

惠升和利安丰 60 天持有期债券型证券投资基金

2026 年中期报告

2026 年 06 月 30 日

基金管理人:惠升基金管理有限责任公司

基金托管人:平安银行股份有限公司

送出日期:2026 年 08 月 31 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2026年04月29日起至2026年06月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	17
§7 投资组合报告	43
7.1 期末基金资产组合情况	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	44
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	47
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	47
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	48
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	48
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	48
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	48
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	48
7.12 本报告期投资基金情况	48
7.13 投资组合报告附注	49

§8 基金份额持有人信息	50
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	50
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	51
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	51
§9 开放式基金份额变动	52
§10 重大事件揭示	52
10.1 基金份额持有人大会决议	52
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	52
10.4 基金投资策略的改变	52
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件	53
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况	53
10.7 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	53
10.8 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	53
10.9 其他重大事件	54
§11 影响投资者决策的其他重要信息	56
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	56
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	56
§12 备查文件目录	56
12.1 备查文件目录	56
12.2 存放地点	57
12.3 查阅方式	57

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	惠升和利安丰60天持有期债券型证券投资基金	
基金简称	惠升和利安丰60天持有债券	
基金主代码	026312	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2026年04月29日	
基金管理人	惠升基金管理有限责任公司	
基金托管人	平安银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,563,500,345.22份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	惠升和利安丰60天持有债券A	惠升和利安丰60天持有债券C
下属分级基金的交易代码	026312	026313
报告期末下属分级基金的份额总额	242,694,218.93份	1,320,806,126.29份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在控制投资组合风险的前提下，追求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金将密切关注债券、权益市场的运行状况，通过自上而下的定性分析和定量分析，对各类资产进行合理配置；结合自下而上深入的主动研究管理，力求在降低信用风险、利率风险和市场风险的基础上适度运用权益类工具为投资者获取稳健的长期收益。
业绩比较基准	中债综合全价（总值）指数收益率×83%+中证红利指数收益率×10%+中证港股通高股息投资指数（人民币）收益率×2%+活期存款基准利率×5%
风险收益特征	本基金为债券型基金，其长期平均预期风险与预期收益水平高于货币市场基金，低于混合型基金、股票型基金。本基金如投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		惠升基金管理有限责任公司	平安银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	叶金松	潘琦
	联系电话	010-86329066	0755-22168257
	电子邮箱	yejs@risingamc.com	PANQI003@pingan.com.cn
客户服务电话		4000005588	95511-3
传真		010-86329180	0755-82080387
注册地址		西藏自治区拉萨市柳梧新区国际总部城3栋1单元4层7号	广东省深圳市罗湖区深南东路 5047号
办公地址		北京市西城区金融大街27号投资广场B座18层	广东省深圳市福田区益田路5023号平安金融中心B座
邮政编码		100033	518001
法定代表人		张金锋	谢永林

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2026年04月29日（基金合同生效日）-2026年06月30日)	
	惠升和利安丰60天 持有债券A	惠升和利安丰60天 持有债券C
本期已实现收益	386,892.06	1,636,612.55
本期利润	-500,973.44	-3,183,765.93
加权平均基金份额本期利润	-0.0020	-0.0023
本期加权平均净值利润率	-0.20%	-0.23%
本期基金份额净值增长率	-0.20%	-0.23%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2026年06月30日)	
期末可供分配利润	-487,708.27	-3,103,376.20
期末可供分配基金份额利润	-0.0020	-0.0023
期末基金资产净值	242,206,510.66	1,317,702,750.09
期末基金份额净值	0.9980	0.9977
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2026年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	-0.20%	-0.23%

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

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

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

④本基金合同于2026年4月29日生效。

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

惠升和利安丰60天持有债券A

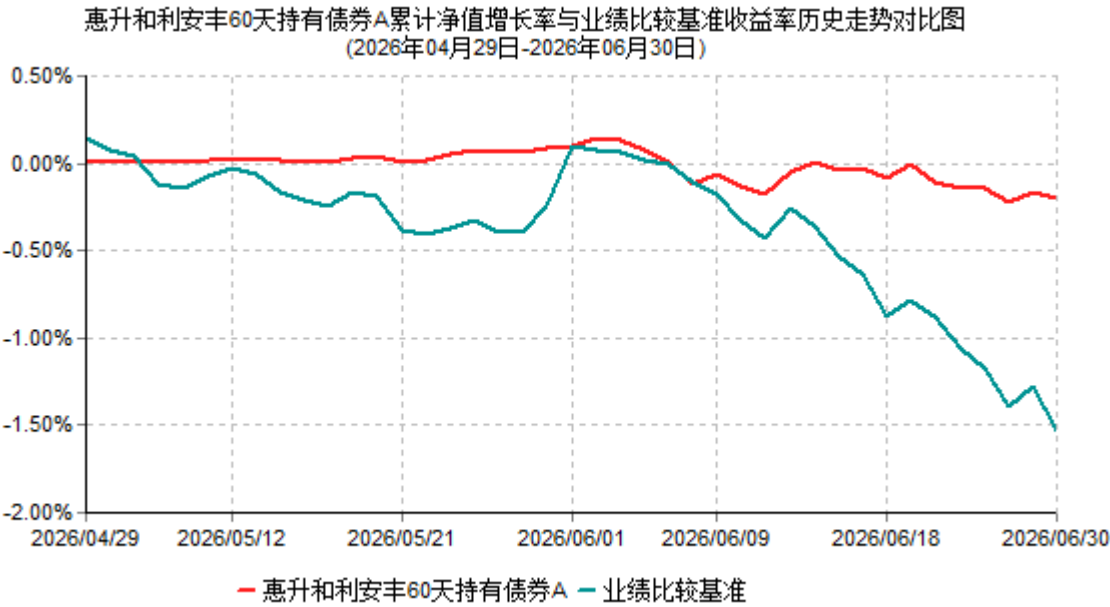
阶段	份额净值	份额净值	业绩比较	业绩比较	①-③	②-④
----	------	------	------	------	-----	-----

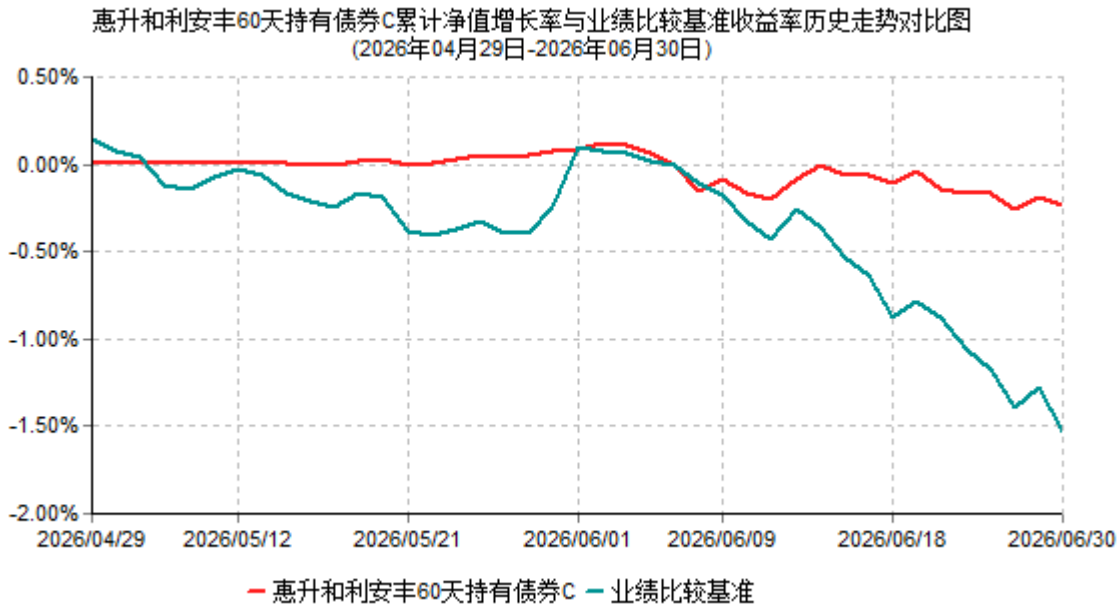
	增长率①	增长率标准差②	基准收益率③	基准收益率标准差④		
自基金合同生效起至今	-0.20%	0.05%	-1.53%	0.12%	1.33%	-0.07%

惠升和利安丰60天持有债券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
自基金合同生效起至今	-0.23%	0.05%	-1.53%	0.12%	1.30%	-0.07%

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





注：①本基金合同于2026年4月29日生效。
②根据本基金的基金合同规定，本基金自合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同中投资范围、投资限制的有关约定。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		

徐玉良	本基金的基金经理	2026-04-29	-	15年	硕士。曾任职于江苏瑞华投资控股集团有限公司、兴业基金管理有限公司等。现任惠升基金管理有限责任公司基金经理。2026年4月29日起任惠升和利安丰60天持有期债券型证券投资基金基金经理。
卓勇	本基金的基金经理	2026-04-29	-	20年	硕士。曾任职于中信建投证券股份有限公司，广州吉富创业投资公司，深圳康曼德资本管理有限公司等。现任惠升基金管理有限责任公司基金经理。2026年4月29日起任惠升和利安丰60天持有期债券型证券投资基金基金经理。

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司开展投资、研究活动防控内幕交易指导意见》等法律法规和基金合同，本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

日内、3日内、5日内），对报告期内的同向交易价差进行了分析，未发现违反公平交易原则的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金成立以来的5-6月两个月市场风格相对极端，除了AI以外的其余资产表现欠佳。红利风格整体调整幅度较大。中证红利指数同期下跌13.75%，在历史上也属于比较大的阶段性回撤。同期本基金虽然没有获得绝对的正收益，但是大幅跑赢基准，控制了向下回撤的幅度。建仓期内，整体仓位较轻，股票部分以宏观经济脱敏度高的电力股为主。AI的极端行情已经演绎了比较久的时间，相关资产的估值水平已经处于历史极致状态。另一方面，其余股票大幅下跌之后，风险收益比更加显著。极端行情反转的可能性在变大。红利资产本身的经营稳定性较高，业绩波动较小，大幅下跌之后，其股息率水平在不断抬升。面对债券市场上涨，十年期国债收益率已经下行至1.75%的背景之下，股息率上升后的红利资产的吸引力是在不断抬升的。因此站在当下来看，其未来向上的可能性和空间感都在提升。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末惠升和利安丰60天持有债券A基金份额净值为0.9980元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-0.20%，同期业绩比较基准收益率为-1.53%；截至报告期末惠升和利安丰60天持有债券C基金份额净值为0.9977元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-0.23%，同期业绩比较基准收益率为-1.53%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从A股上半年的情况来看，景气度较高的AI方向整体业绩增速明显高于其它板块，顺周期资产受美伊冲突的影响总体表现较弱，甚至很多板块和个股甚至在继续下跌。站在当下，AI是否有泡沫已经成为讨论的焦点。下一个阶段确实需要密切关注模型进步的速度以及可以触达的新领域。例如我们当下可以想到的AI未来可见的两个主要方向：AGI+物理AI都是明确有巨大市场空间的领域，我们更要关注模型的进步速度能不能迅速触及到新的领域，以判断AI投资是否会继续高增还是会阶段性出现瓶颈。半年报披露显示市场在AI的仓位过于集中，从再平衡的角度而言，主要看好出海链、有色以及红利等方向。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未实施利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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，平安银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本报告期，本托管人复核的财务指标、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真实、准确、完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：惠升和利安丰60天持有期债券型证券投资基金

报告截止日：2026年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026年06月30日
资 产：		
货币资金	6.4.7.1	54,697,943.97
结算备付金		-
存出保证金		-
交易性金融资产	6.4.7.2	991,009,965.08
其中：股票投资		23,415,757.35
基金投资		71,261,729.00
债券投资		896,332,478.73
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
其他投资		-
衍生金融资产		-
买入返售金融资产	6.4.7.3	565,315,059.82
应收清算款		-
应收股利		92,864.25
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.4	-
资产总计		1,611,115,833.12
负债和净资产	附注号	本期末 2026年06月30日
负 债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债		-

卖出回购金融资产款		-
应付清算款		-
应付赎回款		49,886,137.62
应付管理人报酬		795,071.36
应付托管费		198,767.85
应付销售服务费		223,790.65
应付投资顾问费		-
应交税费		49,010.34
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.5	53,794.55
负债合计		51,206,572.37
净资产：		
实收基金	6.4.7.6	1,563,500,345.22
未分配利润	6.4.7.7	-3,591,084.47
净资产合计		1,559,909,260.75
负债和净资产总计		1,611,115,833.12

注：截止报告期末，惠升和利安丰60天持有债券A基金份额净值0.9980元，惠升和利安丰60天持有债券C基金份额净值0.9977元；惠升和利安丰60天持有债券基金份额总额1,563,500,345.22份（其中A类242,694,218.93份，C类1,320,806,126.29份）。

6.2 利润表

会计主体：惠升和利安丰60天持有期债券型证券投资基金

本报告期：2026年04月29日（基金合同生效日）至2026年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026年04月29日（基金合同 生效日）至2026年06月30 日
一、营业总收入		-1,129,404.24
1.利息收入		1,503,212.40

其中：存款利息收入	6.4.7.8	733,403.84
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		769,808.56
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		3,075,627.34
其中：股票投资收益	6.4.7.9	-37,700.38
基金投资收益	6.4.7.10	679,826.77
债券投资收益	6.4.7.11	2,252,656.70
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-
贵金属投资收益	6.4.7.13	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-
股利收益	6.4.7.15	180,844.25
其他投资收益		-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-5,708,243.98
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-
减：二、营业总支出		2,555,335.13
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	1,641,686.98
2.托管费	6.4.10.2.2	410,421.74
3.销售服务费	6.4.10.2.3	461,988.17
4.投资顾问费		-
5.利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6.信用减值损失	6.4.7.19	-
7.税金及附加		7,280.71
8.其他费用	6.4.7.20	33,957.53
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-3,684,739.37
减：所得税费用		-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-3,684,739.37
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		-3,684,739.37

6.3 净资产变动表

会计主体：惠升和利安丰60天持有期债券型证券投资基金

本报告期：2026年04月29日（基金合同生效日）至2026年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2026年04月29日（基金合同生效日）至2026年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-
二、本期期初净资产	1,601,679,657.39	-	1,601,679,657.39
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-38,179,312.17	-3,591,084.47	-41,770,396.64
（一）、综合收益总额	-	-3,684,739.37	-3,684,739.37
（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）	-38,179,312.17	93,654.90	-38,085,657.27
其中：1.基金申购款	11,799,300.38	1,179.97	11,800,480.35
2.基金赎回款	-49,978,612.55	92,474.93	-49,886,137.62
（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	1,563,500,345.22	-3,591,084.47	1,559,909,260.75
-----------	------------------	---------------	------------------

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

张金锋	张金锋	张晓霞
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

惠升和利安丰60天持有期债券型证券投资基金（以下简称“本基金”），经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2025]2666号《关于准予惠升和利安丰60天持有期债券型证券投资基金注册的批复》核准，由惠升基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《惠升和利安丰60天持有期债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集1,601,679,657.39元，业经大华会计师事务所(特殊普通合伙)出具验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《惠升和利安丰60天持有期债券型证券投资基金基金合同》于2026年4月29日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为1,601,679,657.39份基金份额，无认购资金利息。本基金的基金管理人为惠升基金管理有限责任公司，基金托管人为平安银行股份有限公司（以下简称“平安银行”）。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和本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（包含主板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、存托凭证、港股通标的股票、债券（包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、公开发行的次级债、政府支持机构债券、政府支持债券、证券公司短期公司债券及其他中国证监会允许投资的债券）、经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金（不包含QDII基金、香港互认基金、基金中基金和其他投资范围包含基金的基金、货币市场基金）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具、国债期货、信用衍生品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的相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称"企业会计准则")、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称"中国基金业协会")颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

自公历1月1日至12月31日止为一个会计年度。本财务报表的实际编制期间为2026年4月29日（基金合同生效日）至2026年6月30日。

6.4.4.2 记账本位币

采用人民币为记账本位币。

6.4.4.3 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或金融负债。

(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业务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：一、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业务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。二、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。

6.4.4.4 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。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的金融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。

6.4.4.6 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。

6.4.4.7 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。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。

6.4.4.8 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)。

6.4.4.9 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。基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投资收益。

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相关交易费用及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。

6.4.4.10 费用的确认和计量

针对基金合同约定费率和计算方法的费用，本基金在费用涵盖期间按基金合同约定进行确认。

以摊余成本计量的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。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

同一类别内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。期末可供分配利润指期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。由于本基金各基金份额类别对应的费用不同，其对应的可分配收益可能有所不同。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

6.4.4.12 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。

6.4.4.13 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金融工具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、市盈率法、现金流量折现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，根据中国证券投资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)》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》及中国证券投资基金业协会中基协字[2022]566号《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期重要会计政策未发生变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期主要会计估计未发生变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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》、财税[2014]81号《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]125号《财政部、国家税务总局、证监会关于内地与香港基金互认有关税收政策的通知》、财税[2016]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2025]4号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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；对金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。自2025年8月8日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税，对该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（含在2025年8月8日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

（2）对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、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。对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市H股取得的股息红利,H股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称"中国结算")提出申请,由中国结算向H股公司提供内地个人投资者名册,H股公司按照20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非H股取得的股息红利,由中国结算按照20%的税率代扣个人所得税。对香港市场投资者取得的股息、红利收入按照10%的税率代扣所得税。

(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,该印花税实施减半征收。基金通过沪港通/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。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位:人民币元

项目	本期末 2026年06月30日
活期存款	54,339,590.45
等于: 本金	54,336,971.84
加: 应计利息	2,618.61
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	358,353.52
等于：本金	358,331.57
加：应计利息	21.95
减：坏账准备	-
合计	54,697,943.97

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。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026年06月30日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		24,824,119.67	-	23,415,757.35	-1,408,362.32
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	499,304,929.95	4,216,282.35	503,582,936.35	61,724.05
	银行间市场	390,255,333.22	1,801,542.38	392,749,542.38	692,666.78
	合计	889,560,263.17	6,017,824.73	896,332,478.73	754,390.83
资产支持证券		-	-	-	-
基金		76,316,001.49	-	71,261,729.00	-5,054,272.49
其他		-	-	-	-
合计		990,700,384.33	6,017,824.73	991,009,965.08	-5,708,243.98

6.4.7.3 买入返售金融资产

6.4.7.3.1 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 2026年06月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	265,300,265.30	-
银行间市场	300,014,794.52	-

合计	565,315,059.82	-
----	----------------	---

6.4.7.3.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.4 其他资产

无。

6.4.7.5 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	20,637.02
其中：交易所市场	-
银行间市场	20,637.02
应付利息	-
预提费用-审计费	10,202.22
预提费用-信息披露费	22,955.31
合计	53,794.55

6.4.7.6 实收基金

6.4.7.6.1 惠升和利安丰60天持有债券A

金额单位：人民币元

项目 (惠升和利安丰60天持有债券A)	本期 2026年04月29日（基金合同生效日）至2026年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	250,826,056.89	250,826,056.89
本期申购	149,555.40	149,555.40

本期赎回（以“-”号填列）	-8,281,393.36	-8,281,393.36
本期末	242,694,218.93	242,694,218.93

6.4.7.6.2 惠升和利安丰60天持有债券C

金额单位：人民币元

项目 (惠升和利安丰60天持有债券C)	本期 2026年04月29日（基金合同生效日）至2026年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	1,350,853,600.50	1,350,853,600.50
本期申购	11,649,744.98	11,649,744.98
本期赎回（以“-”号填列）	-41,697,219.19	-41,697,219.19
本期末	1,320,806,126.29	1,320,806,126.29

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

6.4.7.7 未分配利润

6.4.7.7.1 惠升和利安丰60天持有债券A

单位：人民币元

项目 (惠升和利安丰60天持有债券A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	386,892.06	-887,865.50	-500,973.44
本期基金份额交易产生的变动数	-12,512.43	25,777.60	13,265.17
其中：基金申购款	11.94	3.01	14.95
基金赎回款	-12,524.37	25,774.59	13,250.22
本期已分配利润	-	-	-
本期末	374,379.63	-862,087.90	-487,708.27

6.4.7.7.2 惠升和利安丰60天持有债券C

单位：人民币元

项目 (惠升和利安丰60天持有债券C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	1,636,612.55	-4,820,378.48	-3,183,765.93
本期基金份额交易产生的变动数	-49,542.52	129,932.25	80,389.73
其中：基金申购款	979.83	185.19	1,165.02
基金赎回款	-50,522.35	129,747.06	79,224.71
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,587,070.03	-4,690,446.23	-3,103,376.20

6.4.7.8 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年04月29日（基金合同生效日）至2026年06月30日
活期存款利息收入	728,375.99
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	5,027.85
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	733,403.84

6.4.7.9 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年04月29日（基金合同生效日）至2026年06月30日

卖出股票成交总额	22,640,128.43
减：卖出股票成本总额	22,639,930.12
减：交易费用	37,898.69
买卖股票差价收入	-37,700.38

6.4.7.10 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年04月29日（基金合同生效日）至2026 年06月30日
卖出/赎回基金成交总额	71,797,711.60
减：卖出/赎回基金成本总额	71,029,774.71
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	22,367.09
减：交易费用	65,743.03
基金投资收益	679,826.77

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年04月29日（基金合同生效日）至2026年 06月30日
债券投资收益——利息收入	1,812,829.93
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	439,826.77
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	2,252,656.70

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2026年04月29日（基金合同生效日）至2026年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,146,867,861.65
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,140,391,244.96
减：应计利息总额	6,004,325.60
减：交易费用	32,464.32
买卖债券差价收入	439,826.77

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.13 贵金属投资收益

无。

6.4.7.14 衍生工具收益

无。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年04月29日（基金合同生效日）至2026年06月30日
股票投资产生的股利收益	180,844.25
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	180,844.25

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
------	----

	2026年04月29日（基金合同生效日）至2026年06月30日
1.交易性金融资产	-5,708,243.98
——股票投资	-1,408,362.32
——债券投资	754,390.83
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-5,054,272.49
——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	-5,708,243.98

6.4.7.17 其他收入

无。

6.4.7.18 持有基金产生的费用

项目	本期 2026年04月29日（基金合同生效日） 至2026年06月30日
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	-
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	18,253.69
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	5,170.39

注：当期持有基金产生的应支付销售服务费、应支付管理费、应支付托管费按照被投资基金基金合同约定已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，上表列示金额为按照本基金对被投资基金的实际持仓情况根据被投资基金基金合同约定的相应费率和计算方法计算得出。

6.4.7.19 信用减值损失

无。

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026年04月29日（基金合同生效日）至2026年06月30日
审计费用	10,202.22
信息披露费	22,955.31
证券出借违约金	-
开户费	800.00
合计	33,957.53

6.4.7.21 分部报告

无。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方、关联关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
惠升基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
平安银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

无。

6.4.10.1.4 债券回购交易

无。

6.4.10.1.5 基金交易

无。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026年04月29日（基金合同生效日）至2026年 06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,641,686.98
其中：应支付销售机构的客户维护费	782,202.77
应支付基金管理人的净管理费	859,484.21

注：①支付基金管理人的基金管理人报酬按前一日基金资产净值0.60%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

②基金管理人报酬计算公式为：日基金管理人报酬＝前一日基金资产净值×0.60%/当年天数。

③客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用按照代销机构所代销基金的份额保有量作为基

数进行计算，从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026年04月29日（基金合同生效日）至2026年06月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	410,421.74

注：①支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

②基金托管费计算公式为：日基金托管费＝前一日基金资产净值×0.15%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售 服务费的 各关联方 名称	本期 2026年04月29日（基金合同生效日）至2026年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	惠升和利安丰60天持有债券 A	惠升和利安丰60天持有债券 C	合计
平安银行 股份有限 公司	0.00	461,988.17	461,988.17
合计	0.00	461,988.17	461,988.17

注：①支付基金销售机构的基金销售服务费按C类基金份额前一日基金资产净值0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给基金管理人，再由基金管理人计算并支付给各基金销售机构。

②基金销售服务费计算公式为：C类日基金销售服务费＝前一日C类基金资产净值×0.20%/当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2026年04月29日（基金合同生效日）至2026年06月30日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
平安银行股份有限公司	49,966,684.93	-	-	-	-	-

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况无。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年04月29日（基金合同生效日）至2026年06月30日	
	期末余额	当期利息收入
平安银行股份有限公司	54,339,590.45	728,375.99

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

无。

6.4.12 期末（2026年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

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

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人奉行全面风险管理的理念，建立了包含决策、执行、监督三个维度的风险管理架构体系。决策体系：公司决策体系由董事会、总经理、投资决策委员会和风险管理委员会组成，对公司管理、基金运作等重大事项进行集体决策，遵循科学决策程序，有效避免权力过于集中。执行体系：在总经理的领导下，由公司各职能部门组成，承担着公司开展基金业务的日常投资运作活动和具体管理工作，认真执行内部控制战

略，并采取具体措施落实内部控制。监督体系：包括督察长、监察稽核部，负责确保公司管理、基金运作、员工行为符合有关法律法规和公司各项规章制度。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人，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，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2026年06月30日
A-1	30,014,863.56
A-1以下	-
未评级	476,569,538.35
合计	506,584,401.91

注：以上未评级债券包含国债、证券公司短期公司债。债券信用评级取自第三方评级机构的评级。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2026年06月30日
--------	--------------------

A-1	-
A-1以下	-
未评级	9,980,557.72
合计	9,980,557.72

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2026年06月30日
AAA	271,482,398.35
AAA以下	-
未评级	108,285,120.75
合计	379,767,519.10

注：以上未评级债券包含国债、中期票据。债券信用评级取自第三方评级机构的评级。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险，包括因市场交易量不足，导致不能以合理价格及时进行证券交易的风险，或者基金无法应付客户赎回要求所引起的违约风险。

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。

本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，本基金所持证券均可在证券交易所或银行间同业市场进行交易，资产变现能力强。本基金持有的其他资产主要为银行存款等期限短、流动性强的品种。本基金的负债水平也严格按照基金合同及中国证监会相关规定进行管理，因此无重大流动性风险。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金所持证券均为证券交易所和银行间市场流动性较好的品种，市场成交活跃，均能以合理价格交易，变现能力较强；其次，本基金进行严格的集中度控制，确保分散投资；第三，本基金投资策略成熟，能够支持不同市场情形下的投资者赎回要求。实际投资中，本基金投资组合的流动性能够与本基金申购和赎回安排相匹配。

综上所述，本基金的流动性良好，无重大流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026年 06月30 日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	54,697,943.97	-	-	-	-	-	54,697,943.97
交易性金融资产	172,146,331.52	9,980,557.72	395,163,964.97	208,460,314.93	110,581,309.59	94,677,486.35	991,009,965.08
买入返售金融资产	565,315,059.82	-	-	-	-	-	565,315,059.82
应收股利	-	-	-	-	-	92,864.25	92,864.25
资产总计	792,159,335.31	9,980,557.72	395,163,964.97	208,460,314.93	110,581,309.59	94,770,350.60	1,611,115,833.12
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	49,886,137.62	49,886,137.62

应付管理人报酬	-	-	-	-	-	795,071.36	795,071.36
应付托管费	-	-	-	-	-	198,767.85	198,767.85
应付销售服务费	-	-	-	-	-	223,790.65	223,790.65
应交税费	-	-	-	-	-	49,010.34	49,010.34
其他负债	-	-	-	-	-	53,794.55	53,794.55
负债总计	-	-	-	-	-	51,206,572.37	51,206,572.37
利率敏感度缺口	792,159,335.31	9,980,557.72	395,163,964.97	208,460,314.93	110,581,309.59	43,563,778.23	1,559,909,260.75

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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 2026年06月30日	
	市场利率下降 25 个基点	4,792,498.32	
	市场利率上升 25 个基点	-4,704,770.07	

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30日			
	美元折合	港币折合人	其他币种	合计

	人民币	民币	折合人民 币	
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	3,000,423.35	-	3,000,423.35
应收股利	-	92,864.25	-	92,864.25
资产合计	-	3,093,287.60	-	3,093,287.60
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	3,093,287.60	-	3,093,287.60

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇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 2026年06月30日
	所有外币相对人民币升值5%	154,664.38
	所有外币相对人民币贬值5%	-154,664.38

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，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，采用“自上而下”的策略，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。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，包

括VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30日	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产—股票投资	23,415,757.35	1.50
交易性金融资产—基金投资	71,261,729.00	4.57
交易性金融资产—债券投资	896,332,478.73	57.46
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	991,009,965.08	63.53

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准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 2026年06月30日
	业绩比较基准上升 5%	1,371,741.61
	业绩比较基准下降 5%	-1,371,741.61

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

- 第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。
- 第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。
- 第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026年06月30日
第一层次	94,677,486.35
第二层次	896,332,478.73
第三层次	-
合计	991,009,965.08

6.4.14.2.2 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。
本基金本期持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本报告期末,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	23,415,757.35	1.45
	其中：股票	23,415,757.35	1.45
2	基金投资	71,261,729.00	4.42
3	固定收益投资	896,332,478.73	55.63
	其中：债券	896,332,478.73	55.63
	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	565,315,059.82	35.09
	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	54,697,943.97	3.40
8	其他各项资产	92,864.25	0.01
9	合计	1,611,115,833.12	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通机制投资香港股票的公允价值为3,000,423.35元，占基金资产净值比例为0.19%。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	2,985,892.00	0.19
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,753,246.00	0.82
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	1,522,976.00	0.10

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	3,153,220.00	0.20
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	20,415,334.00	1.31

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值(人民币)	占基金资产净值比例(%)
非日常生活消费品	3,000,423.35	0.19
合计	3,000,423.35	0.19

注：以上分类采用数据资讯服务机构提供的国际通用行业分类标准。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	600900	长江电力	481,800	12,753,246.00	0.82
2	601398	工商银行	446,000	3,153,220.00	0.20
3	01070	T C L 电子	268,000	3,000,423.35	0.19
4	000333	美的集团	20,400	1,540,812.00	0.10
5	002468	申通快递	104,600	1,522,976.00	0.10
6	601766	中国中车	277,900	1,445,080.00	0.09

注：所用证券代码采用当地市场代码。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	600900	长江电力	14,193,194.00	0.91
2	000333	美的集团	8,196,643.00	0.53
3	601398	工商银行	8,066,602.00	0.52
4	01070	T C L 电子	3,289,047.67	0.21
5	002832	比音勒芬	3,265,986.00	0.21
6	601166	兴业银行	3,229,114.00	0.21
7	000631	顺发恒能	3,227,630.00	0.21
8	002468	申通快递	1,613,585.00	0.10
9	601766	中国中车	1,611,820.00	0.10
10	00148	建滔集团	770,428.12	0.05

注：“买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	000333	美的集团	6,602,881.00	0.42
2	601398	工商银行	4,858,541.00	0.31
3	002832	比音勒芬	3,365,042.00	0.22
4	601166	兴业银行	3,240,681.00	0.21
5	000631	顺发恒能	2,863,876.00	0.18
6	00148	建滔集团	901,861.43	0.06
7	600900	长江电力	807,246.00	0.05

注：“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 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	47,464,049.79
卖出股票收入（成交）总额	22,640,128.43

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。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	574,830,620.74	36.85
2	央行票据	-	-
3	金融债券	301,497,261.91	19.33
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	10,024,038.36	0.64
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	9,980,557.72	0.64
9	其他	-	-
10	合计	896,332,478.73	57.46

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	019792	25国债19	2,517,000	254,340,919.16	16.30
2	250013	25付息国债13	1,000,000	101,262,547.95	6.49

3	019785	25国债13	700,000	70,883,783.57	4.54
4	232680009	26工行二级资本债02BC	600,000	60,224,449.32	3.86
5	019761	24国债24	570,000	57,316,357.81	3.67

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细
本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策
本基金本报告期内无股指期货投资。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策
本基金本报告期内无国债期货投资。

7.11.2 本期国债期货投资评价
本基金本报告期内无国债期货投资。

7.12 本报告期投资基金情况

7.12.1 投资政策及风险说明
本基金在控制投资组合风险的前提下，追求基金资产的长期稳健增值。根据基金合同约定，本基金投资于股票、存托凭证、股票型基金、混合型基金等权益类资产及可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券的比例合计为基金资产的 5%-20%，且投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金（不包含QDII 基金、香港互认基金、基金中基金和其他投资范围包含基金的基金、货币市场基金）的比例不超过基金资产净值的10%。

本基金为债券型基金，其长期平均预期风险与预期收益水平高于货币市场基金，低于混合型基金、股票型基金。报告期内，本基金的基金投资情况符合本基金合同约定的投资政策、投资限制等要求。

7.12.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有基金投资明细

序号	基金代码	基金名称	运作方式	持有份额 (份)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例(%)	是否属于基金管理人及管理人关联方所管理的基金
1	515180	100红利	契约型 开放式	24,111,100.00	30,789,874.70	1.97	否
2	510300	300ETF	契约型 开放式	4,799,000.00	24,086,181.00	1.54	否
3	512040	国信价值	契约型 开放式	7,001,400.00	7,967,593.20	0.51	否
4	159201	自由现金流ETF华夏	契约型 开放式	6,554,500.00	6,954,324.50	0.45	否
5	159207	高股息ETF广发	契约型 开放式	1,379,600.00	1,463,755.60	0.09	否

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国工商银行股份有限公司、兴业银行股份有限公司、交通银行股份有限公司、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监管部门公开谴责或处罚。

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

7.13.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库之外的情形。

7.13.3 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	92,864.25
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	92,864.25

7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.13.5 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不存在流通受限情况。

7.13.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额 级别	持 有 人 户 数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总 份额 比例	持有份额	占总份 额比例
惠升 和利	331	733,215.16	20,657,796.86	8.511 9%	222,036,422.07	91.488 1%

安丰60天持有债券A						
惠升和利安丰60天持有债券C	2,103	628,058.07	87,700,000.00	6.6399%	1,233,106,126.29	93.3601%
合计	2,434	642,358.40	108,357,796.86	6.9305%	1,455,142,548.36	93.0695%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	惠升和利安丰60天持有债券A	15.00	0.0000%
	惠升和利安丰60天持有债券C	-	-
	合计	15.00	0.0000%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	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	惠升和利安丰60天持有债券A	0
	惠升和利安丰60天持有债券C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	惠升和利安丰60天持有债券A	0
	惠升和利安丰60天	0

	持有债券C	
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	惠升和利安丰60天持有 债券A	惠升和利安丰60天持有 债券C
基金合同生效日(2026年04月29日)基金份额总额	250,826,056.89	1,350,853,600.50
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	149,555.40	11,649,744.98
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	8,281,393.36	41,697,219.19
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	242,694,218.93	1,320,806,126.29

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

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人发布《惠升基金管理有限责任公司基金行业高级管理人员变更公告》，2026年6月15日，石伟先生离任公司副总经理。2026年6月23日，根据托管人工作安排，聘任宋卓先生为平安银行股份有限公司资产托管部总经理。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未发生改变。

10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件
无。

10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况
本报告期内，本基金未改聘会计师事务所。

10.7 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.7.1 管理人受调查或处罚等情况
本报告期内管理人未受到任何调查或处罚。

10.7.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况
本报告期内管理人相关从业人员未受到任何调查或处罚。

10.7.3 托管人受调查或处罚等情况
本报告期内，本基金托管人的托管业务部门无受到调查或处罚等情况。

10.7.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况
本报告期内，本基金托管人的托管业务部门相关从业人员无受到调查或处罚等情况。

10.8 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.8.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
方正证券	2	-	-	-	-	-
华福证券	2	70,104,178.22	100.00%	104,319.93	100.00%	-

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

10.8.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华福证券	2,108,930,551.13	100.00%	9,037,588,000.00	100.00%	-	-	219,143,487.80	100.00%

10.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	惠升和利安丰60天持有期债券型证券投资基金基金合同	规定网站	2026-03-12
2	惠升和利安丰60天持有期债券型证券投资基金基金份额发售公告	规定网站、规定报刊	2026-03-12
3	惠升和利安丰60天持有期债券型证券投资基金（A类份	规定网站	2026-03-12

	额) 基金产品资料概要		
4	惠升和利安丰60天持有期债券型证券投资基金(C类份额) 基金产品资料概要	规定网站	2026-03-12
5	惠升和利安丰60天持有期债券型证券投资基金招募说明书	规定网站	2026-03-12
6	惠升和利安丰60天持有期债券型证券投资基金托管协议	规定网站	2026-03-12
7	惠升基金管理有限责任公司旗下基金2025年年度报告提示性公告	规定报刊	2026-03-30
8	惠升基金管理有限责任公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况(2025年度)	规定网站、规定报刊	2026-03-31
9	惠升基金管理有限责任公司关于旗下部分基金暂停申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告	规定网站、规定报刊	2026-04-02
10	惠升基金管理有限责任公司旗下基金2026年第1季度报告提示性公告	规定报刊	2026-04-21
11	2025年度惠升基金管理有限责任公司以股东身份(通过公募基金持股)参与股东大会投票信息披露	规定网站、规定报刊	2026-04-28
12	惠升和利安丰60天持有期债券型证券投资基金基金合同生效公告	规定网站、规定报刊	2026-04-30
13	惠升和利安丰60天持有期债券型证券投资基金开放日常申购、转换转入及定期定额	规定网站、规定报刊	2026-05-06

	投资业务的公告		
14	惠升基金管理有限责任公司关于旗下部分基金暂停申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告	规定网站、规定报刊	2026-05-22
15	惠升基金管理有限责任公司关于终止中证金牛（北京）基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	规定网站、规定报刊	2026-06-01
16	惠升基金管理有限责任公司基金行业高级管理人员变更公告	规定网站、规定报刊	2026-06-16
17	惠升基金管理有限责任公司关于注销海南分公司的公告	规定网站、规定报刊	2026-06-18
18	惠升和利安丰60天持有期债券型证券投资基金开放日常赎回、转换转出业务的公告	规定网站、规定报刊	2026-06-26
19	惠升基金管理有限责任公司关于旗下部分基金暂停申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告	规定网站、规定报刊	2026-06-30

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本基金本报告期内无此类情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期内无影响投资者决策的其他重要信息。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

中国证监会准予基金募集注册的文件；

《惠升和利安丰60天持有期债券型证券投资基金基金合同》；
《惠升和利安丰60天持有期债券型证券投资基金托管协议》；
基金管理人业务资格批件、营业执照；
基金托管人业务资格批件、营业执照；
报告期内基金管理人在规定媒介上披露的各项公告；
中国证监会要求的其他文件。

12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人及基金托管人的办公场所。

12.3 查阅方式

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

惠升基金管理有限责任公司
二〇二六年八月三十一日