

新华中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金

2026 年第 2 季度报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：新华基金管理股份有限公司

基金托管人：中国邮政储蓄银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二六年七月二十日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2026 年 7 月 17 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	新华中证同业存单 AAA 指数 7 天持有
基金主代码	024719
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2025 年 9 月 16 日
报告期末基金份额总额	121,539,538.04 份
投资目标	本基金通过指数化投资，追求跟踪偏离度以及跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金为被动式指数基金，主要采用抽样复制和动态最优化方法，投资于标的指数中具有代表性和流动性的成份券和备选成份券，或选择非成份券作为替代，构造与标的指数风险收益特征相似的资产组合，以实现对标的指数的有效跟踪。在正常市场情况下，力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。如因指数编制规

	则调整或其他因素导致跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。主要投资策略包括：资产配置策略、同业存单投资策略、资产支持证券投资策略等。
业绩比较基准	中证同业存单 AAA 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。
风险收益特征	本基金为混合型基金，一般而言，其预期风险和预期的收益率低于股票型基金、偏股混合型基金，高于货币市场基金。本基金为指数型基金，主要投资于标的指数成份券及备选成份券，具有与标的指数以及标的指数所代表的市场相似的风险收益特征。
基金管理人	新华基金管理股份有限公司
基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期 (2026 年 4 月 1 日-2026 年 6 月 30 日)
1.本期已实现收益	370,540.49
2.本期利润	437,247.75
3.加权平均基金份额本期利润	0.0027
4.期末基金资产净值	122,761,243.59
5.期末基金份额净值	1.0101

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、以上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（例如基金申购费、赎回费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

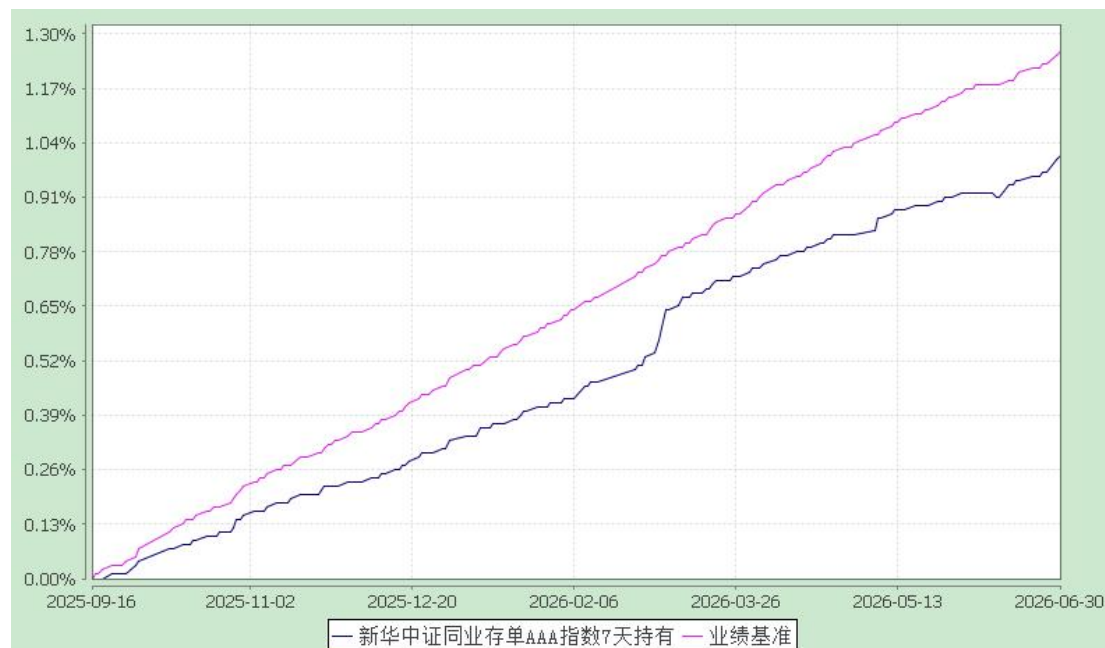
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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	0.27%	0.01%	0.36%	0.00%	-0.09%	0.01%
过去六个月	0.68%	0.01%	0.77%	0.01%	-0.09%	0.00%
自基金合同生效起至今	1.01%	0.01%	1.26%	0.01%	-0.25%	0.00%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

新华中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2025 年 9 月 16 日至 2026 年 6 月 30 日)



注：1、本基金合同于2025年9月16日生效，截至本报告期末基金合同生效未满一年。

2、按照本基金的基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定，截至报告期末本基金已完成建仓，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李洁	本基金基金经理，新华活期添利货币市场基金基金经理、新华安享惠泽 39 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理、新华壹诺宝货币市场基金基金经理、新华中债 1-5 年农发行债券指数证券投资基金基金经理、新华利率债债券	2025-09-16	-	13	经济学硕士，曾任中债信用业务经理、高级经理，新华基金固定收益与平衡投资部债券研究员、基金经理助理。

	型证券投资基金基金经理。				
--	--------------	--	--	--	--

注：1、首任基金经理，任职日期指基金合同生效日，离任日期指根据公司决定确定的解聘日期。

2、非首任基金经理，任职日期和离任日期均指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

3、证券从业的含义遵从《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》、《基金从业人员管理规则》的相关规定。

4.1.1 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

本报告期末本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期，新华基金管理股份有限公司作为新华中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金的管理人按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《新华中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金基金合同》以及其它有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上为持有人谋求最大利益。运作整体合法合规，无损害基金持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易相关制度，通过制度、流程、系统和技术手段落实公平交易原则，公平对待旗下管理的所有投资组合。本报告期，公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金未发生违法违规或对基金财产造成损失的异常交易行为；本基金管理人旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，未发生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% 情形。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

二季度，宏观经济运行总体平稳，外部不确定性显著上升。国内方面，出口保持韧性，但有效需求不足的问题仍然突出，经济复苏斜率有所放缓。生产端，工业增加值增速较一季

度有所回落，PMI 连续小幅收于荣枯线以上，显示制造业景气度有所反复。国际方面，美伊军事冲突及霍尔木兹海峡关闭的冲击持续发酵，全球供应链受阻，国际原油价格长期高企，输入性通胀压力还有待消化，部分中下游行业利润空间受到挤压。此外，主要发达经济体货币政策预期摇摆，外部环境更加复杂严峻。货币政策方面，二季度央行继续坚持以我为主的货币政策基调，综合运用多种工具保持流动性合理充裕。具体操作上，央行未开展降准降息操作，公开市场操作维持精准调控，季末推出了隔夜逆回购工具为市场提供短期流动性。资金面整体维持均衡格局，DR007 利率中枢围绕政策利率小幅波动，季末时点虽有扰动但整体可控。债市方面，受经济基本面预期反复、供给节奏变化及机构行为等因素影响，收益率维持震荡下行。本季度 1 年期 AAA 同业存单收益率先下后上，在 1.42%-1.51% 区间波动，1 年期国债收益率由最高 1.24% 下行至最低 1.10%，10 年期国债收益率由最高 1.82% 下行至最低 1.70% 后小幅反弹至 1.73%。

报告期内，本基金规模有所下降，我们通过适度调整指数成份券标的投资，控制跟踪误差，争取基金运行贴合指数基准。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 1.0101 元，本报告期份额净值增长率为 0.27%，同期业绩比较基准收益率为 0.36%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	126,987,751.30	97.72

	其中：债券	126,987,751.30	97.72
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	2,943,445.66	2.27
7	其他资产	15,884.12	0.01
8	合计	129,947,081.08	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通投资的股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	25,440,041.92	20.72
	其中：政策性金融债	10,126,909.59	8.25
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	101,547,709.38	82.72
9	其他	-	-
10	合计	126,987,751.30	103.44

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	250431	25 农发 31	100,000	10,126,909.59	8.25
2	112690112	26 杭州银行 CD002	100,000	9,997,079.12	8.14
3	112603111	26 农业银行 CD111	100,000	9,980,937.17	8.13
4	112517213	25 光大银行 CD213	100,000	9,964,942.47	8.12
5	112693746	26 宁波银行 CD092	100,000	9,964,932.88	8.12

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国农业发展银行在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚；中国农业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行的处罚；中国光大银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局、国家外汇管理局北京市分局的处罚；宁波银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行宁波市分行的处罚；重庆农村商业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局重庆监管局的处罚；平安银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚；广发银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局、国家外汇管理局广东省分局的处罚；华夏银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行、国家金融监督管理总局的处罚。

本基金对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。

除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资范围不包含股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	7,884.12

2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	8,000.00
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	15,884.12

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告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。

5.11.6 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，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

本报告期期初基金份额总额	199,203,285.60
报告期期间基金总申购份额	1,755,127.18
减：报告期期间基金总赎回份额	79,418,874.74
报告期期间基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	121,539,538.04

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

报告期内，基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

报告期内，基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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

本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内本基金无影响投资者决策的其他重要信息。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- (一)中国证监会准予新华中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金注册的文件
- (二)《关于申请募集新华中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金之法律意见书》
- (三)《新华中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金基金合同》
- (四)《新华中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金托管协议》
- (五)《新华中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金招募说明书》（更新）
- (六)基金管理人业务资格批件、营业执照
- (七)基金托管人业务资格批件、营业执照

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

9.3 查阅方式

投资者可在营业时间到基金管理人和/或基金托管人的住所免费查阅备查文件，或通过基金管理人、基金托管人、其他基金销售机构的网站查询。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

新华基金管理股份有限公司

二〇二六年七月二十日