

华润元大润禧 39 个月定期开放债券型证券 投资基金 2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：华润元大基金管理有限公司

基金托管人：江苏银行股份有限公司

送出日期：2026 年 8 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。

基金托管人江苏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 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	9
§ 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	12
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	15
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	37
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	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	37
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	38
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	38

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	38
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	38
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	38
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	39
7.11 投资组合报告附注	39
§ 8 基金份额持有人信息	40
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	40
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	40
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	40
§ 9 开放式基金份额变动	41
§ 10 重大事件揭示	41
10.1 基金份额持有人大会决议	41
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	42
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	42
10.4 基金投资策略的改变	42
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	42
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	42
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	42
10.8 其他重大事件	43
§ 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	45
§ 12 备查文件目录	45
12.1 备查文件目录	45
12.2 存放地点	45
12.3 查阅方式	45

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华润元大润禧 39 个月定期开放债券型证券投资基金	
基金简称	华润元大润禧 39 个月定开债	
基金主代码	009889	
基金运作方式	契约型、定期开放式	
基金合同生效日	2020 年 8 月 24 日	
基金管理人	华润元大基金管理有限公司	
基金托管人	江苏银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	7,901,340,267.74 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华润元大润禧 39 个月定开债 A	华润元大润禧 39 个月定开债 C
下属分级基金的交易代码	009889	009890
报告期末下属分级基金的份额总额	7,901,300,862.62 份	39,405.12 份

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,通过投资于债券品种,努力降低基金净值波动风险,力争为基金份额持有人提供超过业绩比较基准的长期稳定回报。
投资策略	本基金以封闭期为周期进行投资运作,本基金在封闭期与开放期采取不同的投资策略。本基金在封闭期内采用买入并持有到期投资策略,所投金融资产以收取合同现金流量为目的并持有到期,所投资资产到期日(或回售日)不得晚于封闭运作期到期日。本基金投资含回售权的债券时,应在投资该债券前,确定行使回售权或持有至到期的时间;债券到期日晚于封闭运作期到期日的,基金管理人应当行使回售权而不得持有至到期日。信用债投资策略包括久期配置策略、行业配置策略和个券精选策略。开放期内,本基金管理人将在流动性优先的前提下,综合平衡基金资产在流动性资产和收益性资产之间的配置比例,通过现金留存、持有高流动性债券种、正回购、降低组合久期等方式提高基金资产整体的流动性,满足开放期流动性的需求。
业绩比较基准	在每个封闭期,本基金的业绩比较基准为该封闭期起始日公布的三年期定期存款利率(税后)+1.5%。
风险收益特征	本基金为债券型基金,属于证券投资基金中的中低风险品种,预期风险和预期收益高于货币市场基金,低于股票型基金和混合型基金。

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	华润元大基金管理有限公司		江苏银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	严莉	田作全
	联系电话	0755-88399008	025-58588321
	电子邮箱	kf@cryuantafund.com	tianzuoquan@jsbchina.cn
客户服务电话	4000-1000-89		95319
传真	0755-88399045		025-58588155
注册地址	深圳市福田区福田街道岗厦社区金田路 3086 号大百汇广场 32 层 03-07 单元		南京市中华路 26 号
办公地址	深圳市福田区福田街道岗厦社区金田路 3086 号大百汇广场 32 层 03-07 单元		南京市中华路 26 号
邮政编码	518026		210001
法定代表人	胡昊		袁军

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	http://www.cryuantafund.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	华润元大基金管理有限公司	深圳市福田区福田街道岗厦社区金田路 3086 号大百汇广场 32 层 03-07 单元

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数 据和指标	报告期(2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日)	
	华润元大润禧 39 个月定开债 A	华润元大润禧 39 个月定开债 C
本期已实现收益	98,880,321.69	470.41
本期利润	98,880,321.69	470.41
加权平均基金份 额本期利润	0.0125	0.0119
本期加权平均净 值利润率	1.18%	1.13%
本期基金份额净	1.18%	1.13%

值增长率		
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	560,855,657.63	2,546.50
期末可供分配基金份额利润	0.0710	0.0646
期末基金资产净值	8,462,156,520.25	41,951.62
期末基金份额净值	1.0710	1.0646
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	19.15%	18.45%

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、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（例如，开放式基金的申购赎回费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

华润元大润禧 39 个月定开债 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	0.60%	0.01%	0.86%	0.01%	-0.26%	0.00%
过去六个月	1.18%	0.01%	1.73%	0.01%	-0.55%	0.00%
过去一年	2.64%	0.01%	3.54%	0.01%	-0.90%	0.00%
过去三年	8.01%	0.01%	11.46%	0.01%	-3.45%	0.00%
过去五年	15.86%	0.01%	19.81%	0.03%	-3.95%	-0.02%
自基金合同生效起至今	19.15%	0.01%	24.14%	0.03%	-4.99%	-0.02%

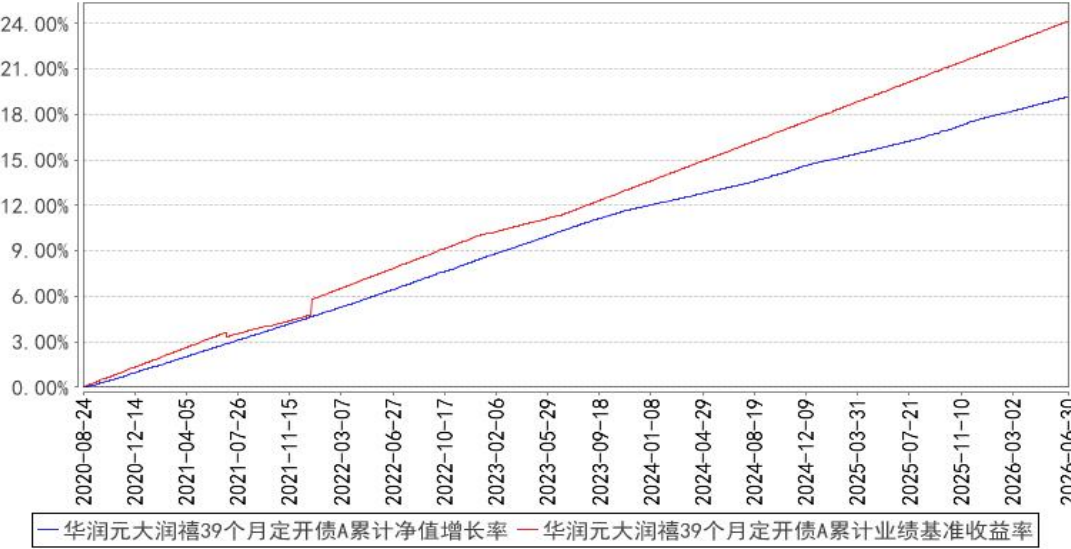
华润元大润禧 39 个月定开债 C

阶段	份额净值增长	份额净值增长率标	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差	①－③	②－④
----	--------	----------	------------	--------------	-----	-----

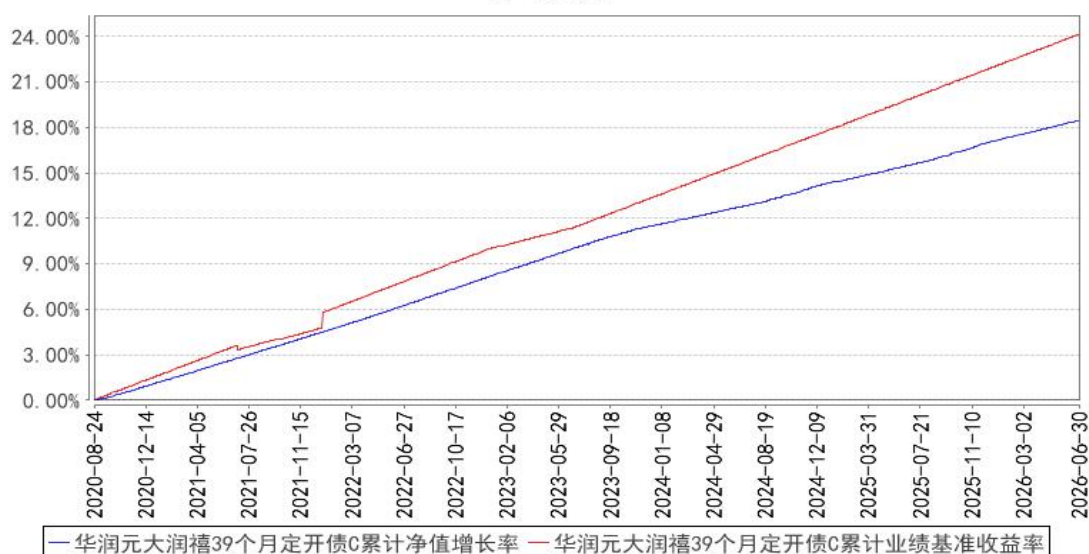
	率①	准差②		④		
过去三个月	0.58%	0.01%	0.86%	0.01%	-0.28%	0.00%
过去六个月	1.13%	0.01%	1.73%	0.01%	-0.60%	0.00%
过去一年	2.54%	0.01%	3.54%	0.01%	-1.00%	0.00%
过去三年	7.69%	0.01%	11.46%	0.01%	-3.77%	0.00%
过去五年	15.28%	0.01%	19.81%	0.03%	-4.53%	-0.02%
自基金合同生效起 至今	18.45%	0.01%	24.14%	0.03%	-5.69%	-0.02%

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

华润元大润禧39个月定开债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



华润元大润禧39个月定开债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



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

华润元大基金管理有限公司经中国证监会证监许可【2012】1746 号文批准，于 2013 年 1 月 17 日完成工商登记注册，总部位于深圳，注册资本 6 亿元人民币。公司由华润深国投信托有限公司、华润金控投资有限公司、台湾元大证券投资信托股份有限公司共同发起设立，占股比例分别为 51%、24.5%、24.5%。

截至 2026 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理十六只基金产品：华润元大富时中国 A50 指数型证券投资基金、华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金、华润元大信息传媒科技混合型证券投资基金、华润元大量化优选混合型证券投资基金、华润元大核心动力混合型证券投资基金、华润元大现金收益货币市场基金、华润元大现金货币市场基金、华润元大稳健收益债券型证券投资基金、华润元大润鑫债券型证券投资基金、华润元大润泰双鑫债券型证券投资基金、华润元大润泽债券型证券投资基金、华润元大润禧 39 个月定期开放债券型证券投资基金、华润元大润丰纯债债券型证券投资基金、华润元大润享三个月定期开放债券型证券投资基金、华润元大泓远利率债债券型证券投资基金、华润元大中债绿色普惠主题金融债券优选指数证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
程涛涛	本基金基金经理	2023 年 9 月 1 日	-	8 年	曾任安信证券资产管理部债券交易员、信达澳亚基金债券交易员；现任华润元大基金管理有限公司固定收益部基金经理，担任华润元大现金收益货币市场基金、华润元大现金通货币市场基金、华润元大稳健收益债券型证券投资基金、华润元大润泽债券型证券投资基金、华润元大润禧 39 个月定期开放债券型证券投资基金、华润元大润鑫债券型证券投资基金基金经理。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期内无上述兼任情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、本基金基金合同和其他相关法律法规的规定，并本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定，没有损害基金持有人利益的行为。

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

本报告期内，基金管理人严格遵守法律法规及公司内部制度关于公平交易的相关规定，在投资管理活动中公平对待不同投资组合，公平交易制度执行情况良好，未发生违反公平交易制度的行为。

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。基金管理人管理的所有投资组合未存在参与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的 5%的情形。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2026 年上半年，债券市场收益率整体呈现下行走势，但具体而言又可大致划分为三个阶段。

第一阶段为一月初至春节前，除 1 年期外，利率债各期限收益率呈现同步下行态势，且各期限收益率下行幅度大致相当。而 1 年期利率债收益率则出现一定上行，与银行间资金面利率的走

势基本同步。

从历史上来看，1 月通常为信贷投放强度较大的月份，银行间资金面往往大幅收紧。但 2026 年 1 月银行间资金利率虽有所上行，但上行幅度远远小于历史均值。该阶段资金面的超预期表现可能表明存款类机构的负债端成本出现了系统性的下降。该阶段存款类机构所发行同业存单的收益率呈下行走势，与银行间资金利率的走势出现明显背离，此现象也一定程度上可以作为印证。

若对第一阶段的收益率走势进行归因分析，1 年期以上收益率的下行可能主要基于两个原因：一是年初阶段各机构存在较大的周期性配置需求；二是银行间资金面的超预期表现对市场情绪有一定提振作用，同时，资金面超预期表现背后的驱动因素也放大了各机构的配置需求。

上半年的第二阶段为春节后至 4 月末。该阶段资金利率中枢持续下行，带动短端收益率下行。短端收益率的率先下行对其他期限起到一定带动作用。收益率下行逐级由短端向中短端再向中长端传导，最终各期限收益率均有所下行。该阶段的行情本质上是由宽松的资金面驱动的，且短端在该过程中占主导因素，因此就收益率下行幅度而言，短端下行幅度明显大于长端。

第三阶段为 5 月初至 6 月末。该阶段资金利率经过此前阶段的大幅下行后进一步下行的空间有限，但绝对水平依然处于低位，且中短端利率也已经处于低位，性价比已然较低。该阶段市场开始交易利差压缩的逻辑，期限利差和品种间利差收缩的逻辑逐步兑现，长端和超长端在此阶段的表现优于短端。

本基金在上半年处于封闭期，持仓稳定。通过银行间融资，本基金将杠杆率维持在较高水平。在融资过程中，本基金根据市场实际情况，合理选择融资期限，力争降低融资成本提升基金收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末华润元大润禧 39 个月定开债 A 基金份额净值为 1.0710 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.18%，同期业绩基准收益率为 1.73%；华润元大润禧 39 个月定开债 C 基金份额净值为 1.0646 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.13%，同期业绩基准收益率为 1.73%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年，预计宏观经济仍然有所承压，财政政策发力的必要性和可能性有所提升。因此资金面的波动可能有所加大，但整体宽松的基调难以改变。

短端收益率从绝对水平看已经处于低位，若无降息降准政策刺激，进一步下行的空间有限，因此从票息收益和交易赔率的角度看，性价比较低。

长端和超长端方面，长端 10 年受 1.7%关口制约，可能存在较大的突破阻力。而超长端 30 年和 50 年与 10 年收益率利差较阔，有进一步压缩的空间，因此继续看好期限利差压缩的逻辑。同时品种间利差也仍有一定空间，品种间利差压缩的逻辑可能进一步演绎。

货币市场方面，同业存单收益率锚定银行间资金利率，下半年进一步下行的空间有限，但大幅上行的可能性也较小。

下半年，本基金仍处于封闭期，但随着持仓债券逐步到期，本基金的杠杆率将逐步降低。同时，本基金将妥善安排存量资产到期后的再投资。

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，本基金管理人应严格按照新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所所在估值调整导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上时对所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。其中，本基金管理人为了确保估值工作的合规开展，建立了负责估值工作决策和执行的专门机构，组成人员包括总经理、督察长、投研分管领导、运营分管领导、合规与风险管理部负责人及基金会计负责人等。该机构成员均具备专业胜任能力和相关从业资格，精通各自领域的理论知识，熟悉相关政策法规，并具有丰富的实践经验。同时，根据基金管理公司制定的相关制度，估值工作决策机构的成员中不包括基金经理。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金不存在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

本报告期内，在托管基金的过程中，本基金托管人—江苏银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规的规定以及《基金托管协议》的约定，尽职尽责履行了托管人应尽的义务，没有从事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遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本基金托管人—江苏银行股份有限公司未发现华润元大基金管理有限公司在基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等

问题上存在损害基金份额持有人利益的行为，或违反《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、在各重要方面的运作违反基金合同规定的情况。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由基金管理人所编制和披露的基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 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：华润元大润禧 39 个月定期开放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	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	1,681,760.93	1,395,277.55
结算备付金		—	500.06
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	—	—
债权投资	6.4.7.5	11,129,652,495.31	11,184,981,596.57
其中：债券投资		11,129,652,495.31	11,184,981,596.57
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		—	—
递延所得税资产		—	—
其他资产	6.4.7.8	—	—

资产总计		11, 131, 334, 256. 24	11, 186, 377, 374. 18
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6. 4. 7. 3	-	-
卖出回购金融资产款		2, 667, 503, 595. 77	2, 821, 405, 365. 36
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		1, 042, 239. 37	1, 070, 843. 50
应付托管费		347, 413. 12	356, 947. 84
应付销售服务费		3. 30	3. 41
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6. 4. 7. 9	242, 532. 81	226, 534. 30
负债合计		2, 669, 135, 784. 37	2, 823, 059, 694. 41
净资产:			
实收基金	6. 4. 7. 10	7, 901, 340, 267. 74	7, 901, 340, 267. 74
未分配利润	6. 4. 7. 12	560, 858, 204. 13	461, 977, 412. 03
净资产合计		8, 462, 198, 471. 87	8, 363, 317, 679. 77
负债和净资产总计		11, 131, 334, 256. 24	11, 186, 377, 374. 18

注： 报告截止日 2026 年 6 月 30 日，华润元大润禧 39 个月定开债 A 基金份额净值 1.0710 元，基金份额总额 7,901,300,862.62 份；华润元大润禧 39 个月定开债 C 基金份额净值 1.0646 元，基金份额总额 39,405.12 份。华润元大润禧 39 个月定开债份额总额合计为 7,901,340,267.74 份。

6.2 利润表

会计主体：华润元大润禧 39 个月定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		127, 262, 798. 41	127, 459, 538. 56
1. 利息收入		127, 262, 798. 41	127, 459, 538. 56
其中：存款利息收入	6. 4. 7. 13	9, 335. 49	15, 998. 29
债券利息收入		127, 208, 614. 80	127, 443, 540. 27
资产支持证券利 息收入		-	-
买入返售金融资		44, 848. 12	-

产收入			
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-	-
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	-
资产支持证券投资 收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益 （损失以“-”号填列）	6.4.7.20	-	-
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.7.21	-	-
减：二、营业总支出		28,382,006.31	35,944,483.27
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	6,257,221.95	6,146,388.30
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	2,085,740.64	2,048,796.02
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	19.91	19.91
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		19,915,693.01	27,802,188.32
其中：卖出回购金融资 产支出		19,915,693.01	27,802,188.32
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-14,283.94	-190,524.02
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.23	137,614.74	137,614.74
三、利润总额（亏损总 额以“-”号填列）		98,880,792.10	91,515,055.29
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以 “-”号填列）		98,880,792.10	91,515,055.29
五、其他综合收益的税 后净额		-	-
六、综合收益总额		98,880,792.10	91,515,055.29

6.3 净资产变动表

会计主体：华润元大润禧 39 个月定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 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	7,901,340,267.74	-	461,977,412.03	8,363,317,679.77
二、本期期初净资产	7,901,340,267.74	-	461,977,412.03	8,363,317,679.77
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-	-	98,880,792.10	98,880,792.10
（一）、综合收益总额	-	-	98,880,792.10	98,880,792.10
（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	7,901,340,267.74	-	560,858,204.13	8,462,198,471.87
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	7,901,340,266.28	-	317,520,771.24	8,218,861,037.52
二、本期期初净资产	7,901,340,266.28	-	317,520,771.24	8,218,861,037.52
三、本期增减变动额(减少以“-”	-	-	91,515,055.29	91,515,055.29

号填列)				
(一)、综合收益总额	-	-	91,515,055.29	91,515,055.29
(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	7,901,340,266.28	-	409,035,826.53	8,310,376,092.81

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：

黄震

张彦军

张彦军

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

华润元大润禧 39 个月定期开放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[2020]1135 号文《关于准予华润元大润禧 39 个月定期开放债券型证券投资基金注册的批复》的核准，由华润元大基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华润元大润禧 39 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，首次募集期间为 2020 年 7 月 22 日至 2020 年 8 月 20 日，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 3,600,040,047.27 元，经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具安永华明(2020)验字第 61032987_H05 号验资报告。经向中国证监会备案，《华润元大润禧 39 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》于 2020

年 8 月 24 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 3,600,110,918.56 份基金份额，其中认购资金利息折合 70,871.29 份基金份额。本基金的基金管理人为华润元大基金管理有限公司，注册登记机构为本基金管理人，基金托管人为江苏银行股份有限公司。

根据《华润元大润禧 39 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》和《华润元大润禧 39 个月定期开放债券型证券投资基金招募说明书》，本基金自募集期起根据认购费、申购费、赎回费、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取认购/申购费用，在投资者赎回时根据持有期限收取赎回费用，而不计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；不收取认购/申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，且从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别计算基金份额净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华润元大润禧 39 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的国债、央行票据、金融债、公司债、企业债、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、中期票据、地方政府债券、政府支持机构债、政府支持债券、资产支持证券、可分离交易可转债中的纯债部分、债券回购、银行存款（定期存款及其他银行存款）、同业存单、国债期货以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金的投资组合比例为：投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%，但在每个开放期的前 3 个月和后 3 个月以及开放期间不受前述投资组合比例的限制。在开放期内，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，持有的现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金的业绩比较基准为：封闭期起始日公布的三年期定期存款利率（税后）+1.5%。

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〉》，中国证券投资基金业协会发布的《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》以及中国证监会和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 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

本基金的主要税项列示如下：

(1) 增值税及附加

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《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《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，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；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；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、税务总局公告 2025 年第 4 号《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。

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 7%、3% 和 2% 的比例缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

（2）企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号《财政部 国家税务总局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《财政部 国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》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。

（3）个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号《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《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《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。

（4）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。

（5）境外投资

本基金运作过程中如有涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127 号《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

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	1,681,760.93
等于：本金	1,681,420.16
加：应计利息	340.77
减：坏账准备	—
定期存款	—
等于：本金	—
加：应计利息	—
减：坏账准备	—
其中：存款期限 1 个月以内	—
存款期限 1-3 个月	—
存款期限 3 个月以上	—
其他存款	—
等于：本金	—
加：应计利息	—
减：坏账准备	—
合计	1,681,760.93

6.4.7.2 交易性金融资产

无。

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

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 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	500,000.00	-204,449.55	7,464,657.55	-	507,260,208.00
	银行间市场	10,490,000,000.00	11,975,689.44	120,605,135.35	188,537.48	10,622,392,287.31
	小计	10,990,000,000.00	11,771,239.89	128,069,792.90	188,537.48	11,129,652,495.31
资产支持证券		-	-	-	-	-
其他		-	-	-	-	-
合计		10,990,000,000.00	11,771,239.89	128,069,792.90	188,537.48	11,129,652,495.31

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	202,821.42	-	-	202,821.42
本期从其他阶段转入	-	-	-	-
本期转出至其他阶段	-	-	-	-
本期新增	1,058.94	-	-	1,058.94
本期转回	15,342.88	-	-	15,342.88

其他变动	-	-	-	-
期末余额	188,537.48	-	-	188,537.48

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	114,518.07
其中：交易所市场	-
银行间市场	114,518.07
应付利息	-
预提审计费	59,507.37
预提信息披露费	59,507.37
预提账户维护费	9,000.00
合计	242,532.81

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

华润元大润禧 39 个月定开债 A

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额

上年度末	7,901,300,862.62	7,901,300,862.62
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
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	7,901,300,862.62	7,901,300,862.62

华润元大润禧 39 个月定开债 C

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	39,405.12	39,405.12
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
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	39,405.12	39,405.12

注：申购包含基金转入及红利再投资的份额及金额；赎回包含基金转出的份额及金额。

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

华润元大润禧 39 个月定开债 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	461,975,335.94	-	461,975,335.94
本期期初	461,975,335.94	-	461,975,335.94
本期利润	98,880,321.69	-	98,880,321.69
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	560,855,657.63	-	560,855,657.63

华润元大润禧 39 个月定开债 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,076.09	-	2,076.09
本期期初	2,076.09	-	2,076.09
本期利润	470.41	-	470.41

本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,546.50	-	2,546.50

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	9,335.38
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	0.11
其他	-
合计	9,335.49

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

无。

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

无。

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

无。

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.19 股利收益

无。

6.4.7.20 公允价值变动收益

不适用。

6.4.7.21 其他收入

无。

6.4.7.22 信用减值损失

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
银行存款	-
买入返售金融资产	-
债权投资	-14,283.94
其他债权投资	-
其他	-
合计	-14,283.94

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	59,507.37
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	137,614.74

注：其他为上清所查询费 600 元。

6.4.7.24 分部报告

截至本期末，本基金仅在中国大陆境内从事证券投资单一业务，因此，无需作披露的分部报告。

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，本基金无需作说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需作披露的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

本基金本报告期内，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
华润元大基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
江苏银行股份有限公司（“江苏银行”）	基金托管人
华润深国投信托有限公司	基金管理人的股东
元大证券投资信托股份有限公司	基金管理人的股东
华润金控投资有限公司	基金管理人的股东
深圳华润元大资产管理有限公司	基金管理人的子公司
广东华润银行股份有限公司（“广东华润银行”）	与基金管理人受同一实际控制的公司
国信证券股份有限公司（“国信证券”）	基金管理人控股股东的联营公司、基金销售机构

注：以下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 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 权证交易

无。

6.4.10.1.5 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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	6,257,221.95	6,146,388.30
其中：应支付销售机构的客户维护费	492,799.70	484,078.03
应支付基金管理人的净管理费	5,764,422.25	5,662,310.27

注：(1) 基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.15% 的年费率计提，按月支付。日管理费=前一日基金资产净值×0.15%÷当年天数。

(2) 根据《开放式证券投资基金销售费用管理规定》，基金管理人依据销售机构销售基金的保有量提取一定比例的客户维护费，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，客户维护费从基金管理费中列支。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	2,085,740.64	2,048,796.02

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.05% 的年费率计提，按月支付。日托管费=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

(1) 支付基金销售机构的销售服务费按前一日对应级别基金资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给华润元大基金管理有限公司，再由华润元大基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。A 类基金份额不收取销售服务费；C 类基金份额约定的销售服务费年费率分别为 0.1%。其计算公式为：

日销售服务费=前一日该级别基金资产净值×对应销售服务费年费率/当年天数。

(2) 本基金本报告期及上年度可比期间均无关联方销售服务费；

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日						
银行间市场交易的 各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
江苏银行	-	-	-	-	204,000,000.00	58,328.47
上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日						
银行间市场交易的 各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
江苏银行	-	-	-	-	500,000,000.00	151,417.95

注：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

本报告期内及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

华润元大润禧 39 个月定开债 A

关联方名称	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 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 (%)
广东华润 银行	1,777,953,378 .11	22.5020	1,777,953,378. 11	22.5020

注：（1）关联方投资本基金适用基金合同的约定费率。

（2）对于分级基金，比例的分母采用各分级基金的总份额。

（3）于本期末及上年度末，除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金 C 类基金份额。

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 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
江苏银行	1,681,760.93	9,335.38	1,684,084.19	15,998.24

注：本基金的银行存款由基金托管人江苏银行保管，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

本基金本报告期末在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

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，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 2,667,503,595.77 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
220203	22 国开 03	2026 年 7 月 1 日	101.05	11,802,000	1,192,627,512.75
220402	22 农发 02	2026 年 7 月 1 日	101.13	13,554,000	1,370,672,393.52
220402	22 农发 02	2026 年 7 月 3 日	101.13	3,158,000	319,358,375.29
合计				28,514,000	2,882,658,281.56

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

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中由涉及金融工具产生的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控

制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了由董事会、监事会、董事会下设风险控制委员会，督察长、管理层下设风险管理委员会，合规管理部、风险管理部和各业务部门构成的四级风险管理架构体系。

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。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金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行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均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，违约风险可能性很小；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。

于本期末，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 45.47%（上年度末：45.54%）。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金与本期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的债券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金与本期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的资产支持证券。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金于本期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的同业存单。

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	上年度末 2025 年 12 月 31 日
AAA	3,847,515,528.86	3,808,739,803.15
AAA 以下	—	—
未评级	7,282,136,966.45	7,376,241,793.42
合计	11,129,652,495.31	11,184,981,596.57

注：（1）债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

（2）未评级债券包括债券期限大于一年的国债、政策性金融债、央行票据等。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本期末及上年度末未持有按长期信用评级列示的资产支持证券。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金于本期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的同业存单。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险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 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求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。

本基金主要投资于上市交易的证券，除在附注中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。除附注中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量因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。

本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资及买入返售金融资产等。本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。下表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

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	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产						
货币资金	1,681,760.93	-	-	-	-	1,681,760.93
债权投资	4,354,775.736.86	6,774,876.758.45	-	-	-	11,129,652,495.31
资产总计	4,356,457,497.79	6,774,876,758.45	-	-	-	11,131,334,256.24
负债						
应付管理人报酬	-	-	-	-	1,042,239.37	1,042,239.37
应付托管费	-	-	-	-	347,413.12	347,413.12
卖出回购金融资产款	2,667,503,595.77	-	-	-	-	2,667,503,595.77
应付销售服务费	-	-	-	-	3.30	3.30
其他负债	-	-	-	-	242,532.81	242,532.81
负债总计	2,667,503,595.77	-	-	-	1,632,188.60	2,669,135,784.37
利率敏感度缺口	1,688,953,902.02	6,774,876,758.45	-	-	-1,632,188.60	8,462,198,471.87
上年度末 2025 年 12 月 31 日	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产						
货币资金	1,395,277.55	-	-	-	-	1,395,277.55
结算备付金	500.06	-	-	-	-	500.06

债权投资	-	4,309,810,452.03	6,875,171,144.54	-	-	11,184,981,596.57
资产总计	1,395,777.61	4,309,810,452.03	6,875,171,144.54	-	-	11,186,377,374.18
负债						
应付管理人报酬	-	-	-	-	1,070,843.50	1,070,843.50
应付托管费	-	-	-	-	356,947.84	356,947.84
卖出回购金融资产款	2,821,405,365.36	-	-	-	-	2,821,405,365.36
应付销售服务费	-	-	-	-	3.41	3.41
其他负债	-	-	-	-	226,534.30	226,534.30
负债总计	2,821,405,365.36	-	-	-	1,654,329.05	2,823,059,694.41
利率敏感度缺口	-2,820,009,587.75	4,309,810,452.03	6,875,171,144.54	-	-1,654,329.05	8,363,317,679.77

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金于本期末及上年度末生息资产为银行存款、结算备付金及债券等。其中，银行存款和结算备付金以活期存款利率或相对固定的利率计息，债券为固定利率持有至到期投资，利息收益在交易时已确定，不受利率变化影响。本基金本期末生息负债仅为卖出回购金融资产，卖出回购金融资产的利息支出在交易时已确定，不受利率变化影响。因此在本期末及上年度末未持有其他生息资产/负债的情况下，市场利率的变动对于本基金资产净值的影响并不显著。

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。

本基金持有的金融工具以人民币计价，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。本基金投资于基金合同和相关法律法规及监管机构允许范围内的投资品种，主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的固定收益品种，且以摊余成本进行后续计量，因此无重大其他价格风险。

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	上年度末 2025年12月31日
----	------------------------	---------------------

	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)	公允价值	占基金资产净 值比例 (%)
交易性金融资 产—股票投资	—	—	—	—
交易性金融资 产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资 产—债券投资	11,129,652,495.31	131.52	11,184,981,596.57	133.74
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	11,129,652,495.31	131.52	11,184,981,596.57	133.74

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

本基金未持有以公允价值计量的金融工具。

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

无。

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

不适用。

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，除债券等债务工具外，其余金融工具因其剩余期限较短，因此账面价值与公允价值相若。于本基金本报告期末，本基金持有的债权投资的账面价值为人民币 11,129,652,495.31 元（2025 年 12 月 31 日：人民币 11,184,981,596.57 元），公允价值为人民币 11,211,103,792.90 元（2025 年 12 月 31 日：人民币 11,291,761,469.57 元），属于第二层次（2025 年 12 月 31 日：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

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	11,129,652,495.31	99.98
	其中：债券	11,129,652,495.31	99.98
	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	1,681,760.93	0.02
8	其他各项资产	-	-
9	合计	11,131,334,256.24	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

无。

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

无。

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

无。

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

无。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

无。

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	507,260,208.00	5.99
2	央行票据	—	—
3	金融债券	10,622,392,287.31	125.53
	其中：政策性金融债	6,774,876,758.45	80.06
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	可转债（可交换债）	—	—
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	11,129,652,495.31	131.52

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	220402	22 农发 02	48,800,000	4,934,986,926.65	58.32
2	220203	22 国开 03	17,200,000	1,738,111,609.84	20.54
3	019728	23 国债 25	5,000,000	507,260,208.00	5.99
4	2320041	23 南京银行 01	3,800,000	386,764,133.09	4.57
5	212380020	23 光大银行债 02	3,800,000	386,553,177.11	4.57

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

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

本基金本报告期末持仓国债期货。

7.10.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末持仓国债期货。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 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

因信贷资金投向不合规、贷后管理不到位等，金融监管总局对中国农业发展银行罚款 1020 万元。

因存在违反金融统计相关规定的行为，中国人民银行依据相关法律法规，对国家开发银行作出警告并罚款 123 万元的行政处罚决定。

因南京银行股份有限公司监管统计指标计量不准确，江苏金融监管局对南京银行股份有限公司罚款 70 万元。

因中国光大银行股份有限公司信息科技外包管理存在不足、监管数据错报等事项，金融监管总局对中国光大银行股份有限公司罚款 430 万元。

报告期内，本基金管理人严格遵循基金投资管理相关制度要求，上述证券发行主体的违法违规行暂不会造成重大负面影响，投资决策程序符合法律法规和公司制度的规定。

7.11.2 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

本基金本报告期末未持有股票。

7.11.3 期末其他各项资产构成

无。

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.11.6 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，投资组合报告中数字分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人 户数 (户)	户均持有的基 金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份 额比例 (%)	持有份额	占总 份额 比例 (%)
华润元大 润禧 39 个 月定开债 A	270	29,264,077.27	7,901,271,212.13	100.00	29,650.49	0.00
华润元大 润禧 39 个 月定开债 C	195	202.08	-	-	39,405.12	100.00
合计	465	16,992,129.61	7,901,271,212.13	100.00	69,055.61	0.00

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

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	华润元大润禧 39 个月定开债 A	748.65	0.0000
	华润元大润禧 39 个月定开债 C	3,572.33	9.0656
	合计	4,320.98	0.0001

注：截至本报告期末，本基金管理人从业人员投资、持有本基金符合相关法律法规、中国证监会规定及相关管理制度的规定。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门	华润元大润禧 39 个月定开债 A	0

负责人持有本开放式基金	华润元大润禧 39 个月定开债 C	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	华润元大润禧 39 个月定开债 A	0
	华润元大润禧 39 个月定开债 C	0
	合计	0

注：1、本期末基金管理人的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金的数量区间为 0 至 10 万份（含）。

2、本期末本基金的基金经理未持有本基金的数量。

3、截至本报告期末，本基金管理人从业人员投资、持有本基金符合相关法律法规、中国证监会规定及相关管理制度的规定。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华润元大润禧 39 个月定开债 A	华润元大润禧 39 个月定开债 C
基金合同生效日 （2020 年 8 月 24 日） 基金份额总额	3,600,072,265.21	38,653.35
本报告期期初基金 份额总额	7,901,300,862.62	39,405.12
本报告期基金总申 购份额	-	-
减：本报告期基金总 赎回份额	-	-
本报告期基金拆分 变动份额	-	-
本报告期期末基金 份额总额	7,901,300,862.62	39,405.12

注：本基金总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门无发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内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

报告期内基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金管理人聘请安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计的会计师事务所。本报告期内未改聘为本基金审计的会计师事务所。

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，管理人无受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内托管人无受调查或处罚等情况

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内托管人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
中泰证券	1	-	-	-	-	-

注：基金专用交易单元的选择标准和程序如下：

1、选择标准

- (1) 证券公司经营管理、信誉与财务状况良好，内部管理规范，具备健全的内部控制，遵守国家及证券监管机构的各项法律法规、监管规定的要求；
- (2) 维护资产委托人利益，不利用委托资产进行利益输送，不承诺交易量；
- (3) 有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告，并有能力根据基金投资的特殊要求，提供专门的定制服务；
- (4) 建立广泛的信息网络，能及时提供准确的信息咨询和路演调研等服务；
- (5) 证券公司具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，能满足基金产品运作有关敏感信息的安全和保密的要求；
- (6) 证券公司交易设施应符合代理基金产品进行证券交易的需要，及时完成交易指令，能按时发送对账单等。

2、选择程序

- (1) 本基金管理人组织相关人员依据上述标准对候选证券公司进行评估，确定选用的证券公司；
- (2) 选用证券公司确定后，公司与被选择的证券公司签订交易单元租用协议，交易单元租用手续办理；
- (3) 交易单元租用完成后，科技与运营部进行相关系统配置，并将交易单元变动情况通知托管人。

3、本基金本报告期内的基金专用交易单元未发生变化。

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	
	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(%)
中泰证券	-	-	-	-	-	-

注：无。

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	华润元大基金管理有限公司关于办公地变更的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、基金管理人网站、证监	2026 年 1 月 7 日

		会基金电子披露网站	
2	华润元大基金管理有限公司关于终止天津市润泽基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026 年 1 月 13 日
3	华润元大基金管理有限公司旗下基金 2025 年第 4 季度报告提示性公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报	2026 年 1 月 22 日
4	华润元大润禧 39 个月定期开放债券型证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026 年 1 月 22 日
5	华润元大基金管理有限公司旗下基金 2025 年年度报告提示性公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报	2026 年 3 月 31 日
6	华润元大润禧 39 个月定期开放债券型证券投资基金 2025 年年度报告	基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026 年 3 月 31 日
7	华润元大基金管理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）	基金管理人网站	2026 年 3 月 31 日
8	华润元大基金管理有限公司旗下基金 2026 年第 1 季度报告提示性公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报	2026 年 4 月 22 日
9	华润元大润禧 39 个月定期开放债券型证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026 年 4 月 22 日
10	2025 年度华润元大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	基金管理人网站	2026 年 4 月 30 日
11	华润元大基金管理有限公司关于旗下基金参加中国人寿保险股份有限公司基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026 年 6 月 16 日
12	华润元大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本公司旗下基金销售业务的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026 年 6 月 18 日
13	华润元大基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026 年 6 月 22 日
14	华润元大基金管理有限公司环境信息披露报告（2025 年度）	基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026 年 6 月 26 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额	期初	申购	赎回	持有份额	份额

		比例达到或者超过 20%的时间区间	份额	份额	份额		占比 (%)
机构	1	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	1,777,953,378.11	0.00	0.00	1,777,953,378.11	22.5019
产品特有风险							
本基金于本报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情形，本基金管理人已经采取措施，审慎确认大额申购与大额赎回，防控产品流动性风险并公平对待投资者。本基金管理人提请投资者注意因单一投资者持有基金份额集中导致的产品流动性风险、大额赎回风险以及净值波动风险等特有风险。							

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、中国证监会关于核准本基金募集的批复；
- 2、本基金基金合同；
- 3、本基金托管协议；
- 4、本报告期内在指定报刊上披露的各项公告。

12.2 存放地点

以上备查文件存放于基金管理人和基金托管人的办公场所。

12.3 查阅方式

基金持有人可在办公时间到基金管理人和基金托管人的办公场所或网站免费查阅。

华润元大基金管理有限公司
2026 年 8 月 31 日