

# 惠升和韵 66 个月定期开放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:惠升基金管理有限责任公司

基金托管人:招商银行股份有限公司

送出日期:2026 年 08 月 31 日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2026年8月28日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2026年01月01日起至2026年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                         | 5  |
| 2.4 信息披露方式                              | 6  |
| 2.5 其他相关资料                              | 6  |
| §3 主要财务指标和基金净值表现                        | 6  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 6  |
| 3.2 基金净值表现                              | 7  |
| §4 管理人报告                                | 8  |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 8  |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明              | 9  |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 9  |
| 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             | 10 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 10 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 10 |
| 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       | 10 |
| §5 托管人报告                                | 11 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 11 |
| 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 | 11 |
| 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       | 11 |
| §6 半年度财务会计报告（未经审计）                      | 11 |
| 6.1 资产负债表                               | 11 |
| 6.2 利润表                                 | 13 |
| 6.3 净资产变动表                              | 15 |
| 6.4 报表附注                                | 17 |
| §7 投资组合报告                               | 35 |
| 7.1 期末基金资产组合情况                          | 35 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合                    | 36 |
| 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       | 36 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动                     | 36 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 36 |
| 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      | 37 |
| 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   | 37 |
| 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   | 37 |
| 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      | 37 |
| 7.10 本基金投资股指期货的投资政策                     | 38 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明               | 38 |
| 7.12 投资组合报告附注                           | 38 |
| §8 基金份额持有人信息                            | 38 |

|                                          |    |
|------------------------------------------|----|
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....              | 38 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....           | 39 |
| 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 .....   | 39 |
| §9 开放式基金份额变动 .....                       | 39 |
| §10 重大事件揭示 .....                         | 39 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 .....                   | 39 |
| 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 .....   | 40 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....        | 40 |
| 10.4 基金投资策略的改变 .....                     | 40 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....              | 40 |
| 10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 .....       | 40 |
| 10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况 .....   | 40 |
| 10.8 其他重大事件 .....                        | 41 |
| §11 影响投资者决策的其他重要信息 .....                 | 44 |
| 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 ..... | 44 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....                | 44 |
| §12 备查文件目录 .....                         | 44 |
| 12.1 备查文件目录 .....                        | 44 |
| 12.2 存放地点 .....                          | 44 |
| 12.3 查阅方式 .....                          | 45 |

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

|            |                       |
|------------|-----------------------|
| 基金名称       | 惠升和韵66个月定期开放债券型证券投资基金 |
| 基金简称       | 惠升和韵66个月定开债券          |
| 基金主代码      | 010631                |
| 基金运作方式     | 契约型定期开放式              |
| 基金合同生效日    | 2020年12月16日           |
| 基金管理人      | 惠升基金管理有限责任公司          |
| 基金托管人      | 招商银行股份有限公司            |
| 报告期末基金份额总额 | 7,629,806,232.05份     |
| 基金合同存续期    | 不定期                   |

2.2 基金产品说明

|        |                                                                                                                                                                           |
|--------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标   | 本基金封闭期内采取买入持有到期投资策略，投资于剩余期限（或回售期限）不超过基金剩余封闭期的固定收益类工具，力求基金资产的稳健增值。                                                                                                         |
| 投资策略   | 本基金以封闭期为周期进行投资运作。在封闭期内，本基金采用买入并持有到期策略构建投资组合，所投金融资产以收取合同现金流量为目的并持有到期，且所投资产到期日（或回售期限）不得晚于本基金封闭期到期日。投资于含回售权的债券，应在投资该债券前确定行使回售权或持有到期的时间，债券到期日晚于封闭期到期日的，基金管理人应当行使回售权而不应当持有至到期。 |
| 业绩比较基准 | 每个封闭期起始日的中国人民银行公布并执行的三年期银行定期存款利率（税后）+0.75%。                                                                                                                               |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，其长期平均预期风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金、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      |      | 惠升基金管理有限责任公司               | 招商银行股份有限公司                  |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 叶金松                        | 张姗                          |
|         | 联系电话 | 010-86329066               | 400-61-95555                |
|         | 电子邮箱 | yejs@risingamc.com         | zhangshan_1027@cmbchina.com |
| 客户服务电话  |      | 4000005588                 | 400-61-95555                |
| 传真      |      | 010-86329180               | 0755-83195201               |
| 注册地址    |      | 西藏自治区拉萨市柳梧新区国际总部城3栋1单元4层7号 | 深圳市深南大道7088号招商银行大厦          |
| 办公地址    |      | 北京市西城区金融大街27号投资广场B座18层     | 深圳市深南大道7088号招商银行大厦          |
| 邮政编码    |      | 100033                     | 518040                      |
| 法定代表人   |      | 张金锋                        | 缪建民                         |

2.4 信息披露方式

|                   |                        |
|-------------------|------------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称    | 上海证券报                  |
| 登载基金中期报告的管理人互联网网址 | www.risingamc.com      |
| 基金中期报告置备地点        | 北京市西城区金融大街27号投资广场B座18层 |

2.5 其他相关资料

|        |              |                        |
|--------|--------------|------------------------|
| 项目     | 名称           | 办公地址                   |
| 注册登记机构 | 惠升基金管理有限责任公司 | 北京市西城区金融大街27号投资广场B座18层 |

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

|               |                                    |
|---------------|------------------------------------|
| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期<br>(2026年01月01日 - 2026年06月30日) |
|---------------|------------------------------------|

|                      |                       |
|----------------------|-----------------------|
| 本期已实现收益              | 75,695,998.22         |
| 本期利润                 | 75,695,998.22         |
| 加权平均基金份额本期利润         | 0.0124                |
| 本期加权平均净值利润率          | 1.14%                 |
| 本期基金份额净值增长率          | 1.16%                 |
| <b>3.1.2 期末数据和指标</b> | 报告期末<br>(2026年06月30日) |
| 期末可供分配利润             | 370,702,298.69        |
| 期末可供分配基金份额利润         | 0.0486                |
| 期末基金资产净值             | 8,000,508,530.74      |
| 期末基金份额净值             | 1.0486                |
| <b>3.1.3 累计期末指标</b>  | 报告期末<br>(2026年06月30日) |
| 基金份额累计净值增长率          | 20.65%                |

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

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

③期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

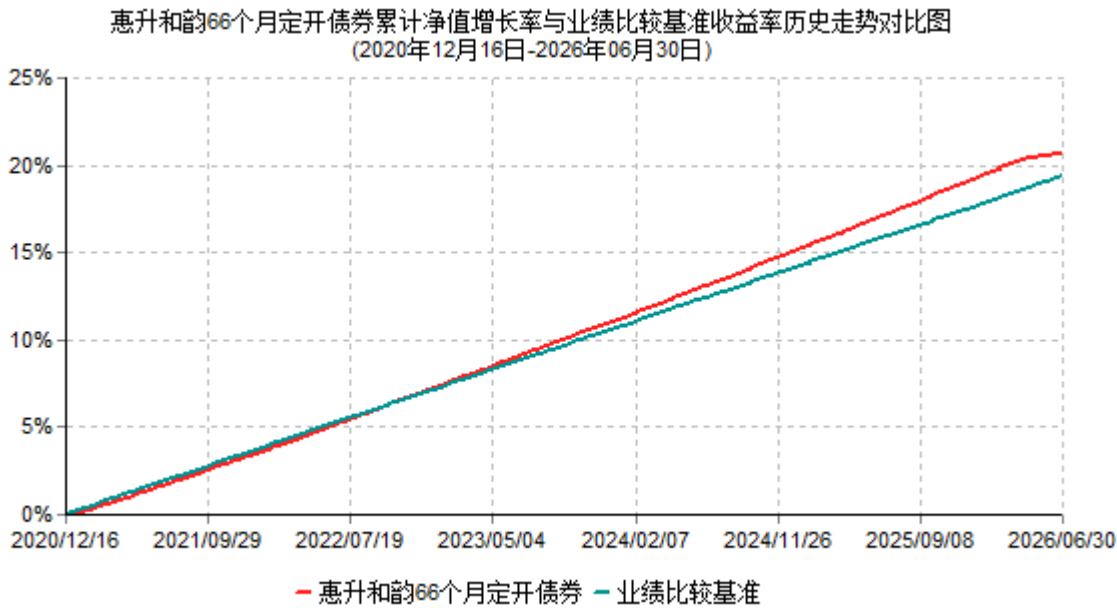
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 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 | 0.34%    | 0.01%       | 0.87%      | 0.01%         | -0.53% | 0.00% |
| 过去六个月 | 1.16%    | 0.01%       | 1.74%      | 0.01%         | -0.58% | 0.00% |
| 过去一年  | 3.00%    | 0.01%       | 3.50%      | 0.01%         | -0.50% | 0.00% |
| 过去三年  | 10.53%   | 0.01%       | 10.51%     | 0.01%         | 0.02%  | 0.00% |

|            |        |       |        |       |       |       |
|------------|--------|-------|--------|-------|-------|-------|
| 过去五年       | 18.70% | 0.01% | 17.51% | 0.01% | 1.19% | 0.00% |
| 自基金合同生效起至今 | 20.65% | 0.01% | 19.40% | 0.01% | 1.25% | 0.00% |

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



§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

惠升基金管理有限责任公司于2018年9月28日正式成立，2019年4月26日取得《经营证券期货业务许可证》。公司股东为张金锋、孙庆、西藏宁算科技集团有限公司等，注册资本为1.2亿元人民币，注册地为西藏自治区拉萨市。公司经营范围包括公开募集证券投资基金管理、基金销售、特定客户资产管理和中国证监会许可的其他业务。

截至2026年6月30日，惠升基金管理有限责任公司共管理惠升和风纯债债券型证券投资基金、惠升惠泽灵活配置混合型发起式证券投资基金等共二十九只公募基金。

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） | 证券从业 | 说明 |
|----|----|---------------|------|----|
|----|----|---------------|------|----|

|    |          | 期限         |      | 年限  |                                                                                                           |
|----|----------|------------|------|-----|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|    |          | 任职日期       | 离任日期 |     |                                                                                                           |
| 卓勇 | 本基金的基金经理 | 2020-12-16 | -    | 20年 | 硕士。曾任职于中信建投证券股份有限公司，广州吉富创业投资公司，深圳康曼德资本管理有限公司等。现任惠升基金管理有限责任公司基金经理。2020年12月16日起担任惠升和韵66个月定期开放债券型证券投资基金基金经理。 |

注：①上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。  
②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。  
③本基金本报告期内没有基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《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》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司开展投资、研究活动防控内幕交易指导意见》等法律法规和基金合同，本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有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

公司一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《惠升基金管理有限责任公司公平交易管理办法》的规定。利用统计分析的方法和工具，按照不同的时间窗口（包括1日内、3日内、5日内），对报告期内的同向交易价差进行了分析，未发现违反公平交易原则的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。本报告期内，未出现涉及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年GDP实际增速4.7%，落在年度目标内，二季度平减指数同比为1.53%，中国经济13个季度以来首次走出综合价格负增长区间，上半年高技术制造业增加值同比增长13.3%，年度口径属2022年以来最快，中国经济的新旧动能转换取得较明显进展。结构上，外需较强，内需疲弱，固投，消费，城镇新增就业人数同比较弱，“K型”分化明显。政策上，货币政策呵护，流动性整体供给充裕；财政政策支出不及预期，政策有待后续落实和加强。债券市场在绝对利率较低的情况下继续震荡向下，且波动率偏低。组合继续控制日常融资成本，力求在控制风险的前提下提升组合回报。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末惠升和韵66个月定开债券基金份额净值为1.0486元，本报告期内，基金份额净值增长率为1.16%，同期业绩比较基准收益率为1.74%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，广义财政政策的力度和节奏值得关注。财政政策端发力是改变目前内需偏弱的必要措施。货币政策更大层面上是配合的角色，更多政策的有力配合才会边际上优化目前经济增长的结构。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及基金合同约定，本基金管理人作为准确、及时进行基金估值和份额净值计价，制定了基金估值和份额净值计价的业务管理制度，成立了估值委员会，使用可靠的估值业务系统，设有完善的风险监测、控制和报告机制。本基金托管人审阅本基金管理人采用的估值原则及技术，并复核、审查基金资产净值和基金份额申购、赎回价格。与估值相关的机构包括但不限于上海、深圳证券交易所，中国证券登记结算有限责任公司，中央国债登记结算有限责任公司，中证指数有限公司以及中国证券投资基金业协会等。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期实施利润分配1次，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

报告期内，本基金未出现连续二十个工作日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

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：惠升和韵66个月定期开放债券型证券投资基金

报告截止日：2026年06月30日

单位：人民币元

| 资 产     | 附注号     | 本期末<br>2026年06月30日 | 上年度末<br>2025年12月31日 |
|---------|---------|--------------------|---------------------|
| 资 产：    |         |                    |                     |
| 货币资金    | 6.4.7.1 | 4,671,508.15       | 4,095,043.20        |
| 结算备付金   |         | -                  | -                   |
| 存出保证金   |         | -                  | -                   |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | -                  | -                   |

|               |            |                            |                             |
|---------------|------------|----------------------------|-----------------------------|
| 其中：股票投资       |            | -                          | -                           |
| 基金投资          |            | -                          | -                           |
| 债券投资          |            | -                          | -                           |
| 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    | 6,151,808,641.91           | -                           |
| 债权投资          | 6.4.7.5    | 1,845,291,822.48           | 8,130,767,466.71            |
| 其中：债券投资       |            | 1,845,291,822.48           | 8,130,767,466.71            |
| 资产支持证券投资      |            | -                          | -                           |
| 其他投资          |            | -                          | -                           |
| 应收清算款         |            | -                          | -                           |
| 应收股利          |            | -                          | -                           |
| 应收申购款         |            | -                          | -                           |
| 递延所得税资产       |            | -                          | -                           |
| 其他资产          |            | -                          | -                           |
| 资产总计          |            | 8,001,771,972.54           | 8,134,862,509.91            |
| <b>负债和净资产</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2026年06月30日</b> | <b>上年度末<br/>2025年12月31日</b> |
| <b>负 债：</b>   |            |                            |                             |
| 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     |            | -                          | 1,593,244,594.51            |
| 应付清算款         |            | -                          | -                           |
| 应付赎回款         |            | -                          | -                           |
| 应付管理人报酬       |            | 858,931.76                 | 831,942.67                  |
| 应付托管费         |            | 286,310.59                 | 277,314.23                  |

|          |         |                  |                  |
|----------|---------|------------------|------------------|
| 应付销售服务费  |         | -                | -                |
| 应付投资顾问费  |         | -                | -                |
| 应交税费     |         | 15,949.80        | -                |
| 应付利润     |         | -                | -                |
| 递延所得税负债  |         | -                | -                |
| 其他负债     | 6.4.7.6 | 102,249.65       | 251,563.36       |
| 负债合计     |         | 1,263,441.80     | 1,594,605,414.77 |
| 净资产：     |         |                  |                  |
| 实收基金     | 6.4.7.7 | 7,629,806,232.05 | 5,999,999,137.72 |
| 未分配利润    | 6.4.7.8 | 370,702,298.69   | 540,257,957.42   |
| 净资产合计    |         | 8,000,508,530.74 | 6,540,257,095.14 |
| 负债和净资产总计 |         | 8,001,771,972.54 | 8,134,862,509.91 |

注：截止报告期末，惠升和韵66个月定开债券基金份额净值1.0486元，基金份额总额7,629,806,232.05份。

6.2 利润表

会计主体：惠升和韵66个月定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2026年01月01日至2026年06月30日

单位：人民币元

| 项 目        | 附注号     | 本期<br>2026年01月01日至<br>2026年06月30日 | 上年度可比期间<br>2025年01月01日至202<br>5年06月30日 |
|------------|---------|-----------------------------------|----------------------------------------|
| 一、营业总收入    |         | 86,945,388.98                     | 138,570,883.52                         |
| 1.利息收入     |         | 86,945,388.98                     | 138,570,883.52                         |
| 其中：存款利息收入  | 6.4.7.9 | 988,142.52                        | 8,225.91                               |
| 债券利息收入     |         | 69,759,692.29                     | 138,562,657.61                         |
| 资产支持证券利息收入 |         | -                                 | -                                      |
| 买入返售金融资产收入 |         | 16,197,554.17                     | -                                      |
| 其他利息收入     |         | -                                 | -                                      |

|                            |            |               |                |
|----------------------------|------------|---------------|----------------|
| 2.投资收益（损失以“-”填列）           |            | -             | -              |
| 其中：股票投资收益                  | 6.4.7.10   | -             | -              |
| 基金投资收益                     | 6.4.7.11   | -             | -              |
| 债券投资收益                     | 6.4.7.12   | -             | -              |
| 资产支持证券投资<br>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   | -             | -              |
| 股利收益                       | 6.4.7.16   | -             | -              |
| 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   | -             | -              |
| 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   | -             | -              |
| <b>减：二、营业总支出</b>           |            | 11,249,390.76 | 28,838,965.34  |
| 1.管理人报酬                    | 6.4.10.2.1 | 4,943,294.53  | 4,735,530.17   |
| 2.托管费                      | 6.4.10.2.2 | 1,647,764.83  | 1,578,510.07   |
| 3.销售服务费                    | 6.4.10.2.3 | -             | -              |
| 4.投资顾问费                    |            | -             | -              |
| 5.利息支出                     |            | 4,186,561.71  | 22,414,867.35  |
| 其中：卖出回购金融资产<br>支出          |            | 4,186,561.71  | 22,414,867.35  |
| 6.信用减值损失                   | 6.4.7.19   | 359,570.33    | -              |
| 7.税金及附加                    |            | 2,353.13      | -              |
| 8.其他费用                     | 6.4.7.20   | 109,846.23    | 110,057.75     |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |            | 75,695,998.22 | 109,731,918.18 |
| <b>减：所得税费用</b>             |            | -             | -              |

|                   |  |               |                |
|-------------------|--|---------------|----------------|
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） |  | 75,695,998.22 | 109,731,918.18 |
| 五、其他综合收益的税后净额     |  | -             | -              |
| 六、综合收益总额          |  | 75,695,998.22 | 109,731,918.18 |

6.3 净资产变动表

会计主体：惠升和韵66个月定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2026年01月01日至2026年06月30日

单位：人民币元

| 项 目                                 | 本期<br>2026年01月01日至2026年06月30日 |                 |                   |
|-------------------------------------|-------------------------------|-----------------|-------------------|
|                                     | 实收基金                          | 未分配利润           | 净资产合计             |
| 一、上期期末净资产                           | 5,999,999,137.72              | 540,257,957.42  | 6,540,257,095.14  |
| 二、本期期初净资产                           | 5,999,999,137.72              | 540,257,957.42  | 6,540,257,095.14  |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                | 1,629,807,094.33              | -169,555,658.73 | 1,460,251,435.60  |
| （一）、综合收益总额                          | -                             | 75,695,998.22   | 75,695,998.22     |
| （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） | 1,629,807,094.33              | 78,748,296.60   | 1,708,555,390.93  |
| 其中：1.基金申购款                          | 7,629,800,098.97              | 368,547,958.74  | 7,998,348,057.71  |
| 2.基金赎回款                             | -5,999,993,004.64             | -289,799,662.14 | -6,289,792,666.78 |
| （三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产            | -                             | -323,999,953.55 | -323,999,953.55   |

|                                          |                                    |                |                  |
|------------------------------------------|------------------------------------|----------------|------------------|
| 变动（净资产减少以“-”号填列）                         |                                    |                |                  |
| 四、本期期末净资产                                | 7,629,806,232.05                   | 370,702,298.69 | 8,000,508,530.74 |
| 项 目                                      | 上年度可比期间<br>2025年01月01日至2025年06月30日 |                |                  |
|                                          | 实收基金                               | 未分配利润          | 净资产合计            |
| 一、上期期末净资产                                | 5,999,999,137.72                   | 313,544,215.90 | 6,313,543,353.62 |
| 二、本期期初净资产                                | 5,999,999,137.72                   | 313,544,215.90 | 6,313,543,353.62 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                     | -                                  | 109,731,918.18 | 109,731,918.18   |
| （一）、综合收益总额                               | -                                  | 109,731,918.18 | 109,731,918.18   |
| （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）      | -                                  | -              | -                |
| 其中：1.基金申购款                               | -                                  | -              | -                |
| 2.基金赎回款                                  | -                                  | -              | -                |
| （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                                | 5,999,999,137.72                   | 423,276,134.08 | 6,423,275,271.80 |

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：

张金锋

张金锋

张晓霞

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

惠升和韵66个月定期开放债券型证券投资基金（以下简称“本基金”），经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2020]2833号《关于准予惠升和韵66个月定期开放债券型证券投资基金注册的批复》注册，由惠升基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《惠升和韵66个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型定期开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 5,999,998,821.92元，业经大华会计师事务所(特殊普通合伙)大华验字[2020]000800号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《惠升和韵66个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》于2020年12月16日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为5,999,998,822.46份基金份额，其中认购资金利息折合0.54份基金份额。本基金的基金管理人为惠升基金管理有限责任公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

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债券（含国债、金融债、央行票据、企业债、公司债、中期票据、地方政府债、公开发行的次级债、可分离交易可转债的纯债部分、短期融资券、超短期融资券、政府支持机构债券、政府支持债券、证券公司短期公司债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、通知存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金不投资于股票等权益类资产，也不投资于可转换债券（可分离交易可转债的纯债部分除外）、可交换债券。本基金不得主动投资于主体信用评级低于AA+级的信用债。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。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《惠升和韵66个月定期开放债券型证券投资

资基金基金合同》和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

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本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

#### **6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明**

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表一致。

#### **6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

##### **6.4.5.1 会计政策变更的说明**

本基金在本报告期重要会计政策未发生变更。

##### **6.4.5.2 会计估计变更的说明**

本基金在本报告期主要会计估计未发生变更。

##### **6.4.5.3 差错更正的说明**

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### **6.4.6 税项**

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2025] 4号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

| 项目           | 本期末<br>2026年06月30日 |
|--------------|--------------------|
| 活期存款         | 3,444,456.88       |
| 等于：本金        | 3,400,735.82       |
| 加：应计利息       | 43,721.06          |
| 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         | 1,227,051.27       |
| 等于：本金        | 1,126,925.71       |
| 加：应计利息       | 100,125.56         |

|        |              |
|--------|--------------|
| 减：坏账准备 | -            |
| 合计     | 4,671,508.15 |

注：其他存款本期末及上年度末余额均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

无。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

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

单位：人民币元

| 项目    | 本期末<br>2026年06月30日 |           |
|-------|--------------------|-----------|
|       | 账面余额               | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | 5,361,769,683.02   | -         |
| 银行间市场 | 790,038,958.89     | -         |
| 合计    | 6,151,808,641.91   | -         |

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

单位：人民币元

| 项目 |       | 本期末<br>2026年06月30日 |              |              |            |                |
|----|-------|--------------------|--------------|--------------|------------|----------------|
|    |       | 初始成本               | 利息调整         | 应计利息         | 减：减值准备     | 账面价值           |
| 债券 | 交易所市场 | 890,000,000.00     | 3,244,381.01 | 2,039,370.98 | 154,997.51 | 895,128,754.48 |

|        |       |                  |              |              |            |                  |
|--------|-------|------------------|--------------|--------------|------------|------------------|
|        | 银行间市场 | 940,000,000.00   | 6,694,400.28 | 3,673,240.54 | 204,572.82 | 950,163,068.00   |
|        | 小计    | 1,830,000,000.00 | 9,938,781.29 | 5,712,611.52 | 359,570.33 | 1,845,291,822.48 |
| 资产支持证券 |       | -                | -            | -            | -          | -                |
| 其他     |       | -                | -            | -            | -          | -                |
| 合计     |       | 1,830,000,000.00 | 9,938,781.29 | 5,712,611.52 | 359,570.33 | 1,845,291,822.48 |

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

单位：人民币元

| 减值准备      | 第一阶段         | 第二阶段                 | 第三阶段                 | 合计         |
|-----------|--------------|----------------------|----------------------|------------|
|           | 未来12个月预期信用损失 | 整个存续期预期信用损失(未发生信用减值) | 整个存续期预期信用损失(已发生信用减值) |            |
| 期初余额      | -            | -                    | -                    | -          |
| 本期从其他阶段转入 | -            | -                    | -                    | -          |
| 本期转出至其他阶段 | -            | -                    | -                    | -          |
| 本期新增      | 375,110.36   | -                    | -                    | 375,110.36 |
| 本期转回      | 15,540.03    | -                    | -                    | 15,540.03  |
| 其他变动      | -            | -                    | -                    | -          |
| 期末余额      | 359,570.33   | -                    | -                    | 359,570.33 |

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2026年06月30日 |
|-------------|--------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                  |
| 应付赎回费       | -                  |
| 应付证券出借违约金   | -                  |
| 应付交易费用      | 12,989.50          |

|            |            |
|------------|------------|
| 其中：交易所市场   | -          |
| 银行间市场      | 12,989.50  |
| 应付利息       | -          |
| 预提费用-审计费   | 29,752.78  |
| 预提费用-信息披露费 | 59,507.37  |
| 合计         | 102,249.65 |

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2026年01月01日至2026年06月30日 |                   |
|---------------|-------------------------------|-------------------|
|               | 基金份额（份）                       | 账面金额              |
| 上年度末          | 5,999,999,137.72              | 5,999,999,137.72  |
| 本期申购          | 7,629,800,098.97              | 7,629,800,098.97  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -5,999,993,004.64             | -5,999,993,004.64 |
| 本期末           | 7,629,806,232.05              | 7,629,806,232.05  |

注：如果本报告期间发生转换入、红利再投业务，则总申购份额中包含该业务；如果本报告期间发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

| 项目             | 已实现部分           | 未实现部分 | 未分配利润合计         |
|----------------|-----------------|-------|-----------------|
| 上年度末           | 540,257,957.42  | -     | 540,257,957.42  |
| 本期期初           | 540,257,957.42  | -     | 540,257,957.42  |
| 本期利润           | 75,695,998.22   | -     | 75,695,998.22   |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 78,748,296.60   | -     | 78,748,296.60   |
| 其中：基金申购款       | 368,547,958.74  | -     | 368,547,958.74  |
| 基金赎回款          | -289,799,662.14 | -     | -289,799,662.14 |
| 本期已分配利润        | -323,999,953.55 | -     | -323,999,953.55 |
| 本期末            | 370,702,298.69  | -     | 370,702,298.69  |

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2026年01月01日至2026年06月30日 |
|-----------|-------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 153,661.42                    |
| 定期存款利息收入  | -                             |
| 其他存款利息收入  | 511,432.04                    |
| 结算备付金利息收入 | -                             |
| 其他        | 323,049.06                    |
| 合计        | 988,142.52                    |

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

无。

6.4.7.10.2 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.11 基金投资收益

无。

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

无。

6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

6.4.7.13 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.14 贵金属投资收益

无。

6.4.7.15 衍生工具收益

无。

6.4.7.16 股利收益

无。

6.4.7.17 公允价值变动收益

无。

6.4.7.18 其他收入

无。

6.4.7.19 信用减值损失

单位：人民币元

| 项目       | 本期<br>2026年01月01日至2026年06月30日 |
|----------|-------------------------------|
| 银行存款     | -                             |
| 买入返售金融资产 | -                             |
| 债权投资     | 359,570.33                    |
| 其他债权投资   | -                             |
| 其他       | -                             |
| 合计       | 359,570.33                    |

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2026年01月01日至2026年06月30日 |
|---------|-------------------------------|
| 审计费用    | 29,752.78                     |
| 信息披露费   | 59,507.37                     |
| 证券出借违约金 | -                             |
| 汇划手续费   | 1,986.08                      |
| 账户维护费   | 18,600.00                     |

|    |            |
|----|------------|
| 合计 | 109,846.23 |
|----|------------|

**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**

无。

**6.4.8.2 资产负债表日后事项**

无。

**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**

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

**6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方**

| 关联方名称      | 与本基金的关系             |
|------------|---------------------|
| 惠升基金管理有限公司 | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |
| 招商银行股份有限公司 | 基金托管人               |
| 自然人股东      | 基金管理人的股东            |

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**

无。

**6.4.10.1.2 权证交易**

无。

**6.4.10.1.3 债券交易**

无。

**6.4.10.1.4 债券回购交易**

无。

6.4.10.1.5 基金交易

无。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目               | 本期<br>2026年01月01日至20<br>26年06月30日 | 上年度可比期间<br>2025年01月01日至20<br>25年06月30日 |
|------------------|-----------------------------------|----------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费   | 4,943,294.53                      | 4,735,530.17                           |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 226,967.44                        | 236,762.40                             |
| 应支付基金管理人的净管理费    | 4,716,327.09                      | 4,498,767.77                           |

注：①支付基金管理人的基金管理人报酬按前一日基金资产净值0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

②基金管理人报酬计算公式为：日基金管理人报酬＝前一日基金资产净值×0.15%/当年天数。

③客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用按照代销机构所代销基金的份额保有量作为基数进行计算，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<br>2026年01月01日至2026<br>年06月30日 | 上年度可比期间<br>2025年01月01日至2025<br>年06月30日 |
|----------------|-----------------------------------|----------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 1,647,764.83                      | 1,578,510.07                           |

注：①支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值0.05%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

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

6.4.10.2.3 销售服务费

不适用。

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

| 关联方名称      | 本期末<br>2026年06月30日 |                  | 上年度末<br>2025年12月31日 |                  |
|------------|--------------------|------------------|---------------------|------------------|
|            | 持有的基金份额            | 持有的基金份额占基金总份额的比例 | 持有的基金份额             | 持有的基金份额占基金总份额的比例 |
| 自然人股东      | 23.02              | 0.00%            | 21.88               | 0.00%            |
| 招商银行股份有限公司 | 0.00               | 0.00%            | 1,199,999,000.00    | 20.0000%         |

注：以上关联方投资本基金的适用费率符合基金合同、招募说明书及相关公告的规定。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称      | 本期<br>2026年01月01日至2026年06月30日 |            | 上年度可比期间<br>2025年01月01日至2025年06月30日 |          |
|------------|-------------------------------|------------|------------------------------------|----------|
|            | 期末余额                          | 当期利息收入     | 期末余额                               | 当期利息收入   |
| 招商银行股份有限公司 | 3,444,456.88                  | 153,661.42 | 2,874,419.30                       | 4,448.99 |

注：本基金的以上银行存款由基金托管人招商银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

单位：人民币元

| 序号 | 权益<br>登记日  | 除息日        | 每10份基<br>金<br>份额分红<br>数 | 现金形式<br>发放总额   | 再投资形<br>式发放总<br>额 | 本期利润<br>分配合计   | 备<br>注 |
|----|------------|------------|-------------------------|----------------|-------------------|----------------|--------|
| 1  | 2026-06-12 | 2026-06-12 | 0.540                   | 323,999,895.84 | 57.71             | 323,999,953.55 | -      |
| 合计 |            |            | 0.540                   | 323,999,895.84 | 57.71             | 323,999,953.55 | -      |

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

金额单位：人民币元

| 6.4.12.1.1 受限证券类别：债券 |          |          |         |          |          |          |          |          |          |    |
|----------------------|----------|----------|---------|----------|----------|----------|----------|----------|----------|----|
| 证券<br>代码             | 证券<br>名称 | 成功<br>认购 | 受限<br>期 | 流通<br>受限 | 认购<br>价格 | 期末<br>估值 | 数量<br>（单 | 期末<br>成本 | 期末<br>估值 | 备注 |

|            |            | 日              |               | 类型            |            | 单价         | 位：张)        | 总额                    | 总额                    |   |
|------------|------------|----------------|---------------|---------------|------------|------------|-------------|-----------------------|-----------------------|---|
| 2455<br>59 | 26五<br>矿01 | 2026-<br>06-26 | 3个<br>交易<br>日 | 新债<br>未上<br>市 | 100.0<br>0 | 100.0<br>2 | 500,00<br>0 | 50,00<br>0,00<br>0.00 | 50,00<br>9,86<br>3.02 | - |

**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**

无。

**6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

无。

**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**

本基金在日常投资活动中主要面临信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人建立了覆盖全业务的风险管理和内部稽核体系，制定了完善的风险管理政策，配备了有效的风险管理系统和足够的专业人员来识别、分析、管理这些风险。

**6.4.13.1 风险管理政策和组织架构**

本基金管理人奉行全面风险管理的理念，建立了包含决策、执行、监督三个维度的风险管理架构体系。决策体系：公司决策体系由董事会、总经理、投资决策委员会和风险管理委员会组成，对公司管理、基金运作等重大事项进行集体决策，遵循科学决策程序，有效避免权力过于集中。执行体系：在总经理的领导下，由公司各职能部门组成，承担着公司开展基金业务的日常投资运作活动和具体管理工作，认真执行内部控制战略，并采取具体措施落实内部控制。监督体系：包括督察长、监察稽核部，负责确保公司管理、基金运作、员工行为符合有关法律法规和公司各项规章制度。

**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。本基金的银行存款存放在本基金的托管人，其他存款存放在本基金证券经纪商，因而与货币资金相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以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。

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。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2026年06月30日 | 上年度末<br>2025年12月31日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| AAA    | 842,125,905.75     | -                   |
| AAA以下  | -                  | -                   |
| 未评级    | 1,003,165,916.73   | 8,130,767,466.71    |
| 合计     | 1,845,291,822.48   | 8,130,767,466.71    |

注：1.未评级的债券包括政策性金融债、中期票据、公司债。债券信用评级取自第三方评级机构的评级。

2.于本报告期末，本基金持有的按长期信用评级列示的债券投资均处于减值第一阶段（上年度末：同）。

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

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的债券投资采用买入持有至到期策略，流动性风险主要来自于基金份额持有人于约定开放日要求赎回其持有的基金份额。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人于开放期内每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本报告期末，除卖出回购金融资产款余额将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》且于基金开放期内按照《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的10%。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。于本报告期末，本基金无主动投资流动性受限资产。

于开放期内，本基金的基金管理人每日对基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过7个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查

与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

本基金对投资组合采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。本基金的基金管理人主要通过合理配置投资组合的到期期限，管理利率波动带来的再投资风险。本基金主要投资于固定利率类的固定收益品种，因此很大程度上独立于市场利率变化。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2026年<br>06月30<br>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                       | 4,671,508.15     | -     | -      | -                | -              | -   | 4,671,508.15     |
| 买入返售金融资产                   | 6,151,808,641.91 | -     | -      | -                | -              | -   | 6,151,808,641.91 |
| 债权投资                       | -                | -     | -      | 1,530,046,055.93 | 315,245,766.55 | -   | 1,845,291,822.48 |
| 资产总计                       | 6,156,480,150.06 | -     | -      | 1,530,046,055.93 | 315,245,766.55 | -   | 8,001,771,972.54 |
| 负债                         |                  |       |        |                  |                |     |                  |

|                     |                   |                  |                  |                  |                |               |                  |
|---------------------|-------------------|------------------|------------------|------------------|----------------|---------------|------------------|
| 应付管理人报酬             | -                 | -                | -                | -                | -              | 858,931.76    | 858,931.76       |
| 应付托管费               | -                 | -                | -                | -                | -              | 286,310.59    | 286,310.59       |
| 应交税费                | -                 | -                | -                | -                | -              | 15,949.80     | 15,949.80        |
| 其他负债                | -                 | -                | -                | -                | -              | 102,249.65    | 102,249.65       |
| 负债总计                | -                 | -                | -                | -                | -              | 1,263,441.80  | 1,263,441.80     |
| 利率敏感度缺口             | 6,156,480,150.06  | -                | -                | 1,530,046,055.93 | 315,245,766.55 | -1,263,441.80 | 8,000,508,530.74 |
| 上年度末<br>2025年12月31日 | 1个月以内             | 1-3个月            | 3个月-1年           | 1-5年             | 5年以上           | 不计息           | 合计               |
| 资产                  |                   |                  |                  |                  |                |               |                  |
| 货币资金                | 4,095,043.20      | -                | -                | -                | -              | -             | 4,095,043.20     |
| 债权投资                | 123,942,192.82    | 1,079,841,247.68 | 6,926,984,026.21 | -                | -              | -             | 8,130,767,466.71 |
| 资产总计                | 128,037,236.02    | 1,079,841,247.68 | 6,926,984,026.21 | -                | -              | -             | 8,134,862,509.91 |
| 负债                  |                   |                  |                  |                  |                |               |                  |
| 卖出回购金融资产款           | 1,593,244,594.51  | -                | -                | -                | -              | -             | 1,593,244,594.51 |
| 应付管理人报酬             | -                 | -                | -                | -                | -              | 831,942.67    | 831,942.67       |
| 应付托管费               | -                 | -                | -                | -                | -              | 277,314.23    | 277,314.23       |
| 其他负债                | -                 | -                | -                | -                | -              | 251,563.36    | 251,563.36       |
| 负债总计                | 1,593,244,594.51  | -                | -                | -                | -              | 1,360,820.26  | 1,594,605,414.77 |
| 利率敏感度缺口             | -1,465,207,358.49 | 1,079,841,247.68 | 6,926,984,026.21 | -                | -              | -1,360,820.26 | 6,540,257,095.14 |

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的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**

于本报告期末，本基金持有至到期的债券投资均为固定利率类的债券品种，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(上年度末：同)。

#### **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，因此无重大其他价格风险。

### **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**

于本报告期末，本基金未持有持续的以公允价值计量的金融工具（上年度末：同）。

##### **6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动**

不适用。

##### **6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明**

本报告期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产（上年度末：同）。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项、债权投资和其他金融负债等。

除债权投资以外，其他不以公允价值计量的金融资产和金融负债的账面价值与公允价值差异很小。

债权投资按如下原则确定公允价值：(i) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，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。(ii) 当金融工具不存在活跃市场，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。采用估值技术时，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，才可以使用不可观察输入值。(iii) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国证券投资基金业协会中基协字[2022]566号《关于固定收益品种的估值处理标准》的有关规定，本基金持有的固定收益品种按照第三方估值机构所独立提供的估值结果确定公允价值。本报告期末，本基金持有的上述投资的公允价值均属于第二层次（上年度末：同）。

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  | -  | -            |
|    | 其中：股票 | -  | -            |
| 2  | 基金投资  | -  | -            |

|   |                   |                  |        |
|---|-------------------|------------------|--------|
| 3 | 固定收益投资            | 1,845,291,822.48 | 23.06  |
|   | 其中：债券             | 1,845,291,822.48 | 23.06  |
|   | 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          | 6,151,808,641.91 | 76.88  |
|   | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -                | -      |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计      | 4,671,508.15     | 0.06   |
| 8 | 其他各项资产            | -                | -      |
| 9 | 合计                | 8,001,771,972.54 | 100.00 |

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金本报告期内未持有股票。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金本报告期内未持有股票。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内未持有股票。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种 | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------|------|--------------|
| 1  | 国家债券 | -    | -            |
| 2  | 央行票据 | -    | -            |

|    |           |                  |       |
|----|-----------|------------------|-------|
| 3  | 金融债券      | 380,321,678.83   | 4.75  |
|    | 其中：政策性金融债 | -                | -     |
| 4  | 企业债券      | 514,807,075.65   | 6.43  |
| 5  | 企业短期融资券   | -                | -     |
| 6  | 中期票据      | 950,163,068.00   | 11.88 |
| 7  | 可转债(可交换债) | -                | -     |
| 8  | 同业存单      | -                | -     |
| 9  | 其他        | -                | -     |
| 10 | 合计        | 1,845,291,822.48 | 23.06 |

注：以上公允价值按摊余成本账面价值列示。

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  | 102485180 | 24陕西交通MTN009 | 1,600,000 | 166,251,886.69 | 2.08         |
| 2  | 102681808 | 26北控水集MTN002 | 1,300,000 | 130,495,481.71 | 1.63         |
| 3  | 102682309 | 26渝高速MTN002  | 1,300,000 | 129,712,142.16 | 1.62         |
| 4  | 245447    | 26交投K2       | 1,200,000 | 120,051,881.97 | 1.50         |
| 5  | 245163    | 26财金03       | 1,000,000 | 100,163,666.14 | 1.25         |

注：以上公允价值按摊余成本账面价值列示。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### **7.10 本基金投资股指期货的投资政策**

本基金本报告期内无股指期货投资。

#### **7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

##### **7.11.1 本期国债期货投资政策**

本基金本报告期内无国债期货投资。

##### **7.11.2 本期国债期货投资评价**

本基金本报告期内无国债期货投资。

#### **7.12 投资组合报告附注**

**7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，广发证券股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到监管部门公开谴责或处罚。**

本基金投资的前十名证券中，上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

**7.12.2 本基金本报告期末未持有股票。**

##### **7.12.3 期末其他各项资产构成**

本基金本报告期末无其他资产。

##### **7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

##### **7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末未持有股票。

##### **7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分**

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## **§8 基金份额持有人信息**

### **8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构**

份额单位：份

| 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  |
| 262      | 29,121,397.83 | 7,629,800,043.09 | 99.9999% | 6,188.96 | 0.0001% |

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 持有份额总数（份） | 占基金总份额比例 |
|------------------|-----------|----------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 317.53    | 0.0000%  |

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

| 项目                             | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|--------------------------------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 0~10              |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 0                 |

§9 开放式基金份额变动

单位：份

|                            |                  |
|----------------------------|------------------|
| 基金合同生效日(2020年12月16日)基金份额总额 | 5,999,998,822.46 |
| 本报告期期初基金份额总额               | 5,999,999,137.72 |
| 本报告期基金总申购份额                | 7,629,800,098.97 |
| 减：本报告期基金总赎回份额              | 5,999,993,004.64 |
| 本报告期基金拆分变动份额               | -                |
| 本报告期期末基金份额总额               | 7,629,806,232.05 |

§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

本报告期内，基金管理人发布《惠升基金管理有限责任公司基金行业高级管理人员变更公告》，2026年6月15日，石伟先生离任公司副总经理。本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内管理人未受到任何调查或处罚。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内管理人相关从业人员未受到任何调查或处罚。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人没有受到监管部门调查或处罚。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人相关从业人员没有受到监管部门调查或处罚。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数 | 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 |    |

|      |   |   |   |            |         |   |
|------|---|---|---|------------|---------|---|
|      | 量 |   |   |            |         |   |
| 中信建投 | 2 | - | - | 415,427.73 | 100.00% | - |
| 华泰证券 | 3 | - | - | -          | -       | - |

- 注：①除本表列示外，本基金本报告期内未选择其他交易单元。
- ②本基金管理人负责选择证券经营机构，租用其交易单元作为本基金的交易单元。为了贯彻中国证监会的有关规定，基金交易单元的选择标准如下：
- 1）经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
  - 2）具备基金运作所需的高效安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
  - 3）具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析报告及全面的信息服务；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。
- ③基金交易单元的选择程序如下：
- 1）本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构；
  - 2）签署协议并通知托管人。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易           |              | 债券回购交易             |                | 权证交易 |              | 基金交易 |              |
|------|----------------|--------------|--------------------|----------------|------|--------------|------|--------------|
|      | 成交金额           | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额               | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期基金成交总额的比例 |
| 中信建投 | 845,091,510.25 | 100.00%      | 136,376,637.000.00 | 100.00%        | -    | -            | -    | -            |
| 华泰证券 | -              | -            | -                  | -              | -    | -            | -    | -            |

10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项                     | 法定披露方式    | 法定披露日期     |
|----|--------------------------|-----------|------------|
| 1  | 惠升基金管理有限责任公司关于旗下证券投资基金估值 | 规定网站、规定报刊 | 2026-01-10 |

|    |                                             |           |            |
|----|---------------------------------------------|-----------|------------|
|    | 调整情况的公告                                     |           |            |
| 2  | 惠升基金管理有限责任公司旗下基金2025年第4季度报告提示性公告            | 规定报刊      | 2026-01-21 |
| 3  | 惠升和韵66个月定期开放债券型证券投资基金2025年第4季度报告            | 规定网站      | 2026-01-21 |
| 4  | 惠升基金管理有限责任公司关于旗下证券投资基金估值调整情况的公告             | 规定网站、规定报刊 | 2026-01-24 |
| 5  | 惠升基金管理有限责任公司旗下基金2025年年度报告提示性公告              | 规定报刊      | 2026-03-30 |
| 6  | 惠升和韵66个月定期开放债券型证券投资基金2025年年度报告              | 规定网站      | 2026-03-30 |
| 7  | 惠升基金管理有限责任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） | 规定网站、规定报刊 | 2026-03-31 |
| 8  | 惠升基金管理有限责任公司关于旗下部分基金暂停申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告  | 规定网站、规定报刊 | 2026-04-02 |
| 9  | 惠升基金管理有限责任公司旗下基金2026年第1季度报告提示性公告            | 规定报刊      | 2026-04-21 |
| 10 | 惠升和韵66个月定期开放债券型证券投资基金2026年第1季度报告            | 规定网站      | 2026-04-21 |
| 11 | 2025年度惠升基金管理有限责任公司以股东身份(通过公募基金持股)参与股东大      | 规定网站、规定报刊 | 2026-04-28 |

|    |                                                  |           |            |
|----|--------------------------------------------------|-----------|------------|
|    | 会投票信息披露                                          |           |            |
| 12 | 惠升基金管理有限责任公司关于旗下部分基金暂停申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告       | 规定网站、规定报刊 | 2026-05-22 |
| 13 | 惠升基金管理有限责任公司关于终止中证金牛（北京）基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告 | 规定网站、规定报刊 | 2026-06-01 |
| 14 | 惠升和韵66个月定期开放债券型证券投资基金分红公告                        | 规定网站、规定报刊 | 2026-06-11 |
| 15 | 惠升和韵66个月定期开放债券型证券投资基金限制代销机构大额申购、转换转入业务的公告        | 规定网站、规定报刊 | 2026-06-15 |
| 16 | 惠升和韵66个月定期开放债券型证券投资基金第一个开放期开放申购、赎回和转换业务的公告       | 规定网站、规定报刊 | 2026-06-15 |
| 17 | 惠升基金管理有限责任公司基金行业高级管理人员变更公告                       | 规定网站、规定报刊 | 2026-06-16 |
| 18 | 惠升基金管理有限责任公司关于注销海南分公司的公告                         | 规定网站、规定报刊 | 2026-06-18 |
| 19 | 关于惠升和韵66个月定期开放债券型证券投资基金提前结束开放期的公告                | 规定网站、规定报刊 | 2026-06-24 |
| 20 | 惠升和韵66个月定期开放债券型证券投资基金更新的招募说明书（2026年第1号）          | 规定网站      | 2026-06-26 |
| 21 | 惠升和韵66个月定期开放债券型证券投资基金基金产品资料概要更新                  | 规定网站      | 2026-06-26 |

|    |                                                      |           |            |
|----|------------------------------------------------------|-----------|------------|
| 22 | 惠升基金管理有限公司<br>关于旗下部分基金暂停申<br>购、赎回、转换及定期定额<br>投资业务的公告 | 规定网站、规定报刊 | 2026-06-30 |
|----|------------------------------------------------------|-----------|------------|

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

| 投资者类别                                                                                                                                                                                                                 | 报告期内持有基金份额变化情况 |                        |                  |      |                  | 报告期末持有基金情况 |         |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------|------------------------|------------------|------|------------------|------------|---------|
|                                                                                                                                                                                                                       | 序号             | 持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间 | 期初份额             | 申购份额 | 赎回份额             | 持有份额       | 份额占比    |
| 机构                                                                                                                                                                                                                    | 1              | 20260101 - 20260616    | 1,499,999,000.00 | -    | 1,499,999,000.00 | -          | 0.0000% |
| 产品特有风险                                                                                                                                                                                                                |                |                        |                  |      |                  |            |         |
| 本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额20%的情形，在市场流动性不足的情况下，如遇投资者巨额赎回或集中赎回，基金管理人可能无法以合理的价格及时变现基金资产，有可能对基金净值产生一定的影响，甚至可能引发基金的流动性风险。<br>在特定情况下，若持有基金份额占比较高的投资者大量赎回本基金，可能导致在其赎回后本基金资产规模持续低于正常运作水平，面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。 |                |                        |                  |      |                  |            |         |

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期内无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

中国证监会准予基金募集注册的文件；  
《惠升和韵66个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》；  
《惠升和韵66个月定期开放债券型证券投资基金托管协议》；  
基金管理人业务资格批件、营业执照；  
基金托管人业务资格批件、营业执照；  
报告期内基金管理人在规定媒介上披露的各项公告；  
中国证监会要求的其他文件。

12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人及基金托管人的办公场所。

### 12.3 查阅方式

投资者可以通过基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站，查阅或下载基金各类备查文件。

惠升基金管理有限责任公司  
二〇二六年八月三十一日