证券代码：600168　　证券简称：武汉控股　　公告编号：临2025－053号

# 武汉三镇实业控股股份有限公司第九届董事会第四十五次会议决议公告

本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担法律责任。

一、董事会会议召开情况

武汉三镇实业控股股份有限公司（以下简称"公司"或"武汉控股"）第九届董事会第四十五次会议于2025年9月28日以通讯表决的方式召开。公司以书面方式通知全体董事，由于本次董事会审议事项属于关联交易事项，关联董事王静、周强、孙大全、曹明回避表决，本次董事会有表决权的董事7人，实际参与表决的董事7人。本次会议的召开符合《中华人民共和国公司法》和《公司章程》及其他有关法律法规的规定，会议合法有效。

二、董事会会议审议情况

会议通过认真审议，采取记名投票方式进行表决，通过了如下决议：

（一）审议通过了《关于调整公司发行股份及支付现金购买资产并募集配套资金具体方案的议案》

武汉控股拟发行股份及支付现金购买武汉市城市建设投资开发集团有限公司（以下简称"交易对方"）所持武汉市政工程设计研究院有限责任公司（以下简称"标的公司"）100%股权，并募集配套资金（以下简称"本次交易"）。

结合实际情况，拟对本次交易方案中的募集配套资金方案进行调整，具体调整内容如下：

（1）本次募集配套资金总额

| 项目 | 调整前 | 调整后 |
|---|---|---|
| 1 | 公司本次募集配套资金总额不超过136,000.00万元 | 公司本次募集配套资金总额不超过75,600.00万元 |

（2）本次募集配套资金用途

本次募集配套资金拟用于支付本次交易的现金对价、中介机构费用及相关税费、投入标的公司在建项目建设，取消用于补充上市公司或标的公司营运资金等，具体如下：

单位：万元

| 序号 | 项目名称 | 拟投资总额 | 拟使用募集资金 | 占募集配套资金总额的比例 |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 支付本次交易的现金对价 | 24,000.00 | 24,000.00 | 31.75% |
| 2 | 全国市场战略化布局项目 | 5,297.89 | 5,200.00 | 6.88% |
| 3 | 厂网河湖一体化全过程咨询中心建设项目 | 3,661.12 | 3,600.00 | 4.76% |
| 4 | 城市综合服务AI数智中心项目 | 13,536.82 | 13,500.00 | 17.86% |
| 5 | 公司信息化及城市基础设施更新运维能力提升项目 | 21,037.26 | 21,000.00 | 27.78% |
| 6 | 低空经济研究及试点应用项目 | 5,842.21 | 5,800.00 | 7.67% |
| 7 | 支付本次交易中介机构费用、相关税费 | 2,500.00 | 2,500.00 | 3.31% |
| | 合计 | 75,875.30 | 75,600.00 | 100.00% |

除上述调整内容外，本次交易方案仍按公司2025年第三次临时股东会审议通过的《关于公司发行股份及支付现金购买资产并募集配套资金暨关联交易方案的议案》中的方案内容执行。

上述议案在提交董事会审议前已经公司董事会独立董事专门会议审议通过。经公司2025年第三次临时股东会授权，上述议案无需提交股东会审议。

表决结果：7票同意、0票反对、0票弃权。关联董事王静、周强、孙大全、曹明已就该议案回避表决。

（二）审议通过了《关于本次交易方案调整不构成重大调整的议案》

本次交易方案调整为调减募集配套资金金额，不涉及标的资产、交易对方的变化，亦不涉及新增或调增募集配套资金。根据《上市公司重大资产重组管理办法》第二十九条第一款、《＜上市公司重大资产重组管理办法＞第二十九条、第四十五条的适用意见——证券期货法律适用意见第15号》的相关规定，本次交易方案调整不构成重大调整。

上述议案在提交董事会审议前已经公司董事会独立董事专门会议审议通过。经公司2025年第三次临时股东会授权，上述议案无需提交股东会审议。

表决结果：7票同意、0票反对、0票弃权。关联董事王静、周强、孙大全、曹明已就该议案回避表决。

（三）审议通过了《关于修订＜武汉三镇实业控股股份有限公司发行股份及支付现金购买资产并募集配套资金暨关联交易草案＞及其摘要的议案》

根据本次交易的具体情况，公司根据《中华人民共和国证券法》以及《上市公司重大资产重组管理办法》等相关法律法规及其他规范性文件要求对《武汉三镇实业控股股份有限公司发行股份及支付现金购买资产并募集配套资金暨关联交易草案》及其摘要的部分内容进行补充修订。

上述议案在提交董事会审议前已经公司董事会独立董事专门会议审议通过。经公司2025年第三次临时股东会授权，上述议案无需提交股东会审议。

表决结果：7票同意、0票反对、0票弃权。关联董事王静、周强、孙大全、曹明已就该议案回避表决。

特此公告。

武汉三镇实业控股股份有限公司董事会
2025年9月28日

证券代码：600168　　证券简称：武汉控股　　公告编号：临2025-054号

# 武汉三镇实业控股股份有限公司关于本次交易方案调整不构成重大调整的公告

本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担法律责任。

武汉三镇实业控股股份有限公司（以下简称"武汉控股"、"上市公司"或"公司"）拟通过发行股份及支付现金的方式向武汉市城市建设投资开发集团有限公司购买其持有的武汉市政工程设计研究院有限责任公司（以下简称"标的公司"）100%股权，并向不超过35名符合中国证券监督管理委员会规定条件的特定投资者发行股份募集配套资金（以上交易事项简称"本次交易"）。

2025年9月28日，武汉控股召开第九届董事会第四十五次会议，审议通过了《关于调整公司发行股份及支付现金购买资产并募集配套资金具体方案的议案》《关于本次交易方案调整不构成重大调整的议案》《关于修订＜武汉三镇实业控股股份有限公司发行股份及支付现金购买资产并募集配套资金暨关联交易草案＞及其摘要的议案》等相关议案，并披露了《武汉三镇实业控股股份有限公司发行股份及支付现金购买资产并募集配套资金暨关联交易报告书（草案）》，对本次交易方案进行调整，具体情况如下：

一、本次交易方案调整的具体情况

（一）本次募集配套资金金额

| 项目 | 调整前 | 调整后 |
|---|---|---|
| 本次募集配套资金金额 | 本次交易募集配套资金总额不超过136,000万元 | 本次交易募集配套资金总额不超过75,600万元 |

（二）本次募集配套资金用途

调整前：

本次募集配套资金拟用于支付本次交易的现金对价、中介机构费用及相关税费、投入标的公司在建项目建设、补充上市公司或标的公司营运资金等，具体如下：

单位：万元

| 序号 | 项目名称 | 拟投资总额 | 拟使用募集资金 | 占募集配套总额的比例 |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 支付本次交易的现金对价 | 24,000.00 | 24,000.00 | 17.65% |
| 2 | 全国市场战略化布局项目 | 5,297.89 | 5,200.00 | 3.82% |
| 3 | 厂网河湖一体化全过程咨询中心建设项目 | 3,661.12 | 3,600.00 | 2.65% |
| 4 | 城市综合服务AI数智中心项目 | 13,536.82 | 13,500.00 | 9.93% |
| 5 | 公司信息化及城市基础设施更新运维能力提升项目 | 21,037.26 | 21,000.00 | 15.44% |
| 6 | 低空经济研究及试点应用项目 | 5,842.21 | 5,800.00 | 4.26% |
| 7 | 补充营运资金 | 60,400.00 | 60,400.00 | 44.41% |
| 8 | 支付本次交易中介机构费用、相关税费 | 2,500.00 | 2,500.00 | 1.84% |
| | 合计 | 136,275.30 | 136,000.00 | 100.00% |

调整后：

本次募集配套资金拟用于支付本次交易的现金对价、中介机构费用及相关税费、投入标的公司在建项目建设等，具体如下：

单位：万元

| 序号 | 项目名称 | 拟投资总额 | 拟使用募集资金 | 占募集配套资金总额的比例 |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 支付本次交易的现金对价 | 24,000.00 | 24,000.00 | 31.75% |
| 2 | 全国市场战略化布局项目 | 5,297.89 | 5,200.00 | 6.88% |
| 3 | 厂网河湖一体化全过程咨询中心建设项目 | 3,661.12 | 3,600.00 | 4.76% |
| 4 | 城市综合服务AI数智中心项目 | 13,536.82 | 13,500.00 | 17.86% |
| 5 | 公司信息化及城市基础设施更新运维能力提升项目 | 21,037.26 | 21,000.00 | 27.78% |
| 6 | 低空经济研究及试点应用项目 | 5,842.21 | 5,800.00 | 7.67% |
| 7 | 支付本次交易中介机构费用、相关税费 | 2,500.00 | 2,500.00 | 3.31% |
| | 合计 | 75,875.30 | 75,600.00 | 100.00% |

二、本次重组方案调整不构成重组方案重大调整

根据《上市公司重大资产重组管理办法》第二十九条第一款规定，"股东会作出重大资产重组的决议后，上市公司拟对交易对象、交易标的、交易价格等作出变更，构成对原交易方案重大调整的，应当在董事会表决通过后重新提交股东会审议，并及时公告相关文件。"

根据中国证券监督管理委员会于2025年3月27日发布的《〈上市公司重大资产重组管理办法〉第二十九条、第四十五条的适用意见——证券期货法律适用意见第15号》，构成重组方案的重大调整的认定如下：

"（一）拟对交易对象进行变更的，原则上视为构成对重组方案重大调整，但是有以下两种情况的，可以视为不构成对重组方案重大调整：

1、拟减少交易对象的，如交易各方同意将该交易对象及其持有的标的资产份额剔除出重组方案，且剔除相关标的资产后按照下述有关交易标的变更的规定不构成对重组方案重大调整的；

2、拟调整交易对象所持标的资产份额的，如交易各方同意交易对象之间转让标的资产份额，且转让份额不超过交易作价百分之二十的。

（二）拟对标的资产进行变更的，原则上视为构成对重组方案重大调整，但是同时满足以下条件的，可以视为不构成对重组方案重大调整：

1、拟增加或减少的交易标的的交易作价、资产总额、资产净额及营业收入占原标的资产相应指标总量的比例均不超过百分之二十；

2、变更标的资产对交易标的的生产经营不构成实质性影响，包括不影响标的资产及业务完整性等。

（三）新增或调增配套募集资金，应当视为构成对重组方案重大调整。调减或取消配套募集资金不构成重组方案的重大调整。证券交易所并购重组委员会会议可以提出本次交易符合重组条件和信息披露要求的审议意见，但要求申请人调减或取消配套募集资金。"

本次交易方案调整仅涉及调减配套募集资金，不涉及对交易对象、标的资产的变更，不涉及新增或调增配套募集资金。根据《上市公司重大资产重组管理办法》第二十九条第一款、《〈上市公司重大资产重组管理办法〉第二十九条、第四十五条的适用意见——证券期货法律适用意见第15号》的规定，本次交易调减配套募集资金不构成重组方案的重大调整。因此，本次重组方案调整不构成重组方案的重大调整。

三、本次交易方案调整履行的决策程序

2025年9月28日，公司召开第九届董事会第四十五次会议，逐项审议通过了《关于调整公司发行股份及支付现金购买资产并募集配套资金具体方案的议案》《关于本次交易方案调整不构成重大调整的议案》《关于修订＜武汉三镇实业控股股份有限公司发行股份及支付现金购买资产并募集配套资金暨关联交易草案＞及其摘要的议案》。提交董事会审议前，公司独立董事专门会议已审议通过前述议案。本次交易方案的调整事项在公司2025年第三次股东会对董事会的授权范围内，无需再行提交股东大会审议。

四、独立财务顾问核查意见

经核查，公司独立财务顾问中国国际金融股份有限公司认为：根据《上市公司重大资产重组管理办法》和《＜上市公司重大资产重组管理办法＞第二十九条、第四十五条的适用意见——证券期货法律适用意见第15号》等相关规定，本次交易方案调整不构成重组方案的重大调整。

特此公告。

武汉三镇实业控股股份有限公司董事会
2025年9月28日

# 关于嘉实致宁3个月定开纯债债券第十八个开放期开放申购、赎回和转换业务的公告

公告送出日期：2025年9月29日

1 公告基本信息

| | |
|---|---|
| 基金名称 | 嘉实致宁3个月定期开放纯债债券型证券投资基金 |
| 基金简称 | 嘉实致宁3个月定开纯债债券 |
| 基金主代码 | 008620 |
| 基金运作方式 | 契约型，以定期开放的方式运作 |
| 基金合同生效日 | 2020年3月6日 |
| 基金管理人名称 | 嘉实基金管理有限公司 |
| 基金托管人名称 | 南京银行股份有限公司 |
| 基金注册登记机构名称 | 嘉实基金管理有限公司 |
| 公告依据 | 《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律法规以及《嘉实致宁3个月定期开放纯债债券型证券投资基金基金合同》、《嘉实致宁3个月定期开放纯债债券型证券投资基金招募说明书》及其更新等 |
| 申购起始日 | 2025年10月9日 |
| 赎回起始日 | 2025年10月9日 |
| 转换转入起始日 | 2025年10月9日 |
| 转换转出起始日 | 2025年10月9日 |

注：投资者范围：符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人。

2 申购、赎回、转换业务的办理时间

（1）开放日及开放时间

投资人办理基金份额的申购、赎回等业务的开放日为相应开放期的每个工作日，2025年10月9日（含该日）至2025年10月15日（含该日）为本基金第十八个开放期，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。

基金合同生效后，若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整，但应在调整实施日前依照《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称"《信息披露办法》"）的有关规定在指定媒介上公告。

（2）申购、赎回、转换开始日及业务办理时间

基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回或转换。在开放期内，投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请且登记机构确认接收的，视为投资人下一开放日提出的申购、赎回或转换申请，并按照下一个开放日的申请处理。但若投资人在开放期最后一日业务办理时间结束之后，下一开放期首日之前提出申购、赎回或转换申请的，视为无效申请。

3 申购业务

3.1 申购金额限制

投资者通过非直销销售机构或嘉实基金管理有限公司网上直销首次申购单笔最低限额为人民币1元（含申购费），追加申购单笔最低限额为人民币1元（含申购费）；投资者通过直销中心柜台首次申购单笔最低限额为人民币20,000元（含申购费），追加申购单笔最低限额为人民币1元（含申购费）。各销售机构对本基金的具体申购最低限额及交易级差有其他规定的，以各销售机构规定为准。

投资者可多次申购，对单个投资者累计持有份额不设上限限制，但单一投资者累计持有份额不得达到或者超过本基金总份额的50%，且不得变相规避50%集中度要求。法律法规、中国证监会或基金合同另有规定的除外。

3.2 申购费率

本基金采用前端收费模式收取基金申购费用。投资者在一天之内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。具体如下：

| 申购金额（含申购费） | 申购费率 |
|---|---|
| M＜100万元 | 0.8% |
| 100万元≤M＜300万元 | 0.5% |
| 300万元≤M＜500万元 | 0.3% |
| M≥500万元 | 按笔收取，单笔1000元 |

个人投资者通过本基金管理人直销网上交易系统申购本基金业务实行申购费率优惠，其申购费率不按申购金额分档，统一优惠为申购金额的0.6%，但中国银行长城借记卡持卡人，申购本基金的申购费率优惠按照相关公告规定的费率执行；机构投资者通过本基金管理人直销网上交易系统申购本基金，其申购费率不按申购金额分档，统一优惠为申购金额的0.6%。优惠后费率如果低于0.6%，则按0.6%执行。基金招募说明书及相关公告规定的相应申购费率低于0.6%时，按实际费率收取申购费。个人投资者于本公司网上直销系统通过汇款方式申购本基金，前端申购费率按照相关公告规定的优惠费率执行。

若有销售机构特别约定开办本基金申购业务实行申购费率优惠并已经发布临时公告，则具体费率优惠措施及业务规则以该等公告为准。

3.3 其他与申购相关的事项

（1）本基金的申购费用由申购人承担，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用，不列入基金财产。

（2）基金管理人可在法律法规允许的情况下，调整上述规定申购金额的数量限制，基金管理人必须在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告并报中国证监会备案。

（3）基金管理人可以在法律法规、基金合同约定的范围内调整申购费率或收费方式，并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

4 赎回业务

4.1 赎回份额限制

投资者通过销售机构赎回本基金份额时，可申请将其持有的部分或全部基金份额赎回；单笔赎回不得少于1份，每个基金交易账户最低持有基金份额余额为1份，若某笔赎回导致某一销售机构的某一基金交易账户的基金份额余额少于1份时，基金管理人有权将投资者在该销售机构的某一基金交易账户剩余基金份额一次性全部赎回。各销售机构对本基金的具体赎回份额限制有其他规定的，以各销售机构规定为准。

4.2 赎回费率

基金份额的赎回费率按照持有时间递减，即相关基金份额持有时间越长，所适用的赎回费率越低。

本基金基金份额的赎回费率具体如下：

| 持有期限（N） | 赎回费率 |
|---|---|
| N＜7天 | 1.5% |
| 7天≤N＜30天 | 0.1% |
| N≥30天 | 0% |

4.3 其他与赎回相关的事项

（1）本基金的赎回费用由基金份额持有人承担。对持续持有期少于30日的投资人收取的赎回费全额计入基金财产。

（2）基金管理人可在法律法规允许的情况下，调整上述规定赎回份额的数量限制，基金管理人必须在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告并报中国证监会备案。

（3）基金管理人可以在法律法规、基金合同约定的范围内调整赎回费率或收费方式，并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

5 转换业务

5.1 可转换基金

本基金开通与嘉实旗下其它开放式基金（由同一注册登记机构办理注册登记的、且已公告开通基金转换业务）之间的转换业务，各基金转换业务的开放状态、交易限制及转换名单可从各基金相关公告或嘉实官网基金详情页面进行查询。

5.2 基金转换费用

本基金转换费用由转出基金赎回费用及基金申购补差费用构成：

1、通过非直销销售机构办理基金转换业务

转出基金有赎回费用的，收取该基金的赎回费用。从低申购费用基金向高申购费用基金转换时，每次收取申购补差费用；从高申购费用基金向低申购费用基金转换时，不收取申购补差费用。申购补差费用按照转换金额对应的转出基金与转入基金的申购费用差额进行补差。

2、通过直销（直销柜台及网上直销）办理基金转换业务

转出基金有赎回费用的，收取该基金的赎回费用。从0申购费用基金向非0申购费用基金转换时，每次按照非0申购费用基金申购费用收取申购补差费；非0申购费用基金互转时，不收取申购补差费用。

通过网上直销办理转换业务的，转入基金适用的申购费率比照该基金网上直销相应优惠费率执行。

3、基金转换份额的计算

基金转换采取未知价法，以申请当日基金份额净值为基础计算。计算公式如下：

转出基金金额=转出份额×转出基金当日基金份额净值

转出基金赎回费用=转出基金金额×转出基金赎回费率

转出基金申购费用=（转出基金金额-转出基金赎回费用）×转出基金申购费率÷（1+转出基金申购费率）

转入基金申购费用=（转出基金金额-转出基金赎回费用）×转入基金申购费率÷（1+转入基金申购费率）

申购补差费用 =MAX（0，转入基金申购费用-转出基金申购费用）

转换费用=转出基金赎回费用+申购补差费用

净转入金额=转出基金金额-转换费用

转入份额=净转入金额/转入基金当日基金份额净值

转出基金有赎回费用的，收取的赎回费归入基金财产的比例不得低于法律法规、中国证监会规定的比例下限以及该基金基金合同的相关约定。

5.3 其他与转换相关的事项

（1）基金转换的时间：投资者需在转出基金和转入基金均有交易的当日，方可办理基金转换业务。

（2）基金转换的原则：

①采用份额转换原则，即基金转换以份额申请；

②当日的转换申请可以在当日交易结束时间前撤销，在当日的交易时间结束后不得撤销；

③基金转换价格以申请转换当日基金份额净值为基础计算；

④投资者可在任一同时销售拟转出基金及转入基金的销售机构处办理基金转换。基金转换只能在同一销售机构进行。转换的两只基金必须都是该销售机构代理的同一基金管理人管理的、在同一基金注册登记机构处注册的基金；

⑤基金管理人可在不损害基金份额持有人权益的情况下更改上述原则，但应在新的原则实施前在至少一种中国证监会指定媒介公告。

（3）基金转换的程序

①基金转换的申请方式

基金投资者必须根据基金管理人和基金销售机构规定的手续，在开放日的业务办理时间提出转换的申请。

投资者提交基金转换申请时，账户中必须有足够可用的转出基金份额余额。

②基金转换申请的确认

基金管理人应以在规定的基金业务办理时间段内收到基金转换申请的当天作为基金转换的申请日（T日），并在T+1日对该交易的有效性进行确认。投资者可在T+2日及之后查询成交情况。

（4）基金转换的数额限制

基金转换时，投资者通过销售机构由本基金转换到基金管理人管理的其他开放式基金时，最低转出份额以基金管理人或销售机构发布的公告为准。

基金管理人可根据市场情况制定或调整基金转换的有关限制并及时公告。

（5）基金转换的注册登记

投资者申请基金转换成功后，基金注册登记机构在T＋1日为投资者办理减少转出基金份额、增加转入基金份额的权益登记手续。一般情况下，投资者自T＋2日起有权赎回转入部分的基金份额。

基金管理人可在法律法规允许的范围内，对上述注册登记办理时间进行调整，并于开始实施前在至少一种中国证监会指定媒介公告。

（6）基金转换与巨额赎回

当发生巨额赎回时，本基金转出与基金赎回具有相同的优先级，基金管理人可根据基金资产组合情况，决定全额转出或部分转出，并且对于本基金转出和基金赎回，将采取相同的比例确认；但基金管理人在当日接受部分转出申请的情况下，对未确认的转换申请将不予顺延。

（7）拒绝或暂停基金转换的情形及处理方式

①发生下列情况之一时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的转入申请：

（a）因不可抗力导致基金无法正常运作；

（b）发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况；

（c）证券交易所或期货交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；

（d）基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，或发生其他损害现有基金份额持有人利益的情形；

（e）基金管理人、基金托管人、销售机构、登记机构、支付结算机构等因异常情况导致基金销售系统、基金注册登记系统、基金会计系统等无法正常运行；

（f）占前一估值日基金资产净值50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停接受基金转入申请；

（g）当继续接受转入申请，可能会导致本基金总规模超过基金管理人规定的本基金总规模上限时；或使本基金单日净申购比例超过基金管理人规定的当日净申购比例上限；

（h）基金管理人接受某笔或者某些转入申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过50%，或者变相规避50%集中度的情形时；

（i）接受某笔或某些转入申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益；

（j）当接受某笔或某些转入申请，可能会导致该投资人累计持有的份额超过单个投资人累计持有的份额上限；或该投资人当日转入金额超过单个投资人单日或单笔转入金额上限；

（k）法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

②发生下列情形之一时，基金管理人可暂停接受投资人的转出申请或者延缓支付转出款项：

（a）因不可抗力导致基金管理人不能支付转出款项；

（b）发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况；

（c）证券交易所或期货交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；

（d）连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回；

（e）发生继续接受转出申请将损害现有基金份额持有人利益的情形；

（f）占前一估值日基金资产净值50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当延缓支付转出款项或暂停接受基金转出申请；

（g）基金管理人、基金托管人、销售机构、登记机构等因异常情况导致基金销售系统、基金注册登记系统、基金会计系统等无法正常运行；

（h）法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

③基金转换业务的解释权归基金管理人，基金管理人可以根据市场情况在不违背有关法律法规和《基金合同》的规定之前提下调整上述转换的收费方式、费率水平、业务规则及有关限制，但应在调整生效前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

投资者到本基金销售机构的销售网点办理本基金转换业务时，其相关具体办理规定以各销售机构的规定为准。

6 基金销售机构

6.1 直销机构

（1）嘉实基金管理有限公司直销中心

| | | | |
|---|---|---|---|
| 办公地址 | 北京市丰台区丽泽路16号院4号楼汇亚大厦12层 | | |
| 电话 | （010）65215588 | 传真 | （010）65215577 |
| 联系人 | 黄娜 | | |

（2）嘉实基金管理有限公司网上直销

具体信息详见本公司网站（www.jsfund.cn）。

6.2 场外非直销机构

广发银行股份有限公司、南京银行股份有限公司、长沙银行股份有限公司、博时财富基金销售有限公司、上海好买基金销售有限公司、上海长量基金销售有限公司、上海利得基金销售有限公司、嘉实财富管理有限公司、北京创金启富基金销售有限公司、北京汇成基金销售有限公司、北京济安基金销售有限公司、上海联泰基金销售有限公司、泰信财富基金销售有限公司、上海基煜基金销售有限公司、上海攀赢基金销售有限公司、大连网金基金销售有限公司、深圳市新兰德证券投资咨询有限公司、和讯信息科技有限公司、上海挖财基金销售有限公司、贵州省贵文文化基金销售有限公司、腾安基金销售（深圳）有限公司、北京百度百盈基金销售有限公司、上海天天基金销售有限公司、蚂蚁（杭州）基金销售有限公司、浙江同花顺基金销售有限公司、泛华普益基金销售有限公司、上海大智慧基金销售有限公司、上海万得基金销售有限公司、珠海盈米基金销售有限公司、京东肯特瑞基金销售有限公司、北京雪球基金销售有限公司、深圳市前海排排网基金销售有限责任公司、华瑞保险销售有限公司、中信建投证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、申万宏源证券有限公司、国投证券股份有限公司、中信证券（山东）有限责任公司、中信证券华南股份有限公司、平安证券股份有限公司、申万宏源西部证券有限公司、东方财富证券股份有限公司、国联民生证券股份有限公司、华福证券有限责任公司、中邮证券有限责任公司、中信期货有限公司。

各销售机构可办理的基金业务类型及具体业务办理状况遵循其各自规定执行。

6.3 其他与基金销售机构相关的事项

销售机构办理本基金申购、赎回和转换等业务的具体网点、流程、规则、数额限制等遵循销售机构的相关规定，各销售机构可办理的基金业务类型及业务办理状况以其各自规定为准。投资者可登录本公司网站（www.jsfund.cn）查询本基金销售机构信息。

7. 基金份额净值公告的披露安排

在开放期内，基金管理人应当在每个开放日的次日，通过指定网站、基金销售机构网站或者营业网点披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值，并在开放期首日披露上一封闭期最后一个工作日的基金份额净值和基金份额累计净值。

8. 其他需要提示的事项

（1）嘉实致宁3个月定期开放纯债债券型证券投资基金为契约型、以定期开放方式运作的证券投资基金，基金管理人为嘉实基金管理有限公司，注册登记机构为嘉实基金管理有限公司，基金托管人为南京银行股份有限公司。

（2）本公告仅对本基金的开放申购、赎回、转换业务事项予以说明。投资者欲了解本基金详细情况，请认真阅读《嘉实致宁3个月定期开放纯债债券型证券投资基金招募说明书》及其更新，亦可登陆本公司网站（www.jsfund.cn）和中国证监会基金电子披露网站（http://eid.csrc.gov.cn/fund）进行查询。

（3）投资者T日提交的有效申请，在正常情况下，基金注册登记机构在T+1日内对该交易的有效性进行确认。投资者应在T+2日后（包括该日）到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。否则，如因申请未得到基金管理人或注册登记机构的确认而造成的损失，由投资者自行承担。基金销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申请。申购与赎回的确认以注册登记机构的确认结果为准。

（4）风险提示：本公司承诺以诚实信用、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，也不保证最低收益。敬请投资者留意投资风险。

（上接D8版）

本基金的投资组合比例为：本基金投资于债券的比例不低于基金资产的80%，其中投资于可转换债券（含分离交易可转债）的比例不超过基金资产的20%。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，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：中债综合财富（1-3年）指数收益率×80%+一年期定期存款利率×20%。

4.2 财务报表的编制基础

本财务报表以持续经营为基础编制。

本基金财务报表仅为了对本基金进行管理人变更并向本基金持有人报告以及根据监管要求向中国证券投资基金业协会、中国证监会及其派出机构和本基金托管人基于本基金管理人变更相关目的呈报。

本财务报表仅列示了本基金于2025年7月21日（管理人变更前一日）的资产负债表、自2025年1月1日至2025年7月21日（管理人变更前一日）止期间的利润表、净资产变动表以及部分财务报表附注，不列示比较数据以及相关财务报表附注。本财务报表未披露金融工具的风险分析及敏感性分析、公允价值相关内容等。因此，本财务报表不是一份完整的财务报表，也不包含一份完整财务报表所应披露的所有会计政策及附注。

除上段所述事项外，本财务报表根据以下附注4.3中所述的会计政策编制，这些会计政策符合中华人民共和国财政部（以下简称"财政部"）颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》的要求。

4.3 重要会计政策和会计估计

4.3.1 会计年度

本基金的会计年度自公历2025年1月1日至2025年12月31日止。本期财务报表的实际编制期间自2025年1月1日至2025年7月21日（管理人变更前一日）止。

4.3.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币，编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

4.3.3 金融资产和金融负债的分类

（a）金融资产的分类

本基金通常根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征，在初始确认时将金融资产分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以摊余成本计量的金融资产。

除非本基金改变管理金融资产的业务模式，在此情形下，所有受影响的相关金融资产在业务模式发生变更后的首个报告期间的第一天进行重分类，否则金融资产在初始确认后不得进行重分类。

本基金将同时符合下列条件且未被指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，分类为以摊余成本计量的金融资产：

－本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标；

－该金融资产的合同条款规定，在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。

除上述以摊余成本计量的金融资产外，本基金将其余所有的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。本基金现无分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

管理金融资产的业务模式，是指本基金如何管理金融资产以产生现金流量。业务模式决定本基金所管理金融资产现金流量的来源是收取合同现金流量、出售金融资产还是两者兼有。本基金以客观事实为依据、以关键管理人员决定的对金融资产进行管理的特定业务目标为基础，确定管理金融资产的业务模式。

本基金对金融资产的合同现金流量特征进行评估，以确定相关金融资产在特定日期产生的合同现金流量是否仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。其中，本金是指金融资产在初始确认时的公允价值；利息包括对货币时间价值、与特定时期未偿付本金金额相关的信用风险、以及其他基本借贷风险、成本和利润的对价。此外，本基金对可能导致金融资产合同现金流量的时间分布或金额发生变更的合同条款进行评估，以确定其是否满足上述合同现金流量特征的要求。

（b）金融负债的分类

本基金将金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及以摊余成本计量的金融负债。

－以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

该类金融负债包括交易性金融负债（含属于金融负债的衍生工具）和指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

－以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

本基金现无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

4.3.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

（a）金融工具的初始确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

（b）金融工具的后续计量

－以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产以公允价值进行后续计量，产生的利得或损失（包括利息和股利收入）计入当期损益，除非该金融资产属于套期关系的一部分。

－以摊余成本计量的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产采用实际利率法以摊余成本计量。以摊余成本计量且不属于任何套期关系的一部分的金融资产所产生的利得或损失，在终止确认、重分类、按照实际利率法摊销或确认减值时，计入当期损益。

－以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债以公允价值进行后续计量，除与套期会计有关外，产生的利得或损失（包括利息费用）计入当期损益。

－以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

（c）金融工具的终止确认

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

－收取该金融资产现金流量的合同权利终止；

－该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；

－该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

－所转移金融资产在终止确认日的账面价值；

－因转移金融资产而收到的对价。

金融负债（或其一部分）的现时义务已经解除的，本基金终止确认该金融负债（或该部分金融负债）。

（d）金融工具的减值

本基金以预期信用损失为基础，对下列项目进行减值会计处理并确认损失准备：

－以摊余成本计量的金融资产

本基金持有的其他以公允价值计量的金融资产不适用预期信用损失模型。

预期信用损失的计量

预期信用损失，是指以发生违约的风险为权重的金融工具信用损失的加权平均值。信用损失，是指本基金按照原实际利率折现的、根据合同应收的所有合同现金流量与预期收取的所有现金流量之间的差额，即全部现金短缺的现值。

在计量预期信用损失时，本基金需考虑的最长期限为面临信用风险的最长合同期限（包括考虑续约选择权）。

整个存续期预期信用损失，是指因金融工具整个预计存续期内所有可能发生的违约事件而导致的预期信用损失。

未来12个月内预期信用损失，是指因资产负债表日后12个月内（若金融工具的预计存续期少于12个月，则为预计存续期）可能发生的金融工具违约事件而导致的预期信用损失，是整个存续期预期信用损失的一部分。

本基金对满足下列情形的金融工具按照相当于未来12个月内预期信用损失的金额计量其损失准备，对其他金融工具按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备：

－该金融工具在资产负债表日只具有较低的信用风险；或

－该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加。

预期信用损失准备的列报

为反映金融工具的信用风险自初始确认后的变化，本基金在每个资产负债表日重新计量预期信用损失，由此形成的损失准备的增加或转回金额，应当作为减值损失或利得计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融资产，损失准备抵减该金融资产在资产负债表中列示的账面价值。

核销

如果本基金不再合理预期金融资产合同现金流量能够全部或部分收回，则直接减记该金融资产的账面余额。这种减记构成相关金融资产的终止确认。这种情况通常发生在本基金确定债务人没有资产或收入来源可产生足够的现金流量以偿还将被减记的金额。但是，被减记的金融资产仍可能受到本基金催收到期款项相关执行活动的影响。

已减记的金融资产以后又收回的，作为减值损失的转回计入收回当期的损益。

4.3.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，根据企业会计准则的规定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。

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

对不存在活跃市场的金融工具，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，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。

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似金融工具的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整并确定公允价值。

4.3.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

－本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；

－本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

4.3.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

4.3.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量，并于会计期末全额转入未分配利润。

4.3.9 收入/（损失）的确认和计量

利息收入

存款利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认为利息收入。

投资收益

股票投资收益、债券投资收益、资产支持证券投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其初始计量金额的差额确认，处置时产生的交易费用计入投资收益。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资及资产支持证券投资，在其持有期间，按票面金额和票面利率计算的利息计入投资收益。

公允价值变动收益

公允价值变动收益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、衍生工具、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。不包括本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资在持有期间按票面利率计算的利息。

4.3.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费（如有）在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算。

4.3.11 基金的收益分配政策

本基金每一基金份额享有同等分配权。本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为12次，每份基金份额每次基金收益分配比例不得低于基金收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的10%；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

4.3.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

4.3.13 其他重要的会计政策和会计估计

编制财务报表时，本基金需要运用估计和假设，这些估计和假设会对会计政策的应用及资产、负债、收入和支出的金额产生影响。实际情况可能与这些估计不同。本基金对估计涉及的关键假设和不确定因素的判断进行持续评估，会计估计变更的影响在变更当期和未来期间予以确认。

根据《关于固定收益品种的估值处理标准》在银行间债券市场、上海证券交易所、深圳证券交易所、北京证券交易所及中国证券监督管理委员会认可的其他交易场所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值基准服务机构提供的价格数据进行估值。

4.4 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

4.4.1 会计政策变更的说明

无。

4.4.2 会计估计变更的说明

无。

4.4.3 差错更正的说明

无。

4.5 税项

本基金运作过程中涉及的各纳税事项，依照财政部、国家税务总局的相关规定以及其他相关规定执行。主要税项列示如下：

（1）根据财政部和国家税务总局发布的《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》（财税[2016]36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[2016]140号）、《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》（财税[2017]2号）及《关于资管产品增值税有关问题的通知》（财税[2017]56号）及其他相关税收法规的规定，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，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。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。对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入免征增值税。

根据《财政部等部门关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》（财政部、国家税务总局发布2025年第4号公告）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。

（2）截至财务报表批准日，财政部和国家税务总局尚未就契约型资管产品的所得税事项出台具体规定。本报告期内，本基金未计提所得税费用。如果有关税收法规在未来得以明确，财务报表就此所作出的估计可能会根据相关税收法规而作出调整。

（3）本基金进行的证券交易所适用的出让方应征收的印花税税率为0.10%，对受让方不再征税；根据《关于减半征收证券交易印花税的公告》（财政部、税务总局公告2023年第39号）的规定，自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收。对于通过沪港通、深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

（4）根据《中华人民共和国个人所得税法》、《国家税务总局关于加强企业债券利息个人所得税代扣代缴工作的通知》（国税函[2003]612号）、《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》（财税[2012]85号）及《财政部国家税务总局证监会关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》（财税[2015]101号）、《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》（财政部、税务总局公告2024年第8号）及其他相关税收法规的规定，对从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（"挂牌公司"）取得的股息红利所得，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，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

截至2025年7月21日（管理人变更前一日），由于没有专门针对本基金作为上述股息红利及债券利息个人所得税代扣代缴义务人的明确税务规定，经与托管人协商一致，本基金对所取得的股息红利收入不计提股息红利个人所得税；本基金在实际取得债券利息时按收到的利息金额确认收入，不计提债券利息个人所得税。如果上述税务事项的最终认定结果与估计存在差异，该差异将可能对作出上述最终认定所对应期间的应代扣代缴所得税和净资产金额产生影响。

（5）对本基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照资管产品管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

（6）对本基金取得的源自境外的差价收入和股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行。

4.6 重要财务报表项目的说明

4.6.1 货币资金

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2025年7月21日（管理人变更前一日） |
|---|---|
| 活期存款 | 51,683,798.95 |
| 等于：本金 | 51,665,297.19 |
| 加：应计利息 | 18,501.76 |
| 定期存款 | － |
| 等于：本金 | － |
| 加：应计利息 | － |
| 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 | － |
| 合计 | 51,683,798.95 |

4.6.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | | 本期末 2025年7月21日（管理人变更前一日） | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 成本 | 应计利息 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | | － | － | － | － |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | | － | － | － | － |
| 债券 | 交易所市场 | 628,403,980.23 | 8,029,677.73 | 647,221,962.63 | 10,788,304.67 |
| | 银行间市场 | － | － | － | － |
| | 合计 | 628,403,980.23 | 8,029,677.73 | 647,221,962.63 | 10,788,304.67 |
| 资产支持证券 | | － | － | － | － |
| 基金 | | － | － | － | － |
| 其他 | | － | － | － | － |
| 合计 | | 628,403,980.23 | 8,029,677.73 | 647,221,962.63 | 10,788,304.67 |

4.6.3 衍生金融资产/负债

4.6.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

4.6.4 买入返售金融资产

4.6.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

4.6.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

4.6.5 债权投资

4.6.5.1 债权投资情况

无。

4.6.6 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 自2025年1月1日至2025年7月21日（管理人变更前一日）止期间 | |
|---|---|---|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 1,655,507,129.48 | 1,655,507,129.48 |
| 本期申购 | 79,851,909.03 | 79,851,909.03 |
| 本期赎回（以"-"号填列） | -1,067,128,529.80 | -1,067,128,529.80 |
| 本期末 | 668,230,508.71 | 668,230,508.71 |

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

4.6.7 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 | 117,738,291.53 | -64,484,066.25 | 53,254,225.28 |
| 本期期初 | 117,738,291.53 | -64,484,066.25 | 53,254,225.28 |
| 本期利润 | 10,066,242.95 | 3,117,511.53 | 13,183,754.48 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -74,233,616.54 | 38,399,235.21 | -35,834,381.33 |
| 其中：基金申购款 | 5,758,375.41 | -3,077,043.07 | 2,681,332.34 |
| 基金赎回款 | -79,991,991.95 | 41,476,278.28 | -38,515,713.67 |
| 本期已分配利润 | － | － | － |
| 本期末 | 53,570,917.94 | -22,967,319.51 | 30,603,598.43 |

4.7 或有事项、资产负债表日后事项的说明

4.7.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

4.7.2 资产负债表日后事项

自2025年7月22日起，本基金变更注册为华夏信盈一年持有期债券型证券投资基金，本基金的管理人由中信证券资管变更为华夏基金管理有限公司。

4.8 关联方关系及其交易

4.8.1 主要关联方关系

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|---|---|
| 中信证券资产管理有限公司 | 基金管理人、基金销售机构 |
| 中信证券股份有限公司 | 原管理人、管理人股东、基金销售机构 |
| 中信银行股份有限公司 | 基金托管人、管理人其他关联方、基金销售机构 |
| 中信证券华南股份有限公司 | 管理人其他关联方、基金销售机构 |
| 中信证券（山东）有限责任公司 | 管理人其他关联方、基金销售机构 |

4.8.2 关联方交易

4.8.2.1 通过关联方席位进行证券交易

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 自2025年1月1日至2025年7月21日（管理人变更前一日）止期间 | |
|---|---|---|
| | 成交金额 | 占成交总额的比例 |
| 股票交易 | － | － |
| 权证交易 | － | － |
| 债券交易 | 671,974,075.98 | 100.00% |
| 债券回购交易 | 12,946,733,000.00 | 100.00% |
| 合计 | 13,618,707,075.98 | 100.00% |

4.8.2.2 通过关联方席位进行证券交易产生的佣金费用

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 自2025年1月1日至2025年7月21日（管理人变更前一日）止期间 | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 当期佣金 | 占当期佣金总量的比例 | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣金总额的比例 |
| 中信证券股份有限公司 | 201,667.16 | 100.00% | 21,887.75 | 100.00% |

注：上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果。

4.8.2.3 关联方报酬

4.8.2.3.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 自2025年1月1日至2025年7月21日（管理人变更前一日）止期间 |
|---|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 5,303,879.88 |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 473,042.75 |
| 应支付基金管理人的净管理费 | 4,830,837.13 |

注：本基金本期发生的基金应支付的固定管理费5,303,879.88元，本基金份额的管理费年费率为0.70%，逐日计提并按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬＝前一日基金资产净值×0.70%/当年天数。

4.8.2.3.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 自2025年1月1日至2025年7月21日（管理人变更前一日）止期间 |
|---|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 757,697.08 |

注：支付托管人的托管费按前一日基金资产净值0.10%的年费率计提，按月支付。其计算公式为：

日托管费＝前一日基金资产净值×0.10%/当年天数。

4.8.2.3.3 销售服务费

无。

4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

无。

4.8.4 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 自2025年1月1日至2025年7月21日（管理人变更前一日）止期间 | |
|---|---|---|
| | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 中信银行股份有限公司 | 51,683,798.95 | 200,625.29 |

注：本基金的银行存款由托管人保管，按同业利率或约定利率计息。

4.8.5 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

4.9 期末（2025年7月21日）（管理人变更前一日）本基金持有的流通受限证券

4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。