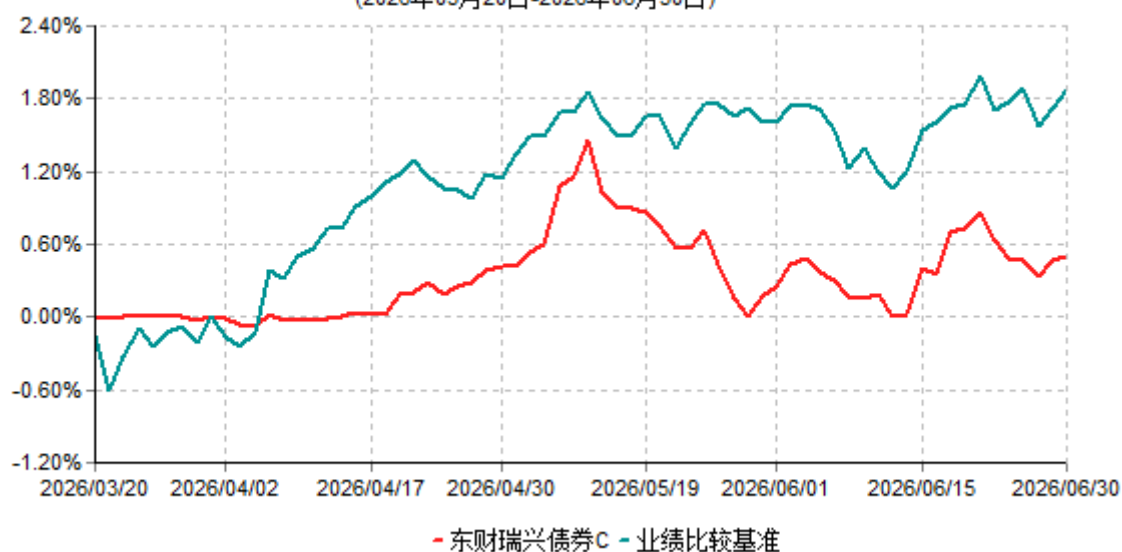
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	0.52%	0.15%	2.08%	0.16%	-1.56%	-0.01%
自基金合同 生效起至今	0.50%	0.14%	1.87%	0.17%	-1.37%	-0.03%

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

东财瑞兴债券A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2026年03月20日-2026年06月30日)



东财瑞兴债券C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2026年03月20日-2026年06月30日)



注：1、本基金基金合同于2026年3月20日生效，截至报告期末本基金基金合同生效未满一年。

2、按本基金基金合同约定，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本基金合同的有关约定。本报告期本基金处于建仓期内。

§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		
宝音	本基金基金经理	2026-03-20	-	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。
徐成	本基金基金经理	2026-03-20	-	8年	北京大学管理学硕士。曾任广发证券股份有限公司行业研究员、国金证券股份有限公司权益研究员，现任东财基金管理有限公司基金经理。

胡凡	本基金基金经理	2026-04-24	-	10年	上海交通大学工商管理硕士。曾任平安养老保险股份有限公司固收投资部三方投资组投资经理、兴银理财有限责任公司固定收益部高级投资经理，现任东财基金管理有限公司基金经理。
楚芸	本基金基金经理	2026-04-24	-	7年	香港中文大学理学硕士。曾任平安科技（深圳）有限公司数据分析师、东方金诚国际信用评估有限公司信评分析师，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	2026-04-09	-	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》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年二季度，债券市场整体上涨，10年期国债收益率从1.82%下行9bp至1.73%，收益率曲线整体略有平坦化；权益市场行情显著分化，沪深300指数上涨11.90%，恒生指数下跌7.69%。

固收：4月债券市场上涨，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

权益：4至6月，权益市场经历了极致的分化行情，以人工智能为核心的科技板块走出单边上涨行情，多数传统行业板块受资金虹吸效应影响持续调整。本轮科技行情由产业周期验证、商业化落地及政策支持等多重因素共同驱动，有较强的基本面支撑；与此同时，部分价值型标的经本轮调整后，投资性价比进一步凸显。

报告期内，本产品恪守稳健运作的投资纪律，坚持风险预算管理与多策略分散相结合的操作框架。债券方面，本产品紧密跟踪市场动向，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。权益方面，报告期内本产品以均衡为核心进行权益配置，在控制整体波动风险的前提下，适时参与市场结构性机会。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2026年06月30日，东财瑞兴债券A份额净值为1.0055元，报告期内基金份额净值增长率为0.55%，同期业绩比较基准收益率为1.87%；东财瑞兴债券C份额净值为1.0050元，报告期内基金份额净值增长率为0.50%，同期业绩比较基准收益率为1.87%。

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，经济K型分化的基本面格局与政策条件预计将延续。权益市场方面，硬科技成长主攻与高股息价值对冲的双主线格局，仍是中长期市场核心方向与本产品的应对策略。短期市场经历深度调整后风险释放较为充分，指数震荡磨底完成后，结构性反弹行情有望延续；本产品在科技端将优先布局订单充足、中报业绩高增的算力硬件与半导体上游标的，规避纯题材炒作个股；高股息板块依托低估值与稳定分红属性，仍是本产品对冲市场波动的核心底仓选择。债市方面，流动性层面总量宽松仍需观察，数量工具相机抉择，资金价格有望在政策利率附近温和运行，债市整体处于利多环境的基本格局难有根本性变化。但化债后周期中，尾部城投舆情风险及主体评级调降等技术性问题带来的估值扰动需要保持警惕。

组合管理上，本产品将继续秉持低信用风险偏好，严格筛选信用债标的，保持积极灵活的久期策略，持续关注市场预期波动下的股债配置机会，坚持硬科技成长主攻与高股息价值对冲的双主线策略。

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，不存在任何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、利润分配、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

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兴债券型证券投资基金报告中财务指标、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核查，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：东财瑞兴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 2026年06月30日
资 产：		
货币资金	6.4.7.1	8,921,281.44
结算备付金		1,907,715.91
存出保证金		79,625.00
交易性金融资产	6.4.7.2	456,466,491.29
其中：股票投资		65,744,741.76
基金投资		8,621,459.00

债券投资		382,100,290.53
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	-
应收清算款		-
应收股利		-
应收申购款		61,510,997.07
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.5	-
资产总计		528,886,110.71
负债和净资产	附注号	本期末 2026年06月30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		66,003,345.21
应付清算款		-
应付赎回款		251,257.91
应付管理人报酬		130,481.75
应付托管费		21,746.97
应付销售服务费		14,226.70
应付投资顾问费		-
应交税费		9,508.37
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.6	75,646.94
负债合计		66,506,213.85

净资产：		
实收基金	6.4.7.7	459,902,788.64
未分配利润	6.4.7.8	2,477,108.22
净资产合计		462,379,896.86
负债和净资产总计		528,886,110.71

注：1、报告截止日2026年6月30日，东财瑞兴债券A基金份额净值人民币1.0055元，基金份额总额335,493,266.11份；东财瑞兴债券C基金份额净值人民币1.0050元，基金份额总额124,409,522.53份。基金份额总额合计为459,902,788.64份。

2、本基金基金合同生效日为2026年3月20日，本期是指2026年3月20日至2026年6月30日，无上年度末可比数据。

6.2 利润表

会计主体：东财瑞兴债券型证券投资基金

本报告期：2026年03月20日（基金合同生效日）至2026年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026年03月20日（基金合同 生效日）至2026年06月30 日
一、营业总收入		1,995,321.05
1.利息收入		157,876.82
其中：存款利息收入	6.4.7.9	25,995.08
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		131,881.74
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,630,862.42
其中：股票投资收益	6.4.7.10	346,252.75
基金投资收益	6.4.7.11	109,925.87
债券投资收益	6.4.7.12	780,035.92
资产支持证券投资收益	6.4.7.13	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-

衍生工具收益	6.4.7.15	-12,088.98
股利收益	6.4.7.16	406,736.86
其他投资收益		-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	206,097.68
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	484.13
减：二、营业总支出		648,165.47
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	420,518.96
2.托管费	6.4.10.2.2	70,086.53
3.销售服务费	6.4.10.2.3	59,737.93
4.投资顾问费		-
5.利息支出		43,512.08
其中：卖出回购金融资产支出		43,512.08
6.信用减值损失	6.4.7.20	-
7.税金及附加		2,290.91
8.其他费用	6.4.7.21	52,019.06
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,347,155.58
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,347,155.58
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		1,347,155.58

注：本基金基金合同生效日为2026年3月20日，本期是指2026年3月20日至2026年6月30日，无上年度可比期间数据。

6.3 净资产变动表

会计主体：东财瑞兴债券型证券投资基金

本报告期：2026年03月20日（基金合同生效日）至2026年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期
	2026年03月20日（基金合同生效日）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	-	-	-
二、本期期初净资产	222,033,956.03	-	222,033,956.03
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	237,868,832.61	2,477,108.22	240,345,940.83
（一）、综合收益总额	-	1,347,155.58	1,347,155.58
（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）	237,868,832.61	1,129,952.64	238,998,785.25
其中：1.基金申购款	422,575,781.37	1,549,611.97	424,125,393.34
2.基金赎回款	-184,706,948.76	-419,659.33	-185,126,608.09
（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	459,902,788.64	2,477,108.22	462,379,896.86

注：本基金基金合同生效日为2026年3月20日，本期是指2026年3月20日至2026年6月30日，无上年度可比期间数据。

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

东财瑞兴债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）系由基金管理人东财基金管理有限公司依照《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《东财瑞兴债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）、《东财瑞兴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[2025] 2563 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222,033,956.03 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（26）第00098号验资报告。经向中国证监会备案，基金合同于2026年3月20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，基金托管人为苏州银行股份有限公司。

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，本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，包括债券（包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、可转换债券（含可分离交易可转债）、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、证券公司短期公司债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、国内依法发行上市的股票（包括创业板及其他依法发行、上市的股票、存托凭证）、港股通标的股票、中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金（仅包括全市场的股票型ETF、基金管理人旗下的股票型基金及计入权益类资产的混合型基金）、国债期货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的相关规定）。本基金的投资组合比例为：本基金对债券的投资比例不低于基金资产的80%，投资于股票（含存托凭证）、可转换债券（含可分离交易可转债）、可交换债券、股票型基金、计入权益类资产的混合型基金的的投资比例为基金资产的5%-20%（其中投资于境内股票资产的比例不低于基金资产的5%，投资于港股通标的股票的比例不超过本基金所投资股票资产的50%）；本基金对经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金投资比例不超过基金资产净值的10%；每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：中债综合财富（总值）指数收益率×88%+中证全指指数收益率×10%+中证港股通综合指数收益率×2%。

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3月20日（基金合同生效日）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 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度，即每年1月1日起至12月31日止。本财务报表的实际编制期间为2026年3月20日（基金合同生效日）至2026年6月30日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

（1）金融资产的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和以摊余成本计量的金融资产，暂无金融资产划分为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

金融资产的合同条款规定在特定日期产生的现金流量仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付，且本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标，则本基金将该金融资产分类为以摊余成本计量的金融资产。此类金融资产主要包括货币资金、各类应收款项、买入返售金融资产等。

不符合分类为以摊余成本计量的金融资产以及公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产条件的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产计入“衍生金融资产”外，其他以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产计入“交易性金融资产”。

（2）金融负债的分类

本基金将持有的金融负债在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金暂无分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。对于以常规方式购买或出售金融资产的，在交易日确认将收到的资产和为此将承担的负债，或者在交易日终止确认已出售的资产。金融资产和金融负债在初始确认时以公允价值计量。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；以摊余成本计量的金融资产和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券或资产支持证券已到付息期但尚未领取的利息，单独确认为应收项目。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，公允价值变动形成的利得或损失以及与该金融资产相关的股利和利息收入计入当期损益。以摊余成本计量的金融资产和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量，发生减值或终止确认产生的利得或损失，计入当期损益。

本基金对分类为以摊余成本计量的金融资产以预期信用损失为基础确认损失准备。除购买或源生的已发生信用减值的金融资产外，本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后的变动情况。若该金融工具的信用风险自初始确认后已显著增加，本基金按照相当于该金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备；若该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加，本基金按照相当于该金融工具未来12个月内预期信用损失的金额计量其损失准备。信用损失准备的增加或转回金额，作为减值损失或利得计入当期损益。

本基金在上一会计期间已经按照相当于金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量了损失准备，但在当期资产负债表日，该金融工具已不再属于自初始确认后信用风险显著增加的情形的，本基金在当期资产负债表日按照相当于未来12个月内预期信用损失的金额计量该金融工具的损失准备，由此形成的损失准备的转回金额作为减值利得计入当期损益。

本基金利用可获得的合理且有依据的前瞻性信息，通过比较金融工具在资产负债表日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止、该金融资产已转移且其所有权上几乎所有的风险和报酬已转移或虽然既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是未保留对该金融资产的控制，终止确认该金融资产。终止确认的

金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。若本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有风险和报酬，且保留了对该金融资产控制的，则按照其继续涉入被转移金融资产的程度继续确认该被转移金融资产，并相应确认相关负债。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才能终止确认该金融负债或其一部分。金融负债全部或部分终止确认的，将终止确认部分的账面价值与支付的对价（包括转出的非现金资产或承担的新金融负债）之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债基于公允价值的输入值的可观察程度以及该等输入值对公允价值计量整体的重要性，将其公允价值划分为三个层次。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。本基金主要金融工具的估值原则如下：

（1）对存在活跃市场的投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值；估值日无市价，且最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，采用最近交易市价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市价不能真实反映公允价值的，应对市价进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

（2）当投资品种不存在活跃市场，基金管理人估值委员会认为必要时，采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定投资品种的公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数；

（3）经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件或基金管理人估值委员会认为必要时，应参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整，确定公允价值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且目前可执行该种法定权利，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。申购、赎回、转换及红利再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金指申购、赎回、转入、转出及红利再投资等事项导致基金份额变动时，相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配（未分配利润）已实现与未实现部分各自占净资产的比例，损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入利润分配（未分配利润）。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

（1）利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提。

（2）投资收益

股票投资收益为卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本与相关交易费用的差额确认。

基金投资收益于卖出基金成交日确认，并按卖出基金成交金额扣除应结转的基金投资成本、相关交易费用与税费后的差额入账。

债券投资收益包括以票面利率计算的利息以及买卖债券价差收入。除贴息债外的债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认债券利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后，逐日确认债券利息收入。买卖债券价差收入为卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本、应计利息（若有）与相关交易费用后的差额确认。

资产支持证券投资收益包括以票面利率计算的利息以及买卖资产支持证券价差收入。资产支持证券利息收入在持有期内，按资产支持证券的票面价值和预计收益率计算

的利息逐日确认资产支持证券利息收入。在收到资产支持证券支付的款项时，其中属于证券投资收益的部分冲减应计利息（若有）后的差额，确认资产支持证券利息收入。买卖资产支持证券价差收入为卖出资产支持证券交易日的成交总额扣除应结转的资产支持证券投资成本、应计利息（若有）与相关交易费用后的差额确认。

衍生工具投资收益为交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本、相关交易费用与税费后的差额确认。

股利收入于除权除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额确认，由上市公司代扣代缴的个人所得税于卖出交易日按实际代扣代缴金额确认。

基金投资在持有期间应取得的红利于除权除息日确认为投资收益。

（3）公允价值变动收益

公允价值变动收益于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值变动形成的利得或损失确认，并于相关金融资产卖出或到期时转出计入投资收益。

（4）信用减值损失

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认信用损失准备。本基金所计提的信用减值损失计入当期损益。

（5）其他收入

在本基金履行了基金合同中的履约义务，即在客户取得服务控制权时确认收入。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

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

6.4.4.11 基金的收益分配政策

（1）在符合有关基金分红条件的前提下，基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准。若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；

（2）本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

（3）基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的该类别基金份额净值减去该类别每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

（4）由于本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同，基金管理人可对各类别基金份额分别制定收益分配方案。本基金同一基金份额类别内的每一基金份额享有同等分配权；

（5）法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。在不违反法律法规且对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可与基金托管人协商一致并按照监管部门要求履行适当程序后对基金收益分配有关业务规则进行调整，无需召开基金份额持有人大会，但应于变更实施日前在规定媒介公告。

6.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，与所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

6.4.4.13 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

- （1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；
- （2）能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；
- （3）能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

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。

6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和基金投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

（1）对于基金投资，根据中基协发[2017]3号《关于发布<基金中基金估值业务指引（试行）>的通知》之附件《基金中基金估值业务指引（试行）》的规定在估值日对非上市基金和上市基金进行估值；

（2）对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）>的通知》（中基协发[2017]6号），在估值日按照该通知规定的流通受限股票公允价值计算模型进行估值；

(3) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，根据《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》（中国证监会公告[2017]13号）及《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》（中基协发[2013]13号）相关规定，本基金根据情况决定使用指数收益法、可比公司法、市场价格模型法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值；

(4) 根据中基协字[2022]566号《关于发布<关于固定收益品种的估值处理标准>的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》，在上海证券交易所、深圳证券交易所、北京证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值基准服务机构提供的价格数据进行估值。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无需说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[2008]1号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008年9月18日上海交易所发布的《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳交易所发布的《关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2021]33号《关于北京证券交易所税收政策适用问题的公告》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财税[2024]8号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2025]4号《关于国债等债券利息

收入增值税政策的公告》、国务院令 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》、财税[2026]10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》、财税[2026]12 号《关于明确增值税应税交易销售额计算口径的公告》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

（1）对公募证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；2027 年 12 月 31 日前，公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，以基金管理人为增值税纳税人，可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税；

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

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

（4）对证券投资基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司代扣代缴个人所得税；从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。其中，对基金持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所挂牌交易的上市公司限售股，解禁后取得的股息红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。对基金通过港股通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中国结算”）提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过港股通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税；

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30日
活期存款	1,005,142.27
等于：本金	1,004,915.52
加：应计利息	226.75
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	7,916,139.17
等于：本金	7,915,894.57
加：应计利息	244.60
减：坏账准备	-
合计	8,921,281.44

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 2026年06月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	65,785,284.91	-	65,744,741.76	-40,543.15
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债 交易所市场	24,087,148.09	286,843.04	24,351,953.54	-22,037.59

券	银行间市场	354,860,450.09	2,676,536.99	357,748,336.99	211,349.91
	合计	378,947,598.18	2,963,380.03	382,100,290.53	189,312.32
资产支持证券		-	-	-	-
基金		8,561,463.82	-	8,621,459.00	59,995.18
其他		-	-	-	-
合计		453,294,346.91	2,963,380.03	456,466,491.29	208,764.35

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-2,272,333.33	-	-	-
--国债期货	-2,272,333.33	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-2,272,333.33	-	-	-

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
TL2609	30年期国债2609	-2.00	-2,275,000.00	-2,666.67
合计				-2,666.67
减：可抵销 期货暂收款				-2,666.67
净额				0.00

注：衍生金融资产项下的利率衍生工具为国债期货投资，净额为0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持国债期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项

下的国债期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为0。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产余额。

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 2026年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	19,088.68
其中：交易所市场	-
银行间市场	19,088.68
应付利息	-
预提费用-审计费	9,330.77
预提费用-信息披露费	35,888.29
预提费用-账户维护费	6,000.00
其他应付	5,339.20
合计	75,646.94

6.4.7.7 实收基金

6.4.7.7.1 东财瑞兴债券A

金额单位：人民币元

项目 (东财瑞兴债券A)	本期 2026年03月20日（基金合同生效日）至2026年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	104,138,345.49	104,138,345.49
本期申购	313,777,724.12	313,777,724.12
本期赎回（以“-”号填列）	-82,422,803.50	-82,422,803.50
本期末	335,493,266.11	335,493,266.11

6.4.7.7.2 东财瑞兴债券C

金额单位：人民币元

项目 (东财瑞兴债券C)	本期 2026年03月20日（基金合同生效日）至2026年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	117,895,610.54	117,895,610.54
本期申购	108,798,057.25	108,798,057.25
本期赎回（以“-”号填列）	-102,284,145.26	-102,284,145.26
本期末	124,409,522.53	124,409,522.53

注：1、申购份额含红利再投、转换入份额；赎回份额含转换出份额。

2、本基金自2026年3月9日至2026年3月18日止期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币221,988,037.93元（其中A类人民币104,115,354.18元，C类人民币117,872,683.75元）。根据《东财瑞兴债券型证券投资基金基金合同/招募说明书/基金份额发售公告》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入人民币45,918.10元（其中A类人民币22,991.31元，C类人民币22,926.79元），在本基金成立后，折算为222,033,956.03份基金份额（其中A类104,138,345.49份，C类117,895,610.54份），划入基金份额持有人账户。

6.4.7.8 未分配利润

6.4.7.8.1 东财瑞兴债券A

单位：人民币元

项目 (东财瑞兴债券A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
-----------------	-------	-------	---------

基金合同生效日	-	-	-
本期利润	690,080.05	113,402.58	803,482.63
本期基金份额交易产生的变动数	1,138,846.06	-84,453.98	1,054,392.08
其中：基金申购款	1,246,628.04	57,292.95	1,303,920.99
基金赎回款	-107,781.98	-141,746.93	-249,528.91
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,828,926.11	28,948.60	1,857,874.71

6.4.7.8.2 东财瑞兴债券C

单位：人民币元

项目 (东财瑞兴债券C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	450,977.85	92,695.10	543,672.95
本期基金份额交易产生的变动数	157,441.54	-81,880.98	75,560.56
其中：基金申购款	229,526.01	16,164.97	245,690.98
基金赎回款	-72,084.47	-98,045.95	-170,130.42
本期已分配利润	-	-	-
本期末	608,419.39	10,814.12	619,233.51

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年03月20日（基金合同生效日）至2026年06月30日
活期存款利息收入	14,573.20
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	8,603.10
结算备付金利息收入	2,096.56
其他	722.22

合计	25,995.08
----	-----------

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

单位：人民币元

项目	本期 2026年03月20日（基金合同生效日）至2026年06月30日
卖出股票成交总额	156,170,547.44
减：卖出股票成本总额	155,554,991.78
减：交易费用	269,302.91
买卖股票差价收入	346,252.75

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 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年03月20日（基金合同生效日）至2026年06月30日
卖出/赎回基金成交总额	84,412,697.71
减：卖出/赎回基金成本总额	84,208,584.73
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	5,595.72
减：交易费用	88,591.39
基金投资收益	109,925.87

6.4.7.12 债券投资收益

6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年03月20日（基金合同生效日）至2026年
----	----------------------------------

	06月30日
债券投资收益——利息收入	641,434.65
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	138,601.27
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	780,035.92

6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年03月20日（基金合同生效日）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	254,309,052.02
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	252,325,542.56
减：应计利息总额	1,831,379.41
减：交易费用	13,528.78
买卖债券差价收入	138,601.27

6.4.7.13 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。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年03月20日（基金合同生效日）至2026年06月30日
期货投资	-12,088.98

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年03月20日（基金合同生效日）至2026年06月30日
股票投资产生的股利收益	406,736.86
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	406,736.86

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026年03月20日（基金合同生效日）至2026年06月30日
1.交易性金融资产	208,764.35
——股票投资	-40,543.15
——债券投资	189,312.32
——资产支持证券投资	-
——基金投资	59,995.18
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-2,666.67
——权证投资	-
——期货投资	-2,666.67
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	206,097.68

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年03月20日（基金合同生效日）至2026年06月30日
基金赎回费收入	484.13
合计	484.13

6.4.7.19 持有基金产生的费用

项目	本期 2026年03月20日（基金合同生效日）至2026年06月30日
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	-
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	6,407.98
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	1,348.00

注：当期持有基金产生的应支付销售服务费、应支付管理费、应支付托管费按照被投资基金基金合同约定已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，上表列示金额为按照本基金对被投资基金的实际持仓情况根据被投资基金基金合同约定的相应费率计算得出。

6.4.7.20 信用减值损失

本基金本报告期未发生信用减值损失。

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026年03月20日（基金合同生效日）至2026年06月30日
----	--

审计费用	9,330.77
信息披露费	35,888.29
证券出借违约金	-
账户维护费-中债登	3,000.00
开户费	800.00
账户维护费-上清所	3,000.00
合计	52,019.06

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
苏州银行股份有限公司（“苏州银行”）	基金托管人
东方财富证券股份有限公司（“东财证券”）	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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年03月20日（基金合同生效日）至2026年06月30日	
	成交金额	占当期股票成交 总额的比例
东财证券	10,520,023.65	2.79%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年03月20日（基金合同生效日）至2026年06月30日	
	成交金额	占当期债券买卖 成交总额的比例
东财证券	27,767,993.88	50.26%

6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年03月20日（基金合同生效日）至2026年06月30日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例
东财证券	282,200,000.00	14.71%

6.4.10.1.5 基金交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年03月20日（基金合同生效日）至2026年06月30日	
	成交金额	占当期基金成交 总额的比例

东财证券	6,775,064.60	3.82%
------	--------------	-------

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年03月20日（基金合同生效日）至2026年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
东财证券	8,563.40	3.41%	-	-

注：1、上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除证券公司需承担的费用后的净额列示。

2、根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自2024年7月1日起，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率，且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026年03月20日（基金合同生效日）至2026年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	420,518.96
其中：应支付销售机构的客户维护费	163,388.76
应支付基金管理人的净管理费	257,130.20

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值扣除前一日所持有本基金管理人管理的公开募集的基金份额所对应资产净值后的余额（若为负数，则取0）的0.60%年费率计提，本基金投资于本基金管理人所管理的公开募集的基金份额的部分不收取管理费。逐日累计至每月月末，按月支付。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.60\% \div \text{当年天数}$$

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扣除前一日所持有的基金管理人管理的公开募集的基金份额所对应资产净值后的余额，若为负数，则E取0

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026年03月20日（基金合同生效日）至2026年06月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	70,086.53

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值扣除前一日所持有基金托管人托管的公开募集的基金份额所对应资产净值后的余额（若为负数，则取0）的0.10%年费率计提，本基金投资于本基金托管人所托管的公开募集的基金份额的部分不收取托管费。逐日累计至每月月末，按月支付。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

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扣除前一日所持有的基金托管人托管的公开募集的基金份额所对应资产净值后的余额，若为负数，则E取0

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售 服务费的 各关联方 名称	本期 2026年03月20日（基金合同生效日）至2026年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	东财瑞兴债券A	东财瑞兴债券C	合计
天天基金	0.00	27,191.17	27,191.17
东财证券	0.00	1,266.10	1,266.10
合计	0.00	28,457.27	28,457.27

注：本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费年费率为0.20%，销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值的0.20%年费率计提。销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

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

（1）基金管理人直销渠道：对于基金份额计提的销售服务费，在投资者赎回基金份额或基金合同终止时，随赎回款（或清算款）一并返还给投资者。基金销售子公司销售母公司所管理基金的，按照本条要求执行。

（2）代销渠道：对于投资者持续持有期限未超过一年（即365天，下同）的基金份额计提的销售服务费，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。对于持续持有期限超过一年的基金份额继续计提的销售服务费，在投资者赎回基金份额或基金合同终止时，随赎回款（或清算款）一并返还给投资者。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末未发生与关联方的银行间同业市场债券（含回购）交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期末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

本基金本报告期末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

- 1、本报告期内，基金管理人未运用固有资金投资本基金。
- 2、本基金基金合同生效日为2026年3月20日，本期是指2026年3月20日至2026年6月30日，无上年度可比期间数据。

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

东财瑞兴债券A

份额单位：份

关联方名称	本期末	
	2026年06月30日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例

东方财富 信息股份 有限公司	99,769,530.08	29.74%
----------------------	---------------	--------

东财瑞兴债券C

份额单位：份

关联方名称	本期末 2026年06月30日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
-	-	-

- 1、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。
- 2、本基金基金合同生效日为2026年3月20日，本期是指2026年3月20日至2026年6月30日，无上年度可比期间数据。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年03月20日（基金合同生效日）至2026年06月30日	
	期末余额	当期利息收入
苏州银行- 托管户	1,005,142.27	14,573.20
东财证券- 证券资金 户	220,537.35	5,509.75

- 注：1、本基金的银行存款由基金托管人苏州银行保管，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

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.10.8.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用

本基金本报告期无交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用。

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

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688072	拓荆科技	2026-06-29	重大事项停牌	832.00	2026-07-13	890.99	454	378,873.26	377,728.00	-

注：本基金截至2026年6月30日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2026年6月30日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额66,003,345.21元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
012680075	26中交一公SCP001(科创债)	2026-07-01	100.74	100,000	10,074,151.78
102481115	24中核MTN001	2026-07-01	101.35	100,000	10,135,235.62
102580349	25电网MTN005	2026-07-01	101.49	100,000	10,149,265.75
102581389	25龙源电力MTN004	2026-07-01	100.78	100,000	10,078,394.52
232480007	24建行二级资本债01B	2026-07-01	106.59	100,000	10,659,240.00
232480052	24浦发银行二级资本债01A	2026-07-01	103.41	100,000	10,340,721.64
232580002	25建行二级资本债01BC	2026-07-01	101.77	100,000	10,176,555.07
合计				700,000	71,613,564.38

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

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2026年06月30日
A-1	-
A-1以下	-
未评级	30,316,118.36
合计	30,316,118.36

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。

6.4.13.2.2 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 2026年06月30日
--------	--------------------

AAA	114,586,991.85
AAA以下	10,137,456.99
未评级	227,059,723.33
合计	351,784,172.17

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 2026年0 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	8,921,281.44	-	-	-	8,921,281.44
结算备付金	1,907,715.91	-	-	-	1,907,715.91
存出保证金	-	-	-	79,625.00	79,625.00
交易性金融资产	133,089,374.70	175,572,772.81	73,438,143.02	74,366,200.76	456,466,491.29
应收申购款	-	-	-	61,510,997.07	61,510,997.07
资产总	143,918,372.05	175,572,772.81	73,438,143.02	135,956,822.83	528,886,110.71

计					
负债					
卖出回 购金融 资产款	66,003,345.21	-	-	-	66,003,345.21
应付赎 回款	-	-	-	251,257.91	251,257.91
应付管 理人报 酬	-	-	-	130,481.75	130,481.75
应付托 管费	-	-	-	21,746.97	21,746.97
应付销 售服务 费	-	-	-	14,226.70	14,226.70
应交税 费	-	-	-	9,508.37	9,508.37
其他负 债	-	-	-	75,646.94	75,646.94
负债总 计	66,003,345.21	-	-	502,868.64	66,506,213.85
利率敏 感度缺 口	77,915,026.84	175,572,772.81	73,438,143.02	135,453,954.19	462,379,896.86

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（单位：人民币元）
		本期末 2026年06月30日
	利率下降25个基点	2,633,371.73
	利率上升25个基点	-2,590,937.58

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

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30日	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产—股票投资	65,744,741.76	14.22
交易性金融资产—基金投资	8,621,459.00	1.86
交易性金融资产—债券投资	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-
其他	-	-
合计	74,366,200.76	16.08

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末 2026年06月30日
	业绩比较基准上升5%	9,610,471.36
	业绩比较基准下降5%	-9,610,471.36

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 2026年06月30日
第一层次	74,827,358.30
第二层次	381,639,132.99
第三层次	-
合计	456,466,491.29

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。

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	65,744,741.76	12.43
	其中：股票	65,744,741.76	12.43
2	基金投资	8,621,459.00	1.63
3	固定收益投资	382,100,290.53	72.25
	其中：债券	382,100,290.53	72.25
	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	10,828,997.35	2.05
8	其他各项资产	61,590,622.07	11.65
9	合计	528,886,110.71	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

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	2,099,400.00	0.45
B	采矿业	4,684,800.00	1.01
C	制造业	42,362,094.76	9.16
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,717,045.00	0.59
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	221,943.00	0.05
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	12,849,555.00	2.78
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	809,904.00	0.18
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	65,744,741.76	14.22

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资
---	------	------	-------	---------	------

号					产净值比例(%)
1	301377	鼎泰高科	41,000	22,586,900.00	4.88
2	601088	中国神华	120,000	4,684,800.00	1.01
3	601939	建设银行	404,000	3,890,520.00	0.84
4	601398	工商银行	527,800	3,731,546.00	0.81
5	002384	东山精密	13,600	3,567,960.00	0.77
6	601988	中国银行	504,600	2,886,312.00	0.62
7	300308	中际旭创	2,000	2,540,000.00	0.55
8	002714	牧原股份	60,000	2,099,400.00	0.45
9	600276	恒瑞医药	40,000	2,081,600.00	0.45
10	600887	伊利股份	85,000	2,036,600.00	0.44
11	603288	海天味业	60,000	1,989,600.00	0.43
12	601318	中国平安	40,000	1,909,600.00	0.41
13	300502	新易盛	2,100	1,274,700.00	0.28
14	600900	长江电力	48,100	1,273,207.00	0.28
15	600025	华能水电	138,600	1,232,154.00	0.27
16	600054	黄山旅游	75,200	809,904.00	0.18
17	002371	北方华创	800	707,648.00	0.15
18	688048	长光华芯	1,379	692,258.00	0.15
19	002463	沪电股份	4,400	672,320.00	0.15
20	601138	工业富联	6,700	483,405.00	0.10
21	688502	茂莱光学	681	472,341.60	0.10
22	002916	深南电路	1,000	457,900.00	0.10
23	002032	苏泊尔	11,200	443,520.00	0.10
24	601288	农业银行	71,100	431,577.00	0.09
25	000895	双汇发展	19,100	427,840.00	0.09
26	688072	拓荆科技	454	377,728.00	0.08
27	300476	胜宏科技	800	277,144.00	0.06
28	300628	亿联网络	7,700	260,414.00	0.06
29	002851	麦格米特	1,500	250,770.00	0.05

30	688120	华海清科	737	237,446.66	0.05
31	600372	中航机载	21,200	230,020.00	0.05
32	000950	重药控股	44,300	221,943.00	0.05
33	601139	深圳燃气	37,400	211,684.00	0.05
34	688012	中微公司	447	209,419.50	0.05
35	603308	应流股份	1,400	84,560.00	0.02

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末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	301377	鼎泰高科	22,426,904.00	4.85
2	601939	建设银行	18,953,481.00	4.10
3	601728	中国电信	17,196,670.00	3.72
4	300308	中际旭创	7,367,423.00	1.59
5	601088	中国神华	7,168,899.00	1.55
6	001267	汇绿生态	6,956,178.00	1.50
7	601988	中国银行	5,603,505.00	1.21
8	600900	长江电力	5,005,626.00	1.08
9	601398	工商银行	4,883,661.00	1.06
10	002384	东山精密	4,596,064.00	0.99
11	688082	盛美上海	4,285,680.00	0.93
12	688037	芯源微	4,063,849.73	0.88
13	300476	胜宏科技	4,032,540.00	0.87
14	600030	中信证券	3,981,000.00	0.86
15	600938	中国海油	3,615,780.00	0.78
16	601318	中国平安	3,335,034.00	0.72
17	688205	德科立	3,128,734.12	0.68
18	600025	华能水电	2,704,614.00	0.58

19	600941	中国移动	2,620,033.00	0.57
20	600036	招商银行	2,609,991.00	0.56

注：本项“买入金额”按买入成交金额填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	601728	中国电信	17,384,244.00	3.76
2	601939	建设银行	15,066,498.00	3.26
3	001267	汇绿生态	6,869,525.00	1.49
4	300308	中际旭创	5,161,823.00	1.12
5	688082	盛美上海	4,758,570.00	1.03
6	600030	中信证券	4,080,224.00	0.88
7	300476	胜宏科技	3,877,559.00	0.84
8	688037	芯源微	3,866,957.32	0.84
9	600900	长江电力	3,796,838.00	0.82
10	600938	中国海油	3,666,043.00	0.79
11	688205	德科立	3,630,669.85	0.79
12	300136	信维通信	2,825,000.00	0.61
13	600036	招商银行	2,700,100.00	0.58
14	600941	中国移动	2,621,560.00	0.57
15	601988	中国银行	2,601,765.00	0.56
16	605060	联德股份	2,392,000.00	0.52
17	002938	鹏鼎控股	2,375,384.00	0.51
18	301396	宏景科技	2,364,660.00	0.51
19	300857	协创数据	2,320,000.00	0.50
20	300394	天孚通信	2,131,483.00	0.46

注：本项“卖出金额”按卖出成交金额填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	221,340,276.69
卖出股票收入（成交）总额	156,170,547.44

注：本项“买入股票成本”和“卖出股票收入”均按买卖成交金额填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	23,513,068.00	5.09
2	央行票据	-	-
3	金融债券	144,230,361.11	31.19
	其中：政策性金融债	40,617,490.42	8.78
4	企业债券	10,137,456.99	2.19
5	企业短期融资券	50,512,688.22	10.92
6	中期票据	152,867,830.67	33.06
7	可转债(可交换债)	838,885.54	0.18
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	382,100,290.53	82.64

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	220208	22国开08	200,000	20,284,109.59	4.39
2	019785	25国债13	130,000	13,164,131.23	2.85
3	092280066	22工行二级资本债03B	100,000	11,076,761.10	2.40
4	232480007	24建行二级资本债01B	100,000	10,659,240.00	2.31

5	232380033	23成都银行二级资本债01	100,000	10,646,350.68	2.30
---	-----------	---------------	---------	---------------	------

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

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金国债期货投资策略主要以套期保值为核心，旨在管理利率风险、调整债券组合久期，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对债券市场和期货市场运行趋势的研究，结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与国债期货的投资，以控制组合回撤、丰富组合投资策略以及改善组合的风险收益特性。本报告期内，本基金投资国债期货符合既定的投资政策和投资目的。

7.12 本报告期投资基金情况

7.12.1 投资政策及风险说明

本基金投资中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金（仅包括全市场的股票型 ETF、基金管理人旗下的股票型基金及计入权益类资产的混合型基金）。计入上述权益类资产的混合型基金需符合下列两个条件之一：1、基金合同约定股票（含存托凭证）资产投资比例不低于基金资产60%的混合型基金；2、根据基金披露的定期报告，最近四个季度中任一季度股票（含存托凭证）资产占基金资产比例均不低于60%的混合型基金。

本基金所投资基金产品受权益市场行情、持仓调整、流动性变化等因素影响，可能造成组合波动。管理人将持续监测底层基金运作与风险表现，动态优化资产配置结构，管控各类风险敞口。

7.12.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有基金投资明细

序号	基金代码	基金名称	运作方式	持有份额 (份)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例(%)	是否属于基金管理人及管理人关联方所管理的基金
1	517520	黄金股ETF永赢	交易型开放式	1,920,100.00	3,041,438.40	0.66	否
2	512800	华宝中证银行ETF	交易型开放式	2,842,800.00	2,086,615.20	0.45	否
3	159915	易方达创业板ETF	交易型开放式	268,300.00	1,170,861.20	0.25	否
4	588200	嘉实上证科创板芯片ETF	交易型开放式	168,100.00	829,741.60	0.18	否
5	512880	国泰中证全指证券公司ETF	交易型开放式	500,000.00	563,000.00	0.12	否
6	515000	华宝中证科技龙头ETF	交易型开放式	273,000.00	467,376.00	0.10	否
7	563300	华泰柏瑞中证2000ETF	交易型开放式	287,400.00	462,426.60	0.10	否

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 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。

2026年6月5日，国家金融监督管理总局对中国工商银行股份有限公司处以行政处罚。2025年12月10日，中国人民银行对中国工商银行股份有限公司处以行政处罚。

2026年6月5日和2025年9月12日，国家金融监督管理总局对中国建设银行股份有限公司处以行政处罚。2026年2月12日，中国人民银行对中国建设银行股份有限公司处以行政处罚。

2025年12月5日，国家金融监督管理总局对成都银行股份有限公司处以行政处罚。

2026年2月12日，中国人民银行对上海浦东发展银行股份有限公司处以行政处罚。2025年12月19日和2025年10月31日，国家金融监督管理总局对上海浦东发展银行股份有限公司处以行政处罚。

2025年12月19日，国家金融监督管理总局对兴业银行股份有限公司处以行政处罚。

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。

7.13.2 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

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.13.3 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	79,625.00
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	61,510,997.07
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	61,590,622.07

7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113042	上银转债	578,787.46	0.13
2	113052	兴业转债	260,098.08	0.06

7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.13.6 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 级别	持 有 人 户 数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总 份额 比例	持有份额	占总份 额比例
东财 瑞兴 债券A	269	1,247,186.86	289,320,302.83	86.2 4%	46,172,963.28	13.76%
东财 瑞兴 债券C	227	548,059.57	99,800,881.87	80.2 2%	24,608,640.66	19.78%
合计	490	938,577.12	389,121,184.70	84.6 1%	70,781,603.94	15.39%

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	东财瑞兴债券A	1,137,830.92	0.34%
	东财瑞兴债券C	26,008.09	0.02%
	合计	1,163,839.01	0.25%

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	东财瑞兴债券A	10~50
	东财瑞兴债券C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	东财瑞兴债券A	50~100
	东财瑞兴债券C	0
	合计	50~100

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	东财瑞兴债券A	东财瑞兴债券C
基金合同生效日(2026年03月20日)基金份额总额	104,138,345.49	117,895,610.54
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	313,777,724.12	108,798,057.25
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	82,422,803.50	102,284,145.26
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	335,493,266.11	124,409,522.53

§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：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。基金托管人未涉及基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内未改变投资策略

10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

报告期内，本基金所投资的基金未发生包括转换运作方式、与其他基金合并、终止基金合同、召开基金份额持有人大会及大会表决意见等重大影响事件。

10.6 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。

10.7 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.7.1 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。

10.7.2 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。

10.7.3 托管人受调查或处罚等情况

托管人无受调查或处罚等情况。

10.7.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

托管人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.8 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

10.8.1 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	10,520,023.65	2.79%	8,563.40	3.41%	-
江海证券	4	366,990,800.48	97.21%	242,569.27	96.59%	新增4个交易单元。

- 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。

10.8.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
东财证券	27,767,993.88	50.26%	282,200,000.00	14.71%	-	-	6,775,064.60	3.82%

江海证 券	27,483,034. 75	49.74%	1,636,793,00 0.00	85.29%	-	-	170,407,681. 66	96.18%
----------	-------------------	--------	----------------------	--------	---	---	--------------------	--------

10.9 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	东财瑞兴债券型证券投资基金基金合同生效公告	证监会规定网站及报刊	2026-03-21
2	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
3	东财瑞兴债券型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换和定期定额投资业务公告	证监会规定网站及报刊	2026-04-07
4	东财瑞兴债券型证券投资基金招募说明书更新	证监会规定网站	2026-04-25
5	东财瑞兴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	2026-04-25
6	东财瑞兴债券型证券投资基金基金经理变更公告	证监会规定网站及报刊	2026-04-25
7	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
8	东财瑞兴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
9	东财瑞兴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

投资者类	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

别							
机构	1	2026-04-23至2026-06-30	-	99,769,530.08	-	99,769,530.08	21.69%
	2	2026-04-09至2026-06-25	-	59,988,002.40	-	59,988,002.40	13.04%
	3	2026-06-26至2026-06-30	-	99,482,590.53	-	99,482,590.53	21.63%
产品特有风险							
本基金由于存在上述单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况，存在以下特有风险：（1）持有基金份额比例达到或超过20%的投资者大额赎回导致的基金份额净值波动风险；（2）持有基金份额比例达到或超过20%的投资者大额赎回导致的流动性风险；（3）持有基金份额比例达到或超过20%的投资者大额赎回导致的巨额赎回风险。							

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兴债券型证券投资基金募集注册的文件
- 二、《东财瑞兴债券型证券投资基金基金合同》
- 三、《东财瑞兴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