

诺安汇利灵活配置混合型证券投资基金
2026 年中期报告

2026 年 06 月 30 日

基金管理人：诺安基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 08 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 01 月 01 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	7
2.4	信息披露方式	7
2.5	其他相关资料	7
§ 3	主要财务指标和基金净值表现	7
3.1	主要会计数据和财务指标	7
3.2	基金净值表现	8
§ 4	管理人报告	11
4.1	基金管理人及基金经理情况	11
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	14
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
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	15
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	16
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
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	16
§ 5	托管人报告	17
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
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 ..	17
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	17
§ 6	半年度财务会计报告（未经审计）	17
6.1	资产负债表	17
6.2	利润表	18
6.3	净资产变动表	19
6.4	报表附注	20
§ 7	投资组合报告	41
7.1	期末基金资产组合情况	41
7.2	报告期末按行业分类的股票投资组合	42
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	42
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动	43
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	45
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	45
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	45
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	45
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	46
7.10	本基金投资股指期货的投资政策	46
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	46

7.12	投资组合报告附注	46
§ 8	基金份额持有人信息	47
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	47
8.2	盈利投资者数量占比	47
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	47
8.4	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	48
§ 9	开放式基金份额变动	48
§ 10	重大事件揭示	48
10.1	基金份额持有人大会决议	48
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	48
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	49
10.4	基金投资策略的改变	49
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	49
10.6	管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	49
10.7	基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	49
10.8	其他重大事件	50
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息	52
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	52
11.2	影响投资者决策的其他重要信息	52
§ 12	备查文件目录	52
12.1	备查文件目录	52
12.2	存放地点	52
12.3	查阅方式	52

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	诺安汇利灵活配置混合型证券投资基金			
基金简称	诺安汇利混合			
基金主代码	005901			
基金运作方式	契约型开放式			
基金合同生效日	2018 年 07 月 11 日			
基金管理人	诺安基金管理有限公司			
基金托管人	中国农业银行股份有限公司			
报告期末基金份额总额	34,836,375.23 份			
基金合同存续期	不定期			
下属分级基金的基金简称	诺安汇利混合 A	诺安汇利混合 C	诺安汇利混合 D	诺安汇利混合 E
下属分级基金的交易代码	005901	005902	024908	022851
报告期末下属分级基金的份额总额	5,865,804.87 份	4,212,981.81 份	412,237.78 份	24,345,350.77 份

注：自 2024 年 12 月 12 日起，本基金增加 E 类基金份额，自 2025 年 7 月 18 日起，本基金增加 D 类基金份额，分设 A 类基金份额、C 类基金份额、D 类基金份额和 E 类基金份额。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制组合下行风险的基础上,通过积极的大类资产配置和个股个券精选，实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	1、大类资产配置策略 本基金通过对国内外经济形势、宏观经济运行周期、财政及货币政策、资金供需情况、证券市场估值水平及信用风险等因素的研判，预测各大类资产在不同市场周期内的风险收益特征,并以此来调整基金资产在债券、股票、现金等大类资产之间的配置比例。 2、类属资产配置策略 受信用风险、税赋水平、市场流动性、市场风险等不同因素的影响，国债、央票、金融债、企业债、公司债、短期融资券等不同类属的券种收益率变化特征存在明显的差异,并表现出不同的利差变化趋势。基金管理人将分析各类属券种的利差变化趋势，合理配置并灵活调整不同类属券种在组合中的构成比例,通过对类属的合理配置力争获取超越基准的收益率水平。 3、普通债券投资策略 本基金将采取利率策略、期限结构策略、信用策略、息差策略和个券选择策略，判断不同债券在经济周期的不同阶段的相对投资价值，并确定不同债券在组合资产中的配置比例，实现组合的稳健增值。 4、可转换债券投资策略

	本基金将积极参与公司发行条款较好、基本面优秀、申购收益高的可转债的一级市场申购,待其上市后依据对其正股的判断以及可转债合理定价水平决定继续持有或卖出;同时,本基金将综合运用多种投资策略在可转债二级市场上进行投资操作,力争在风险可控的前提下获取较高的投资收益。 5、可交换债券投资策略 可交换债券在换股期间用于交换的股票是发行人持有的其他上市公司(以下简称“目标公司”)的股票。可交换债券同样兼具股票和债券的特性。其中,债券特性与可转换债券相同,指持有至到期获取的票面利息和票面价值。股票特性则指目标公司的成长能力、盈利能力及目标公司股票价格的成长性等。本基金将通过对可交换债券的纯债价值和目标公司的股票价值进行研究分析,综合开展投资决策。 6、股票投资策略 本基金可适当参与股票二级市场投资,增强基金资产收益。 股票投资主要采用自上而下与自下而上相结合,定性分析与定量分析相结合。充分借鉴内部和外部研究观点,动态跟踪行业景气度和估值水平,优先选择具备完善的法人治理结构和有效的激励机制、明显受益于行业景气提升、根据市盈率(P/E)、市净率(P/B)和折现现金流(DCF)等指标衡量的估值水平相对偏低的上市公司。 7、存托凭证投资策略 本基金将根据投资目标和股票投资策略,基于对基础证券投资价值的研究判断,进行存托凭证的投资。 8、资产支持证券投资策略 资产支持证券投资关键在于对基础资产质量及未来现金流的分析,本基金将在国内资产证券化产品具体政策框架下,采用基本面分析和数量化模型相结合,对个券进行风险分析和价值评估后进行投资。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资,以降低流动性风险。 9、国债期货投资策略 本基金在进行国债期货投资时,将根据风险管理原则,以套期保值为主要目的,采用流动性好、交易活跃的期货合约,通过对债券市场和期货市场运行趋势的研究,结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平,与现货资产进行匹配,通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险性特征,运用国债期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险,如大额申购赎回等;利用金融衍生品的杠杆作用,以达到降低投资组合的整体风险的目的。 10、权证投资策略 在严格控制风险的前提下,本基金可适度进行权证投资。投资权证的目的为控制下跌风险和实现基金资产增值。 未来,随着证券市场的发展、金融工具的丰富和交易方式的创新等,基金还将积极寻求其他投资机会,履行适当程序后更新和丰富组合投资策略。
--	--

业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×30%+中证综合债指数收益率×70%
风险收益特征	本基金为混合型基金,其风险与收益高于债券型基金与货币市场基金,低于股票型基金,属于证券投资基金中的中高风险、中高收益品种。

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		诺安基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李学君	任航
	联系电话	0755-83026688	010-66060069
	电子邮箱	info@lionfund.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-888-8998	95599
传真		0755-83026677	010-68121816
注册地址		深圳市深南大道 4013 号兴业银行大厦 19-20 层	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址		深圳市深南大道 4013 号兴业银行大厦 19-20 层	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码		518048	100031
法定代表人		夏宇	谷澍

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.lionfund.com.cn
基金中期报告置备地点	深圳市深南大道 4013 号兴业银行大厦 19-20 层诺安基金管理有限公司

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	诺安基金管理有限公司	深圳市深南大道 4013 号兴业银行大厦 19-20 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 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日）			
	诺安汇利混合 A	诺安汇利混合 C	诺安汇利混合 D	诺安汇利混合 E
本期已实现收益	313,282.98	156,621.55	6,157.27	1,347,053.30
本期利润	247,274.23	114,295.20	4,929.07	958,852.58
加权平均基金份额本期利润	0.0237	0.0198	0.0448	0.0186
本期加权平均净值利润率	1.61%	1.38%	3.04%	1.27%

本期基金份额净值增长率	1.88%	1.59%	1.83%	1.58%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2026 年 06 月 30 日）			
	诺安汇利混合 A	诺安汇利混合 C	诺安汇利混合 D	诺安汇利混合 E
期末可供分配利润	2,866,885.63	1,888,957.34	200,825.52	11,733,265.74
期末可供分配基金份额利润	0.4887	0.4484	0.4872	0.4820
期末基金资产净值	8,732,690.50	6,101,939.15	613,063.30	36,078,616.51
期末基金份额净值	1.4887	1.4484	1.4872	1.4820
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2026 年 06 月 30 日）			
	诺安汇利混合 A	诺安汇利混合 C	诺安汇利混合 D	诺安汇利混合 E
基金份额累计净值增长率	48.87%	44.84%	2.62%	6.16%

注：1、上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，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

诺安汇利混合 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	1.73%	0.11%	4.40%	0.38%	-2.67%	-0.27%
过去六个月	1.88%	0.13%	3.81%	0.34%	-1.93%	-0.21%
过去一年	2.99%	0.12%	8.83%	0.30%	-5.84%	-0.18%
过去三年	-5.12%	0.97%	18.97%	0.32%	-24.09%	0.65%
过去五年	-16.71%	0.93%	16.23%	0.33%	-32.94%	0.60%
过去七年	35.79%	0.95%	35.82%	0.34%	-0.03%	0.61%
自基金合同生效起至今	48.87%	0.92%	46.22%	0.36%	2.65%	0.56%

诺安汇利混合 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	1.59%	0.11%	4.40%	0.38%	-2.81%	-0.27%
过去六个月	1.59%	0.13%	3.81%	0.34%	-2.22%	-0.21%
过去一年	2.38%	0.12%	8.83%	0.30%	-6.45%	-0.18%
过去三年	-6.81%	0.97%	18.97%	0.32%	-25.78%	0.65%
过去五年	-19.16%	0.93%	16.23%	0.33%	-35.39%	0.60%
过去七年	30.08%	0.95%	35.82%	0.34%	-5.74%	0.61%
自基金合同生效起至今	44.84%	0.92%	46.22%	0.36%	-1.38%	0.56%

效起至今						
------	--	--	--	--	--	--

诺安汇利混合 D

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	1.70%	0.11%	4.40%	0.38%	-2.70%	-0.27%
过去六个月	1.83%	0.13%	3.81%	0.34%	-1.98%	-0.21%
自基金合同生 效起至今	2.62%	0.13%	7.28%	0.31%	-4.66%	-0.18%

诺安汇利混合 E

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	1.58%	0.11%	4.40%	0.38%	-2.82%	-0.27%
过去六个月	1.58%	0.13%	3.81%	0.34%	-2.23%	-0.21%
过去一年	2.38%	0.12%	8.83%	0.30%	-6.45%	-0.18%
自基金合同生 效起至今	6.16%	0.12%	9.56%	0.29%	-3.40%	-0.17%

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

诺安汇利混合 A



诺安汇利混合 C



诺安汇利混合 D



诺安汇利混合 E



注：本基金各类份额自实际有资产之日起披露业绩数据。

§ 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

截至 2026 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理六十五只开放式基金：诺安平衡证券投资基金、诺安货币市场基金、诺安先锋混合型证券投资基金、诺安优化收益债券型证券投资基金、诺安价值增长混合型证券投资基金、诺安灵活配置混合型证券投资基金、诺安成长混合型证券投资基金、诺安增利债券型证券投资基金、诺安中证 A100 指数证券投资基金、诺安中小盘精选混合型证券投资基金、诺安主题精选混合型证券投资基金、诺安全球黄金证券投资基金、诺安沪深 300 指数增强型证券投资基金、诺安行业轮动混合型证券投资基金、诺安多策略混合型证券投资基金、诺安油气能源股票证券投资基金（LOF）、诺安全球收益不动产证券投资基金、诺安新动力灵活配置混合型证券投资基金、诺安创业板指数增强型证券投资基金（LOF）、诺安策略精选股票型证券投资基金、诺安双利债券型发起式证券投资基金、诺安研究精选股票型证券投资基金、诺安鸿鑫混合型证券投资基金、诺安稳固收益一年定期开放债券型证券投资基金、诺安泰鑫一年定期开放债券型证券投资基金、诺安优势行业灵活配置混合型证券投资基金、诺安天天宝货币市场基金、诺安理财宝货币市场基金、诺安聚鑫宝货币市场基金、诺安稳健回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安聚利债券型证券投资

基金、诺安新经济股票型证券投资基金、诺安低碳经济股票型证券投资基金、诺安中证 500 指数增强型证券投资基金、诺安创新驱动灵活配置混合型证券投资基金、诺安先进制造股票型证券投资基金、诺安利鑫灵活配置混合型证券投资基金、诺安景鑫灵活配置混合型证券投资基金、诺安益鑫灵活配置混合型证券投资基金、诺安安鑫灵活配置混合型证券投资基金、诺安精选回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安和鑫灵活配置混合型证券投资基金、诺安积极回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安优选回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安进取回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安高端制造股票型证券投资基金、诺安改革趋势灵活配置混合型证券投资基金、诺安瑞鑫定期开放债券型发起式证券投资基金、诺安圆鼎定期开放债券型发起式证券投资基金、诺安鑫享定期开放债券型发起式证券投资基金、诺安联创顺鑫债券型证券投资基金、诺安汇利灵活配置混合型证券投资基金、诺安积极配置混合型证券投资基金、诺安优化配置混合型证券投资基金、诺安浙享定期开放债券型发起式证券投资基金、诺安精选价值混合型证券投资基金、诺安鼎利混合型证券投资基金、诺安恒鑫混合型证券投资基金、诺安新兴产业混合型证券投资基金、诺安研究优选混合型证券投资基金、诺安均衡优选一年持有期混合型证券投资基金、诺安智盈优选三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、诺安智泉量化选股混合型发起式证券投资基金、诺安悦鑫 90 天持有期债券型证券投资基金、诺安科技智选混合型证券投资基金等。

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		
李晓杰	本基金基金经理	2024 年 08 月 26 日	—	13 年	硕士，具有基金从业资格。曾先后就职于东兴证券股份有限公司、新时代信托股份有限公司、华夏久盈资产管理有限责任公司，任投资经理。2023 年 2 月加入诺安基金管理有限公司。2023 年 2 月起任诺安低碳经济股票型证券投资基金基金经理，2024 年 6 月起任诺安均衡优选一年持有期混合型证券投资基金基金经理，2024 年 8 月起任诺安汇利

					灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2025 年 3 月起任诺安新动力灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
郭晓晖	本基金基金经理	2024 年 08 月 26 日	—	14 年	硕士，具有基金从业资格。曾就职于中华联合保险集团股份有限公司，从事投研工作。 2017 年 3 月加入诺安基金管理有限公司，历任基金经理助理。2022 年 1 月至 2023 年 5 月任诺安精选回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2021 年 8 月至 2023 年 6 月任诺安稳健回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2018 年 11 月起任诺安圆鼎定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理，2018 年 12 月起任诺安鑫享定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理，2021 年 11 月起任诺安聚利债券型证券投资基金基金经理，2022 年 1 月起任诺安稳固收益一年定期开放债券型证券投资基金基金经理，2024 年 8 月起任诺安汇利灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

注：①对于首任基金经理，上述“任职日期”指基金合同生效日，“离任日期”指根据公司决定确定的解聘日期；对于非首任基金经理，上述“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期；

②证券从业的含义遵从《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》

的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期间，本基金管理人严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规，遵守了基金合同的规定，遵守了本公司管理制度。本基金投资管理未发生违法违规行为。

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

根据中国证监会 2011 年修订的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，本公司更新并完善了《诺安基金管理有限公司公平交易制度》。制度的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，同时涵盖投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

投资研究方面，公司设立全公司所有投资组合适用的证券备选库，在此基础上，不同投资组合根据其投资目标、投资风格和投资范围的不同，建立不同投资组合的投资对象备选库和交易对手备选库；公司拥有健全的投资授权制度，明确各投资决策主体的职责和权限划分，投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序；公司建立了统一的研究管理平台，所有内外部研究报告均通过该研究管理平台发布，并保障该平台对所有研究员和投资组合经理开放。

交易执行方面，对于场内交易，基金管理人在投资交易系统中设置了公平交易功能，交易中心按照时间优先、价格优先的原则执行所有指令，如果多个投资组合在同一时点就同一证券下达了相同方向的投资指令，并且市价在指令限价以内，投资交易系统自动将该证券的每笔交易报单按比例分拆到各投资组合。对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等非集中竞价交易的交易分配，在参与申购之前，各投资组合经理独立地确定申购价格和数量，并下达申购指令；公司在获配额度确定后，按照价格优先的原则进行分配，如果申购价格相同，则根据该价位各投资组合的申购数量进行比例分配。对于银行间市场交易、固定收益平台、交易所大宗交易，投资组合经理以该投资组合的名义向交易中心下达投资指令，交易中心向银行间市场或交易对手询价、成交确认，并根据“时间优先、价格优先”的原则保证各投资组合获得公平的交易机会。

本报告期内，公平交易制度总体执行情况良好，未发现违反公平交易制度的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的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交易量不存在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

固收方面，2026 年上半年，纯债收益率震荡下行。1-2 月，公募销售费用新规发布，整体缓于预期，权益和商品抬升市场风险偏好，但央行结构化降息，大额投放流动性，存款大量到期并未影响到银行负债稳定性，银行和保险等机构增加配置，债券利率修复下行，2 月末有部分止盈压力；3 月，两会政府工作报告无明显超预期信息，美伊冲突爆发后，伊朗封锁霍尔木兹海峡引发原油价格大幅上涨，通胀预期抬升，通胀、外贸、内需数据较好，同业自律管理推动短端下行，债券曲线趋陡。4 月，PPI 转正、PMI 重回 50、一季度经济数据较好，未对债券走势形成影响，市场资金充裕，DR 价格明显走低，债券利率下行；5 月非银负债端改善，月中通胀数据超预期以及供给发行带来波动，但经济数据和信贷转弱，央行月末重回净投放，债券利率延续下行态势；6 月，银行资金净融出规模超季节性下降，资金价格持续收紧，叠加非银负债端赎回压力，带动债券曲线上行，隔夜逆回购工具宣布后，市场定价隔夜利率水平，债券利率重新回暖修复。相比 2025 年末，利率债曲线陡峭化下行，10 年国债收益率下行 10BP 至 1.73% 附近，10 年国开债收益率下行约 21BP 至 1.78% 附近，信用利差和等级利差压缩。2026 年上半年，管理人主要参与中高等级信用债和利率债的投资，优化基金组合结构和久期。

权益方面，2026 年上半年市场结构分化明显，以科创 50 为代表的科技股涨幅较大，其中上证指数上涨 3.16%，沪深 300 指数上涨 7.55%，中证 1000 指数上涨 15.99%，科创 50 指数上涨 64.25%。2026 年一季度因美伊冲突事件发生，指数调整幅度较大，市场担心持续高油价会对企业盈利和估值产生压制。随着美伊冲突事件缓解，二季度受益于 AI 算力需求驱动和重大科技公司上市预期推动，光模块和 PCB 产业链涨幅较大，并逐步扩散到利基存储、MLCC 和其他细分科技方向，另一方面，国内消费未见明显好转，大宗商品价格回落，大盘价值股跌幅较大，其中石油石化、食品饮料、有色和保险跌幅居前。2026 年上半年基金增加科技仓位，其中增加电子和通信配置，降低非银和有色板块配置。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末诺安汇利混合 A 份额净值为 1.4887 元，本报告期诺安汇利混合 A 份额净值增长率为 1.88%，同期业绩比较基准收益率为 3.81%；截至本报告期末诺安汇利混合 C 份额净值为 1.4484 元，本报告期诺安汇利混合 C 份额净值增长率为 1.59%，同期业绩比较基准收益率为 3.81%；截至本报告期末诺安汇利混合 D 份额净值为 1.4872 元，本报告期诺安汇利混合 D 份额净值增长率为 1.83%，

同期业绩比较基准收益率为 3.81%；截至本报告期末诺安汇利混合 E 份额净值为 1.4820 元，本报告期诺安汇利混合 E 份额净值增长率为 1.58%，同期业绩比较基准收益率为 3.81%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

固收方面，展望下半年，国内经济结构特征可能延续，国内产业转型升级下，基建投资为经济发展平衡选择，新型基建强于传统项目，AI 引领新一轮技术革命，中美竞争下发展速度加快，完备成熟产业链叠加出海战略带动国内制造业和出口增速明显，地产行业和消费领域有待进一步恢复。整体来看，技术发展推动的经济周期迭代下结构特征更明显，政策调控以及海外地缘影响推动物价温和回升，货币政策保持宽松，流动性合理充裕，财政政策积极发力，海外方面关注未来美联储操作变化。总体来看，市场影响多空交织，债券市场或维持震荡走势。

权益方面，展望 2026 年下半年，虽然上半年科技成长板块涨幅较大，预期较为充分，但长期来看，AI 算力需求确定性强，随着 AI 算力相关板块业绩逐步兑现和国内经济数据持续改善，我们依然看好 2026 年下半年投资机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同的约定，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，负责研究、指导基金估值业务，制定和适时修订基金的估值程序和技术。估值委员会成员具有多年证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备投资、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重大利益冲突。

本基金管理人已与第三方定价服务机构签署服务协议，由其按约定提供相关参考数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行过利润分配。该处理符合相关法律法规及《诺安汇利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》约定。

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

截至本报告期末，本基金未出现连续 20 个工作日基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 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，中国农业银行股份有限公司（以下简称“本基金托管人”）在本基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律、法规的规定和基金合同、托管协议的约定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，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，本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律、法规的规定和基金合同、托管协议的约定，对本基金的投资运作情况进行了必要的监督，对本基金的基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支、利润分配等方面进行了复核，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的真实、准确和完整发表意见

本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律、法规的规定和基金合同、托管协议的约定，以自身能够获取的数据和信息为限，对本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行核查，以上内容真实、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：诺安汇利灵活配置混合型证券投资基金

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	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	2,152,828.32	8,285,562.65
结算备付金		191,414.98	136,570.91
存出保证金		6,518.77	12,866.83
交易性金融资产	6.4.7.2	50,278,285.96	100,335,677.08
其中：股票投资		3,505,138.00	9,514,214.50
基金投资		—	—
债券投资		46,773,147.96	90,821,462.58
资产支持证券投资		—	—

贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	1,200,000.00	11,500,000.00
应收清算款		-	2,697,142.58
应收股利		-	-
应收申购款		62,464.45	1,033,060.26
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		53,891,512.48	124,000,880.31
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		1,407,058.94	6,726,771.79
应付赎回款		792,065.22	3,971,412.18
应付管理人报酬		33,228.75	72,302.74
应付托管费		8,307.20	18,075.68
应付销售服务费		26,454.79	64,343.98
应付投资顾问费		-	-
应交税费		1,967.54	11,702.29
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	96,120.58	111,513.53
负债合计		2,365,203.02	10,976,122.19
净资产:			
实收基金	6.4.7.7	34,836,375.23	77,592,328.39
未分配利润	6.4.7.8	16,689,934.23	35,432,429.73
净资产合计		51,526,309.46	113,024,758.12
负债和净资产总计		53,891,512.48	124,000,880.31

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，诺安汇利混合 A 基金份额净值 1.4887 元，基金份额总额 5,865,804.87 份；诺安汇利混合 C 基金份额净值 1.4484 元，基金份额总额 4,212,981.81 份；诺安汇利混合 D 基金份额净值 1.4872 元，基金份额总额 412,237.78 份；诺安汇利混合 E 基金份额净值 1.4820 元，基金份额总额 24,345,350.77 份。诺安汇利混合份额总额合计为 34,836,375.23 份。

6.2 利润表

会计主体：诺安汇利灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日 至 2025 年 06 月 30 日
一、营业总收入		2,100,180.65	706,807.54
1. 利息收入		24,956.80	44,906.26
其中：存款利息收入	6.4.7.9	5,593.29	5,215.41
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		19,363.51	39,690.85
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		2,507,046.41	462,768.88
其中：股票投资收益	6.4.7.10	1,202,559.71	-4,601.61
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	1,272,627.87	431,659.18
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.12	-	-
股利收益	6.4.7.13	31,858.83	35,711.31
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.14	-497,764.02	173,687.83
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	65,941.46	25,444.57
减：二、营业总支出		774,829.57	139,582.66
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	299,263.26	58,527.81
2. 托管费	6.4.10.2.2	74,815.82	14,631.89
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	253,069.15	51,485.23
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		45,881.79	-
其中：卖出回购金融资产支出		45,881.79	-
6. 信用减值损失	6.4.7.16	-	-
7. 税金及附加		2,290.86	72.00
8. 其他费用	6.4.7.17	99,508.69	14,865.73
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,325,351.08	567,224.88
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,325,351.08	567,224.88
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		1,325,351.08	567,224.88

6.3 净资产变动表

会计主体：诺安汇利灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 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	77,592,328.39	35,432,429.73	113,024,758.12
二、本期期初净资产	77,592,328.39	35,432,429.73	113,024,758.12
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-42,755,953.16	-18,742,495.50	-61,498,448.66
（一）、综合收益总额	-	1,325,351.08	1,325,351.08
（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）	-42,755,953.16	-20,067,846.58	-62,823,799.74
其中：1. 基金申购款	62,330,336.55	29,104,262.24	91,434,598.79
2. 基金赎回款	-105,086,289.71	-49,172,108.82	-154,258,398.53
（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	34,836,375.23	16,689,934.23	51,526,309.46
项目	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 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	5,359,441.95	2,083,615.30	7,443,057.25
二、本期期初净资产	5,359,441.95	2,083,615.30	7,443,057.25
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	87,287,349.23	39,212,291.93	126,499,641.16
（一）、综合收益总额	-	567,224.88	567,224.88
（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）	87,287,349.23	38,645,067.05	125,932,416.28
其中：1. 基金申购款	102,365,721.76	45,121,761.61	147,487,483.37
2. 基金赎回款	-15,078,372.53	-6,476,694.56	-21,555,067.09
（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	92,646,791.18	41,295,907.23	133,942,698.41

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：

刘翔

基金管理人负责人

田冲

主管会计工作负责人

何柳姿

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

诺安汇利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”)《关于准予诺安汇利灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》(证监许可〔2018〕665号)批准,由诺安基金管理有限公司(以下简称“诺安基金公司”)依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律法规以及《诺安汇利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》发售,基金合同于2018年7月11日生效。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集规模为224,114,781.61份基金份额,其中认购利息折合37,653.74份基金份额。本基金的基金管理人为诺安基金管理有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司(以下简称“中国农业银行”)。

根据本基金的基金管理人诺安基金管理有限公司于2024年12月12日发布的《诺安基金管理有限公司关于诺安汇利灵活配置混合型证券投资基金增加基金份额类别并修改基金合同、托管协议等法律文件部分条款的公告》以及更新的《诺安汇利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,自2024年12月12日起,本基金增加E类基金份额。根据本基金的基金管理人诺安基金管理有限公司于2025年7月18日发布的《诺安基金管理有限公司关于诺安汇利灵活配置混合型证券投资基金增加基金份额类别并修改基金合同、托管协议等法律文件部分条款的公告》以及更新的《诺安汇利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,自2025年7月18日起,本基金增加D类基金份额。分级后本基金设四类基金份额:A类基金份额、C类基金份额、E类基金份额和D类基金份额。A类基金份额的基金代码为005901(与分级前基金代码相同),C类基金份额代码为005902(与分级前基金代码相同),E类基金份额代码为022851(与分级前基金代码相同),D类基金份额代码为024908。其中,A类基金份额在申购时收取申购费用,在赎回时根据持有期限收取赎回费用,但不从该类别基金资产中计提销售服务费;C类基金份额、D类基金份额和E类基金份额在申购时不收取申购费用,在赎回时根据持有期限收取赎回费用,且从该类别基金资产中计提销售服务费。由于基金费用的不同,本基金A类基金份额、C类基金份额、D类基金份额和E类份额将分别计算基金份额净值,计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《诺安汇利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《诺安汇利灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金投资于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(包括中小板、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(包括国内依法发行、上市的国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、可转换债券(含可分离交易可转债)、可交换债券、短期融资券、次级债等)、债券回购、货币市场工具、同业存单、权证、资产支持证券、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的相关规定）。本基金可持有可转债、可交换债券转股所得的股票以及权证等中国证监会允许基金投资的其它金融工具，也可直接从二级市场上买入股票和权证。如法律法规或中国证监会允许基金投资其他品种的，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入本基金的投资范围。本基金的投资组合比例为：本基金投资于股票、存托凭证的比例为基金资产的 0%-95%，每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有现金或到期日在 1 年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

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颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制。同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露内容与格式准则第 2 号——定期报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则第 3 号〈会计报表附注的编制及披露〉》，中国证券投资基金业协会发布的《公开募集证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号——年度报告和中期报告》及其他中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2026 年 06 月 30 日的财务状况以及 2026 年 01 月 01 日起至 2026 年 06 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间未发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间未发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

（1）增值税及附加

根据中华人民共和国主席令第四十一号《中华人民共和国增值税法》、中华人民共和国国务院令 第 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》及财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》的规定：资管产品运营过程中发生的应税交易，资管产品管理人为纳税人。自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的规定征收率计算缴纳增值税；公募证券投资基金（封闭式证券投资基金、开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入免征增值税；金融同业往来利息收入免征增值税，金融同业往来利息收入包括金融机构与人民银行所发生的资金往来业务、银行联行往来业务、金融机构间的资金往来业务，以及金融机构开展同业存款、同业借款、同业代付、买断式买入返售金融商品、质押式买入返售金融商品、同业存单，取得的利息收入。取得存款利息收入不属于应税交易，不征收增值税。

根据财政部、税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》的规定，自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。

根据《中华人民共和国城市维护建设税法》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育附加。

（2）企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税〔2004〕78 号《财政部 国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税。

根据财政部、国家税务总局财税〔2008〕1 号《财政部 国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

（3）个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税〔2008〕132 号《关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税〔2012〕85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税〔2015〕101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

（4）印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰ 调整为 1‰，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

（5）境外投资

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日
活期存款	2,152,828.32
等于：本金	2,152,498.95
加：应计利息	329.37
定期存款	—

等于：本金	—
加：应计利息	—
其中：存款期限 1 个月以内	—
存款期限 1-3 个月	—
存款期限 3 个月以上	—
其他存款	—
等于：本金	—
加：应计利息	—
合计	2,152,828.32

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		2,995,364.38	—	3,505,138.00	509,773.62
贵金属投资-金交所黄金合约		—	—	—	—
债券	交易所市场	1,944,688.81	42,217.71	1,936,867.71	-50,038.81
	银行间市场	43,940,060.14	636,280.25	44,836,280.25	259,939.86
	合计	45,884,748.95	678,497.96	46,773,147.96	209,901.05
资产支持证券		—	—	—	—
基金		—	—	—	—
其他		—	—	—	—
合计		48,880,113.33	678,497.96	50,278,285.96	719,674.67

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

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	1,200,000.00	—
银行间市场	—	—
合计	1,200,000.00	—

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.6 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	6.64
应付证券出借违约金	—
应付交易费用	12,430.18
其中：交易所市场	6,486.92
银行间市场	5,943.26
应付利息	—
预提费用	83,683.76
合计	96,120.58

6.4.7.7 实收基金

诺安汇利混合 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	10,728,170.83	10,728,170.83
本期申购	2,789,924.05	2,789,924.05
本期赎回（以“-”号填列）	-7,652,290.01	-7,652,290.01
本期末	5,865,804.87	5,865,804.87

诺安汇利混合 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	6,102,315.09	6,102,315.09
本期申购	1,699,537.92	1,699,537.92
本期赎回（以“-”号填列）	-3,588,871.20	-3,588,871.20
本期末	4,212,981.81	4,212,981.81

诺安汇利混合 D

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	17,702.53	17,702.53
本期申购	412,273.72	412,273.72
本期赎回（以“-”号填列）	-17,738.47	-17,738.47
本期末	412,237.78	412,237.78

诺安汇利混合 E

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	60,744,139.94	60,744,139.94
本期申购	57,428,600.86	57,428,600.86
本期赎回（以“-”号填列）	-93,827,390.03	-93,827,390.03
本期末	24,345,350.77	24,345,350.77

6.4.7.8 未分配利润

诺安汇利混合 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	5,737,961.01	-789,723.88	4,948,237.13
本期期初	5,737,961.01	-789,723.88	4,948,237.13
本期利润	313,282.98	-66,008.75	247,274.23
本期基金份额交易产生的变动数	-2,716,810.24	388,184.51	-2,328,625.73
其中：基金申购款	1,504,399.54	-186,406.18	1,317,993.36
基金赎回款	-4,221,209.78	574,590.69	-3,646,619.09
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,334,433.75	-467,548.12	2,866,885.63

诺安汇利混合 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	3,071,432.11	-472,867.33	2,598,564.78
本期期初	3,071,432.11	-472,867.33	2,598,564.78
本期利润	156,621.55	-42,326.35	114,295.20
本期基金份额交易产生的变动数	-987,628.30	163,725.66	-823,902.64
其中：基金申购款	863,165.47	-121,033.52	742,131.95
基金赎回款	-1,850,793.77	284,759.18	-1,566,034.59
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,240,425.36	-351,468.02	1,888,957.34

诺安汇利混合 D

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	9,453.20	-1,301.68	8,151.52
本期期初	9,453.20	-1,301.68	8,151.52
本期利润	6,157.27	-1,228.20	4,929.07
本期基金份额交易产生的变动数	218,021.46	-30,276.53	187,744.93
其中：基金申购款	227,576.86	-31,452.98	196,123.88
基金赎回款	-9,555.40	1,176.45	-8,378.95
本期已分配利润	-	-	-
本期末	233,631.93	-32,806.41	200,825.52

诺安汇利混合 E

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	32,321,029.28	-4,443,552.98	27,877,476.30
本期期初	32,321,029.28	-4,443,552.98	27,877,476.30
本期利润	1,347,053.30	-388,200.72	958,852.58
本期基金份额交易产生的变动数	-20,006,011.30	2,902,948.16	-17,103,063.14
其中：基金申购款	30,702,004.07	-3,853,991.02	26,848,013.05
基金赎回款	-50,708,015.37	6,756,939.18	-43,951,076.19
本期已分配利润	-	-	-
本期末	13,662,071.28	-1,928,805.54	11,733,265.74

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
活期存款利息收入	4,774.07
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	802.88
其他	16.34
合计	5,593.29

注：此处“其他”列示的是存出保证金利息收入及申购款利息收入。

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益—买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
卖出股票成交总额	15,508,811.89
减：卖出股票成本总额	14,285,941.96

减：交易费用	20,310.22
买卖股票差价收入	1,202,559.71

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01月01日至2026年06月30日
债券投资收益--利息收入	1,378,114.47
债券投资收益--买卖债券（债转股及债券到期兑付） 差价收入	-105,486.60
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	1,272,627.87

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01月01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	101,157,832.34
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	99,410,319.46
减：应计利息总额	1,850,309.48
减：交易费用	2,690.00
买卖债券差价收入	-105,486.60

6.4.7.12 衍生工具收益

6.4.7.12.1 衍生工具收益--买卖权证差价收入

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
股票投资产生的股利收益	31,858.83
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	31,858.83

6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
------	----

	2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
1. 交易性金融资产	-497,764.02
--股票投资	-835,454.98
--债券投资	337,690.96
--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	-497,764.02

6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
基金赎回费收入	64,192.48
其他	1,748.98
合计	65,941.46

注：此处“其他”列示的是基金转换费收入等。

6.4.7.16 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
审计费用	14,876.39
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
汇划手续费	6,524.93
账户维护费	18,600.00
合计	99,508.69

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金无需要说明的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

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

本报告期内，本基金管理人子公司诺安控股（香港）有限公司、诺安基金（香港）有限公司已注销。除上述变化外，本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
诺安基金管理有限公司	基金管理人、登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司	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

本基金本报告期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

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01月01日至2026 年06月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至2025 年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	299,263.26	58,527.81
其中：应支付销售机构的客户维护费	111,358.72	21,603.32
应支付基金管理人的净管理费	187,904.54	36,924.49

注：本基金的管理费率为年费率 0.60%。

基金管理费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.60\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	74,815.82	14,631.89

注：本基金的托管费率为年费率 0.15%。

基金托管费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日				
	当期发生的基金应支付的销售服务费				
	诺安汇利 混合 A	诺安汇利 混合 C	诺安汇利 混合 D	诺安汇利 混合 E	合计
诺安基金管理有限公司	-	1,723.03	71.13	1,125.76	2,919.92
中国农业银行股份有限公司	-	-	-	650.70	650.70
合计	-	1,723.03	71.13	1,776.46	3,570.62
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日				
	当期发生的基金应支付的销售服务费				
	诺安汇利 混合 A	诺安汇利 混合 C	诺安汇利 混合 D	诺安汇利 混合 E	合计
诺安基金管理有限公司	-	175.54	-	101.32	276.86
中国农业银行股份有限公司	-	-	-	-	-
合计	-	175.54	-	101.32	276.86

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额和 E 类基金份额的年销售服务费率为 0.6%，

销售服务费计算方法如下：

$$H=E \times 0.6\% \div \text{当年天数}$$

H 为该类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为该类基金份额前一日的基金资产净值

本基金 D 类基金份额的年销售服务费率为 0.1%。销售服务费计算方法如下：

$$H = E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

H 为该类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为该类基金份额前一日的基金资产净值

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

本基金本报告期内及上年度可比期间内未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

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

本基金本报告期及上年度可比期间未发生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。

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

本基金本报告期及上年度可比期间未发生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。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

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

本基金本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

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 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银	2,152,828.32	4,774.07	1,463,502.11	4,272.74

行股份有限公司-活期存款				
--------------	--	--	--	--

注：本基金由基金托管人保管的银行存款，按银行约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间内无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2026 年 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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是混合型基金，其长期平均风险和预期收益水平高于债券型基金及货币市场基金，低于股票型基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资和债券投资等。

本基金在日常经营活动面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是通过控制上述风险，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。本基金管理人秉承全面风险控制的理论，将风险管理融入业务中，使风险控制与投资业务紧密结合，在董事会专业委员会监督管理下，建立了由督察长、合规风控委员会、监察稽核部、风险控制部、相关职能部门和业务部门构成的立体式风险管理架构体系。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，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。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行中国农业银行股份有限公司，因而与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在银行间同业市场仅与达到本基金管理人既定信用政策标准的交易对手进行交易，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。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且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管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券市值的 10%。

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

本基金于本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

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	上年度末
--------	-----	------

	2026 年 06 月 30 日	2025 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	-	5,969,710.82
合计	-	5,969,710.82

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	上年度末 2025 年 12 月 31 日
AAA	2,606,777.79	42,107,977.41
AAA 以下	2,057,638.36	4,187,802.74
未评级	42,108,731.81	38,555,971.61
合计	46,773,147.96	84,851,751.76

注：未评级债券为国债、政策性金融债、央行票据或无第三方机构评级的债券。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金于本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。

本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人要求赎回的基金资产超出基金持有的现金类资产规模，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于开放期内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 2026 年 06 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约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。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人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期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公司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 6.4.12。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 2026 年 06 月 30 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低于 15%。

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。

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。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量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。

本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在一定程度上独立于市场利率变化。

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	6个月以内	6个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产						
货币资金	2,152,828.32	-	-	-	-	2,152,828.32
结算备付金	191,414.98	-	-	-	-	191,414.98
存出保证金	6,518.77	-	-	-	-	6,518.77
交易性金融资产	10,665,847.81	2,262,455.46	12,878,548.91	20,966,295.78	3,505,138.00	50,278,285.96
买入返售金融资产	1,200,000.00	-	-	-	-	1,200,000.00
应收申购款	-	-	-	-	62,464.45	62,464.45
资产总计	14,216,609.88	2,262,455.46	12,878,548.91	20,966,295.78	3,567,602.45	53,891,512.48
负债						
应付清算款	-	-	-	-	1,407,058.94	1,407,058.94
应付赎回款	-	-	-	-	792,065.22	792,065.22
应付管理人报酬	-	-	-	-	33,228.75	33,228.75
应付托管费	-	-	-	-	8,307.20	8,307.20
应付销售服务费	-	-	-	-	26,454.79	26,454.79
应交税费	-	-	-	-	1,967.54	1,967.54
其他负债	-	-	-	-	96,120.58	96,120.58
负债总计	-	-	-	-	2,365,203.02	2,365,203.02
利率敏感度缺口	14,216,609.88	2,262,455.46	12,878,548.91	20,966,295.78	1,202,399.43	51,526,309.46
上年度末 2025年12月31 日	6个月以内	6个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产						
货币资金	8,285,562.65	-	-	-	-	8,285,562.65
结算备付金	136,570.91	-	-	-	-	136,570.91

存出保证金	12,866.83	-	-	-	-	12,866.83
交易性金融资产	29,858,106.09	806,323.51	7,017,247.31	53,139,785.67	9,514,214.50	100,335,677.08
买入返售金融资产	11,500,000.00	-	-	-	-	11,500,000.00
应收清算款	-	-	-	-	2,697,142.58	2,697,142.58
应收申购款	-	-	-	-	1,033,060.26	1,033,060.26
资产总计	49,793,106.48	806,323.51	7,017,247.31	53,139,785.67	13,244,417.34	124,000,880.31
负债	-	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	6,726,771.79	6,726,771.79
应付赎回款	-	-	-	-	3,971,412.18	3,971,412.18
应付管理人报酬	-	-	-	-	72,302.74	72,302.74
应付托管费	-	-	-	-	18,075.68	18,075.68
应付销售服务费	-	-	-	-	64,343.98	64,343.98
应交税费	-	-	-	-	11,702.29	11,702.29
其他负债	-	-	-	-	111,513.53	111,513.53
负债总计	-	-	-	-	10,976,122.19	10,976,122.19
利率敏感度缺口	49,793,106.48	806,323.51	7,017,247.31	53,139,785.67	2,268,295.15	113,024,758.12

注：各期限分类的标准为按金融资产或金融负债的利率重新定价日或到期日孰早者进行分类。

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）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	市场利率下降 27 个基点	647,754.26	643,380.73
	市场利率上升 27 个基点	-629,565.01	-630,116.79

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。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金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，通过投资组合的分散化等方式，来主动应对可能发生的其他价格风险。

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		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)	公允价值	占基金资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	3,505,138.00	6.80	9,514,214.50	8.42
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	3,505,138.00	6.80	9,514,214.50	8.42

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2026 年 06 月 30 日，本基金持有的交易性权益类投资公允价值占基金净资产的比例为 6.80%（2025 年 12 月 31 日：8.42%），因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的波动对本基金净资产无重大影响（2025 年 12 月 31 日：同）。

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	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	3,505,138.00	9,514,214.50
第二层次	46,773,147.96	90,821,462.58
第三层次	—	—
合计	50,278,285.96	100,335,677.08

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金调整公允价值计量层次转换时点的相关会计政策在前后各会计期间保持一致。

对于公开市场交易的证券等投资，若出现交易不活跃、非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的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，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，其剩余期限较短，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

本基金无需说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	3,505,138.00	6.50
	其中：股票	3,505,138.00	6.50
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	46,773,147.96	86.79

	其中：债券	46,773,147.96	86.79
	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	1,200,000.00	2.23
	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	2,344,243.30	4.35
8	其他各项资产	68,983.22	0.13
9	合计	53,891,512.48	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	156,780.00	0.30
C	制造业	2,795,863.00	5.43
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	172,260.00	0.33
J	金融业	193,470.00	0.38
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	186,765.00	0.36
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	3,505,138.00	6.80

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	300750	宁德时代	500	196,505.00	0.38
2	603259	药明康德	1,500	186,765.00	0.36
3	688008	澜起科技	600	185,940.00	0.36
4	002916	深南电路	400	183,160.00	0.36
5	600941	中国移动	2,000	172,260.00	0.33
6	603986	兆易创新	200	163,000.00	0.32
7	688147	微导纳米	1,000	161,880.00	0.31
8	300274	阳光电源	1,000	159,020.00	0.31
9	688981	中芯国际	1,000	158,820.00	0.31
10	300843	胜蓝股份	1,000	156,250.00	0.30
11	300602	飞荣达	3,000	153,600.00	0.30
12	002463	沪电股份	1,000	152,800.00	0.30
13	300567	精测电子	400	127,040.00	0.25
14	300308	中际旭创	100	127,000.00	0.25
15	000425	徐工机械	15,000	121,350.00	0.24
16	002966	苏州银行	15,000	104,400.00	0.20
17	300576	容大感光	2,000	102,440.00	0.20
18	601899	紫金矿业	4,000	100,560.00	0.20
19	002842	翔鹭钨业	2,000	96,400.00	0.19
20	300568	星源材质	5,000	93,600.00	0.18
21	002142	宁波银行	3,000	89,070.00	0.17
22	002782	可立克	4,000	84,200.00	0.16
23	000807	云铝股份	3,700	81,918.00	0.16
24	688139	海尔生物	3,000	79,260.00	0.15
25	688352	硕中科技	3,000	72,540.00	0.14
26	601138	工业富联	1,000	72,150.00	0.14
27	688328	深科达	700	66,990.00	0.13
28	601958	金钼股份	2,000	56,220.00	0.11

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

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	430,311.00	0.38
2	300274	阳光电源	363,822.00	0.32
3	600941	中国移动	286,983.00	0.25

4	300602	飞荣达	284,863.00	0.25
5	600031	三一重工	275,805.00	0.24
6	600276	恒瑞医药	225,460.00	0.20
7	603296	华勤技术	217,187.00	0.19
8	002532	天山铝业	208,043.00	0.18
9	300763	锦浪科技	202,709.00	0.18
10	600409	三友化工	191,212.00	0.17
11	688328	深科达	184,724.93	0.16
12	002594	比亚迪	180,660.00	0.16
13	300418	昆仑万维	176,646.00	0.16
14	002916	深南电路	170,725.00	0.15
15	601168	西部矿业	168,018.00	0.15
16	600875	东方电气	163,215.00	0.14
17	000960	锡业股份	153,425.00	0.14
18	603986	兆易创新	152,068.00	0.13
19	000893	亚钾国际	148,166.00	0.13
20	600426	华鲁恒升	147,484.00	0.13

注：买入金额按成交金额(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	601899	紫金矿业	598,020.00	0.53
2	002475	立讯精密	502,478.00	0.44
3	603993	洛阳钼业	481,097.00	0.43
4	601688	华泰证券	411,817.00	0.36
5	600519	贵州茅台	408,666.00	0.36
6	601601	中国太保	387,439.00	0.34
7	600031	三一重工	381,884.00	0.34
8	601318	中国平安	374,219.00	0.33
9	300308	中际旭创	364,647.00	0.32
10	688981	中芯国际	363,695.99	0.32
11	600276	恒瑞医药	362,265.00	0.32
12	300274	阳光电源	329,994.00	0.29
13	300750	宁德时代	301,469.00	0.27
14	600036	招商银行	296,160.00	0.26
15	600426	华鲁恒升	291,718.00	0.26
16	002532	天山铝业	271,300.00	0.24
17	600875	东方电气	237,409.00	0.21
18	300763	锦浪科技	226,407.00	0.20

19	002594	比亚迪	213,395.00	0.19
20	000333	美的集团	206,945.00	0.18

注：卖出金额按成交金额(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	9,112,320.44
卖出股票收入（成交）总额	15,508,811.89

注：买入股票成本和卖出股票收入按成交金额(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	10,396,868.25	20.18
2	央行票据	—	—
3	金融债券	31,711,863.56	61.54
	其中：政策性金融债	31,711,863.56	61.54
4	企业债券	2,571,204.64	4.99
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	2,093,211.51	4.06
7	可转债（可交换债）	—	—
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	46,773,147.96	90.78

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	190408	19 农发 08	100,000	10,357,098.63	20.10
2	250218	25 国开 18	100,000	10,235,583.56	19.86
3	250215	25 国开 15	100,000	9,904,876.71	19.22
4	250018	25 付息国债 18	60,000	6,178,162.19	11.99
5	2600001	26 超长特别国债 01	40,000	4,009,709.29	7.78

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

本基金本报告期末投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 基金投资前十名证券的发行主体本期被监管部门立案调查或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚说明

本基金投资的前十名证券的发行主体，本报告期没有出现被监管部门立案调查的情形，也没有出现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同约定备选库之外的股票。

7.12.3 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	6,518.77
2	应收清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	62,464.45
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	68,983.22

7.12.4 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。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，投资组合报告中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
诺安汇利混合 A	378	15,518.00	3,359.86	0.06%	5,862,445.01	99.94%
诺安汇利混合 C	362	11,638.07	1,216.99	0.03%	4,211,764.82	99.97%
诺安汇利混合 D	11	37,476.16	406,568.99	98.62%	5,668.79	1.38%
诺安汇利混合 E	2,259	10,777.05	—	—	24,345,350.77	100.00%
合计	3,010	11,573.55	411,145.84	1.18%	34,425,229.39	98.82%

注：1、分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额；对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

2、户均持有的基金份额合计=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

8.2 盈利投资者数量占比

项目	过去一年（2025 年 07 月 01 日-2026 年 06 月 30 日）
盈利投资者数量占比	70.23%

8.3 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	诺安汇利混合 A	232,828.12	3.9692%
	诺安汇利混合 C	397,222.69	9.4285%
	诺安汇利混合 D	—	—
	诺安汇利混合 E	232,867.41	0.9565%
	合计	862,918.22	2.4771%

注：分级基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分

母采用各自级别的份额；对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.4 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	诺安汇利混合 A	0
	诺安汇利混合 C	10~50
	诺安汇利混合 D	0
	诺安汇利混合 E	10~50
	合计	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	诺安汇利混合 A	0
	诺安汇利混合 C	0
	诺安汇利混合 D	0
	诺安汇利混合 E	0~10
	合计	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	诺安汇利混合 A	诺安汇利混合 C	诺安汇利混合 D	诺安汇利混合 E
基金合同生效日（2018 年 07 月 11 日）基金份额总额	100,385,731.68	123,729,049.93	—	—
本报告期期初基金份额总额	10,728,170.83	6,102,315.09	17,702.53	60,744,139.94
本报告期基金总申购份额	2,789,924.05	1,699,537.92	412,273.72	57,428,600.86
减：本报告期基金总赎回份额	7,652,290.01	3,588,871.20	17,738.47	93,827,390.03
本报告期基金拆分变动份额	—	—	—	—
本报告期期末基金份额总额	5,865,804.87	4,212,981.81	412,237.78	24,345,350.77

§ 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，没有基金份额持有人大会决议。

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

本基金管理人重大人事变动情况如下：

截至本报告披露日，本基金管理人董事长（法定代表人）由李强先生变更为夏宇先生，总经理由齐斌先生变更为刘翔先生。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，未发生影响基金管理人经营或基金运营业务的诉讼。

本报告期内，无涉及本基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金的投资策略没有重大改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金聘请的会计师事务所没有发生变更。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人无受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人未发生受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人相关从业人员未发生受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
渤海证券	2	3,364,831.01	13.67%	1,500.37	13.67%	—
东吴证券	1	11,619,603.32	47.19%	5,181.19	47.20%	—
东兴证券	1	—	—	—	—	—
广发证券	1	114,100.00	0.46%	49.72	0.45%	—
万联证券	1	—	—	—	—	—
招商证券	1	—	—	—	—	—

中信证券	1	9,522,598.00	38.68%	4,245.98	38.68%	-
------	---	--------------	--------	----------	--------	---

注：1、本报告期租用证券公司交易单元的变更情况：无

2、专用交易单元的选择标准和程序

基金管理人选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的选择标准为：

- （1）依法取得相关业务资格；
- （2）信誉良好，财务状况良好，经营行为规范，合规风控能力和交易、研究等服务能力较强；
- （3）具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合基金进行证券交易的需要；
- （4）研究实力较强，有足够数量的专职的高素质研究人员，能为公司提供全面的研究支持和信息服务；
- （5）能根据基金投资的特定要求，提供个性化的研究服务；

基金管理人根据以上标准进行充分评估后，选定证券公司，并在完成公司内部审批流程后，与之签订相关协议。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		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
渤海证券	-	-	8,180,000.00	11.07%	-	-	-	-
东吴证券	811,814.00	100.00%	65,717,000.00	88.93%	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加微众银行为销售机构并开通定投、转换业务及参加基金费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026年01月13日
2	诺安汇利灵活配置混合型证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2026年01月22日
3	诺安基金管理有限公司旗下部分基金 2025 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2026年01月22日
4	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加国信嘉利基金为销售机构并开通定投、转换业务及参加基金费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026年01月23日
5	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加利得基金为销售机构并开通定投、转换业务及参加基金费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026年01月28日
6	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加贵文基金为销售机构并开通定投、转换业务及参加基金费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026年01月29日
7	诺安汇利灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）2026 年第 1 期	中国证监会规定报刊及网站	2026年02月05日
8	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金招募说明书、基金产品资料概要（更新）的提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2026年02月05日
9	诺安汇利灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会规定报刊及网站	2026年02月05日
10	诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加国信嘉利基金为销售机构并开通定投、转换业务及参加基金费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026年03月11日
11	诺安汇利灵活配置混合型证券投资基金 2025 年年度报告	中国证监会规定报刊及网站	2026年03月31日
12	诺安基金管理有限公司旗下基金 2025 年年度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2026年03月31日
13	诺安基金管理有限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）	中国证监会规定报刊及网站	2026年03月31日
14	诺安基金管理有限公司关于“诺安基金”APP 业务迁移的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026年04月03日
15	诺安汇利灵活配置混合型证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2026年04月22日

16	诺安基金管理有限公司旗下基金 2026 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2026年04月22日
17	2025 年度诺安基金管理有限公司以股东身份（通过公募基金持股）参与股东大会投票信息披露	中国证监会规定报刊及网站	2026年04月30日
18	诺安基金管理有限公司关于终止中证金牛办理本公司旗下基金销售业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026年05月29日
19	诺安基金管理有限公司关于调整旗下公募基金风险等级划分方法的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026年06月13日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本报告期内，本基金未出现单一投资者持有本基金份额比例达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

（1）本基金管理人于 2026 年 6 月 13 日披露了《诺安基金管理有限公司关于调整旗下公募基金风险等级划分方法的公告》，自 2026 年 6 月 25 日起，本基金风险等级调整为 R3。

（2）根据《诺安基金管理有限公司关于旗下部分基金调整业绩比较基准并修订基金合同等法律文件的公告》，自 2026 年 9 月 21 日起，本基金业绩比较基准调整为：中证综合债指数收益率*85%+沪深 300 指数收益率*10%+活期存款基准利率*5%。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- ①中国证券监督管理委员会批准诺安汇利灵活配置混合型证券投资基金募集的文件。
- ②《诺安汇利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》。
- ③《诺安汇利灵活配置混合型证券投资基金托管协议》。
- ④《诺安汇利灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》。
- ⑤基金管理人业务资格批件、营业执照。
- ⑥报告期内诺安汇利灵活配置混合型证券投资基金在规定媒介上披露的各项公告。

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

投资者对本报告书如有疑问，可致电本基金管理人全国统一客户服务电话：400-888-8998，亦可至基金管理人网站 www.lionfund.com.cn 查阅详情。

诺安基金管理有限公司

2026 年 08 月 31 日