

汇安丰恒灵活配置混合型证券投资基金

2024 年年度报告

2024 年 12 月 31 日

基金管理人:汇安基金管理有限责任公司

基金托管人:上海浦东发展银行股份有限公司

送出日期:2025 年 03 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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2025年3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。

本报告期自2024年1月1日起至2024年12月31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、基金净值表现及利润分配情况.....	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	10
§4 管理人报告.....	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
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.....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
4.9 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.....	16
§5 托管人报告.....	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
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.....	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	17
§6 审计报告.....	17
6.1 审计报告基本信息.....	17
6.2 审计报告的基本内容.....	17
§7 年度财务报表.....	19
7.1 资产负债表.....	20
7.2 利润表.....	21
7.3 净资产变动表.....	23
7.4 报表附注.....	25
§8 投资组合报告.....	57
8.1 期末基金资产组合情况.....	57
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	57
8.3 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.....	58
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	83
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	85
8.6 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.....	86
8.7 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.....	86
8.8 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.....	86

8.9 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	86
8.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	86
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	86
8.12 投资组合报告附注.....	86
§9 基金份额持有人信息	87
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	87
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	88
9.3 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.....	88
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况	88
§10 开放式基金份额变动	89
§11 重大事件揭示.....	89
11.1 基金份额持有人大会决议	89
11.2 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	89
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	89
11.4 基金投资策略的改变	89
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	89
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	89
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	90
11.8 其他重大事件	91
§12 影响投资者决策的其他重要信息	93
12.1 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	93
§13 备查文件目录.....	93
13.1 备查文件目录.....	93
13.2 存放地点	93
13.3 查阅方式	94

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	汇安丰恒灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	汇安丰恒混合	
基金主代码	003845	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017年03月13日	
基金管理人	汇安基金管理有限责任公司	
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	533,816,892.76份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	汇安丰恒混合A	汇安丰恒混合C
下属分级基金的交易代码	003845	003846
报告期末下属分级基金的份额总额	6,363,004.57份	527,453,888.19份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在深入的基本面研究的基础上，通过灵活的资产配置、策略配置与严谨的风险管理，力争实现基金资产的持续稳定增值。
投资策略	<p>本基金通过合理稳健的资产配置策略，进行积极主动的股票投资和债券投资，把握中国经济增长和资本市场发展机遇，严格控制下行风险，力争实现基金份额净值的长期平稳增长。</p> <p>本基金投资策略主要包括资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、股指期货和国债期货投资策略、权证投资策略、存托凭证投资策略等。</p>
业绩比较基准	沪深300指数收益率×50%+上证国债指数收益率×50%
风险收益特征	本基金为混合型基金，理论上其风险收益水平高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。

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		汇安基金管理有限责任公司	上海浦东发展银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	郭冬青	朱萍
	联系电话	010-56711600	021-31888888
	电子邮箱	guodq@huianfund.cn	zhup02@spdb.com.cn
客户服务电话		010-56711690	95528
传真		010-56711640	021-63602540
注册地址		上海市虹口区欧阳路218弄1号2楼215室	上海市中山东一路12号
办公地址		北京市东城区东直门南大街5号中青旅大厦13层；上海市虹口区东大名路501号白玉兰大厦36层	上海市博成路1388号浦银中心A栋
邮政编码		100007	200126
法定代表人		刘强	张为忠

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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.huianfund.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人办公地点

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	容诚会计师事务所(特殊普通合伙)	北京市西城区阜成门外大街22号1幢10层1001-1至1001-26
注册登记机构	汇安基金管理有限责任公司	上海市虹口区东大名路501号上海白玉兰广场36层02单元

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2024年		2023年		2022年	
	汇安丰恒混合A	汇安丰恒混合C	汇安丰恒混合A	汇安丰恒混合C	汇安丰恒混合A	汇安丰恒混合C
本期已实现收益	283,372.36	39,485,955.66	-16,401,411.96	150,326.91	8,392,740.89	515.27
本期利润	304,978.55	47,779,098.44	-14,835,316.94	554,631.61	-176,508.56	373.32
加权平均基金份额本期利润	0.0565	0.0538	-0.1171	0.0613	-0.0012	0.0361
本期加权平均净值利润率	6.26%	5.54%	-12.17%	6.45%	-0.12%	3.41%
本期基金份额净值增长率	6.71%	6.62%	-11.48%	-11.53%	-0.10%	-0.20%
3.1.2 期末数据和指标	2024年末		2023年末		2022年末	
期末可供分配利润	-2,811,123.22	-196,120,765.21	-52,191.80	-130,411,072.81	-35,539,475.91	-1,357.83
期末可供分配基金份额利润	-0.4418	-0.3718	-0.4905	-0.4238	-0.2692	-0.1829
期末基金资产净值	5,943,854.90	534,630,572.25	93,148.49	292,526,681.86	130,533,528.76	7,979.14
期末基金份额净值	0.9341	1.0136	0.8754	0.9507	0.9889	1.0746
3.1.3 累计期末指标	2024年末		2023年末		2022年末	
基金份额累计净值增长率	-6.59%	1.36%	-12.46%	-4.93%	-1.11%	7.46%

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、对期末可供分配利润，采用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余额的孰低数。

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

汇安丰恒混合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	1.98%	0.25%	0.80%	0.23%	1.18%	0.02%
过去六个月	3.86%	0.19%	3.09%	0.20%	0.77%	-0.01%
过去一年	6.71%	0.14%	6.48%	0.28%	0.23%	-0.14%
过去三年	-5.64%	0.55%	-7.30%	0.47%	1.66%	0.08%
过去五年	4.51%	0.44%	6.95%	0.55%	-2.44%	-0.11%
自基金合同生效起至今	-6.59%	0.62%	24.48%	0.56%	-31.07%	0.06%

汇安丰恒混合C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.95%	0.25%	0.80%	0.23%	1.15%	0.02%
过去六个月	3.82%	0.19%	3.09%	0.20%	0.73%	-0.01%
过去一年	6.62%	0.14%	6.48%	0.28%	0.14%	-0.14%
过去三年	-5.87%	0.55%	-7.30%	0.47%	1.43%	0.08%
过去五年	4.27%	0.44%	6.95%	0.55%	-2.68%	-0.11%
自基金合同生效起至今	1.36%	0.64%	24.48%	0.56%	-23.12%	0.08%

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

汇安丰恒混合A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2017年03月13日-2024年12月31日)



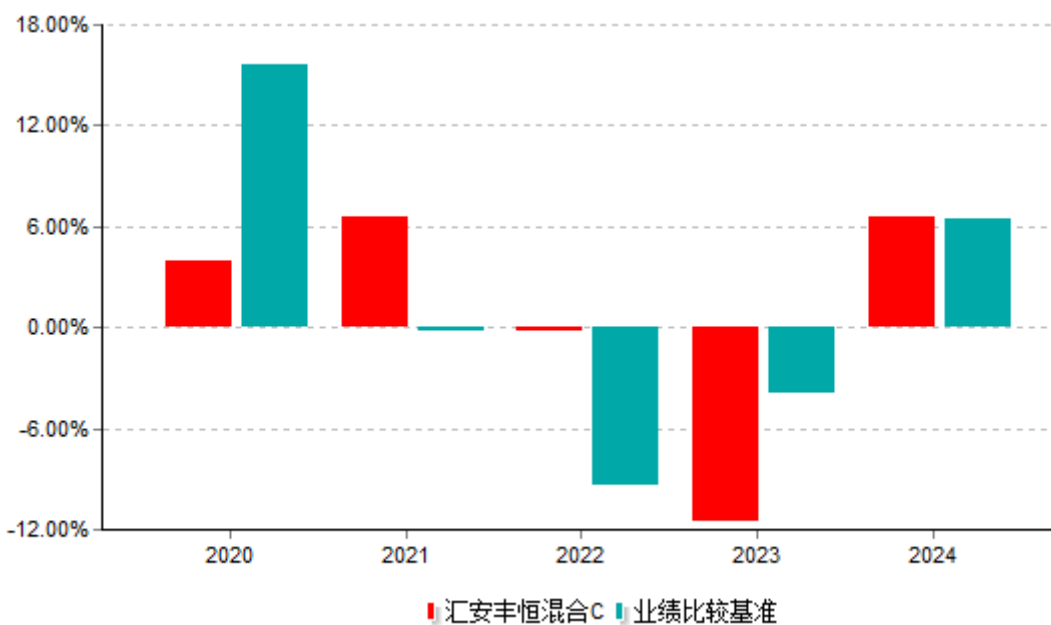
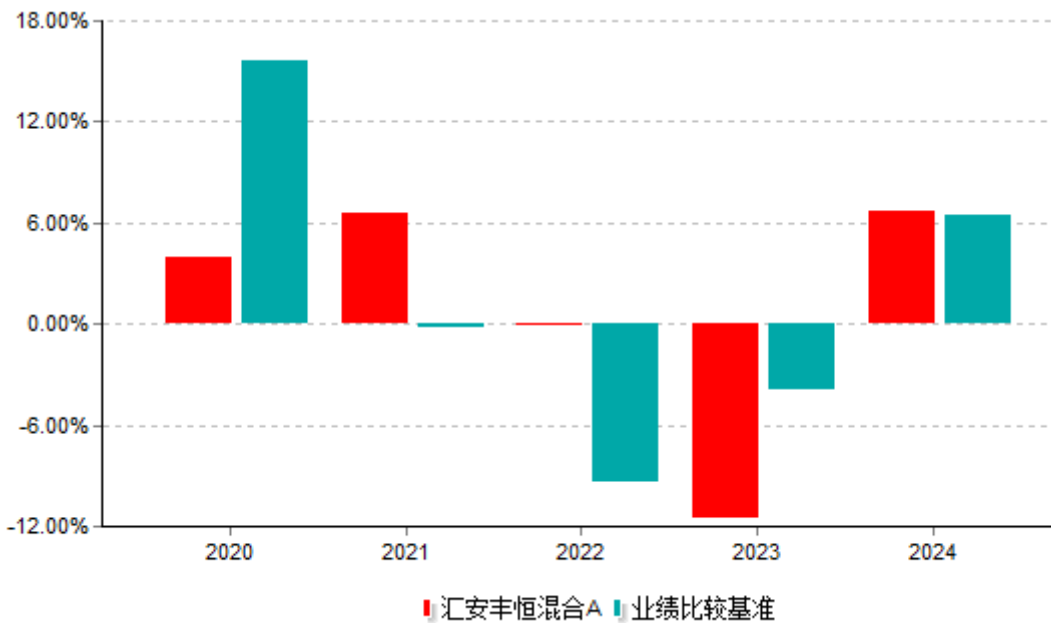
汇安丰恒混合C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2017年03月13日-2024年12月31日)



注：①本报告期，本基金投资比例符合基金合同要求。

②自2024年3月15日，本基金业绩比较基准由“上证国债指数收益率*50.00%+沪深300指数收益率*50.00%”变更为“中证中信证券量化债股优选稳健策略指数收益率*95.00%+银行活期存款利率(税后)*5.00%”。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年来未进行过利润分配。

§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

本基金管理人为汇安基金管理有限责任公司，于2016年4月19日获中国证监会批复，2016年4月25日正式成立，是业内首家全自然人、由内部核心专业人士控股的公募基金基金管理公司，注册资本1亿元人民币，注册地为上海市，设北京、上海双总部。公司目前具有公开募集证券投资基金管理、基金销售、特定客户资产管理的资格。

截至2024年12月31日，公司旗下管理64只公募基金——汇安嘉汇纯债债券型证券投资基金、汇安嘉裕纯债债券型证券投资基金、汇安丰利灵活配置混合型证券投资基金、汇安丰融灵活配置混合型证券投资基金、汇安嘉源纯债债券型证券投资基金、汇安丰泽灵活配置混合型证券投资基金、汇安沪深300指数增强型证券投资基金、汇安丰恒灵活配置混合型证券投资基金、汇安多策略灵活配置混合型证券投资基金、汇安资产轮动灵活配置混合型证券投资基金、汇安裕华纯债定期开放债券型发起式证券投资基金、汇安成长优选灵活配置混合型证券投资基金、汇安稳裕债券型证券投资基金、汇安趋势动力股票型证券投资基金、汇安量化优选灵活配置混合型证券投资基金、汇安裕阳三年持有期混合型证券投资基金、汇安短债债券型证券投资基金、汇安嘉鑫纯债债券型证券投资基金、富时中国A50交易型开放式指数证券投资基金、汇安核心成长混合型证券投资基金、汇安鼎利纯债债券型证券投资基金、汇安多因子混合型证券投资基金、汇安行业龙头混合型证券投资基金、汇安中短债债券型证券投资基金、汇安嘉诚债券型证券投资基金、汇安量化先锋混合型证券投资基金、汇安中债-广西壮族自治区公司信用类债券指数证券投资基金、汇安宜创量化精选混合型证券投资基金、汇安嘉盛纯债债券型证券投资基金、汇安信利债券型证券投资基金、汇安裕和纯债债券型证券投资基金、汇安上证证券交易型开放式指数证券投资基金、汇安嘉利混合型证券投资基金、汇安核心资产混合型证券投资基金、汇安裕鑫12个月定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、汇安价值蓝筹混合型证券投资基金、汇安消费龙头混合型证券投资基金、汇安恒鑫12个月定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、汇安中证500指数增强型证券投资基金、汇安泓阳三年持有期混合型证券投资基金、汇安恒利39个月定期开放纯债债券型证券投资基金、汇安盛鑫三年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、汇安嘉盈一年持有期债券型证券投资基金、汇安均衡优选混合型证券投资基金、汇安核心价值混合型证券投资基金、汇安鑫利优选混合型证券投资基金、汇安泓利一年持有期混合型证券投资基金、汇安鑫泽稳健一年持有期混合型证券投资基金、汇安信泰稳健一年持有期混合型证券投资基金、汇安优势企业精选混合型证券投资基金、汇安永利30天持有期短债债券型证券投资基金、汇安润阳三年持有期混合型证券投资基金、汇安永福90天持有期中短债债券型证券投资基金、汇安裕同纯债债券型证券投资基金、汇安添利18个月持有期混合型证券投资基金、汇安远见成长混合型证券投资基金、汇安品质优选混合型证券投资基金、汇安价值先锋混合型证券投资基金、汇安裕泰纯债债券型证券投资基金、汇安裕盈纯债债券型证券投资基金、汇安中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金、汇安均衡成长

混合型证券投资基金、汇安行业优选混合型证券投资基金、汇安中债0-3年政策性金融债指数证券投资基金。

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		
金鸿峰	多策略组基金经理、本基金的基金经理	2021-07-13	-	8年	金鸿峰女士，中央财经大学国防经济学硕士研究生，8年证券、基金行业从业经验。曾任北京市农产品电子商务公司市场部经理，2016年5月加入汇安基金管理有限责任公司，现任多策略组基金经理。2021年7月23日至2022年7月28日，任汇安嘉裕纯债债券型证券投资基金基金经理；2021年8月4日至2022年8月16日，任汇安裕和纯债债券型证券投资基金基金经理；2021年7月13日至今，任汇安中债-广西壮族自治区公司信用类债券指数证券投资基金基金经理；2021年7月13日至今，任汇安嘉汇纯债债券型证券投资基金基金经理；2021年7月13日至今，任汇安丰恒灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2021年7月23日至今，任汇安嘉源纯债债券型证券投资基

					金基金经理；2021年7月28日至今，任汇安嘉鑫纯债债券型证券投资基金基金经理；2021年7月28日至今，任汇安鼎利纯债债券型证券投资基金基金经理；2021年8月4日至今，任汇安嘉盛纯债债券型证券投资基金基金经理；2022年8月16日至今，任汇安稳裕债券型证券投资基金基金经理；2022年11月8日至今，任汇安裕泰纯债债券型证券投资基金基金经理；2024年9月25日至今，任汇安中债0-3年政策性金融债指数证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	--

- 1、“任职日期”和“离职日期”分别指根据公司对外披露的聘任日期和解聘日期。
- 2、证券从业的含义遵从行业协会的相关规定。
- 3、本基金无基金经理助理。

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

本报告期末本基金的基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.1.4 基金经理薪酬机制

本基金管理人旗下基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的，不存在基金经理薪酬激励与其在私募资产管理计划浮动管理费或产品业绩挂钩的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求利益，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

公司严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善了公司公平交易制度，制度的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等所有投资管理活动，同时包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、监控等投资管理活动相关的各个环节，形成了有效的公平交易执行体系。

对于场内交易，公司启用了交易系统内的公平交易程序，在指令分发及指令执行阶段，均由系统强制执行公平委托；此外，公司严格控制不同投资组合之间的同日反向交易。对于场外交易，公司完善银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易的交易分配制度，保证各投资组合获得公平的交易机会。对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易，各投资组合经理在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量，公司按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，完善相应制度及流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行，确保公平交易原则的实现。基金管理人公平对待旗下管理的所有投资组合，报告期内公平交易制度得到良好的贯彻执行，未发现存在违反公平交易原则的情况。

报告期内，公司对连续四个季度期间内、不同时间窗口下（如：1日内、3日内、5日内）公司管理的不同投资组合同向交易开展交易价差分析。分析结果表明，本报告期内公司对各投资组合公平对待，不存在利益输送的行为。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

基金管理人严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。本报告期内，本基金未发现可能的异常交易情况，不存在所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边成交量超过该证券当日成交量的5%的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2024年上半年债市呈现趋势性牛市行情，下半年扰动因素偏多，债券市场存在几次较大幅度的调整，尤其是9月底政策转向，权益市场大幅度上涨，债市快速下跌。本产品以信用债为主要持仓，上半年整体操作风格偏积极，杠杆策略和久期策略均有效，3季度逐渐增加权益仓位的配置，同时减少债券的持仓比例，降低杠杆。但在3季度末和4季度初债券市场调整中增加长久期信用债配置，重新提高产品杠杆。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末汇安丰恒混合A基金份额净值为0.9341元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为6.71%，同期业绩比较基准收益率为6.48%；截至报告期末汇安丰恒混合C基金份额净值为1.0136元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为6.62%，同期业绩比较基准收益率为6.48%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2025年中国债市或维持震荡。当前基本面数据有亮点，生产整体强于需求，工业增加值持续改善，制造业和基建维持高位，地产销售边际改善。但企业利润持续影响投资，企业扩产意愿不足，居民消费还有待提升，出口存在一定不确定性。社融数据主要还是依靠政府债拉动，除去政府债，依然不强，企业和居民的新增贷款依然偏弱。基本面数据对债市有一定支撑，且稳增长和化债的背景下，不支持利率大幅度上行。后续央行将在权衡国内外经济金融市场的前提下，对货币政策进行相机抉择。资金价格短期内较难下降，利率中短端继续呈现融资成本和资产票息倒挂的态势，长端赔率过低，下行空间有限，利率大概率将维持震荡。本产品继续挖掘信用资质良好的信用债，确保流动性，同时根据市场情况调整久期和杠杆水平。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人依照法律法规和公司内部控制的整体要求，致力于内控机制的完善，积极推动主动合规管理；全面加强风险控制，不断提高风险控制水平；有计划地开展监察稽核工作，推动公司内控体系和制度措施的落实，强化对基金投资运作和公司经营管理的合规性管理。

本报告期内，本基金管理人结合新法规的实施、新的监管要求和公司业务发展情况，坚持从保障基金持有人利益出发，由督察长领导独立于各业务部门的合规风控部不断推动完善相关制度流程的建立、健全，及时贯彻落实新的监管要求，并通过实时监控、定期检查、专项检查等方式深入开展监察稽核工作，包括对基金投资运作、基金投资交易、基金销售与宣传、投资者适当性管理、客户服务、产品开发、信息披露、反洗钱工作、信息系统与信息安全和基金运营等方面进行监察稽核，及时发现上述业务开展中的相关问题，提出改进建议并跟踪改进落实情况。

本基金管理人承诺将坚持诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，积极健全内部管理制度，不断提高监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，切实保护基金份额持有人的利益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照《企业会计准则》、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。

本基金管理人设有估值委员会，公司运营总监担任估值委员会主席，投资部门、合规风控部和运营部指定人员担任委员。估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备行业研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供银行间同业市场及交易所交易的债券品种的估值数据。

4.8 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发生利润分配情况。

4.9 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

本报告期内，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对汇安丰恒灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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，本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对汇安丰恒灵活配置混合型证券投资基金的投资运作进行了监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支以及利润分配等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度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，由汇安基金管理有限责任公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	容诚审字[2025]200Z1163号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	汇安丰恒灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了汇安丰恒灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“汇安丰恒混合基金”）财务报表，包括2024年12月31日的资产负债表，2024年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“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，公允反映了汇安丰恒混合基金2024年12月31日的财务状况以及2024年度的经营成果和净资产变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于汇安丰恒混合基金，并履行了职</p>

	业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	不适用
其他事项	不适用
其他信息	不适用
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>汇安丰恒混合基金的基金管理人汇安基金管理有限责任公司（以下简称“基金管理人”）管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估汇安丰恒混合基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算汇安丰恒混合基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督汇安丰恒混合基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发</p>

	<p>表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对导致对汇安丰恒混合基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致汇安丰恒混合基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>	
会计师事务所的名称	容诚会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	张振波	金诗涛
会计师事务所的地址	北京市西城区阜成门外大街22号1幢10层1001-1至1001-26	
审计报告日期	2025-03-27	

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：汇安丰恒灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2024年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024年12月31日	上年度末 2023年12月31日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	30,928,654.51	22,296,322.28
结算备付金		1,025.78	1,025.78
存出保证金		-	5,542.45
交易性金融资产	7.4.7.2	490,760,463.51	155,262,053.77
其中：股票投资		39,225,075.48	-
基金投资		-	-
债券投资		451,535,388.03	155,262,053.77
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	114,126,383.18
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		27,440,058.96	1,602,156.55
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		549,130,202.76	293,293,484.01
负债和净资产	附注号	本期末 2024年12月31日	上年度末 2023年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-

衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-1,056.10	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		8,001,698.28	394,298.81
应付管理人报酬		237,869.36	81,964.30
应付托管费		39,644.91	13,660.70
应付销售服务费		39,210.58	7,841.56
应付投资顾问费		-	-
应交税费		46,094.26	3,139.74
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	192,314.32	172,748.55
负债合计		8,555,775.61	673,653.66
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	533,816,892.76	307,802,564.68
未分配利润	7.4.7.8	6,757,534.39	-15,182,734.33
净资产合计		540,574,427.15	292,619,830.35
负债和净资产总计		549,130,202.76	293,293,484.01

注：报告截止日2024年12月31日，基金份额总额533,816,892.76份，其中汇安丰恒混合A基金份额净值0.9341元，份额总额6,363,004.57份；汇安丰恒混合C基金份额净值1.0136元，份额总额527,453,888.19份。

7.2 利润表

会计主体：汇安丰恒灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2024年01月01日至2024年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2024年01月01日至2024年12月31日	2023年01月01日至2023年12月31日
一、营业总收入		56,698,841.03	-13,148,950.45
1.利息收入		395,751.51	220,244.07

其中：存款利息收入	7.4.7.9	336,377.56	95,071.83
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		59,373.95	125,172.24
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		46,451,529.31	-15,345,486.24
其中：股票投资收益	7.4.7.10	4,459,562.92	-18,450,035.25
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	41,139,053.91	-77,907.80
资产支持证券投资	7.4.7.12	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.13	-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	852,912.48	3,182,456.81
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	8,314,748.97	1,970,399.72
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	1,536,811.24	5,892.00
减：二、营业总支出		8,614,764.04	1,131,734.88
1.管理人报酬	7.4.10.2.1	5,271,896.33	783,148.79
2.托管费	7.4.10.2.2	878,649.45	130,524.79
3.销售服务费	7.4.10.2.3	873,849.74	7,848.25
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		1,251,595.66	-
其中：卖出回购金融资产支出		1,251,595.66	-

6.信用减值损失		-	-
7.税金及附加		89,270.60	838.05
8.其他费用	7.4.7.18	249,502.26	209,375.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		48,084,076.99	-14,280,685.33
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		48,084,076.99	-14,280,685.33
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		48,084,076.99	-14,280,685.33

7.3 净资产变动表

会计主体：汇安丰恒灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2024年01月01日至2024年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年12月31日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	307,802,564.68	-15,182,734.33	292,619,830.35
二、本期期初净资产	307,802,564.68	-15,182,734.33	292,619,830.35
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	226,014,328.08	21,940,268.72	247,954,596.80
（一）、综合收益总额	-	48,084,076.99	48,084,076.99
（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）	226,014,328.08	-26,143,808.27	199,870,519.81

其中：1.基金申购款	5,392,779,417.13	-170,114,001.06	5,222,665,416.07
2.基金赎回款	-5,166,765,089.05	143,970,192.79	-5,022,794,896.26
（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	533,816,892.76	6,757,534.39	540,574,427.15
项目	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年12月31日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	132,004,770.18	-1,463,262.28	130,541,507.90
二、本期期初净资产	132,004,770.18	-1,463,262.28	130,541,507.90
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	175,797,794.50	-13,719,472.05	162,078,322.45
（一）、综合收益总额	-	-14,280,685.33	-14,280,685.33
（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）	175,797,794.50	561,213.28	176,359,007.78
其中：1.基金申购款	308,425,547.29	-15,767,054.30	292,658,492.99
2.基金赎回款	-132,627,752.79	16,328,267.58	-116,299,485.21
（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	307,802,564.68	-15,182,734.33	292,619,830.35

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署:

刘强

王嘉浩

江士

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

汇安丰恒灵活配置混合型证券投资基金(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[2016]2693号《关于准予汇安丰恒灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》注册,由汇安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《汇安丰恒灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币200,086,315.98元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2017)第260号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《汇安丰恒灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2017年3月13日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为200,086,316.11份基金份额,其中认购资金利息折合0.13份基金份额。本基金的基金管理人为汇安基金管理有限责任公司,基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

根据《汇安丰恒灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《汇安丰恒灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》,本基金根据认购费/申购费和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/申购基金时收取认购/申购费用,在赎回时根据持有期限收取赎回费用,并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为A类基金份额;在投资人认购/申购时不收取认购/申购费用,而是从本类别基金资产中计提销售服务费,并在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额,称为C类基金份额。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并公布基金份额净值和基金份额累计净值。投资人可自行选择认购/申购的基金份额类别。本基金不同基金份额类别之间不得互相转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《汇安丰恒灵活配置混合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

依法发行上市的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、存托凭证、债券(包括国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、可转换债券、中小企业私募债等)、债券回购、同业存单、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货、国债期货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)。本基金的投资组合比例为:股票资产投资比例为基金资产的0-95%;每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后,保持不低于基金资产净值的5%的现金或者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、存出保证金及应收申购款等;权证、股指期货、国债期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的原业绩比较基准为:沪深300指数收益率 \times 50%+上证国债指数收益率 \times 50%,根据本基金的基金管理人汇安基金管理有限责任公司于2024年3月15日发布的《汇安基金管理有限责任公司关于汇安丰恒灵活配置混合型证券投资基金变更业绩比较基准并修改基金合同的公告》,本基金的业绩比较基准自2024年3月15日变更为:中证中信证券量化债股优选稳健策略指数收益率 \times 95%+银行活期存款利率(税后) \times 5%。

本财务报表由本基金的基金管理人汇安基金管理有限责任公司于2025年3月27日批准报出。

7.4.2 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》、《汇安丰恒灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2024年度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2024年12月31日的财务状况以及2024年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产、金融负债或权益工具。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、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公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产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。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的商业模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即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。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资、资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂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。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

(3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑在资产负债表日无须付出不必要的额外成本和努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来12个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来12个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 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；或者(3) 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。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按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。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 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。

(3) 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。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 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变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征：(1) 赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利，这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位，并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量；(2) 该工具所属的类别次于其他所有工具类别，即本基金份额在归属于该类

别前无须转换为另一种工具，且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权；(3) 该工具所属的类别中(该类别次于其他所有工具类别)，所有工具具有相同的特征(例如它们必须都具有可回售特征，并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同)；(4) 除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外，该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征；(5) 该工具在存续期内的预计现金流量总额，应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括本基金的任何影响)。

可回售工具，是指根据合同约定，持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融资产的权利，或者在未来某一不确定事项发生或者持有方死亡或退休时，自动回售给发行方的金融工具。

本基金没有同时具备下列特征的其他金融工具或合同：(1) 现金流量总额实质上基于基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括该基金或合同的任何影响)；(2) 实质上限制或固定了上述工具持有方所获得的剩余回报。

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息及在适用情况下公允价值变动产生的预估增值税后的净额确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 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，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

7.4.4.12 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并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金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》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协

发[2017]6号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”),按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和可交换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种,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》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布<关于固定收益品种的估值处理标准>的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和可交换债券除外),按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 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。

7.4.6 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[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》、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》、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》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。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。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。

(2) 对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，股票的股息、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) 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。对基金从上市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。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(5) 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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024年12月31日	上年度末 2023年12月31日
活期存款	29,030,282.52	20,713,875.14
等于：本金	29,027,643.48	20,710,511.97
加：应计利息	2,639.04	3,363.17
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	1,898,371.99	1,582,447.14
等于：本金	1,898,176.61	1,581,942.09
加：应计利息	195.38	505.05
减：坏账准备	-	-
合计	30,928,654.51	22,296,322.28

注：其他存款本期末余额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。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年12月31日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	36,996,915.22	-	39,225,075.48	2,228,160.26	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	198,167,939.53	2,306,393.42	203,721,293.42	3,246,960.47
	银行间市场	240,335,646.89	4,235,494.61	247,814,094.61	3,242,953.11
	合计	438,503,586.42	6,541,888.03	451,535,388.03	6,489,913.58
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	475,500,501.64	6,541,888.03	490,760,463.51	8,718,073.84	
项目	上年度末 2023年12月31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	20,179,523.29	243,616.44	20,427,616.44	4,476.71
	银行间市场	131,317,651.84	3,117,937.33	134,834,437.33	398,848.16
	合计	151,497,175.13	3,361,553.77	155,262,053.77	403,324.87
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	151,497,175.13	3,361,553.77	155,262,053.77	403,324.87	

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 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 2024年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
合计	-	-
项目	上年度末 2023年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	114,126,383.18	-
合计	114,126,383.18	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

7.4.7.5 其他资产

无。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年12月31日	上年度末 2023年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	176.82	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	2,137.50	2,748.55
其中：交易所市场	-	0.05
银行间市场	2,137.50	2,748.50
应付利息	-	-
预提费用-审计费	70,000.00	50,000.00
预提费用-信息披露费	120,000.00	120,000.00
合计	192,314.32	172,748.55

7.4.7.7 实收基金

7.4.7.7.1 汇安丰恒混合A

金额单位：人民币元

项目 (汇安丰恒混合A)	本期 2024年01月01日至2024年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	106,405.67	106,405.67
本期申购	18,556,459.12	18,556,459.12
本期赎回（以“-”号填列）	-12,299,860.22	-12,299,860.22
本期末	6,363,004.57	6,363,004.57

7.4.7.7.2 汇安丰恒混合C

金额单位：人民币元

项目 (汇安丰恒混合C)	本期 2024年01月01日至2024年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	307,696,159.01	307,696,159.01
本期申购	5,374,222,958.01	5,374,222,958.01
本期赎回（以“-”号填列）	-5,154,465,228.83	-5,154,465,228.83
本期末	527,453,888.19	527,453,888.19

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

7.4.7.8 未分配利润

7.4.7.8.1 汇安丰恒混合A

单位：人民币元

项目 (汇安丰恒混合A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-52,191.80	38,934.62	-13,257.18
本期期初	-52,191.80	38,934.62	-13,257.18
本期利润	283,372.36	21,606.19	304,978.55
本期基金份额交易产生的变动数	-3,042,303.78	2,331,432.74	-710,871.04
其中：基金申购款	-8,809,788.29	6,886,963.01	-1,922,825.28
基金赎回款	5,767,484.51	-4,555,530.27	1,211,954.24
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-2,811,123.22	2,391,973.55	-419,149.67

7.4.7.8.2 汇安丰恒混合C

单位：人民币元

项目 (汇安丰恒混合C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-130,411,072.81	115,241,595.66	-15,169,477.15
本期期初	-130,411,072.81	115,241,595.66	-15,169,477.15
本期利润	39,485,955.66	8,293,142.78	47,779,098.44
本期基金份额交易产	-105,195,648.06	79,762,710.83	-25,432,937.23

生的变动数			
其中：基金申购款	-2,207,166,336.57	2,038,975,160.79	-168,191,175.78
基金赎回款	2,101,970,688.51	-1,959,212,449.96	142,758,238.55
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-196,120,765.21	203,297,449.27	7,176,684.06

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年 12月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年 12月31日
活期存款利息收入	284,770.66	94,021.42
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	51,606.41	505.18
结算备付金利息收入	-	422.92
其他	0.49	122.31
合计	336,377.56	95,071.83

7.4.7.10 股票投资收益

7.4.7.10.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年 12月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年 12月31日
卖出股票成交总额	90,717,712.05	109,376,914.81
减：卖出股票成本总额	85,973,242.49	127,652,332.30
减：交易费用	284,906.64	174,617.76
买卖股票差价收入	4,459,562.92	-18,450,035.25

7.4.7.10.2 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

7.4.7.11 债券投资收益

7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年 12月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年 12月31日
债券投资收益——利息收入	27,709,254.55	239,907.49
债券投资收益——买卖债券 (债转股及债券到期兑付) 差价收入	13,429,799.36	-317,815.29
债券投资收益——赎回差价 收入	-	-
债券投资收益——申购差价 收入	-	-
合计	41,139,053.91	-77,907.80

7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年12月 31日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年12月 31日
卖出债券(债转股 及债券到期兑付) 成交总额	2,472,070,676.66	12,491,400.00
减: 卖出债券(债 转股及债券到期兑 付)成本总额	2,424,842,569.29	12,314,236.19
减: 应计利息总额	33,458,520.78	491,400.00
减: 交易费用	339,787.23	3,579.10
买卖债券差价收入	13,429,799.36	-317,815.29

7.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.12 资产支持证券投资收益

7.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

7.4.7.12.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

7.4.7.12.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.12.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.13 贵金属投资收益

7.4.7.13.1 贵金属投资收益项目构成

无。

7.4.7.13.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

7.4.7.13.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.13.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.14 衍生工具收益

7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

7.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024 年12月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023 年12月31日
股票投资产生的股利收益	852,912.48	3,182,456.81
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	852,912.48	3,182,456.81

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年01月01日至2024年12 月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年12 月31日
1.交易性金融资产	8,314,748.97	1,970,399.72
——股票投资	2,228,160.26	1,314,838.66
——债券投资	6,086,588.71	655,561.06
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3.其他	-	-
减：应税金融商品公允 价值变动产生的预估增 值税	-	-
合计	8,314,748.97	1,970,399.72

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年 12月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年 12月31日
基金赎回费收入	1,536,492.54	5,892.00
转换费收入	318.70	-
合计	1,536,811.24	5,892.00

7.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年 12月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年 12月31日
审计费用	70,000.00	50,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
汇划手续费	22,302.26	2,175.00
账户维护费-中债登	18,000.00	18,000.00
其他	1,200.00	1,200.00
账户维护费-上清所	18,000.00	18,000.00
合计	249,502.26	209,375.00

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明**7.4.8.1 或有事项**

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
汇安基金管理有限责任公司	基金管理人、基金登记机构、基金销售机构

上海浦东发展银行股份有限公司	基金托管人
何斌	基金管理人的股东
秦军	基金管理人的股东
郭小峰	基金管理人的股东
任建辉	基金管理人的股东
刘强	基金管理人的股东
郭兆强	基金管理人的股东
尹喜杰	基金管理人的股东
王福德	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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

无。

7.4.10.1.2 权证交易

无。

7.4.10.1.3 债券交易

无。

7.4.10.1.4 债券回购交易

无。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至20 24年12月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至20 23年12月31日

当期发生的基金应支付的管理费	5,271,896.33	783,148.79
其中：应支付销售机构的客户维护费	2,068,720.77	27,683.42
应支付基金管理人的净管理费	3,203,175.56	755,465.37

注：支付基金管理人汇安基金管理有限责任公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值0.6%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×0.6%/当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024年01月01日至2024年12月31日	2023年01月01日至2023年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	878,649.45	130,524.79

注：支付基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，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。

7.4.10.2.3 销售服务费

无。

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给汇安基金管理有限责任公司，再由汇安基金管理有限责任公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日销售服务费=前一日C类基金份额的基金资产净值×0.10%/当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4 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

7.4.10.4.1 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。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.10.5.2 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

无。

7.4.10.6 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 2024年01月01日至2024年12月31日		上年度可比期间 2023年01月01日至2023年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
上海浦东发展银行股份有限公司	29,030,282.52	284,770.66	20,713,875.14	94,021.42

注：本基金的银行存款由基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况--固定净值型货币市场基金之外的基金

无。

7.4.12 期末（2024年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002252	上海莱士	2024-12-23	重大事项停牌	7.22	2025-01-07	6.93	1,700	12,600.46	12,274.00	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金，属于证券投资基金中预期风险与预期收益中等的投资品种，其风险收益水平高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。

本基金在日常经营活动中涉及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，通过管理及信息系统持续监控上述各类风险。

公司建立董事会领导下的风险管理体系，包括董事会的下设的风险控制委员会、总经理下设的风险管理委员会、督察长、合规风控部以及各个业务部门组成。

公司致力于实行全面、系统的风险管理，通过制定系统化的风险管理程序，对风险管理的整个流程进行评估和改进。公司奉行分工明确、相互协作、彼此牵制的风险管理组织结构，构建由四大防线共同筑成的风险管理体系：第一道防线由各个业务部门构成，

各业务部门总监作为风险责任人；第二道监控防线由合规风控部构成，对公司运营过程中产生的或潜在的各项风险进行有效管理，并就内部控制及风险管理制度的执行情况独立地履行检查、评价、报告、建议职能；第三道防线是由总经理及其下设的风险管理委员会构成，总经理负责公司日常经营管理中的风险管理工作。总经理下设风险管理委员会，负责对公司经营及基金运作中的风险进行研究、评估和防控；第四道监控防线由董事会及其下设公司风险控制委员会构成。董事会负责公司整体风险的预防和控制，审核、监督公司风险管理制度的有效执行。董事会下设公司风险控制委员会，协助董事会确立公司风险取向，风险总量、风险限额，制定和调整公司风险管理战略、原则、政策和指导方针，并确保其得到有效执行。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

7.4.13.2 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上海浦东发展银行股份有限公司及券商结算账户，因而与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。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

7.4.13.2.4 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 2024年12月31日	上年度末 2023年12月31日
AAA	197,713,390.33	83,067,755.87
AAA以下	97,334,365.47	40,455,454.97
未评级	156,487,632.23	31,738,842.93
合计	451,535,388.03	155,262,053.77

注：未评级债券为公司债、中期票据。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

7.4.13.3 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或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人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。

于2024年12月31日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

7.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人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》及《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上市公司发行的证券不得超过该证券的10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的30% (完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

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2024年12月31日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为0.002%。

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。于2024年12月31日，本基金组合资产中7个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

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

本基金投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种比重较大，此外还持有银行存款、结算备付金、存出保证金及买入返售金融资产等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年 12月31 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	30,928,654.51	-	-	-	30,928,654.51
结算备付金	1,025.78	-	-	-	1,025.78
交易性金融资产	115,987,381.82	144,396,045.74	191,151,960.47	39,225,075.48	490,760,463.51
应收申购款	-	-	-	27,440,058.96	27,440,058.96
资产总计	146,917,062.11	144,396,045.74	191,151,960.47	66,665,134.44	549,130,202.76
负债					
卖出回购金融资产款	-1,056.10	-	-	-	-1,056.10
应付赎回款	-	-	-	8,001,698.28	8,001,698.28

回款					
应付管理人报酬	-	-	-	237,869.36	237,869.36
应付托管费	-	-	-	39,644.91	39,644.91
应付销售服务费	-	-	-	39,210.58	39,210.58
应交税费	-	-	-	46,094.26	46,094.26
其他负债	-	-	-	192,314.32	192,314.32
负债总计	-1,056.10	-	-	8,556,831.71	8,555,775.61
利率敏感度缺口	146,918,118.21	144,396,045.74	191,151,960.47	58,108,302.73	540,574,427.15
上年度末 2023年 12月31 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	22,296,322.28	-	-	-	22,296,322.28
结算备付金	1,025.78	-	-	-	1,025.78
存出保证金	5,542.45	-	-	-	5,542.45
交易性金融资	10,543,928.96	123,920,124.81	20,798,000.00	-	155,262,053.77

产					
买入返售金融资产	114,126,383.18	-	-	-	114,126,383.18
应收申购款	-	-	-	1,602,156.55	1,602,156.55
资产总计	146,973,202.65	123,920,124.81	20,798,000.00	1,602,156.55	293,293,484.01
负债					
应付赎回款	-	-	-	394,298.81	394,298.81
应付管理人报酬	-	-	-	81,964.30	81,964.30
应付托管费	-	-	-	13,660.70	13,660.70
应付销售服务费	-	-	-	7,841.56	7,841.56
应交税费	-	-	-	3,139.74	3,139.74
其他负债	-	-	-	172,748.55	172,748.55
负债总计	-	-	-	673,653.66	673,653.66
利率敏感度缺口	146,973,202.65	123,920,124.81	20,798,000.00	928,502.89	292,619,830.35

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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变
----	--------------------

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位:人民币元)	
		本期末 2024年12月31日	上年度末 2023年12月31日
	市场利率下降25个基点	5,044,557.81	871,907.22
市场利率上升25个基点	-4,894,710.50	-862,359.21	

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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股票和债券,所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响,也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中,通过对宏观经济情况及政策的分析,结合证券市场运行情况,做出资产配置及组合构建的决定;通过对单个证券的定性分析及定量分析,选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化,对投资策略、资产配置、投资组合进行修正,来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票资产投资比例为基金资产的0-95%,每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后,保持不低于基金资产净值的5%的现金或者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;权证、股指期货、国债期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。此外,本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控,定期运用多种定量方法对基金进行风险度量,及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位:人民币元

项目	本期末 2024年12月31日		上年度末 2023年12月31日	
	公允价值	占基金	公允价值	占基金

		资产净 值比例 (%)		资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	39,225,075.48	7.26	-	-
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
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	39,225,075.48	7.26	-	-

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

注：于2024年12月31日，本基金持有的交易性权益类投资公允价值占基金资产净值的比例为7.26%(2023年12月31日：无)，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响(2023年12月31日：同)。

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末	上年度末
---------------	-----	------

	2024年12月31日	2023年12月31日
第一层次	39,212,801.48	-
第二层次	451,547,662.03	155,262,053.77
第三层次	-	-
合计	490,760,463.51	155,262,053.77

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期		
	2024年01月01日至2024年12月31日		
	交易性金融资产		合计
债券投资	股票投资		
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-	-
其中：计入损益的利得或损失	-	-	-
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	-	-

期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-	-
项目	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	62,846.08	62,846.08
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	66,351.34	66,351.34
当期利得或损失总额	-	3,505.26	3,505.26
其中：计入损益的利得或损失	-	3,505.26	3,505.26
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	-	-
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-	-

注：于2024年12月31日，本基金未持有第三层次的交易性金融资产（2023年12月31日：同）。于2024年度，本基金无从第三层次转出的交易性金融资产（2023年度：本基金从第三层次转出的交易性金融资产均为限售期结束可正常交易的股票投资）。

计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

无。

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2024年12月31日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2023年12月31日：同)。

7.4.14.4 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和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

7.4.15 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。

§8 投资组合报告

8.1 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	39,225,075.48	7.14
	其中：股票	39,225,075.48	7.14
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	451,535,388.03	82.23
	其中：债券	451,535,388.03	82.23
	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	30,929,680.29	5.63
8	其他各项资产	27,440,058.96	5.00
9	合计	549,130,202.76	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	152,545.00	0.03
B	采矿业	3,245,247.00	0.60
C	制造业	18,317,087.68	3.39
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,582,913.00	0.29
E	建筑业	717,901.00	0.13
F	批发和零售业	618,061.00	0.11
G	交通运输、仓储和邮政业	1,149,729.00	0.21
H	住宿和餐饮业	76,717.00	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,107,292.80	0.39
J	金融业	9,832,732.00	1.82
K	房地产业	450,166.00	0.08
L	租赁和商务服务业	315,701.00	0.06
M	科学研究和技术服务业	129,170.00	0.02
N	水利、环境和公共设施管理业	73,597.00	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	23,120.00	0.00
Q	卫生和社会工作	138,843.00	0.03
R	文化、体育和娱乐业	234,416.00	0.04
S	综合	59,837.00	0.01
	合计	39,225,075.48	7.26

8.2.2 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港股通股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
----	------	------	-------	---------	--------------

1	600519	贵州茅台	900	1,371,600.00	0.25
2	601398	工商银行	189,300	1,309,956.00	0.24
3	601288	农业银行	228,200	1,218,588.00	0.23
4	601857	中国石油	118,800	1,062,072.00	0.20
5	601988	中国银行	151,000	832,010.00	0.15
6	601628	中国人寿	15,400	645,568.00	0.12
7	601728	中国电信	67,600	488,072.00	0.09
8	601088	中国神华	11,200	486,976.00	0.09
9	600028	中国石化	67,000	447,560.00	0.08
10	601658	邮储银行	70,900	402,712.00	0.07
11	600036	招商银行	9,900	389,070.00	0.07
12	600900	长江电力	12,700	375,285.00	0.07
13	000858	五粮液	2,300	322,092.00	0.06
14	002594	比亚迪	1,000	282,660.00	0.05
15	601138	工业富联	12,600	270,900.00	0.05
16	600809	山西汾酒	1,400	257,894.00	0.05
17	601998	中信银行	35,400	247,092.00	0.05
18	600418	江淮汽车	5,900	221,250.00	0.04
19	601319	中国人保	25,700	195,834.00	0.04
20	002625	光启技术	3,800	181,640.00	0.03
21	601318	中国平安	3,300	173,745.00	0.03
22	601166	兴业银行	9,000	172,440.00	0.03
23	603288	海天味业	3,600	165,240.00	0.03
24	601816	京沪高铁	25,900	159,544.00	0.03
25	300760	迈瑞医疗	600	153,000.00	0.03
26	600030	中信证券	4,800	140,016.00	0.03
27	300502	新易盛	1,200	138,696.00	0.03
28	000568	泸州老窖	1,100	137,720.00	0.03
29	601225	陕西煤业	5,800	134,908.00	0.02
30	601668	中国建筑	22,300	133,800.00	0.02
31	600276	恒瑞医药	2,900	133,110.00	0.02

32	300750	宁德时代	500	133,000.00	0.02
33	601211	国泰君安	7,000	130,550.00	0.02
34	601328	交通银行	16,800	130,536.00	0.02
35	002415	海康威视	4,200	128,940.00	0.02
36	002384	东山精密	4,400	128,480.00	0.02
37	600104	上汽集团	6,100	126,636.00	0.02
38	600025	华能水电	13,000	123,630.00	0.02
39	601601	中国太保	3,600	122,688.00	0.02
40	601933	永辉超市	19,300	122,362.00	0.02
41	601899	紫金矿业	8,000	120,960.00	0.02
42	601058	赛轮轮胎	8,300	118,939.00	0.02
43	600839	四川长虹	12,300	118,695.00	0.02
44	601066	中信建投	4,600	118,450.00	0.02
45	601077	渝农商行	19,500	117,975.00	0.02
46	000988	华工科技	2,700	116,910.00	0.02
47	600309	万华化学	1,600	114,160.00	0.02
48	000333	美的集团	1,500	112,830.00	0.02
49	603160	汇顶科技	1,400	112,756.00	0.02
50	600406	国电南瑞	4,400	110,968.00	0.02
51	600066	宇通客车	4,200	110,796.00	0.02
52	601633	长城汽车	4,200	110,586.00	0.02
53	601766	中国中车	12,800	107,264.00	0.02
54	601162	天风证券	23,500	105,280.00	0.02
55	601555	东吴证券	13,300	103,740.00	0.02
56	601818	光大银行	26,700	103,329.00	0.02
57	601985	中国核电	9,900	103,257.00	0.02
58	002028	思源电气	1,400	101,780.00	0.02
59	600018	上港集团	16,500	100,980.00	0.02
60	600536	中国软件	2,100	98,049.00	0.02
61	002273	水晶光电	4,400	97,768.00	0.02
62	603501	韦尔股份	900	93,969.00	0.02

63	600096	云天化	4,200	93,660.00	0.02
64	600885	宏发股份	2,900	92,278.00	0.02
65	002340	格林美	14,100	92,073.00	0.02
66	000001	平安银行	7,800	91,260.00	0.02
67	600837	海通证券	8,200	91,184.00	0.02
68	601108	财通证券	11,000	89,870.00	0.02
69	600019	宝钢股份	12,800	89,600.00	0.02
70	600352	浙江龙盛	8,700	89,523.00	0.02
71	601168	西部矿业	5,500	88,385.00	0.02
72	600988	赤峰黄金	5,600	87,416.00	0.02
73	600398	海澜之家	11,500	86,250.00	0.02
74	600760	中航沈飞	1,700	86,224.00	0.02
75	002475	立讯精密	2,100	85,596.00	0.02
76	600690	海尔智家	3,000	85,410.00	0.02
77	002517	恺英网络	6,200	84,382.00	0.02
78	603606	东方电缆	1,600	84,080.00	0.02
79	600177	雅戈尔	9,400	83,660.00	0.02
80	600050	中国联通	15,500	82,305.00	0.02
81	003816	中国广核	19,900	82,187.00	0.02
82	600660	福耀玻璃	1,300	81,120.00	0.02
83	601888	中国中免	1,200	80,412.00	0.01
84	600989	宝丰能源	4,700	79,148.00	0.01
85	601128	常熟银行	10,400	78,728.00	0.01
86	002371	北方华创	200	78,200.00	0.01
87	601615	明阳智能	6,200	78,182.00	0.01
88	603993	洛阳钼业	11,700	77,805.00	0.01
89	600109	国金证券	8,800	76,824.00	0.01
90	002352	顺丰控股	1,900	76,570.00	0.01
91	600886	国投电力	4,600	76,452.00	0.01
92	600298	安琪酵母	2,100	75,705.00	0.01
93	002797	第一创业	9,000	75,150.00	0.01

94	600999	招商证券	3,900	74,724.00	0.01
95	002156	通富微电	2,500	73,875.00	0.01
96	601567	三星医疗	2,400	73,824.00	0.01
97	600765	中航重机	3,600	73,692.00	0.01
98	002185	华天科技	6,300	73,143.00	0.01
99	601577	长沙银行	8,200	72,898.00	0.01
100	600015	华夏银行	9,100	72,891.00	0.01
101	600919	江苏银行	7,400	72,668.00	0.01
102	605499	东鹏饮料	290	72,070.80	0.01
103	600016	民生银行	17,300	71,449.00	0.01
104	002202	金风科技	6,900	71,277.00	0.01
105	601995	中金公司	2,100	70,749.00	0.01
106	600862	中航高科	2,800	70,728.00	0.01
107	601012	隆基绿能	4,500	70,695.00	0.01
108	688041	海光信息	471	70,551.09	0.01
109	601390	中国中铁	11,000	70,290.00	0.01
110	600895	张江高科	2,600	69,680.00	0.01
111	300999	金龙鱼	2,100	68,481.00	0.01
112	000066	中国长城	4,700	68,479.00	0.01
113	002738	中矿资源	1,900	67,450.00	0.01
114	600497	驰宏锌锗	12,100	67,397.00	0.01
115	002304	洋河股份	800	66,824.00	0.01
116	600873	梅花生物	6,600	66,198.00	0.01
117	601600	中国铝业	9,000	66,150.00	0.01
118	002138	顺络电子	2,100	66,108.00	0.01
119	601233	桐昆股份	5,600	66,080.00	0.01
120	603893	瑞芯微	600	66,036.00	0.01
121	600905	三峡能源	15,100	65,987.00	0.01
122	601696	中银证券	5,800	64,728.00	0.01
122	600150	中国船舶	1,800	64,728.00	0.01
124	601336	新华保险	1,300	64,610.00	0.01

125	001979	招商蛇口	6,300	64,512.00	0.01
126	600436	片仔癀	300	64,350.00	0.01
127	000933	神火股份	3,800	64,220.00	0.01
128	601990	南京证券	7,400	64,084.00	0.01
129	002966	苏州银行	7,900	64,069.00	0.01
130	601881	中国银河	4,200	63,966.00	0.01
131	002736	国信证券	5,700	63,840.00	0.01
132	603392	万泰生物	900	63,414.00	0.01
133	600369	西南证券	13,500	63,045.00	0.01
134	600346	恒力石化	4,100	62,935.00	0.01
135	002078	太阳纸业	4,200	62,454.00	0.01
136	603596	伯特利	1,400	62,426.00	0.01
137	601006	大秦铁路	9,200	62,376.00	0.01
138	601216	君正集团	11,800	62,068.00	0.01
139	603979	金诚信	1,700	61,710.00	0.01
140	601186	中国铁建	6,700	61,439.00	0.01
141	002142	宁波银行	2,500	60,775.00	0.01
142	601009	南京银行	5,700	60,705.00	0.01
143	688777	中控技术	1,208	60,001.36	0.01
144	600673	东阳光	5,300	59,837.00	0.01
145	601688	华泰证券	3,400	59,806.00	0.01
146	002353	杰瑞股份	1,600	59,184.00	0.01
147	601698	中国卫通	2,900	59,160.00	0.01
148	600795	国电电力	12,900	59,082.00	0.01
149	601997	贵阳银行	9,800	58,800.00	0.01
150	600909	华安证券	9,700	58,782.00	0.01
151	601689	拓普集团	1,195	58,555.00	0.01
152	601800	中国交建	5,600	58,520.00	0.01
153	002444	巨星科技	1,800	58,230.00	0.01
154	002195	岩山科技	14,600	57,962.00	0.01
155	600031	三一重工	3,500	57,680.00	0.01

156	002008	大族激光	2,300	57,500.00	0.01
157	002281	光迅科技	1,100	57,387.00	0.01
158	600887	伊利股份	1,900	57,342.00	0.01
159	601169	北京银行	9,300	57,195.00	0.01
160	603345	安井食品	700	57,036.00	0.01
161	600155	华创云信	7,700	56,980.00	0.01
162	000630	铜陵有色	17,300	55,879.00	0.01
163	601229	上海银行	6,100	55,815.00	0.01
164	603260	合盛硅业	1,000	55,560.00	0.01
165	002673	西部证券	6,800	55,420.00	0.01
166	600521	华海药业	3,100	55,397.00	0.01
167	000728	国元证券	6,600	55,176.00	0.01
168	600637	东方明珠	7,100	55,096.00	0.01
169	002532	天山铝业	7,000	55,090.00	0.01
170	600763	通策医疗	1,240	55,056.00	0.01
171	002223	鱼跃医疗	1,500	54,735.00	0.01
172	600879	航天电子	6,100	54,656.00	0.01
173	600118	中国卫星	2,000	54,600.00	0.01
174	000783	长江证券	8,000	54,560.00	0.01
175	000651	格力电器	1,200	54,540.00	0.01
176	600141	兴发集团	2,500	54,250.00	0.01
177	600529	山东药玻	2,100	54,117.00	0.01
178	000538	云南白药	900	53,955.00	0.01
179	600859	王府井	3,500	53,935.00	0.01
180	600820	隧道股份	7,500	53,925.00	0.01
181	601179	中国西电	7,100	53,889.00	0.01
182	600893	航发动力	1,300	53,885.00	0.01
183	601111	中国国航	6,800	53,788.00	0.01
184	600153	建发股份	5,100	53,652.00	0.01
185	600143	金发科技	6,200	53,568.00	0.01
186	000166	申万宏源	10,000	53,500.00	0.01

187	600704	物产中大	10,500	53,130.00	0.01
188	603939	益丰药房	2,200	53,086.00	0.01
189	600872	中炬高新	2,400	52,848.00	0.01
190	601456	国联民生	3,900	52,728.00	0.01
191	600188	兖矿能源	3,700	52,429.00	0.01
192	000400	许继电气	1,900	52,307.00	0.01
193	600048	保利发展	5,900	52,274.00	0.01
194	002436	兴森科技	4,700	52,217.00	0.01
195	601666	平煤股份	5,200	52,104.00	0.01
196	600486	扬农化工	900	52,083.00	0.01
197	002472	双环传动	1,700	52,054.00	0.01
198	600549	厦门钨业	2,700	52,029.00	0.01
199	600060	海信视像	2,600	51,844.00	0.01
200	600699	均胜电子	3,300	51,711.00	0.01
201	600580	卧龙电驱	3,000	51,570.00	0.01
202	300207	欣旺达	2,300	51,313.00	0.01
203	002938	鹏鼎控股	1,400	51,072.00	0.01
204	002128	电投能源	2,600	50,908.00	0.01
205	600867	通化东宝	6,300	50,778.00	0.01
206	603019	中科曙光	700	50,624.00	0.01
207	600029	南方航空	7,800	50,622.00	0.01
208	002568	百润股份	1,800	50,418.00	0.01
209	600745	闻泰科技	1,300	50,414.00	0.01
210	001289	龙源电力	3,200	50,272.00	0.01
211	000423	东阿阿胶	800	50,176.00	0.01
212	600674	川投能源	2,900	50,025.00	0.01
213	002739	万达电影	4,100	49,774.00	0.01
214	600008	首创环保	15,000	49,200.00	0.01
215	600390	五矿资本	7,600	49,020.00	0.01
216	600863	内蒙华电	11,300	48,929.00	0.01
217	002262	恩华药业	2,000	48,700.00	0.01

218	600498	烽火通信	2,500	48,650.00	0.01
219	601000	唐山港	10,300	48,513.00	0.01
220	600170	上海建工	18,300	48,495.00	0.01
221	600392	盛和资源	4,700	48,316.00	0.01
222	603298	杭叉集团	2,700	48,303.00	0.01
223	600316	洪都航空	1,500	48,180.00	0.01
224	000831	中国稀土	1,700	47,685.00	0.01
225	600023	浙能电力	8,400	47,544.00	0.01
226	600941	中国移动	400	47,264.00	0.01
227	603589	口子窖	1,200	47,088.00	0.01
228	603179	新泉股份	1,100	46,970.00	0.01
229	601966	玲珑轮胎	2,600	46,904.00	0.01
230	601717	郑煤机	3,600	46,728.00	0.01
231	300017	网宿科技	4,400	46,508.00	0.01
232	600985	淮北矿业	3,300	46,431.00	0.01
232	600438	通威股份	2,100	46,431.00	0.01
234	600535	天士力	3,200	46,272.00	0.01
235	002465	海格通信	4,200	46,116.00	0.01
236	600516	方大炭素	9,500	45,885.00	0.01
236	000997	新大陆	2,300	45,885.00	0.01
238	300136	信维通信	1,800	45,792.00	0.01
239	002558	巨人网络	3,600	45,684.00	0.01
240	601880	辽港股份	26,300	45,499.00	0.01
241	000617	中油资本	6,600	45,474.00	0.01
242	600010	包钢股份	24,400	45,384.00	0.01
243	603338	浙江鼎力	700	45,164.00	0.01
244	603529	爱玛科技	1,100	45,122.00	0.01
245	600584	长电科技	1,100	44,946.00	0.01
246	000009	中国宝安	4,900	44,835.00	0.01
247	600511	国药股份	1,300	44,486.00	0.01
248	000738	航发控制	2,000	44,480.00	0.01

249	600009	上海机场	1,300	44,395.00	0.01
250	000895	双汇发展	1,700	44,132.00	0.01
251	603087	甘李药业	1,000	44,100.00	0.01
252	600021	上海电力	4,800	44,016.00	0.01
253	600348	华阳股份	6,200	43,958.00	0.01
254	002261	拓维信息	2,400	43,944.00	0.01
255	600208	衢州发展	14,800	43,808.00	0.01
256	600998	九州通	8,500	43,520.00	0.01
257	000960	锡业股份	3,100	43,493.00	0.01
258	002493	荣盛石化	4,800	43,440.00	0.01
259	002294	信立泰	1,400	43,302.00	0.01
260	601868	中国能建	18,900	43,281.00	0.01
261	001965	招商公路	3,100	43,245.00	0.01
262	600655	豫园股份	6,700	43,081.00	0.01
263	603077	和邦生物	21,100	43,044.00	0.01
264	600754	锦江酒店	1,600	42,976.00	0.01
265	601238	广汽集团	4,600	42,964.00	0.01
266	600380	健康元	3,800	42,826.00	0.01
267	600585	海螺水泥	1,800	42,804.00	0.01
268	300058	蓝色光标	4,600	42,688.00	0.01
269	000878	云南铜业	3,500	42,665.00	0.01
270	603737	三棵树	1,000	42,600.00	0.01
271	600926	杭州银行	2,900	42,369.00	0.01
272	000932	华菱钢铁	10,100	42,218.00	0.01
273	601100	恒立液压	800	42,216.00	0.01
274	601016	节能风电	13,300	42,161.00	0.01
275	605358	立昂微	1,700	42,109.00	0.01
276	600011	华能国际	6,200	41,974.00	0.01
277	603228	景旺电子	1,500	41,760.00	0.01
278	600583	海油工程	7,600	41,572.00	0.01
279	000623	吉林敖东	2,400	41,448.00	0.01

280	603816	顾家家居	1,500	41,370.00	0.01
281	002244	滨江集团	4,800	41,328.00	0.01
282	600938	中国海油	1,400	41,314.00	0.01
283	603927	中科软	1,900	41,230.00	0.01
284	603885	吉祥航空	3,000	41,100.00	0.01
284	600707	彩虹股份	5,000	41,100.00	0.01
286	603568	伟明环保	1,900	41,097.00	0.01
287	000563	陕国投 A	11,500	40,940.00	0.01
288	600166	福田汽车	16,300	40,913.00	0.01
289	002432	九安医疗	1,000	40,780.00	0.01
290	002409	雅克科技	700	40,565.00	0.01
291	600600	青岛啤酒	500	40,460.00	0.01
292	601021	春秋航空	700	40,369.00	0.01
293	600282	南钢股份	8,600	40,334.00	0.01
294	600415	小商品城	3,000	40,230.00	0.01
295	600546	山煤国际	3,400	40,222.00	0.01
296	002595	豪迈科技	800	40,152.00	0.01
297	000002	万科 A	5,500	39,930.00	0.01
298	601607	上海医药	1,900	39,900.00	0.01
299	601788	光大证券	2,200	39,842.00	0.01
300	600131	国网信通	2,100	39,711.00	0.01
301	601198	东兴证券	3,600	39,636.00	0.01
302	002407	多氟多	3,300	39,600.00	0.01
303	300002	神州泰岳	3,400	39,406.00	0.01
304	601360	三六零	3,800	39,330.00	0.01
305	002311	海大集团	800	39,240.00	0.01
306	300054	鼎龙股份	1,500	39,030.00	0.01
307	600803	新奥股份	1,800	39,024.00	0.01
308	000776	广发证券	2,400	38,904.00	0.01
309	601611	中国核建	4,300	38,872.00	0.01
310	603156	养元饮品	1,700	38,828.00	0.01

311	000625	长安汽车	2,900	38,744.00	0.01
312	601939	建设银行	4,400	38,676.00	0.01
313	600039	四川路桥	5,300	38,584.00	0.01
314	002044	美年健康	8,400	38,556.00	0.01
315	300012	华测检测	3,100	38,533.00	0.01
316	603259	药明康德	700	38,528.00	0.01
317	600489	中金黄金	3,200	38,496.00	0.01
318	002065	东华软件	5,300	38,478.00	0.01
319	601155	新城控股	3,200	38,272.00	0.01
320	000021	深科技	2,000	38,120.00	0.01
321	000750	国海证券	8,900	38,092.00	0.01
322	600845	宝信软件	1,300	38,038.00	0.01
323	601231	环旭电子	2,300	37,950.00	0.01
324	300724	捷佳伟创	600	37,926.00	0.01
325	600566	济川药业	1,300	37,804.00	0.01
326	600737	中粮糖业	3,700	37,777.00	0.01
327	002756	永兴材料	1,000	37,720.00	0.01
328	300395	菲利华	1,000	37,610.00	0.01
329	600004	白云机场	3,900	37,440.00	0.01
330	600079	人福医药	1,600	37,408.00	0.01
331	601298	青岛港	4,100	37,351.00	0.01
332	000039	中集集团	4,800	37,296.00	0.01
333	002385	大北农	8,600	37,238.00	0.01
334	600085	同仁堂	900	36,531.00	0.01
335	600115	中国东航	9,100	36,400.00	0.01
336	000063	中兴通讯	900	36,360.00	0.01
337	000683	远兴能源	6,500	36,335.00	0.01
338	600739	辽宁成大	3,500	36,225.00	0.01
339	603369	今世缘	800	36,184.00	0.01
340	002624	完美世界	3,500	36,155.00	0.01
341	601669	中国电建	6,600	36,036.00	0.01

342	601866	中远海发	13,800	36,018.00	0.01
343	601838	成都银行	2,100	35,931.00	0.01
344	600958	东方证券	3,400	35,904.00	0.01
345	600582	天地科技	5,800	35,844.00	0.01
346	600563	法拉电子	300	35,676.00	0.01
347	002958	青农商行	11,700	35,568.00	0.01
348	002179	中航光电	900	35,370.00	0.01
349	002064	华峰化学	4,300	35,174.00	0.01
350	002500	山西证券	5,600	35,168.00	0.01
351	600435	北方导航	3,600	35,136.00	0.01
352	600416	湘电股份	3,100	34,999.00	0.01
353	600901	江苏金租	6,700	34,974.00	0.01
354	000729	燕京啤酒	2,900	34,916.00	0.01
355	600038	中直股份	900	34,704.00	0.01
356	002155	湖南黄金	2,200	34,606.00	0.01
357	000963	华东医药	1,000	34,600.00	0.01
358	002984	森麒麟	1,400	34,524.00	0.01
359	601098	中南传媒	2,300	34,523.00	0.01
360	600995	南网储能	3,400	34,408.00	0.01
361	600499	科达制造	4,400	34,320.00	0.01
362	000893	亚钾国际	1,700	34,272.00	0.01
363	601958	金钼股份	3,400	34,204.00	0.01
364	600959	江苏有线	10,200	34,170.00	0.01
365	601901	方正证券	4,100	34,153.00	0.01
366	600970	中材国际	3,600	34,128.00	0.01
367	601618	中国中冶	10,300	33,990.00	0.01
368	600111	北方稀土	1,600	33,952.00	0.01
369	600547	山东黄金	1,500	33,945.00	0.01
370	600598	北大荒	2,300	33,925.00	0.01
371	000703	恒逸石化	5,400	33,912.00	0.01
372	000768	中航西飞	1,200	33,888.00	0.01

373	600258	首旅酒店	2,300	33,741.00	0.01
374	000301	东方盛虹	4,100	33,661.00	0.01
375	000958	电投产融	5,400	33,642.00	0.01
376	300383	光环新网	2,300	33,557.00	0.01
377	600325	华发股份	5,800	33,408.00	0.01
378	002926	华西证券	4,000	33,240.00	0.01
379	600517	国网英大	6,000	33,060.00	0.01
380	000636	风华高科	2,300	33,005.00	0.01
381	603486	科沃斯	700	32,900.00	0.01
382	600968	海油发展	7,700	32,879.00	0.01
383	000591	太阳能	6,900	32,844.00	0.01
384	600271	航天信息	3,600	32,796.00	0.01
385	002497	雅化集团	2,800	32,760.00	0.01
386	601118	海南橡胶	6,000	32,460.00	0.01
387	000998	隆平高科	2,900	32,393.00	0.01
388	601808	中海油服	2,100	32,025.00	0.01
389	000708	中信特钢	2,800	31,948.00	0.01
390	000921	海信家电	1,100	31,790.00	0.01
391	600741	华域汽车	1,800	31,698.00	0.01
392	000830	鲁西化工	2,700	31,563.00	0.01
393	002152	广电运通	2,700	31,482.00	0.01
394	300979	华利集团	400	31,460.00	0.01
395	600848	上海临港	3,100	31,310.00	0.01
396	002203	海亮股份	2,900	31,175.00	0.01
397	601928	凤凰传媒	2,700	31,158.00	0.01
398	603712	七一二	1,600	31,152.00	0.01
399	000999	华润三九	700	31,038.00	0.01
400	600372	中航机载	2,500	30,825.00	0.01
401	601872	招商轮船	4,800	30,768.00	0.01
402	603379	三美股份	800	30,704.00	0.01
403	603658	安图生物	700	30,548.00	0.01

404	600884	杉杉股份	4,100	30,545.00	0.01
405	000060	中金岭南	6,500	30,485.00	0.01
406	000513	丽珠集团	800	30,400.00	0.01
407	000519	中兵红箭	2,100	30,345.00	0.01
408	002939	长城证券	3,700	30,340.00	0.01
409	601636	旗滨集团	5,400	30,294.00	0.01
410	002027	分众传媒	4,300	30,229.00	0.01
411	000425	徐工机械	3,800	30,134.00	0.01
412	002429	兆驰股份	5,200	30,056.00	0.01
413	600056	中国医药	2,700	29,970.00	0.01
414	601598	中国外运	5,600	29,960.00	0.01
415	300037	新宙邦	800	29,952.00	0.01
416	600755	厦门国贸	4,500	29,880.00	0.01
417	600528	中铁工业	3,700	29,822.00	0.01
418	600196	复星医药	1,200	29,820.00	0.01
419	600233	圆通速递	2,100	29,799.00	0.01
420	000723	美锦能源	6,600	29,766.00	0.01
421	600129	太极集团	1,200	29,664.00	0.01
421	000629	钒钛股份	10,300	29,664.00	0.01
423	002850	科达利	300	29,304.00	0.01
424	002025	航天电器	600	29,136.00	0.01
425	600977	中国电影	2,500	29,025.00	0.01
426	601212	白银有色	10,400	28,912.00	0.01
427	603858	步长制药	1,800	28,440.00	0.01
428	600399	抚顺特钢	4,900	28,420.00	0.01
429	002506	协鑫集成	10,600	28,302.00	0.01
430	601106	中国一重	9,700	28,227.00	0.01
431	002050	三花智控	1,200	28,212.00	0.01
432	300073	当升科技	700	28,196.00	0.01
433	601877	正泰电器	1,200	28,092.00	0.01
434	600027	华电国际	5,000	28,050.00	0.01

435	300474	景嘉微	300	28,047.00	0.01
436	601916	浙商银行	9,600	27,936.00	0.01
437	600483	福能股份	2,800	27,916.00	0.01
438	600061	国投资本	3,700	27,824.00	0.01
439	600329	达仁堂	900	27,720.00	0.01
439	600062	华润双鹤	1,400	27,720.00	0.01
439	300699	光威复材	800	27,720.00	0.01
442	603833	欧派家居	400	27,576.00	0.01
443	002414	高德红外	3,700	27,491.00	0.01
444	600612	老凤祥	500	27,135.00	0.01
445	600875	东方电气	1,700	27,013.00	0.00
446	603290	斯达半导	300	26,946.00	0.00
447	002439	启明星辰	1,700	26,894.00	0.00
448	002507	涪陵榨菜	1,900	26,847.00	0.00
449	600350	山东高速	2,600	26,728.00	0.00
450	600801	华新水泥	2,200	26,620.00	0.00
451	600183	生益科技	1,100	26,455.00	0.00
452	688525	佰维存储	426	26,399.22	0.00
453	600373	中文传媒	2,100	26,355.00	0.00
454	300001	特锐德	1,200	26,340.00	0.00
455	601236	红塔证券	3,100	26,319.00	0.00
456	600918	中泰证券	4,000	26,280.00	0.00
457	600808	马钢股份	8,500	26,265.00	0.00
458	000050	深天马 A	2,900	26,187.00	0.00
459	002430	杭氧股份	1,200	26,160.00	0.00
460	601019	山东出版	2,300	26,105.00	0.00
461	600460	士兰微	1,000	26,020.00	0.00
462	603456	九洲药业	1,900	25,992.00	0.00
463	300442	润泽科技	500	25,980.00	0.00
464	000977	浪潮信息	500	25,940.00	0.00
465	688099	晶晨股份	377	25,892.36	0.00

466	603688	石英股份	900	25,857.00	0.00
467	601699	潞安环能	1,800	25,848.00	0.00
468	601992	金隅集团	14,500	25,810.00	0.00
469	000598	兴蓉环境	3,400	25,806.00	0.00
470	688180	君实生物	941	25,717.53	0.00
471	601878	浙商证券	2,100	25,704.00	0.00
472	601117	中国化学	3,100	25,699.00	0.00
473	600663	陆家嘴	2,600	25,584.00	0.00
474	600332	白云山	900	25,578.00	0.00
475	000725	京东方 A	5,800	25,462.00	0.00
476	605117	德业股份	300	25,440.00	0.00
477	000887	中鼎股份	1,900	24,928.00	0.00
478	600500	中化国际	6,200	24,924.00	0.00
479	002120	韵达股份	3,300	24,816.00	0.00
480	601608	中信重工	5,900	24,780.00	0.00
481	603882	金域医学	900	24,777.00	0.00
482	600362	江西铜业	1,200	24,768.00	0.00
483	603786	科博达	400	24,720.00	0.00
484	688772	珠海冠宇	1,534	24,666.72	0.00
485	002056	横店东磁	1,900	24,624.00	0.00
486	002299	圣农发展	1,700	24,616.00	0.00
487	603650	彤程新材	700	24,479.00	0.00
488	002936	郑州银行	11,600	24,360.00	0.00
489	000786	北新建材	800	24,248.00	0.00
490	002001	新和成	1,100	24,167.00	0.00
491	002230	科大讯飞	500	24,160.00	0.00
492	603233	大参林	1,600	24,096.00	0.00
493	002572	索菲亚	1,400	24,052.00	0.00
494	688521	芯原股份	456	23,908.08	0.00
495	603707	健友股份	1,800	23,886.00	0.00
496	002683	广东宏大	900	23,832.00	0.00

497	600022	山东钢铁	16,400	23,780.00	0.00
498	600426	华鲁恒升	1,100	23,771.00	0.00
499	301236	软通动力	400	23,484.00	0.00
500	002240	盛新锂能	1,700	23,426.00	0.00
501	603799	华友钴业	800	23,408.00	0.00
502	603225	新凤鸣	2,100	23,373.00	0.00
503	300568	星源材质	2,400	23,328.00	0.00
504	002373	千方科技	2,300	23,322.00	0.00
505	002241	歌尔股份	900	23,229.00	0.00
506	600026	中远海能	2,000	23,200.00	0.00
507	600378	昊华科技	800	23,128.00	0.00
508	002607	中公教育	6,800	23,120.00	0.00
509	600967	内蒙一机	2,700	22,950.00	0.00
510	600126	杭钢股份	4,800	22,944.00	0.00
511	300088	长信科技	3,500	22,890.00	0.00
512	002423	中粮资本	1,700	22,763.00	0.00
513	601568	北元集团	5,400	22,680.00	0.00
514	002648	卫星化学	1,200	22,548.00	0.00
515	600219	南山铝业	5,700	22,287.00	0.00
516	000938	紫光股份	800	22,264.00	0.00
517	002670	国盛金控	1,700	22,253.00	0.00
518	300285	国瓷材料	1,300	22,152.00	0.00
519	603444	吉比特	100	21,884.00	0.00
520	688005	容百科技	692	21,832.60	0.00
521	688122	西部超导	506	21,666.92	0.00
522	601865	福莱特	1,100	21,659.00	0.00
523	600095	湘财股份	3,000	21,600.00	0.00
524	300003	乐普医疗	1,900	21,546.00	0.00
525	600339	中油工程	6,000	21,480.00	0.00
526	300498	温氏股份	1,300	21,463.00	0.00
527	600377	宁沪高速	1,400	21,434.00	0.00

528	002508	老板电器	1,000	21,430.00	0.00
529	603517	绝味食品	1,300	21,372.00	0.00
530	601377	兴业证券	3,400	21,284.00	0.00
531	601965	中国汽研	1,200	21,144.00	0.00
532	002268	电科网安	1,300	21,125.00	0.00
533	000778	新兴铸管	5,500	21,120.00	0.00
534	603195	公牛集团	300	21,072.00	0.00
535	000027	深圳能源	3,200	20,736.00	0.00
536	600176	中国巨石	1,800	20,502.00	0.00
537	600161	天坛生物	1,000	20,500.00	0.00
537	000800	一汽解放	2,500	20,500.00	0.00
539	002865	钧达股份	400	20,440.00	0.00
540	600089	特变电工	1,600	20,384.00	0.00
541	002557	洽洽食品	700	20,335.00	0.00
542	000785	居然智家	5,600	19,992.00	0.00
543	002653	海思科	600	19,950.00	0.00
544	300433	蓝思科技	900	19,710.00	0.00
545	600570	恒生电子	700	19,593.00	0.00
546	000408	藏格矿业	700	19,411.00	0.00
547	002266	浙富控股	6,200	19,344.00	0.00
548	600588	用友网络	1,800	19,314.00	0.00
549	002019	亿帆医药	1,800	19,296.00	0.00
550	000338	潍柴动力	1,400	19,180.00	0.00
551	000709	河钢股份	8,600	19,006.00	0.00
552	601228	广州港	5,600	18,984.00	0.00
553	002831	裕同科技	700	18,970.00	0.00
554	000983	山西焦煤	2,300	18,952.00	0.00
555	002368	太极股份	800	18,944.00	0.00
556	300014	亿纬锂能	400	18,696.00	0.00
557	601828	美凯龙	5,800	18,618.00	0.00
558	300015	爱尔眼科	1,400	18,550.00	0.00

559	600361	创新新材	4,800	18,528.00	0.00
560	688536	思瑞浦	200	18,500.00	0.00
561	000883	湖北能源	3,700	18,426.00	0.00
562	002080	中材科技	1,400	18,312.00	0.00
563	300394	天孚通信	200	18,272.00	0.00
564	000987	越秀资本	2,600	18,252.00	0.00
565	603218	日月股份	1,500	18,075.00	0.00
566	603883	老百姓	1,100	18,007.00	0.00
567	300118	东方日升	1,500	17,970.00	0.00
568	603806	福斯特	1,200	17,760.00	0.00
569	002603	以岭药业	1,100	17,611.00	0.00
570	300529	健帆生物	600	17,604.00	0.00
571	600481	双良节能	3,200	17,600.00	0.00
572	600299	安迪苏	1,400	17,570.00	0.00
573	002460	赣锋锂业	500	17,505.00	0.00
574	000596	古井贡酒	100	17,330.00	0.00
575	000818	航锦科技	900	17,190.00	0.00
576	300253	卫宁健康	2,400	17,184.00	0.00
577	600764	中国海防	600	16,992.00	0.00
578	002074	国轩高科	800	16,976.00	0.00
579	600315	上海家化	1,000	16,910.00	0.00
580	000825	太钢不锈	4,800	16,704.00	0.00
581	600928	西安银行	4,600	16,606.00	0.00
582	002408	齐翔腾达	3,300	16,599.00	0.00
583	002466	天齐锂业	500	16,500.00	0.00
584	002372	伟星新材	1,300	16,419.00	0.00
585	000739	普洛药业	1,000	16,260.00	0.00
586	603728	鸣志电器	300	16,200.00	0.00
587	000876	新希望	1,800	16,164.00	0.00
588	300413	芒果超媒	600	16,134.00	0.00
589	300296	利亚德	2,500	16,100.00	0.00

590	002812	恩捷股份	500	15,995.00	0.00
591	600927	永安期货	1,200	15,828.00	0.00
592	002531	天顺风能	2,000	15,820.00	0.00
593	002709	天赐材料	800	15,776.00	0.00
594	003031	中瓷电子	300	15,717.00	0.00
595	601919	中远海控	1,000	15,500.00	0.00
596	000157	中联重科	2,100	15,183.00	0.00
597	300677	英科医疗	600	15,168.00	0.00
598	002459	晶澳科技	1,100	15,125.00	0.00
599	000155	川能动力	1,400	14,952.00	0.00
600	000807	云铝股份	1,100	14,883.00	0.00
601	300144	宋城演艺	1,600	14,864.00	0.00
602	300274	阳光电源	200	14,766.00	0.00
603	002841	视源股份	400	14,764.00	0.00
604	002236	大华股份	900	14,400.00	0.00
604	000156	华数传媒	2,000	14,400.00	0.00
606	300487	蓝晓科技	300	14,361.00	0.00
607	002487	大金重工	700	14,343.00	0.00
608	603056	德邦股份	1,000	14,330.00	0.00
609	002129	TCL中环	1,600	14,192.00	0.00
610	000032	深桑达 A	800	14,112.00	0.00
611	002555	三七互娱	900	14,076.00	0.00
612	300390	天华新能	600	13,830.00	0.00
613	300009	安科生物	1,600	13,824.00	0.00
614	300601	康泰生物	800	13,720.00	0.00
615	688303	大全能源	567	13,687.38	0.00
616	002791	坚朗五金	600	13,644.00	0.00
617	000100	TCL科技	2,700	13,581.00	0.00
618	000967	盈峰环境	2,700	13,419.00	0.00
619	601139	深圳燃气	1,900	13,414.00	0.00
620	603317	天味食品	1,000	13,340.00	0.00

621	601127	赛力斯	100	13,339.00	0.00
622	002690	美亚光电	900	13,338.00	0.00
623	300146	汤臣倍健	1,100	13,255.00	0.00
624	300604	长川科技	300	13,239.00	0.00
625	000792	盐湖股份	800	13,168.00	0.00
626	300070	碧水源	2,600	13,156.00	0.00
627	300373	扬杰科技	300	13,056.00	0.00
628	300567	精测电子	200	12,860.00	0.00
629	688385	复旦微电	333	12,783.87	0.00
630	688012	中微公司	67	12,673.72	0.00
631	000733	振华科技	300	12,651.00	0.00
632	000937	冀中能源	2,000	12,640.00	0.00
633	600132	重庆啤酒	200	12,604.00	0.00
634	000401	冀东水泥	2,400	12,552.00	0.00
635	300748	金力永磁	700	12,516.00	0.00
636	002916	深南电路	100	12,500.00	0.00
637	002252	上海莱士	1,700	12,274.00	0.00
638	601858	中国科传	600	12,228.00	0.00
639	300763	锦浪科技	200	12,214.00	0.00
640	300124	汇川技术	200	11,716.00	0.00
641	603127	昭衍新药	700	11,641.00	0.00
642	002867	周大生	800	11,624.00	0.00
643	300628	亿联网络	300	11,580.00	0.00
644	603185	弘元绿能	700	11,375.00	0.00
645	300438	鹏辉能源	400	11,244.00	0.00
646	600732	爱旭股份	1,000	11,020.00	0.00
647	002920	德赛西威	100	11,011.00	0.00
648	300558	贝达药业	200	10,786.00	0.00
649	601158	重庆水务	2,200	10,780.00	0.00
650	688331	荣昌生物	357	10,749.27	0.00
651	603986	兆易创新	100	10,680.00	0.00

652	002601	龙佰集团	600	10,602.00	0.00
653	000898	鞍钢股份	4,400	10,560.00	0.00
654	300251	光线传媒	1,100	10,384.00	0.00
654	002271	东方雨虹	800	10,384.00	0.00
656	688567	孚能科技	878	10,184.80	0.00
657	688009	中国通号	1,612	10,091.12	0.00
658	000537	中绿电	1,100	10,032.00	0.00
659	688223	晶科能源	1,400	9,954.00	0.00
660	002563	森马服饰	1,400	9,828.00	0.00
661	300866	安克创新	100	9,764.00	0.00
662	003022	联泓新科	700	9,639.00	0.00
663	603826	坤彩科技	500	9,625.00	0.00
664	300803	指南针	100	9,595.00	0.00
665	688002	睿创微纳	203	9,543.03	0.00
666	300595	欧普康视	500	9,475.00	0.00
667	300024	机器人	500	8,975.00	0.00
668	603000	人民网	400	8,816.00	0.00
669	301308	江波龙	100	8,600.00	0.00
670	601898	中煤能源	700	8,526.00	0.00
671	603605	珀莱雅	100	8,470.00	0.00
672	002180	纳思达	300	8,451.00	0.00
673	002007	华兰生物	500	8,425.00	0.00
674	300676	华大基因	200	8,394.00	0.00
675	003035	南网能源	2,000	8,360.00	0.00
676	001286	陕西能源	900	8,352.00	0.00
677	002410	广联达	700	8,232.00	0.00
678	601989	中国重工	1,700	8,177.00	0.00
679	300122	智飞生物	300	7,890.00	0.00
680	002153	石基信息	1,100	7,854.00	0.00
681	301498	乖宝宠物	100	7,832.00	0.00
682	002714	牧原股份	200	7,688.00	0.00

683	002821	凯莱英	100	7,609.00	0.00
684	002085	万丰奥威	400	7,580.00	0.00
685	688249	晶合集成	316	7,375.44	0.00
686	300919	中伟股份	200	7,224.00	0.00
687	301165	锐捷网络	100	7,220.00	0.00
688	300114	中航电测	100	7,178.00	0.00
689	603296	华勤技术	100	7,095.00	0.00
690	688396	华润微	149	7,031.31	0.00
691	300212	易华录	300	7,020.00	0.00
692	600487	亨通光电	400	6,888.00	0.00
693	300223	北京君正	100	6,820.00	0.00
694	002518	科士达	300	6,759.00	0.00
695	688187	时代电气	141	6,756.72	0.00
696	688008	澜起科技	99	6,722.10	0.00
697	601061	中信金属	900	6,534.00	0.00
698	002049	紫光国微	100	6,437.00	0.00
699	300776	帝尔激光	100	6,358.00	0.00
700	002945	华林证券	400	6,132.00	0.00
701	300682	朗新集团	500	6,100.00	0.00
702	300357	我武生物	300	6,096.00	0.00
703	603899	晨光股份	200	6,050.00	0.00
704	688475	萤石网络	200	6,038.00	0.00
705	300496	中科创达	100	5,956.00	0.00
706	688819	天能股份	200	5,444.00	0.00
707	688561	奇安信	200	5,366.00	0.00
708	300765	新诺威	200	5,318.00	0.00
709	600606	绿地控股	2,500	5,250.00	0.00
710	000031	大悦城	1,700	5,168.00	0.00
711	601099	太平洋	1,200	5,112.00	0.00
712	300339	润和软件	100	5,003.00	0.00
713	600007	中国国贸	200	4,892.00	0.00

714	000959	首钢股份	1,600	4,880.00	0.00
715	688538	和辉光电	2,094	4,858.08	0.00
716	688599	天合光能	244	4,709.20	0.00
717	002318	久立特材	200	4,682.00	0.00
718	301358	湖南裕能	100	4,532.00	0.00
719	000539	粤电力 A	1,000	4,530.00	0.00
720	300957	贝泰妮	100	4,269.00	0.00
721	300476	胜宏科技	100	4,209.00	0.00
722	300888	稳健医疗	100	4,208.00	0.00
723	603868	飞科电器	100	4,152.00	0.00
724	601001	晋控煤业	300	4,101.00	0.00
725	688172	燕东微	200	4,010.00	0.00
726	688295	中复神鹰	200	3,986.00	0.00
727	002463	沪电股份	100	3,965.00	0.00
728	600688	上海石化	1,300	3,926.00	0.00
729	300408	三环集团	100	3,851.00	0.00
730	600312	平高电气	200	3,840.00	0.00
731	603556	海兴电力	100	3,699.00	0.00
732	601918	新集能源	500	3,590.00	0.00
733	688425	铁建重工	806	3,546.40	0.00
734	600720	中交设计	400	3,544.00	0.00
735	000034	神州数码	100	3,505.00	0.00
736	000426	兴业银锡	300	3,336.00	0.00
737	300316	晶盛机电	100	3,190.00	0.00
738	688779	五矿新能	581	3,090.92	0.00
739	000559	万向钱潮	500	3,075.00	0.00
740	688126	沪硅产业	160	3,011.20	0.00
741	300140	节能环境	500	2,995.00	0.00
742	002422	科伦药业	100	2,993.00	0.00
743	600295	鄂尔多斯	300	2,928.00	0.00
744	603305	旭升集团	200	2,630.00	0.00

745	300759	康龙化成	100	2,570.00	0.00
746	688472	阿特斯	200	2,512.00	0.00
747	600482	中国动力	100	2,447.00	0.00
748	300142	沃森生物	200	2,416.00	0.00
749	600160	巨化股份	100	2,412.00	0.00
750	600685	中船防务	100	2,370.00	0.00
751	601136	首创证券	100	2,200.00	0.00
752	000403	派林生物	100	2,113.00	0.00
753	300450	先导智能	100	2,002.00	0.00
754	300861	美畅股份	100	1,995.00	0.00
755	301267	华夏眼科	100	1,904.00	0.00
756	603659	璞泰来	100	1,591.00	0.00
757	000975	山金国际	100	1,537.00	0.00
758	688363	华熙生物	6	306.24	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	3,434,380.00	1.17
2	601398	工商银行	3,037,579.00	1.04
3	601857	中国石油	2,962,091.00	1.01
4	601288	农业银行	2,764,103.00	0.94
5	601988	中国银行	1,895,308.00	0.65
6	300750	宁德时代	1,475,394.00	0.50
7	600036	招商银行	1,362,834.00	0.47
8	601628	中国人寿	1,345,940.00	0.46
9	601088	中国神华	1,340,299.00	0.46
10	600900	长江电力	1,322,178.00	0.45

11	600028	中国石化	1,180,479.00	0.40
12	000858	五粮液	940,160.00	0.32
13	601318	中国平安	927,328.00	0.32
14	601138	工业富联	925,916.00	0.32
15	601728	中国电信	914,890.00	0.31
16	002594	比亚迪	837,421.00	0.29
17	000333	美的集团	790,762.00	0.27
18	601658	邮储银行	766,927.00	0.26
19	601166	兴业银行	687,967.00	0.24
20	601899	紫金矿业	677,202.00	0.23

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	2,120,004.00	0.72
2	601398	工商银行	1,958,672.00	0.67
3	601288	农业银行	1,778,190.00	0.61
4	601857	中国石油	1,636,872.00	0.56
5	300750	宁德时代	1,580,896.00	0.54
6	601988	中国银行	1,213,102.00	0.41
7	600036	招商银行	1,015,984.00	0.35
8	600900	长江电力	955,982.00	0.33
9	601628	中国人寿	928,895.00	0.32
10	601318	中国平安	827,128.00	0.28
11	601088	中国神华	803,393.00	0.27
12	600028	中国石化	760,119.00	0.26
13	000333	美的集团	714,376.00	0.24

14	000858	五粮液	647,390.00	0.22
15	002594	比亚迪	610,704.00	0.21
16	601138	工业富联	569,795.00	0.19
17	601166	兴业银行	532,255.00	0.18
18	601899	紫金矿业	505,850.00	0.17
19	601728	中国电信	503,235.00	0.17
20	300059	东方财富	496,060.00	0.17

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	122,970,157.71
卖出股票收入（成交）总额	90,717,712.05

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 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	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	256,448,170.13	47.44
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	160,447,361.55	29.68
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	34,639,856.35	6.41
10	合计	451,535,388.03	83.53

8.6 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	2105765	21吉林债33	300,000	34,639,856.35	6.41
2	149763	21嘉投03	300,000	33,779,046.58	6.25
3	115174	23山能02	300,000	32,055,698.63	5.93
4	102380022	23洛阳城乡MTN 001	300,000	31,345,436.07	5.80
5	2280314	22衢交债	300,000	31,256,876.71	5.78

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

本基金投资的前十名证券的发行主体本期未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。

8.12.2 本基金本报告期末不存在投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库的情形。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	27,440,058.96
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	27,440,058.96

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

8.12.6 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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 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	持有份额	占总份额比例

	(户)			比例		
汇安丰恒混合A	259	24,567.59	0.00	0.00%	6,363,004.57	100.00%
汇安丰恒混合C	4,677	112,776.11	26,686,433.32	5.06%	500,767,454.87	94.94%
合计	4,914	108,631.85	26,686,433.32	5.00%	507,130,459.44	95.00%

9.2 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	汇安丰恒混合A	271,693.89	4.2699%
	汇安丰恒混合C	102,764.36	0.0195%
	合计	374,458.25	0.0701%

9.3 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 研究部门负责人持有本开放式基金	汇安丰恒混合A	0~10
	汇安丰恒混合C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	汇安丰恒混合A	0
	汇安丰恒混合C	0
	合计	0

9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的 产品情况

无

§10 开放式基金份额变动

单位：份

	汇安丰恒混合A	汇安丰恒混合C
基金合同生效日(2017年03月13日)基金份额总额	195,086,316.11	5,000,000.00
本报告期期初基金份额总额	106,405.67	307,696,159.01
本报告期基金总申购份额	18,556,459.12	5,374,222,958.01
减：本报告期基金总赎回份额	12,299,860.22	5,154,465,228.83
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	6,363,004.57	527,453,888.19

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

§11 重大事件揭示**11.1 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。

11.2 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

本报告期基金管理人无重大人事变动。

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 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。

11.4 基金投资策略的改变

本基金在报告期内基金投资策略没有改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金的管理人于2024年9月14日发布《汇安基金管理有限责任公司关于旗下基金改聘会计师事务所的公告》，改聘容诚会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。本基金本报告期应支付给容诚会计师事务所（特殊普通合伙）审计费用70,000.00元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，未发生基金托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情形。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用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	
中信证券	2	213,687,869.76	100.00%	697,245.00	100.00%	-

注：1、（1）基金管理人负责选择证券经纪商，使用其经纪服务席位作为本基金的交易单元。

基金证券经纪商选择标准如下：

- 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，交易设施稳定、响应支持及时、能满足公募基金采用券商交易模式进行证券交易和结算的需要；
- 3）具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：券商基本面评价（财务状况、经营状况）、券商研究机构评价（报告质量、及时性和数量）、券商每日信息评价（及时性和有效性）和券商协作表现评价等四个方面。

（2）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测试并考察后确定选用交易单元的证券经营机构；
- 2）本基金管理人和被选中的证券经营机构签订证券经纪服务协议。

（3）交易单元变更情况

本基金本报告期内无交易单元变更。

2、自2024年7月1日起，基金管理人旗下公募基金执行《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》的相关规定。

11.7.2 基金租用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
中信证券	2,701,509,940.00	100.00%	14,494,500,000.00	100.00%	-	-	-	-

11.8 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	汇安丰恒灵活配置混合型证券投资基金2023年第4季度报告	规定报刊和/或公司网站	2024-01-20
2	汇安基金管理有限责任公司关于提请投资者及时更新已过期身份证件及其他身份基本信息的公告	规定报刊和/或公司网站	2024-01-26
3	汇安丰恒灵活配置混合型证券投资基金暂停大额申购(含转换转入、定期定额投资)业务的公告	规定报刊和/或公司网站	2024-02-06
4	汇安丰恒灵活配置混合型证券投资基金暂停大额申购(含转换转入、定期定额投资)业务的公告	规定报刊和/或公司网站	2024-03-14
5	汇安基金管理有限责任公司关于汇安丰恒灵活配置混合型证券投资基金变更业绩比较基准并修改基金合同的公告	规定报刊和/或公司网站	2024-03-15

6	汇安丰恒灵活配置混合型证券投资基金基金合同	规定报刊和/或公司网站	2024-03-15
7	汇安丰恒灵活配置混合型证券投资基金（2024年第1号）招募说明书（更新）	规定报刊和/或公司网站	2024-03-15
8	汇安丰恒灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要（更新）	规定报刊和/或公司网站	2024-03-15
9	汇安丰恒灵活配置混合型证券投资基金2023年年度报告	规定报刊和/或公司网站	2024-03-30
10	汇安丰恒灵活配置混合型证券投资基金恢复大额申购（含转换转入及定期定额投资）业务的公告	规定报刊和/或公司网站	2024-04-01
11	汇安丰恒灵活配置混合型证券投资基金（2024年第2号）招募说明书（更新）	规定报刊和/或公司网站	2024-04-12
12	汇安丰恒灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要（更新）	规定报刊和/或公司网站	2024-04-12
13	汇安丰恒灵活配置混合型证券投资基金2024年第1季度报告	规定报刊和/或公司网站	2024-04-20
14	汇安基金管理有限责任公司关于系统维护的公告	规定报刊和/或公司网站	2024-04-29
15	汇安丰恒灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要（更新）	规定报刊和/或公司网站	2024-06-19
16	汇安丰恒灵活配置混合型证券投资基金2024年第2季度报告	规定报刊和/或公司网站	2024-07-19
17	汇安丰恒灵活配置混合型证券投资基金2024年中期报告	规定报刊和/或公司网站	2024-08-31

18	汇安基金管理有限责任公司关于旗下基金改聘会计师事务所的公告	规定报刊和/或公司网站	2024-09-14
19	汇安基金管理有限责任公司关于华南分公司营业场所变更的公告	规定报刊和/或公司网站	2024-09-30
20	汇安丰恒灵活配置混合型证券投资基金（2024年第3号）招募说明书（更新）	规定报刊和/或公司网站	2024-09-30
21	汇安丰恒灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要（更新）	规定报刊和/或公司网站	2024-09-30
22	汇安丰恒灵活配置混合型证券投资基金2024年第3季度报告	规定报刊和/或公司网站	2024-10-25

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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

本基金本报告期内未存在单一基金份额持有人持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会批准汇安丰恒灵活配置混合型证券投资基金募集的文件；
- (2) 《汇安丰恒灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- (3) 《汇安丰恒灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》；
- (4) 《汇安丰恒灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- (6) 在规定报刊及规定网站上披露的各项公告
- (7) 中国证监会规定的其他文件

13.2 存放地点

北京市东城区东直门南大街5号中青旅大厦13层

上海市虹口区东大名路501白玉兰大厦36层

13.3 查阅方式

投资者可到基金管理人的办公场所及网站免费查阅备查文件，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

投资者对本报告如有疑问，可咨询本基金管理人汇安基金管理有限责任公司，客户服务中心电话010-56711690。

公司网站：<http://www.huianfund.cn>

汇安基金管理有限责任公司

二〇二五年三月三十一日