

国金安裕债券型证券投资基金 2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：国金基金管理有限公司

基金托管人：广发证券股份有限公司

送出日期：2026 年 8 月 29 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。

基金托管人广发证券股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 8 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 4 月 21 日至 2026 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	8
§ 4 管理人报告	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	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	46
7.1 期末基金资产组合情况	46
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	46
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	47
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	50
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	50
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	50

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	50
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	51
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	51
7.11 本报告期投资基金情况	51
7.12 投资组合报告附注	56
§ 8 基金份额持有人信息	57
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	57
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	57
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	57
§ 9 开放式基金份额变动	58
§ 10 重大事件揭示	58
10.1 基金份额持有人大会决议	58
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	58
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	58
10.4 基金投资策略的改变	58
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件	59
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况	59
10.7 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	59
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	59
10.9 其他重大事件	60
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	61
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	61
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	61
§ 12 备查文件目录	61
12.1 备查文件目录	61
12.2 存放地点	61
12.3 查阅方式	61

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国金安裕债券型证券投资基金	
基金简称	国金安裕债券	
基金主代码	027024	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2026 年 4 月 21 日	
基金管理人	国金基金管理有限公司	
基金托管人	广发证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	288,898,772.49 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	国金安裕债券 A	国金安裕债券 C
下属分级基金的交易代码	027024	027025
报告期末下属分级基金的份额总额	99,839,743.28 份	189,059,029.21 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制投资组合风险的前提下，通过积极主动的资产配置与投资管理，力争实现组合资产长期稳健的增值。
投资策略	本基金的主要投资策略包括：资产配置策略、债券投资策略、股票投资策略、存托凭证投资策略、国债期货交易策略、信用衍生品投资策略、公开募集证券投资基金投资策略。 资产配置策略部分，本基金综合考虑宏观经济环境、政策及产业趋势、市场利率、流动性水平等因素，以定性与定量分析相结合的方式，在基金合同约定的范围内确定债券类资产、权益类资产等各类资产的配置比例，并随着各类资产风险收益的相对变化，动态调整组合结构，使基金在保持总体风险水平相对稳定的基础上优化投资组合。本基金其余主要投资策略详见本基金招募说明书及产品资料概要。
业绩比较基准	中债-综合全价（总值）指数收益率*85%+中证 800 指数收益率*10%+活期存款基准利率*5%
风险收益特征	本基金为债券型基金，理论上其预期风险和预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

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		国金基金管理有限公司	广发证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	虞志海	罗琦
	联系电话	010-88005852	020-66338888
	电子邮箱	yuzhihai@gfund.com	gzluoqi@gf.com.cn
客户服务电话		4000-2000-18	95575

传真	010-88005666	020-87553363-6847
注册地址	北京市怀柔区怀柔镇红星路 1037 号一层 1049 室	广东省广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街 2 号 618 室
办公地址	北京市朝阳区景辉街 31 号院 1 号楼三星大厦 51 层	广州市天河区马场路 26 号广发证券大厦 34 楼
邮政编码	100026	510627
法定代表人	邵海波	林传辉

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.gfund.com
基金中期报告置备地点	基金管理人和基金托管人的办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	国金基金管理有限公司	北京市朝阳区景辉街 31 号院 1 号楼三星大厦 51 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数 据和指标	2026 年 4 月 21 日（基金合同生效日）-2026 年 6 月 30 日	
	国金安裕债券 A	国金安裕债券 C
本期已实现收益	93,411.75	89,451.60
本期利润	-327,245.92	-698,939.84
加权平均基金份 额本期利润	-0.0028	-0.0032
本期加权平均净 值利润率	-0.28%	-0.32%
本期基金份额净 值增长率	-0.25%	-0.29%
3.1.2 期末数 据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利 润	-251,227.00	-548,007.81
期末可供分配基 金份额利润	-0.0025	-0.0029

期末基金资产净值	99,588,516.28	188,511,021.40
期末基金份额净值	0.9975	0.9971
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	-0.25%	-0.29%

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. 期末可供分配利润的计算方法：如果期末未分配利润的未实现部分为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分；如果期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润（已实现部分相抵未实现部分）。

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

4. 本基金合同自 2026 年 4 月 21 日起生效。

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

国金安裕债券 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
自基金合同生效起至今	-0.25%	0.08%	0.81%	0.14%	-1.06%	-0.06%

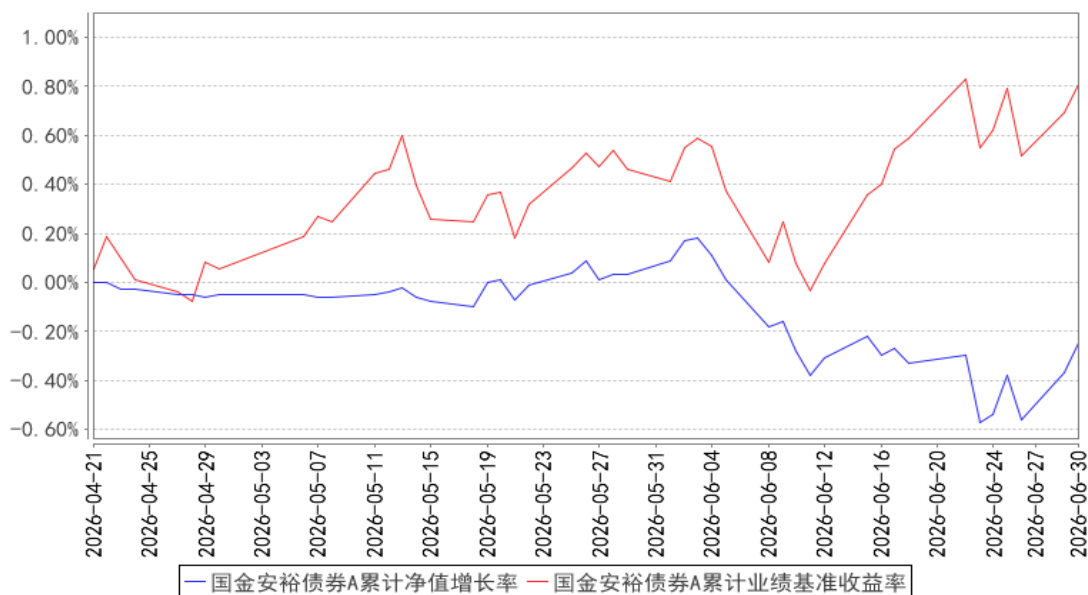
国金安裕债券 C

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
自基金合同生效起至今	-0.29%	0.09%	0.81%	0.14%	-1.10%	-0.05%

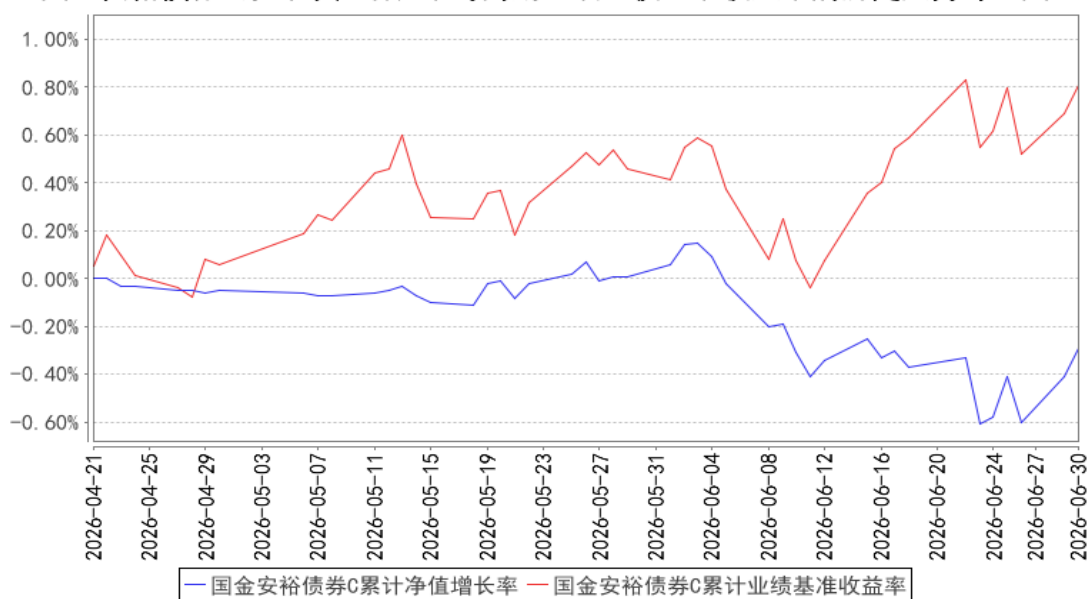
注：本基金的业绩比较基准为：中债-综合全价(总值)指数收益率*85%+中证 800 指数收益率*10%+活期存款基准利率*5%。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

国金安裕债券A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



国金安裕债券C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金 A 类份额、C 类份额基金合同生效日为 2026 年 4 月 21 日，基金合同生效日至报告期末，本基金运作时间未满一年。

2、根据基金合同规定：基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。本基金建仓期为 2026 年 4 月 21 日至 2026 年 10 月 20 日，截至本报告期末，本基金建仓期尚未结束。

3.3 其他指标

无

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

国金基金管理有限公司（原名称为“国金通用基金管理有限公司”）经中国证券监督管理委员会（证监许可[2011]1661号）批准，于2011年11月2日成立，总部设在北京。公司注册资本为3.6亿元人民币，股东为国金证券股份有限公司、苏州工业园区兆润投资控股集团有限公司、广东宝丽华新能源股份有限公司、涌金投资控股有限公司、苏州元道亨经济信息咨询中心（有限合伙）、苏州元道利经济信息咨询中心（有限合伙）和苏州元道贞经济信息咨询中心（有限合伙），股权比例分别为51%、19.5%、19.5%、5%、1.5%、1.9%、1.6%。截至2026年6月30日，国金基金管理有限公司共管理34只公募基金，具体包括国金国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金、国金沪深300指数增强证券投资基金、国金金腾货币市场证券投资基金、国金众赢货币市场证券投资基金、国金及第中短债债券型证券投资基金、国金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金、国金量化多因子股票型证券投资基金、国金惠鑫短债债券型证券投资基金、国金惠盈纯债债券型证券投资基金、国金惠安利率债债券型证券投资基金、国金鑫意医药消费混合型发起式证券投资基金、国金惠远纯债债券型证券投资基金、国金惠丰39个月定期开放债券型证券投资基金、国金惠享一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、国金鑫悦经济新动能混合型证券投资基金、国金自主创新混合型证券投资基金、国金惠诚债券型证券投资基金、国金ESG持续增长混合型证券投资基金、国金核心资产一年持有期混合型证券投资基金、国金新兴价值混合型证券投资基金、国金量化精选混合型证券投资基金、国金铁建重庆渝遂高速公路封闭式基础设施证券投资基金、国金中证1000指数增强型证券投资基金、国金中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金、国金中债1-5年政策性金融债指数证券投资基金、国金智享量化选股混合型证券投资基金、国金中证A500指数增强型证券投资基金、国金安瑞平衡混合型证券投资基金、国金红利量化选股混合型证券投资基金、国金中证全指指数增强型证券投资基金、国金安和债券型证券投资基金、国金智远量化选股混合型证券投资基金、国金科创创业量化选股股票型证券投资基金、国金安裕债券型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王珂	本基金的基金经理	2026年4月21日	-	12年	王珂先生，英国埃克斯特大学博士。2013年9月至2015年12月在上海期货交易

					所金融衍生品研究院担任博士后研究员，2015 年 12 月至 2017 年 4 月在众安保险资产管理部担任组合投资经理，2017 年 4 月至 2024 年 1 月在中国人保资产管理有限公司组合管理部担任资深投资经理。2024 年 1 月加入国金基金管理有限公司，现任大类资产配置部总经理。
--	--	--	--	--	---

注：（1）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，首任基金经理的任职日期按基金合同生效日填写；（2）证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》《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》和其他有关法律法规的规定，以及《国金安裕债券型证券投资基金基金合同》的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求利益，无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《国金基金管理有限公司公平交易管理办法》的规定，通过制度、流程和系统等方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下所有投资组合。在投资决策内部控制方面，各投资组合按投资管理制度和流程独立决策，并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；在交易执行控制方面，通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行细则、严格的流程控制、持续的技术改进，确保公平交易原则的实现；在行为监控和分析评估方面，通过 IT 系统和人工监控等方式进行日常监控，确保做好公平交易的监控和分析。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易，未出现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的情况。

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

报告期内，权益市场主要指数震荡上涨，板块结构分化，电子、通信等行业涨幅居前，债市收益率整体呈现震荡下行态势。上半年股债跷跷板效应有所弱化，市场内部的结构性分化，一定

程度上削弱了股债基于宏观基本面联动的逻辑。具体来看，1 月初到 2 月末，股市延续跨年行情，市场呈现相对均衡的普涨格局，而由于信贷需求偏弱，债市在调整后迎来银行配置资金集中入场，收益率稳步下行。随着 2 月底美伊冲突爆发，油价飙升，输入性通胀预期有所升温，风险偏好大幅降低，截至 3 月底，股市出现较为明显的调整，而由于国内流动性维持宽松，债市在震荡中温和调整，短端表现优于长端。4 月，随着地缘局势缓和，股市开始企稳反弹，市场主线聚焦于 AI 产业链，电子、通信等行业表现极为强势，而受制于内需偏弱的传统行业普跌，市场结构分化进一步加剧，整体反映宏观经济的 K 型复苏，而债市在经济出现阶段性回落及信贷需求持续偏弱的影响下，机构配置力量强化，收益率震荡下行。6 月，随着央行引导资金利率中枢回归至政策利率附近，债市在资金面边际收紧但基本面仍偏弱的背景下低位窄幅震荡。

报告期内，本基金根据对大类资产的判断，在建仓期采取相对稳健的投资策略：债券方面，以中短久期信用债为主，逐步增加配置；股票方面，结合市场波动情况逢低缓慢建仓；REITs 方面，逢调整逐步布局。后续，本基金将重点跟踪国内宏观基本面、政策面及流动性的变化、人民币汇率及海外形势的变化，结合对市场的判断做好大类资产的灵活调整，妥善实施风险预算管理，在严格控制投资组合风险的前提下，努力实现超越业绩比较基准的收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金 A 类份额单位净值为 0.9975 元，累计单位净值为 0.9975 元；本报告期 A 类份额净值增长率为-0.25%，同期业绩比较基准增长率为 0.81%。

本基金 C 类份额单位净值为 0.9971 元，累计单位净值为 0.9971 元；本报告期 C 类份额净值增长率为-0.29%，同期业绩比较基准增长率为 0.81%。

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，经济基本面仍处于经济引擎切换周期中，需求偏弱的格局仍在，新旧经济结构分化，经济内生动能偏弱的格局尚未出现实质性改善。政策端以用好用足存量政策为总基调，财政侧重提升资金使用效率，货币政策延续适度宽松取向。债券方面，基本面修复偏缓叠加流动性合理充裕，对债市仍构成支撑。信用债套息策略仍可坚持，但随着信用利差的压缩，该策略的性价比或弱于上半年，需沿收益率曲线寻找利差机会，可关注收益率曲线骑乘策略和长端利率债的交易性机会；股票方面，经济结构转型期间股市或仍将呈现结构分化，可关注匹配经济结构转型方向、产业逻辑较强、有业绩支撑的高景气低拥挤度板块的投资机会，适度均衡配置以应对潜在的波动风险；转债方面，整体估值仍处于历史相对较高水平，再融资新规及部分高价转债的赎回对市场预期形成一定影响，转债的整体性价比预计弱于权益，可关注正股基本面较好、信用风险较低且估值合理的优质转债个券配置机会；REITs 方面，当前产权类 REITs 的分派率处于

历史极值区间，多数板块利差分位数处于高位，估值层面对负面因素的计入或已相对充分。择券应兼顾“估值安全垫”与“季报业绩兑现度”两个维度，优先关注季报超预期的次新项目以及现金流稳定的高息资产。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人按照相关法律法规及基金合同关于估值的约定，严格执行内部估值控制程序，对基金所持有的投资品种进行估值。

公司设立的基金估值委员会为公司基金估值决策机构，估值委员会由公司督察长、投资总监、运营总监、清算业务负责人、研究部门负责人、风控业务负责人、合规业务负责人组成，可根据需要邀请产品托管人代表、公司独立董事、会计师事务所代表等外部人员参加。公司运营总监为公司基金估值委员会主席。运营支持部根据估值委员会的估值意见进行相关具体的估值调整或处理，并负责与托管人进行估值结果的核对，运营支持部业务人员复核后使用。基金经理作为估值工作小组成员，在基金估值定价过程中，充分表达对相关问题及定价方案的意见或建议，参与估值方案提议的制定，估值政策和估值方案最终由估值委员会决定，基金经理不具有表决权。本基金管理人参与估值流程的各方之间不存在任何的重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中债金融估值中心有限公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金相关法律法规和基金合同，结合本基金实际运作情况，本报告期内，本基金未进行利润分配，不存在应分配而未分配的情况。

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，本基金无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，本基金托管人在对国金安裕债券型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金托管业务管理办法》等相关法律法规的规定和基金合同、托管协议的约定勤勉履行基金托管人职责，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告期内，国金基金管理有限公司在本基金各重要方面的运作符合基金合同、托管协议的约定，本基金托管人未发现本基金在投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支及利润分配等方面存在任何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的真实、准确和完整发表意见

本基金托管人依法对国金基金管理有限公司编制和披露的国金安裕债券型证券投资基金 2026 年中期报告中的财务指标、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：国金安裕债券型证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日
资 产：		
货币资金	6.4.7.1	15,417,495.58
结算备付金		-
存出保证金		-
交易性金融资产	6.4.7.2	284,774,212.29
其中：股票投资		17,749,535.80
基金投资		19,927,472.98
债券投资		247,097,203.51
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
其他投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-
债权投资	6.4.7.5	-
其中：债券投资		-
资产支持证券投资		-
其他投资		-
其他债权投资	6.4.7.6	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-
应收清算款		-
应收股利		-
应收申购款		3,020.00

递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.8	-
资产总计		300,194,727.87
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 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		8,500,034.97
应付清算款		-
应付赎回款		3,306,712.83
应付管理人报酬		163,852.93
应付托管费		40,963.21
应付销售服务费		35,597.80
应付投资顾问费		-
应交税费		8,296.77
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.9	39,731.68
负债合计		12,095,190.19
净资产:		
实收基金	6.4.7.10	288,898,772.49
其他综合收益	6.4.7.11	-
未分配利润	6.4.7.12	-799,234.81
净资产合计		288,099,537.68
负债和净资产总计		300,194,727.87

注：1. 报告截止日 2026 年 6 月 30 日，国金安裕债券 A 基金份额净值 0.9975 元，基金份额总额 99,839,743.28 份；国金安裕债券 C 基金份额净值 0.9971 元，基金份额总额 189,059,029.21 份。国金安裕债券份额总额合计为 288,898,772.49 份。

2. 本期财务报表的实际编制期间系 2026 年 4 月 21 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日。

3. 截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

6.2 利润表

会计主体：国金安裕债券型证券投资基金

本报告期：2026 年 4 月 21 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期
-----	-----	----

		2026 年 4 月 21 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-410,242.83
1. 利息收入		234,499.41
其中：存款利息收入	6.4.7.13	234,499.41
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		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		564,306.87
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-635,777.49
基金投资收益	6.4.7.15	-2,060.31
债券投资收益	6.4.7.16	848,635.65
资产支持证券投资收益	6.4.7.17	-
贵金属投资收益	6.4.7.18	-
衍生工具收益	6.4.7.19	-
股利收益	6.4.7.20	353,509.02
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-
其他投资收益		-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	-1,209,049.11
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.22	-
减：二、营业总支出		615,942.93
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	390,800.77
其中：暂估管理人报酬		-
2. 托管费	6.4.10.2.2	97,700.19
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	84,782.49
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		2,853.72
其中：卖出回购金融资产支出		2,853.72
6. 信用减值损失	6.4.7.24	-
7. 税金及附加		1,494.58
8. 其他费用	6.4.7.25	38,311.18
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-1,026,185.76
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-1,026,185.76
五、其他综合收益的税后净额		-

六、综合收益总额		-1,026,185.76
----------	--	---------------

6.3 净资产变动表

会计主体：国金安裕债券型证券投资基金

本报告期：2026 年 4 月 21 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 4 月 21 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	345,276,404.68	-	-	345,276,404.68
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-56,377,632.19	-	-799,234.81	-57,176,867.00
（一）、综合收益总额	-	-	-1,026,185.76	-1,026,185.76
（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）	-56,377,632.19	-	226,950.95	-56,150,681.24
其中：1. 基金申购款	47,285.09	-	-209.42	47,075.67
2. 基金赎回款	-56,424,917.28	-	227,160.37	-56,197,756.91
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	288,898,772.49	-	-799,234.81	288,099,537.68

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>邵海波</u>	<u>聂武鹏</u>	<u>于晓莲</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

国金安裕债券型证券投资基金（以下简称“本基金”），系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[2026]443 号文《关于准予国金安裕债券型证券投资基金注册的批复》注册，由国金基金管理有限公司向社会公开募集，基金合同于 2026 年 4 月 21 日正式生效，本基金首次设立募集规模为 345,276,404.68 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人和注册登记机构均为国金基金管理有限公司，基金托管人为广发证券股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包含主板、科创板、创业板及其他依法发行上市的股票）、存托凭证、债券（包括国债、金融债、央行票据、地方政府债、政府支持机构债券、政府支持债券、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款、以及其他银行存款等）、货币市场工具、国债期货、信用衍生品、经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金（仅包含全市场的股票型 ETF、公开募集不动产投资信托基金及本基金管理人旗下的股票型基金、计入权益类资产的混合型基金，不包括 QDII 基金、香港互认基金、货币市场基金、基金中基金和其他可投资公募基金的非基金中基金）以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的投资组合比例为：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%；投资于权益类资产、可转换债券（含分离交易可转债）和可交换债券的比例合计为基金资产的 5%-20%，其中，投资于境内股票资产（含股票型 ETF）的比例不低于基金资产的 5%；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，本基金持有的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。权益类资产包括

股票、存托凭证、股票型基金、计入权益类资产的混合型基金以及公开募集不动产投资信托基金。其中，上述计入权益类资产的混合型基金需符合下列两个条件之一：（1）基金合同约定股票资产及存托凭证投资比例合计不低于基金资产的 60%；（2）根据基金披露的定期报告，最近四个季度股票资产及存托凭证投资比例合计均不低于基金资产的 60%。如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

本基金的业绩比较基准为：中债-综合全价(总值)指数收益率*85%+中证 800 指数收益率*10%+活期存款基准利率*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、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”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《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》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露内容与格式准则第 2 号——定期报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》，以及中国证券投资基金业协会颁布的《公开募集证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号——年度报告和中期报告》和中国证监会、中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2026 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2026 年 4 月 21 日（基金合同生效日）起至 2026 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年自 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间系自 2026 年 4 月 21 日（基金合同生效日）起至 2026 年 6 月 30 日止。

6.4.4.2 记账本位币

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

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

(2) 金融负债分类

除由于金融资产转移不符合终止确认条件或继续涉入被转移金融资产所形成的金融负债以外，本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

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

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

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金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，其公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

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是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发

生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

交易性金融负债（含属于金融负债的衍生工具），按照公允价值进行后续计量，其公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

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。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重

新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值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作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，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) 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

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，且该种法定权利现在是可执行的，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的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现

利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

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

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或预期收益率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(3) 股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

(4) 处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(5) 买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

(6) 公允价值变动收益系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(7) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致本基金资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时予以确认。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

同一类别每一基金份额享有同等分配权。本基金收益分配方式有现金分红和红利再投资两种。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交

易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

6.4.4.12 外币交易

无

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

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

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

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

6.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

6.4.6.2 增值税

根据中华人民共和国主席令第四十一号《中华人民共和国增值税法》、中华人民共和国国务院令 826 号文《中华人民共和国增值税法实施条例》及财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号文《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》的规定，资管产品运营过程中发生的应税交易，资管产品管理人为纳税人；自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，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、债券取得的收入免征增值税；自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，金融同业往来利息收入免征增值税，金融同业往来利息收入包括金融机构与人民银行所发生的资金往来业务、银行联行往来业务、金融机构间的资金往来业务，以及金融机构开展同业存款、同业借款、同业代付、买断式买入返售金融商品、质押式买入返售金融商品、同业存单，取得的利息收入；取得存款利息收入不属于应税交易，不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局公告 2025 年第 4 号文《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》的规定，自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》及财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号文《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》的规定，自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，资管产品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，可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的规定征收率计算缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下称资管产品运营业务）和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额；

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按规定的比例缴纳。

6.4.6.3 企业所得税

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

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

6.4.6.4 个人所得税

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

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税；

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	7,136,692.91
等于：本金	7,133,426.46
加：应计利息	3,266.45
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	8,280,802.67
等于：本金	8,280,653.02
加：应计利息	149.65
减：坏账准备	-
合计	15,417,495.58

注：其他存款为本基金存放在开立于基金结算机构的证券账户内的存款。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		18,303,249.60	-	17,749,535.80	-553,713.80
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	122,405,322.62	1,153,522.42	123,474,922.42	-83,922.62
	银行间市场	121,985,843.28	1,533,281.09	123,622,281.09	103,156.72
	合计	244,391,165.90	2,686,803.51	247,097,203.51	19,234.10
资产支持证券		-	-	-	-
基金		20,602,042.39	-	19,927,472.98	-674,569.41
其他		-	-	-	-
合计		283,296,457.89	2,686,803.51	284,774,212.29	-1,209,049.11

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

无

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无

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

无

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

无

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无

6.4.7.8 其他资产

无

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	1,820.50
其中：交易所市场	-
银行间市场	1,820.50
应付利息	-
预提费用	37,911.18
合计	39,731.68

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

国金安裕债券 A

项目	本期 2026 年 4 月 21 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	120,780,608.40	120,780,608.40
本期申购	4,518.49	4,518.49
本期赎回（以“-”号填列）	-20,945,383.61	-20,945,383.61
基金拆分/份额折算前	-	-

基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	99,839,743.28	99,839,743.28

国金安裕债券 C

项目	本期 2026 年 4 月 21 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	224,495,796.28	224,495,796.28
本期申购	42,766.60	42,766.60
本期赎回（以“-”号填列）	-35,479,533.67	-35,479,533.67
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	189,059,029.21	189,059,029.21

注：1. 若本基金有分红及转换业务，申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

2. 本基金合同生效日为 2026 年 4 月 21 日。

3. 本基金设立时，国金安裕债券 A 类基金份额已收到首次募集扣除认购费后的有效净认购金额为人民币 120,765,140.96 元，折合 120,765,140.96 份国金安裕债券 A 类基金份额；有效认购款项在募集期间产生的利息为人民币 15,467.44 元，折合 15,467.44 份国金安裕债券 A 类基金份额；以上收到的实收基金共计人民币 120,780,608.40 元，折合 120,780,608.40 份国金安裕债券 A 类基金份额。国金安裕债券 C 类基金份额已收到首次募集的有效认购金额为人民币 224,471,007.77 元，折合 224,471,007.77 份国金安裕债券 C 类基金份额；有效认购款项在募集期间产生的利息为人民币 24,788.51 元，折合 24,788.51 份国金安裕债券 C 类基金份额；以上收到的实收基金共计人民币 224,495,796.28 元，折合 224,495,796.28 份国金安裕债券 C 类基金份额。国金安裕债券 A 类基金份额和 C 类基金份额收到的实收基金合计人民币 345,276,404.68 元，分别折合成 A 类及 C 类基金份额，合计折合 345,276,404.68 份国金安裕债券基金份额。

6.4.7.11 其他综合收益

无

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

国金安裕债券 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-

前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	93,411.75	-420,657.67	-327,245.92
本期基金份额交易产生的变动数	-10,230.94	86,249.86	76,018.92
其中：基金申购款	2.04	-22.63	-20.59
基金赎回款	-10,232.98	86,272.49	76,039.51
本期已分配利润	-	-	-
本期末	83,180.81	-334,407.81	-251,227.00

国金安裕债券 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	89,451.60	-788,391.44	-698,939.84
本期基金份额交易产生的变动数	-4,325.72	155,257.75	150,932.03
其中：基金申购款	6.04	-194.87	-188.83
基金赎回款	-4,331.76	155,452.62	151,120.86
本期已分配利润	-	-	-
本期末	85,125.88	-633,133.69	-548,007.81

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2026 年 4 月 21 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	231,710.74
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	560.21
结算备付金利息收入	-
其他	2,228.46
合计	234,499.41

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2026年4月21日（基金合同生效日）至2026年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-635,777.49

股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-635,777.49

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 4 月 21 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	12,676,919.58
减：卖出股票成本总额	13,284,226.34
减：交易费用	28,470.73
买卖股票差价收入	-635,777.49

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无

6.4.7.15 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 4 月 21 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
卖出/赎回基金成交总额	-
减：卖出/赎回基金成本总额	-
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	-
减：交易费用	2,060.31
基金投资收益	-2,060.31

6.4.7.16 债券投资收益

6.4.7.16.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年4月21日（基金合同生效日）至2026年6 月30日
债券投资收益——利息收入	804,525.05
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	44,110.60
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	848,635.65

6.4.7.16.2 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4月21日（基金合同生效日）至2026年 6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	41,790,210.82
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	41,367,594.53
减：应计利息总额	376,735.34
减：交易费用	1,770.35
买卖债券差价收入	44,110.60

6.4.7.16.3 债券投资收益——赎回差价收入

无

6.4.7.16.4 债券投资收益——申购差价收入

无

6.4.7.17 资产支持证券投资收益

6.4.7.17.1 资产支持证券投资收益项目构成

无

6.4.7.17.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无

6.4.7.17.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无

6.4.7.17.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无

6.4.7.18 贵金属投资收益

6.4.7.18.1 贵金属投资收益项目构成

无

6.4.7.18.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无

6.4.7.18.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无

6.4.7.18.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无

6.4.7.19 衍生工具收益

6.4.7.19.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无

6.4.7.19.2 衍生工具收益——其他投资收益

无

6.4.7.20 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 4 月 21 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	157,829.28
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	195,679.74
合计	353,509.02

6.4.7.21 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 4 月 21 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-1,209,049.11
股票投资	-553,713.80
债券投资	19,234.10
资产支持证券投资	-
基金投资	-674,569.41
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	-1,209,049.11

6.4.7.22 其他收入

无

6.4.7.23 持有基金产生的费用

项目	本期 2026 年 4 月 21 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 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）	5,332.65

当期持有基金产生的应支付托管费（元）	230.25
当期交易基金产生的交易费（元）	2,060.31

注：当期持有基金产生的应支付销售服务费、当期持有基金产生的应支付管理费、当期持有基金产生的应支付托管费按照被投资基金的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，该披露金额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的基金合同约定的费率和计算方法计算得出，不构成本基金的费用项目。

6.4.7.24 信用减值损失

无

6.4.7.25 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 4 月 21 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	9,744.75
信息披露费	23,666.43
证券出借违约金	-
账户维护费	4,500.00
其他	400.00
合计	38,311.18

6.4.7.26 分部报告

无

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金并无须作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

本报告期内未发生变化。

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
国金基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构
广发证券股份有限公司	基金托管人、基金代销机构、基金结算机构
国金证券股份有限公司	基金管理人股东、基金代销机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 4 月 21 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例（%）
广发证券股份有限公司	44,264,395.52	100.00

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 4 月 21 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例（%）
广发证券股份有限公司	184,986,502.97	100.00

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 4 月 21 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例（%）
广发证券股份有限公司	45,500,000.00	100.00

6.4.10.1.4 基金交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 4 月 21 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期基金 成交总额的比例（%）
广发证券股份有限公司	20,602,042.39	100.00

6.4.10.1.5 权证交易

无

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4月21日（基金合同生效日）至2026年6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 （%）

广发证券股份有 限公司	21,419.28	100.00	-	-
----------------	-----------	--------	---	---

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费和经手费后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究服务。

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 4 月 21 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	390,800.77
其中：应支付销售机构的客户维护费	175,216.23
应支付基金管理人的净管理费	215,584.54

注：1. 本基金投资于本基金管理人所管理的其他公开募集证券投资基金的部分不收取管理费。本基金的管理费按前一日基金资产净值扣除本基金持有的基金管理人自身管理的其他公开募集证券投资基金部分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。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本基金持有的基金管理人自身管理的其他公开募集证券投资基金部分所对应资产净值后的余额，若为负数，则 E 取 0。

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。费用扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 4 月 21 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
----	---

	日
当期发生的基金应支付的托管费	97,700.19

注：本基金投资于本基金托管人所托管的其他公开募集证券投资基金的部分不收取托管费。本基金的托管费按前一日基金资产净值扣除本基金持有的基金托管人自身托管的其他公开募集证券投资基金部分所对应资产净值后的余额（若为负数，则取 0）的 0.15%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$H=E\times 0.15\%\div \text{当年天数}$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值扣除本基金持有的基金托管人自身托管的其他公开募集证券投资基金部分所对应资产净值后的余额，若为负数，则 E 取 0。

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。

若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。费用扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

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 4 月 21 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国金安裕债券 A	国金安裕债券 C	合计
国金证券股份有限公司	-	3,830.79	3,830.79
广发证券股份有限公司	-	78,897.84	78,897.84
合计	-	82,728.63	82,728.63

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。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 类基金份额前一日基金资产净值

C 类基金份额的基金销售服务费每日计提。

（1）基金管理人的销售服务费返还机制

通过基金管理人认购/申购 C 类基金份额的不收取销售服务费。

对于通过基金管理人认购/申购该类基金份额的情况，将先行计提相应的销售服务费，在投资者赎回该笔基金份额或基金合同终止时，该费用将随同赎回款（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) 其他销售机构的销售服务费的收取与返还机制

对于投资者持续持有期限未超过一年（即 365 天，下同）的 C 类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，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给登记机构，由登记机构代付给销售机构。

对于通过其他销售机构认购/申购并且持续持有期限超过一年的 C 类基金份额，不再继续收取销售服务费。

对于持续持有期限超过一年的 C 类基金份额，将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，该费用随赎回款（或清算款）一并返还给投资者。

若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。费用扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

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

无

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

无

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

无

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

无

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

国金安裕债券 A

关联方名称	本期末
	2026 年 6 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（%）
广发证券股份有限公司	20,000,777.78	20.0329

注：除基金管理人之外的其他关联方持有本基金基金份额的交易费用按市场公开的交易费率计算并支付。

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 2026 年 4 月 21 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
广发证券股份有限公司-活期存款	7,136,692.91	231,710.74
广发证券股份有限公司-其他存款	8,280,802.67	560.21

注：1. 本基金的其他存款为存放在开立于基金结算机构证券账户中的证券交易结算资金，按协议约定利率计息。

2. 除其他存款外，本基金的上述存款按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于本报告期内未参与关联方承销期内承销的证券。

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

无

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末进行利润分配。

6.4.12 期末（2026 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无

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为人民币 1,000,042.47 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
232480004	24 农行二级资本债 01A	2026 年 7 月 1 日	103.99	12,000	1,247,845.81
合计				12,000	1,247,845.81

注：期末估值总额=期末估值单价（保留小数点后无限位）×数量。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2026 年 6 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为人民币 7,499,992.50 元，于 2026 年 7 月 1 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无

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

本基金管理人的风险管理政策是通过事前充分到位的防范、事中实时有效的过程控制、事后完备可追踪的检查和反馈，将风险管理贯穿于投研运作的整个流程，从而使基金投资风险可测、可控、可承担，有效防范和化解投研业务的市场风险、信用风险、流动性风险及操作风险。

本基金管理人建立了董事会领导下的架构清晰、控制有效、系统全面、切实可行的风险管理组织体系，合规风控部风险管理团队在识别、衡量投资风险后，通过正式报告的方式，将分析结果及时传达给基金经理、投资总监、投资决策委员会和风险控制委员会，协助制定风险控制决策，实现风险管理目标。

董事会负责公司整体风险的预防和控制，审核、监督公司风险控制制度的有效执行。董事会下设风险管理委员会，并制定《风险管理委员会议事规则》，规范其组成人员、职责、议事规则等事宜。

督察长负责公司及其投资组合运作的监察稽核工作，向董事会汇报。

总经理办公会负责公司日常经营管理中的风险控制工作。总经理办公会下设投资决策委员会

和风险控制委员会，负责对公司经营及投资组合运作中的风险进行识别、评估和防控。公司制定《风险控制委员会议事规则》，规范其组成人员、职责、议事规则等事宜。

本基金管理人推行全员风险管理理念，公司各部门是风险管理的一线部门，公司各部门负责人是其部门风险管理的第一责任人，根据公司制度规定的各项作业流程和规范，加强对风险的控制。

本基金管理人实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制，基金经理是本基金风险管理的第一责任人。

合规风控部监察稽核团队负责对风险控制制度的建立和落实情况进行监督，在职权范围内独立履行检查、评价、报告、建议职能；合规风控部风险管理团队独立于投资研究体系，负责落实具体的风险管理政策，对投资进行事前、事中及事后的风险管理。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，并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

本基金本报告期末未持有按短期信用评级的债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末未持有按短期信用评级的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末未持有按短期信用评级的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2026 年 6 月 30 日
AAA	247,097,203.51
AAA 以下	—
未评级	—
合计	247,097,203.51

注：表中所列示的债券投资为除短期融资券、超短期融资券及其他按短期信用评级的债券投资、国债、政策性金融债、央行票据、地方债以外的债券投资。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末未持有按长期信用评级的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末未持有按长期信用评级的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及《公开募集证券投资基金侧袋机制指引(试行)》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。并于开放日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。当本基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，本基金的基金管理人经与基金托管人协商一致，并咨询会计师事务所意见后，可以依照法律法规及基金合同的约定启用侧袋机制，最大限度保护基金份额持有人利益。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

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

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年6 月 30 日	1个月以内	1-3 个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	15,417,495.58	-	-	-	-	-	15,417,495.58
交易性金融资产	213,658.36	-	462,105.75	184,001,509.48	62,419,929.92	37,677,008.78	284,774,212.29
应收申购款	-	-	-	-	-	3,020.00	3,020.00
资产总计	15,631,153.94	-	462,105.75	184,001,509.48	62,419,929.92	37,680,028.78	300,194,727.87
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	3,306,712.83	3,306,712.83
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	163,852.93	163,852.93
应付托管费	-	-	-	-	-	40,963.21	40,963.21
卖出回购金融资产	8,500,034.97	-	-	-	-	-	8,500,034.97

款							
应付 销售 服务 费		-	-	-	-	35,597.80	35,597.80
应交 税费		-	-	-	-	8,296.77	8,296.77
其他 负债		-	-	-	-	39,731.68	39,731.68
负债 总计	8,500,034.97	-	-	-	-	3,595,155.22	12,095,190.19
利率 敏感 度缺 口	7,131,118.97	-462,105.75	184,001,509.48	62,419,929.92	34,084,873.56	288,099,537.68	

注：1、各期限分类的标准为按金融资产或金融负债的重新定价日、行权日或到期日孰早者进行分类。

2、本基金合同自 2026 年 4 月 21 日起生效，无上年度可比期间数据。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	该利率敏感性分析基于本基金报表日的利率风险状况；	
	假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他变量不变；	
	此项影响并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动。	
分析	相关风险变量的变	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）
	动	本期末（2026 年 6 月 30 日）
	+25 个基准点	-1,358,406.38
	-25 个基准点	1,367,239.26

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇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。本基金主要投资于交易所上市或银行间同业市场交易的证券等，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。本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资

产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。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的风险及潜在价格风险进行度量和测试，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产－股票投资	17,749,535.80	6.16
交易性金融资产－基金投资	19,927,472.98	6.92
交易性金融资产－债券投资	247,097,203.51	85.77
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	284,774,212.29	98.85

注：1、由于四舍五入的原因公允价值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

2、本基金合同自 2026 年 4 月 21 日起生效，无上年度可比期间数据。

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。	
	Beta 系数是根据组合报告期内所有交易日的净值数据和业绩比较基准数据回归得出，反映了基金和业绩比较基准的相关性。	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末（2026 年 6 月 30 日）
	+5%	6,666,239.59
	-5%	-6,666,239.59

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

本基金未采用风险价值法或类似方法进行分析、管理市场风险。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定： 第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价； 第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值； 第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026 年 6 月 30 日
第一层次	38,944,819.96
第二层次	245,829,392.33
第三层次	-
合计	284,774,212.29

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券、基金等投资，若出现交易不活跃（包括重大事项停牌、境内股票涨跌停等导致的交易不活跃）和非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的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，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。本基金政策以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。
--

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	17,749,535.80	5.91
	其中：股票	17,749,535.80	5.91
2	基金投资	19,927,472.98	6.64
3	固定收益投资	247,097,203.51	82.31
	其中：债券	247,097,203.51	82.31
	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	15,417,495.58	5.14
8	其他各项资产	3,020.00	0.00
9	合计	300,194,727.87	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

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	2,550,330.00	0.89
C	制造业	11,399,575.80	3.96
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	317,640.00	0.11
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	398,840.00	0.14
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	386,220.00	0.13
J	金融业	1,949,870.00	0.68
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	747,060.00	0.26
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-

O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	17,749,535.80	6.16

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	002475	立讯精密	13,000	915,200.00	0.32
2	300308	中际旭创	600	762,000.00	0.26
3	603259	药明康德	6,000	747,060.00	0.26
4	300274	阳光电源	4,500	715,590.00	0.25
5	002371	北方华创	800	707,648.00	0.25
6	000333	美的集团	8,000	604,240.00	0.21
7	300750	宁德时代	1,400	550,214.00	0.19
8	601899	紫金矿业	21,000	527,940.00	0.18
9	688629	华丰科技	2,500	468,775.00	0.16
10	000831	中国稀土	8,000	443,920.00	0.15
11	603019	中科曙光	4,000	428,920.00	0.15
12	600036	招商银行	12,000	426,000.00	0.15
13	601628	中国人寿	12,000	424,200.00	0.15
14	002415	海康威视	12,000	410,400.00	0.14
15	601088	中国神华	10,000	390,400.00	0.14
16	600887	伊利股份	16,000	383,360.00	0.13
17	600188	兖矿能源	20,000	355,400.00	0.12
18	600926	杭州银行	23,000	332,350.00	0.12
19	600900	长江电力	12,000	317,640.00	0.11
19	688981	中芯国际	2,000	317,640.00	0.11
20	002050	三花智控	7,000	306,810.00	0.11
21	002463	沪电股份	2,000	305,600.00	0.11
22	601225	陕西煤业	15,000	305,250.00	0.11
23	002468	申通快递	20,000	291,200.00	0.10
24	600030	中信证券	10,000	287,300.00	0.10
25	002064	华峰化学	30,000	284,700.00	0.10
26	601600	中国铝业	34,000	279,480.00	0.10
27	002532	天山铝业	26,000	278,980.00	0.10
28	002128	电投能源	12,000	277,440.00	0.10

29	000807	云铝股份	12,000	265,680.00	0.09
30	600941	中国移动	3,000	258,390.00	0.09
31	601336	新华保险	4,000	238,640.00	0.08
32	002595	豪迈科技	4,770	222,282.00	0.08
33	601233	桐昆股份	10,000	216,500.00	0.08
34	601138	工业富联	3,000	216,450.00	0.08
35	603993	洛阳钼业	12,000	210,600.00	0.07
36	002422	科伦药业	5,000	192,600.00	0.07
37	600111	北方稀土	4,000	192,200.00	0.07
38	601211	国泰海通	10,000	182,000.00	0.06
39	300394	天孚通信	600	181,608.00	0.06
40	300672	国科微	600	177,000.00	0.06
41	600176	中国巨石	2,000	145,760.00	0.05
42	601699	潞安环能	10,000	142,800.00	0.05
43	301031	中熔电气	1,184	141,428.80	0.05
44	600309	万华化学	2,000	136,820.00	0.05
45	000975	山金国际	8,000	136,000.00	0.05
46	600150	中国船舶	4,000	135,160.00	0.05
47	688111	金山办公	600	127,830.00	0.04
48	300502	新易盛	200	121,400.00	0.04
49	600219	南山铝业	30,000	119,700.00	0.04
50	601869	长飞光纤	200	109,180.00	0.04
51	600026	中远海能	6,000	107,640.00	0.04
52	002273	水晶光电	3,000	106,440.00	0.04
53	002938	鹏鼎控股	1,000	105,380.00	0.04
54	600183	生益科技	600	104,040.00	0.04
55	300285	国瓷材料	1,000	103,180.00	0.04
56	300408	三环集团	600	100,140.00	0.03
57	688012	中微公司	200	93,700.00	0.03
58	601001	晋控煤业	5,000	86,950.00	0.03
59	600938	中国海油	3,000	81,450.00	0.03
60	002142	宁波银行	2,000	59,380.00	0.02
61	002293	罗莱生活	5,000	49,450.00	0.02
62	600489	中金黄金	2,000	36,100.00	0.01

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	300308	中际旭创	1,011,536.00	0.35
2	002475	立讯精密	916,975.00	0.32
3	600309	万华化学	729,983.00	0.25
4	600036	招商银行	689,134.00	0.24

5	601899	紫金矿业	677,322.00	0.24
6	002468	申通快递	664,233.00	0.23
7	300274	阳光电源	661,349.00	0.23
8	000333	美的集团	647,297.00	0.22
9	603259	药明康德	625,437.00	0.22
10	002595	豪迈科技	614,515.55	0.21
11	300750	宁德时代	587,899.00	0.20
12	600887	伊利股份	554,279.00	0.19
13	002050	三花智控	531,244.00	0.18
14	002128	电投能源	499,181.00	0.17
15	300502	新易盛	491,005.00	0.17
16	601138	工业富联	487,400.00	0.17
17	601225	陕西煤业	484,463.00	0.17
18	002371	北方华创	475,290.00	0.16
19	600188	兖矿能源	454,702.00	0.16
20	601088	中国神华	454,317.00	0.16

注：上述买入金额为买入成交金额（成交单价乘以成交数量），不包括相关交易费用。

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	600309	万华化学	473,468.00	0.16
2	300502	新易盛	437,669.20	0.15
3	601318	中国平安	414,781.00	0.14
4	600031	三一重工	390,689.00	0.14
5	600989	宝丰能源	388,158.00	0.13
6	300308	中际旭创	346,203.00	0.12
7	002468	申通快递	319,503.00	0.11
8	002595	豪迈科技	307,780.00	0.11
9	601398	工商银行	303,200.00	0.11
10	601138	工业富联	294,626.00	0.10
11	601100	恒立液压	283,564.00	0.10
12	688122	西部超导	282,462.88	0.10
13	000338	潍柴动力	282,280.00	0.10
14	600176	中国巨石	276,468.00	0.10
15	300285	国瓷材料	272,552.00	0.09
16	301291	明阳电气	271,881.00	0.09
17	000960	锡业股份	257,485.00	0.09
18	601058	赛轮轮胎	247,624.00	0.09
19	000792	盐湖股份	245,386.00	0.09
20	600036	招商银行	228,261.00	0.08

注：上述卖出金额为卖出成交金额（成交单价乘以成交数量），不包括相关交易费用。

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	31,587,475.94
卖出股票收入（成交）总额	12,676,919.58

注：上述买入股票成本总额和卖出股票收入总额均为买卖成交金额（成交单价乘以成交数量），不包括相关交易费用。

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	103,296,719.45	35.85
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	122,207,111.24	42.42
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	20,325,561.64	7.06
7	可转债（可交换债）	1,267,811.18	0.44
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	247,097,203.51	85.77

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	232480004	24 农行二级资本债 01A	200,000	20,797,430.14	7.22
2	232480073	24 工行二级资本债 02BC	200,000	20,759,570.41	7.21
3	092202005	22 国开行二级资本债 01A	200,000	20,731,232.88	7.20
4	312510006	25 中行 TLAC 非资本债 01(BC)	200,000	20,415,095.89	7.09
5	244110	华电 YK21	200,000	20,352,709.04	7.06

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

无

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

无

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

无

7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.10.1 本期国债期货投资政策

本基金报告期内未参与国债期货投资。

7.10.2 本期国债期货投资评价

本基金报告期内未参与国债期货投资。

7.11 本报告期投资基金情况

7.11.1 投资政策及风险说明

本基金可投资于全市场的股票型 ETF、公开募集不动产投资信托基金及本基金管理人旗下的股票型基金、计入权益类资产的混合型基金。本基金不得投资于本基金管理人旗下的公开募集不动产投资信托基金。对于主动管理类基金，本基金从基金风格、业绩表现、稳定性、规模变化等多角度进行分析，通过风险调整后收益及风险控制等量化指标对基金进行分析，筛选基金进行投资；对于被动管理类基金，本基金将从标的指数表现、跟踪误差、超额收益、基金规模变化等多角度进行分析；对于公开募集不动产投资信托基金，本基金管理人将结合所投资商业不动产/基础设施资产类型、运营情况、财务数据以及现金流分派情况等进行项目综合分析，筛选现金流稳定、运营情况良好的基金进行投资。本基金还将定期对基金投资组合进行回顾和动态调整，剔除不再符合筛选标准的基金，增加符合筛选标准的基金，以实现基金投资组合的优化。

本基金为债券型基金，理论上其预期风险和预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

7.11.2 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	508068	华夏北京保障房中心租赁住房封闭式基础	契约型封闭式	320,000.00	1,277,760.00	0.44	否

		设施 (REITs)					
2	508028	中信建 投国家 电投新 能源封 闭式基 础设施 (REITs)	契约 型封 闭式	125,000.00	1,231,625.00	0.43	否
3	180601	华夏华 润消费 封闭式 基础设 施 (REITs)	契约 型封 闭式	116,200.00	1,138,760.00	0.40	否
4	508005	华夏首 创奥特 莱斯封 闭式基 础设施 REITs	契约 型封 闭式	267,400.00	1,093,666.00	0.38	否
5	508058	中金厦 门安居 保障性 租赁住 房封闭 式基础 设施 (REITs)	契约 型封 闭式	270,375.00	1,053,651.38	0.37	否
6	180701	银华绍 兴原水 水利封 闭式基 础设施 (REITs)	契约 型封 闭式	264,300.00	1,023,105.30	0.36	否
7	508026	嘉实中 国电建	契约 型封	262,400.00	989,248.00	0.34	否

		清洁能源封闭式基础设施 (REITs)	闭式				
8	508011	嘉实物美消费封闭式基础设施 (REITs)	契约型封闭式	272,800.00	988,627.20	0.34	否
9	508098	嘉实京东仓储物流封闭式基础设施 (REITs)	契约型封闭式	274,700.00	952,384.90	0.33	否
10	508006	富国首创水务封闭式基础设施 (REITs)	契约型封闭式	263,400.00	932,962.80	0.32	否
11	180603	华夏大悦城购物中心封闭式基础设施 (REITs)	契约型封闭式	210,000.00	932,400.00	0.32	否
12	508069	华夏南京交通高速公路封闭式基础设施 (REITs)	契约型封闭式	167,200.00	929,632.00	0.32	否

13	508002	华安百联消费封闭式基础设施 REITs	契约型封闭式	310,000.00	904,890.00	0.31	否
14	508018	华夏中国交建高速公路封闭式基础设施 (REITs)	契约型封闭式	150,000.00	887,400.00	0.31	否
15	180305	南方顺丰仓储物流封闭式基础设施 (REITs)	契约型封闭式	254,300.00	867,925.90	0.30	否
16	508087	国泰海通济南能源供热封闭式基础设施 (REITs)	契约型封闭式	78,800.00	857,974.40	0.30	否
17	508089	华夏特变电工新能源封闭式基础设施 (REITs)	契约型封闭式	181,500.00	853,957.50	0.30	否
18	180401	鹏华深圳能源清洁能源封闭	契约型封闭式	130,000.00	741,910.00	0.26	否

		式基础设施 (REITs)					
19	180501	红土创新深圳安居租赁住房封闭式基础设施 (REITs)	契约型封闭式	198,340.00	672,372.60	0.23	否
20	508084	汇添富九州通医药仓储物流封闭式基础设施 (REITs)	契约型封闭式	120,000.00	477,000.00	0.17	否
21	508003	中金联东科技创新产业园封闭式基础设施 (REITs)	契约型封闭式	120,000.00	427,320.00	0.15	否
22	180202	华夏越秀高速公路封闭式基础设施 (REITs)	契约型封闭式	80,000.00	382,400.00	0.13	否
23	180502	招商基金招商蛇口租赁住房封闭式	契约型封闭式	90,000.00	310,500.00	0.11	否

		基础设施 (REITs)					
--	--	-----------------	--	--	--	--	--

7.11.3 报告期末基金持有的全部公开募集不动产投资信托基金情况

合计持有数量（只）	合计持有份额（份）	合计公允价值（元）	合计占基金资产 净值比例（%）
23	4,526,715.00	19,927,472.98	6.92

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国农业银行股份有限公司在报告编制日前一年内被国家金融监督管理总局处罚。中国工商银行股份有限公司在报告编制日前一年内被中国人民银行、国家金融监督管理总局、国家外汇管理局处罚。国家开发银行在报告编制日前一年内被中国人民银行、国家外汇管理局处罚。中国银行股份有限公司在报告编制日前一年内被国家金融监督管理总局处罚。中国民生银行股份有限公司在报告编制日前一年内被国家金融监督管理总局、国家金融监督管理总局宁波监管局处罚。

除上述情况外，本基金投资的其他前十名证券的发行主体未出现本期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。本基金投资上述主体的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

7.12.2 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

本报告期，基金投资的前十名股票未超出基金合同约定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	3,020.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,020.00

7.12.4 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	462,105.75	0.16
2	113052	兴业转债	460,350.58	0.16
3	110073	国投转债	213,658.36	0.07
4	127110	广核转债	131,696.49	0.05

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无

§ 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（%）
国金安裕债券 A	624	159,999.59	21,297,169.45	21.33	78,542,573.83	78.67
国金安裕债券 C	1,597	118,383.86	30,502,255.55	16.13	158,556,773.66	83.87
合计	2,221	130,075.99	51,799,425.00	17.93	237,099,347.49	82.07

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	国金安裕债券 A	—	—
	国金安裕债券 C	3,000.93	0.0016
	合计	3,000.93	0.0010

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、基金投资和相关部门负责人持有本开	国金安裕债券 A	0
	国金安裕债券 C	0

放式基金		
	合计	0
本基金基金经理持有 本开放式基金	国金安裕债券 A	0
	国金安裕债券 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	国金安裕债券 A	国金安裕债券 C
基金合同生效日 （2026 年 4 月 21 日）基金份额总额	120,780,608.40	224,495,796.28
基金合同生效日起 至报告期期末基金 总申购份额	4,518.49	42,766.60
减：基金合同生效 日起至报告期期末 基金总赎回份额	20,945,383.61	35,479,533.67
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	99,839,743.28	189,059,029.21

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内，本基金无投资策略的重大变更。

10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

无。

10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务至今，本报告期内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，基金管理人高级管理人员及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

本报告期内，托管人在开展基金托管业务过程中未受到相关监管部门调查或处罚。

10.7.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，托管人分管公募基金托管业务的高级管理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 (%)	
广发证券	3	44,264,395.52	100.00	21,419.28	100.00	-

注：（一）选择标准

- 1. 具备相关业务资质，公司经营行为规范；
- 2. 财务状况良好，公司经营状况稳定；
- 3. 具备较强的交易服务能力，相关制度建设、人员配置、系统建设等满足基金进行证券交易的需要；
- 4. 具备较强的研究服务能力，相关制度建设、人员配置、研究能力、研究质量等可以保障较为专业、审慎的研究服务；
- 5. 具备较强的合规风控能力，合规风控管理体系机制较为健全；
- 6. 交易佣金费率标准符合要求。

（二）选择程序

- 1. 基金管理人根据上述标准选用符合条件的证券公司；
- 2. 基金管理人和被选用的证券公司签订协议。

（三）变更情况

本基金本报告期新增广发证券 3 个交易单元。

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 (%)
广 发 证 券	184,986,502.97	100.00	45,500,000.00	100.00	-	-	20,602,042.39	100.00

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	《国金安裕债券型证券投资基金基金合同生效公告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2026 年 4 月 22 日
2	《2025 年度国金基金管理有限公司 以股东身份（通过公募基金持股） 参与股东大会投票信息披露》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2026 年 4 月 24 日
3	《国金基金管理有限公司关于终止 中证金牛（北京）基金销售有限公 司办理旗下基金相关业务公告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2026 年 5 月 29 日
4	《关于国金安裕债券型证券投资基 金开放日常申购、赎回、基金转换 及定期定额投资业务的公告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2026 年 6 月 17 日
5	《国金基金管理有限公司关于终止 上海凯石财富基金销售有限公司办 理旗下基金相关业务公告》	指定披露媒体和本基金 基金管理人网站	2026 年 6 月 18 日

6	《国金基金管理有限公司关于旗下部分基金调整业绩比较基准并修订基金合同等法律文件的公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2026 年 6 月 27 日
7	《国金基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份资料信息的公告》	指定披露媒体和本基金基金管理人网站	2026 年 6 月 30 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准基金募集注册的文件；
- 2、国金安裕债券型证券投资基金基金合同；
- 3、国金安裕债券型证券投资基金托管协议；
- 4、国金安裕债券型证券投资基金招募说明书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、报告期内披露的各项公告。

12.2 存放地点

北京市朝阳区景辉街 31 号院 1 号楼三星大厦 51 层。

12.3 查阅方式

投资者可到基金管理人、基金托管人的办公场所或基金管理人网站免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

投资者对本报告如有疑问，可咨询本管理人。

咨询电话：4000-2000-18

公司网址：www.gfund.com

国金基金管理有限公司

2026 年 8 月 29 日