

# 汇安嘉利混合型证券投资基金

## 2024 年中期报告

2024 年 06 月 30 日

基金管理人:汇安基金管理有限责任公司

基金托管人:中国光大银行股份有限公司

送出日期:2024 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，并由董事长签发。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年8月30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2024年1月1日起至2024年6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                         | 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遵规守信情况的说明              | 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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 15 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 15 |
| 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       | 15 |
| §5 托管人报告                                | 15 |
| 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明                  | 15 |
| 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 | 16 |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见       | 16 |
| §6 半年度财务会计报告（未经审计）                      | 16 |
| 6.1 资产负债表                               | 16 |
| 6.2 利润表                                 | 18 |
| 6.3 净资产变动表                              | 20 |
| 6.4 报表附注                                | 22 |
| §7 投资组合报告                               | 47 |
| 7.1 期末基金资产组合情况                          | 47 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合                    | 48 |
| 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       | 48 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动                     | 49 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 51 |
| 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      | 52 |
| 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   | 52 |
| 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   | 52 |
| 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      | 52 |
| 7.10 本基金投资股指期货的投资政策                     | 52 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明               | 52 |
| 7.12 投资组合报告附注                           | 53 |
| §8 基金份额持有人信息                            | 55 |

|  |    |
|--|----|
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....              | 55 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....           | 56 |
| 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 .....   | 56 |
| §9 开放式基金份额变动 .....                       | 56 |
| §10 重大事件揭示 .....                         | 57 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 .....                   | 57 |
| 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 .....   | 57 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....        | 57 |
| 10.4 基金投资策略的改变 .....                     | 57 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....              | 57 |
| 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....      | 57 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....             | 58 |
| 10.8 其他重大事件 .....                        | 60 |
| §11 影响投资者决策的其他重要信息 .....                 | 61 |
| 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 ..... | 61 |
| §12 备查文件目录 .....                         | 61 |
| 12.1 备查文件目录 .....                        | 61 |
| 12.2 存放地点 .....                          | 61 |
| 12.3 查阅方式 .....                          | 61 |

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                 |                |
|-----------------|-----------------|----------------|
| 基金名称            | 汇安嘉利混合型证券投资基金   |                |
| 基金简称            | 汇安嘉利混合          |                |
| 基金主代码           | 009133          |                |
| 基金运作方式          | 契约型开放式          |                |
| 基金合同生效日         | 2020年04月21日     |                |
| 基金管理人           | 汇安基金管理有限责任公司    |                |
| 基金托管人           | 中国光大银行股份有限公司    |                |
| 报告期末基金份额总额      | 107,838,352.84份 |                |
| 基金合同存续期         | 不定期             |                |
| 下属分级基金的基金简称     | 汇安嘉利混合A         | 汇安嘉利混合C        |
| 下属分级基金的交易代码     | 009133          | 009134         |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 85,623,633.15份  | 22,214,719.69份 |

### 2.2 基金产品说明

|        |  |
|--------|--|
| 投资目标   | 本基金在严格控制风险的前提下，通过优化大类资产配置和选择高安全边际的证券，力争实现基金资产的长期稳健增值。                            |
| 投资策略   | 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、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略、融资业务投资策略、存托凭证投资策略等。 |
| 业绩比较基准 | 沪深300指数收益率*15%+中债综合财富指数收益率*85%   |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金，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 | 中国光大银行股份有限公司 |
| 信息披露 | 姓名 | 郭冬青          | 石立平          |

|        |      |   |                           |
|--------|------|---|---------------------------|
| 露负责人   | 联系电话 | 010-56711600                                  | 010-63639180              |
|        | 电子邮箱 | guodq@huianfund.cn                            | shiliping@cebbank.com     |
| 客户服务电话 |      | 010-56711690                                  | 95595                     |
| 传真     |      | 010-56711640                                  | 010-63639132              |
| 注册地址   |      | 上海市虹口区欧阳路218弄1号2楼215室                         | 北京市西城区太平桥大街25号、甲25号中国光大中心 |
| 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 | 北京市西城区太平桥大街25号中国光大中心      |
| 邮政编码   |      | 100007  | 100033                    |
| 法定代表人  |      | 刘强  | 吴利军                       |

## 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             |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | www.huianfund.cn |
| 基金中期报告备置地点          | 基金管理人及基金托管人住所    |

## 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称           | 办公地址                         |
|--------|--------------|------------------------------|
| 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                       |
|               | (2024年01月01日-2024年06月30日) |

|                      |                       |               |
|----------------------|-----------------------|---------------|
|                      | 汇安嘉利混合A               | 汇安嘉利混合C       |
| 本期已实现收益              | -963,024.80           | -301,442.08   |
| 本期利润                 | 472,036.22            | 78,209.09     |
| 加权平均基金份额本期利润         | 0.0053                | 0.0033        |
| 本期加权平均净值利润率          | 0.55%                 | 0.35%         |
| 本期基金份额净值增长率          | 0.56%                 | 0.36%         |
| <b>3.1.2 期末数据和指标</b> | 报告期末<br>(2024年06月30日) |               |
| 期末可供分配利润             | -4,968,446.87         | -1,639,052.55 |
| 期末可供分配基金份额利润         | -0.0580               | -0.0738       |
| 期末基金资产净值             | 83,387,217.24         | 21,274,181.04 |
| 期末基金份额净值             | 0.9739                | 0.9577        |
| <b>3.1.3 累计期末指标</b>  | 报告期末<br>(2024年06月30日) |               |
| 基金份额累计净值增长率          | -2.61%                | -4.23%        |

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

汇安嘉利混合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   |
|-------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去一个月 | -0.50%   | 0.13%       | 0.23%      | 0.07%         | -0.73% | 0.06% |

|            |         |       |        |       |         |       |
|------------|---------|-------|--------|-------|---------|-------|
| 过去三个月      | 0.14%   | 0.11% | 1.17%  | 0.11% | -1.03%  | 0.00% |
| 过去六个月      | 0.56%   | 0.15% | 3.39%  | 0.13% | -2.83%  | 0.02% |
| 过去一年       | -4.86%  | 0.24% | 3.51%  | 0.13% | -8.37%  | 0.11% |
| 过去三年       | -10.40% | 0.27% | 6.87%  | 0.16% | -17.27% | 0.11% |
| 自基金合同生效起至今 | -2.61%  | 0.24% | 13.68% | 0.17% | -16.29% | 0.07% |

汇安嘉利混合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   |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|---------|-------|
| 过去一个月      | -0.53%   | 0.13%       | 0.23%      | 0.07%         | -0.76%  | 0.06% |
| 过去三个月      | 0.04%    | 0.11%       | 1.17%      | 0.11%         | -1.13%  | 0.00% |
| 过去六个月      | 0.36%    | 0.15%       | 3.39%      | 0.13%         | -3.03%  | 0.02% |
| 过去一年       | -5.23%   | 0.24%       | 3.51%      | 0.13%         | -8.74%  | 0.11% |
| 过去三年       | -11.46%  | 0.27%       | 6.87%      | 0.16%         | -18.33% | 0.11% |
| 自基金合同生效起至今 | -4.23%   | 0.24%       | 13.68%     | 0.17%         | -17.91% | 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



汇安嘉利混合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  
(2020年04月21日-2024年06月30日)



汇安嘉利混合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  
(2020年04月21日-2024年06月30日)



注：本报告期，本基金投资比例符合基金合同要求。

## §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

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6月30日，公司旗下管理63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、汇安裕阳三年定期开放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、汇安裕兴12个月定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、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。

#### 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<br>经理（助理）<br>期限 |          | 证券<br>从业<br>年限 | 说明  |
|-----|----------------------------|-------------------------|----------|----------------|---|
|     |                            | 任职<br>日期                | 离任<br>日期 |                |   |
| 仇秉则 | 绝对收益组基金经<br>理、本基金的基金经<br>理 | 2020-<br>04-21          | -        | 18年            | 仇秉则先生，CFA，CPA，<br>中山大学经济学学士，18年<br>证券、基金行业从业经验。<br>曾任普华永道中天会计师<br>事务所审计经理，嘉实基金<br>管理有限公司固定收益部<br>高级信用分析师。2016年6<br>月加入汇安基金管理有限<br>责任公司，担任绝对收益组<br>基金经理。2016年12月2日<br>至2019年10月11日，任汇安<br>嘉汇纯债债券型证券投资<br>基金基金经理；2016年12月<br>5日至2019年10月11日，任<br>汇安嘉裕纯债债券型证券<br>投资基金基金经理；2016年<br>12月19日至2018年2月9日，<br>2019年5月10日至2020年5<br>月11日，任汇安丰利灵活配<br>置混合型证券投资基金基<br>金经理；2016年12月22日至<br>2019年10月11日，任汇安嘉<br>源纯债债券型证券投资基<br>金基金经理；2016年12月22<br>日至2019年11月19日，任汇<br>安丰融灵活配置混合型证<br>券投资基金基金经理；2017<br>年1月25日至2018年2月9<br>日，任汇安丰泰灵活配置混 |

|  |  |  |  |   |
|--|--|--|--|---|
|  |  |  |  | <p>合型证券投资基金基金经理；2017年1月10日至2019年1月10日，任汇安丰华灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2017年1月13日至2018年5月14日，任汇安丰泽灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2017年3月13日至2018年5月14日，任汇安丰恒灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2017年7月27日至2019年10月11日，任汇安丰裕灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2017年8月10日至2019年10月11日，任汇安丰益灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2019年10月14日至2021年4月21日任汇安稳裕债券型证券投资基金基金经理；2020年12月18日至2021年12月31日，任汇安恒利39个月定期开放纯债债券型证券投资基金基金经理；2021年2月2日至2022年11月11日，任汇安嘉盈一年持有期债券型证券投资基金基金经理；2021年10月12日至2022年12月8日，任汇安裕兴12个月定期开放纯债债券型发起式证券投资基金基金经理；2021年11月9日至2024年3月26日，任汇安信泰稳健一年持有期混合型证券投资</p> |
|--|--|--|--|---|

|  |  |  |  |   |
|--|--|--|--|---|
|  |  |  |  | <p>基金基金经理；2019年8月9日至今，任汇安嘉诚债券型证券投资基金基金经理；2020年3月5日至今，任汇安信利债券型证券投资基金基金经理；2020年4月21日至今，任汇安嘉利混合型证券投资基金基金经理；2021年5月6日至今，任汇安泓利一年持有期混合型证券投资基金基金经理；2021年8月3日至今，任汇安鑫泽稳健一年持有期混合型证券投资基金基金经理；2022年8月10日至今，任汇安添利18个月持有期混合型证券投资基金基金经理。</p> |
|--|--|--|--|---|

上述任职日期、离职日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

根据基金管理人2024年8月9日的公告，解聘仇秉则担任本基金的基金经理，增聘张靖担任本基金的基金经理。

#### 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。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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。

#### 4.3.2 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

上半年经济基本面保持平稳，经济金融数据逐季度走弱，整体呈现出供给强于需求、外需强于内需的特点。生产端保持稳定，工业企业营收和工业增加值持续增长。需求端，二季度出台了放松限购、去库存、降低融资成本和首付比例等多项支持房地产的举措，但未能实质扭转房地产市场下行的趋势，房地产销售和投资仍处于下滑态势，房产价格的下降对居民资产负债表造成了损伤，居民消费出现走弱趋势。基建方面，由于化解债务任务叠加地方债发行进度偏慢，基建投资受到一定制约。经济内生动力恢复仍面临压力，居民、企业信心和资产负债表仍有待修复。

在权益市场方面，上半年整体赚钱效应不佳，市场参与者避险情绪升温。从结构上看，中小市值公司表现较弱，高股息品种和上游行业表现相对突出。自5月以来，可转债市场出现明显回调，部分发行人的信用问题逐渐受到市场重视，可转债内嵌期权的估值也调整至历史较低水平。

在债券市场方面，由于供需和基本面等因素影响，债券收益率震荡下行，多次调整后创下新低。同时，央行也多次发声表示关注长期收益率过低的问题，未来要关注央行对长端收益率的态度以及实质动作。

报告期内，基金组合债券端维持中性久期策略。股票和转债方面适当降低仓位，在品种选择上也注重防御属性，降低了组合的波动，在市场调整过程中规避了部分损失。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末汇安嘉利混合A基金份额净值为0.9739元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.56%，同期业绩比较基准收益率为3.39%；截至报告期末汇安嘉利混合

C基金份额净值为0.9577元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.36%，同期业绩比较基准收益率为3.39%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，海外政治、经济不确定性增强，国内需求恢复仍然面临一定压力，后续需要更加有力的政策支持，需要改善居民资产负债表和收入预期。外需或因海外局势以及需求回落等因素影响放缓。组合未来纯债部分继续保持中性久期配置，关注利率波段机会；股票方面主要以低波红利为主，控制组合波动；可转债主要配置偏债型和平衡型品种，充分利用债底保护，控制组合向下风险。

#### 4.6 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。

#### 4.7 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发生利润分配情况。

#### 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

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，中国光大银行股份有限公司在汇安嘉利混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）托管过程中，严格遵守了《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》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，依法安全保管了基金的全部资产，对本基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督，对发现的问题及时提出了意见和建议。同时，按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告，没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为，诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

## 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

本报告期内，中国光大银行股份有限公司依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，对基金管理人的投资运作、信息披露等行为进行了复核、监督，未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金在运作中遵守了有关法律法规的要求，各重要方面由投资管理人依据基金合同及实际运作情况进行处理。

## 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

中国光大银行股份有限公司依法对基金管理人编制的《汇安嘉利混合型证券投资基金2024年中期报告》进行了复核，认为报告中相关财务指标、净值表现、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确。

## §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：汇安嘉利混合型证券投资基金

报告截止日：2024年06月30日

单位：人民币元

| 资产   | 附注号     | 本期末<br>2024年06月30日 | 上年度末<br>2023年12月31日 |
|------|---------|--------------------|---------------------|
| 资产：  |         |                    |                     |
| 货币资金 | 6.4.7.1 | 1,245,059.29       | 558,285.28          |



|               |            |                            |                             |
|---------------|------------|----------------------------|-----------------------------|
| 结算备付金         |            | 163,910.44                 | 618,837.18                  |
| 存出保证金         |            | 14,451.14                  | 46,480.44                   |
| 交易性金融资产       | 6.4.7.2    | 103,174,454.66             | 100,625,653.35              |
| 其中：股票投资       |            | 8,104,709.60               | 15,838,043.10               |
| 基金投资          |            | -                          | -                           |
| 债券投资          |            | 95,069,745.06              | 84,787,610.25               |
| 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    | 1,000,000.00               | 11,010,463.82               |
| 应收清算款         |            | -                          | -                           |
| 应收股利          |            | -                          | -                           |
| 应收申购款         |            | 20,114.00                  | 525.99                      |
| 递延所得税资产       |            | -                          | -                           |
| 其他资产          | 6.4.7.5    | -                          | -                           |
| 资产总计          |            | 105,617,989.53             | 112,860,246.06              |
| <b>负债和净资产</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2024年06月30日</b> | <b>上年度末<br/>2023年12月31日</b> |
| <b>负债：</b>    |            |                            |                             |
| 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         |            | 566,650.64                 | -                           |
| 应付赎回款         |            | 69,119.61                  | 277,921.85                  |
| 应付管理人报酬       |            | 87,202.23                  | 96,544.15                   |
| 应付托管费         |            | 13,080.33                  | 14,481.64                   |
| 应付销售服务费       |            | 7,171.41                   | 7,964.44                    |
| 应付投资顾问费       |            | -                          | -                           |

|             |         |                |                |
|-------------|---------|----------------|----------------|
| 应交税费        |         | 963.74         | 616.35         |
| 应付利润        |         | -              | -              |
| 递延所得税负债     |         | -              | -              |
| 其他负债        | 6.4.7.6 | 212,403.29     | 177,228.41     |
| 负债合计        |         | 956,591.25     | 574,756.84     |
| <b>净资产：</b> |         |                |                |
| 实收基金        | 6.4.7.7 | 107,838,352.84 | 116,299,259.95 |
| 未分配利润       | 6.4.7.8 | -3,176,954.56  | -4,013,770.73  |
| 净资产合计       |         | 104,661,398.28 | 112,285,489.22 |
| 负债和净资产总计    |         | 105,617,989.53 | 112,860,246.06 |

注：报告截止日2024年6月30日，基金份额总额107,838,352.84份，其中汇安嘉利混合A基金份额净值0.9739元，份额总额85,623,633.15份；汇安嘉利混合C基金份额净值0.9577元，份额总额22,214,719.69份。

## 6.2 利润表

会计主体：汇安嘉利混合型证券投资基金

本报告期：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

| 项目                   | 附注号     | 本期<br>2024年01月01日至<br>2024年06月30日 | 上年度可比期间<br>2023年01月01日至202<br>3年06月30日 |
|----------------------|---------|-----------------------------------|--|
| <b>一、营业总收入</b>       |         | 1,328,070.78                      | 1,631,747.09                           |
| 1.利息收入               |         | 56,542.44                         | 287,641.80                             |
| 其中：存款利息收入            | 6.4.7.9 | 10,226.86                         | 28,140.03                              |
| 债券利息收入               |         | -                                 | -                                      |
| 资产支持证券利息<br>收入       |         | -                                 | -                                      |
| 买入返售金融资产<br>收入       |         | 46,315.58                         | 259,501.77                             |
| 其他利息收入               |         | -                                 | -                                      |
| 2.投资收益（损失以“-”<br>填列） |         | -543,304.47                       | 592,342.64                             |

|                                 |            |               |               |
|---------------------------------|------------|---------------|---------------|
| 其中：股票投资收益                       | 6.4.7.10   | -1,610,205.88 | -2,209,835.34 |
| 基金投资收益                          |            | -             | -             |
| 债券投资收益                          | 6.4.7.11   | 932,369.74    | 2,489,495.35  |
| 资产支持证券投资<br>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   | 134,531.67    | 312,682.63    |
| 其他投资收益                          |            | -             | -             |
| 3.公允价值变动收益（损失<br>以“-”号填列）       | 6.4.7.16   | 1,814,712.19  | 750,238.99    |
| 4.汇兑收益（损失以“-”<br>号填列）           |            | -             | -             |
| 5.其他收入（损失以“-”<br>号填列）           | 6.4.7.17   | 120.62        | 1,523.66      |
| <b>减：二、营业总支出</b>                |            | 777,825.47    | 1,089,846.12  |
| 1.管理人报酬                         | 6.4.10.2.1 | 541,348.99    | 808,015.24    |
| 2.托管费                           | 6.4.10.2.2 | 81,202.29     | 121,202.30    |
| 3.销售服务费                         | 6.4.10.2.3 | 44,897.98     | 58,663.21     |
| 4.投资顾问费                         |            | -             | -             |
| 5.利息支出                          |            | 6,456.27      | -             |
| 其中：卖出回购金融资产<br>支出               |            | 6,456.27      | -             |
| 6.信用减值损失                        |            | -             | -             |
| 7.税金及附加                         |            | 784.58        | 412.81        |
| 8.其他费用                          | 6.4.7.18   | 103,135.36    | 101,552.56    |
| <b>三、利润总额（亏损总额<br/>以“-”号填列）</b> |            | 550,245.31    | 541,900.97    |
| 减：所得税费用                         |            | -             | -             |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”<br/>号填列）</b>   |            | 550,245.31    | 541,900.97    |

|               |  |            |            |
|---------------|--|------------|------------|
| 五、其他综合收益的税后净额 |  | -          | -          |
| 六、综合收益总额      |  | 550,245.31 | 541,900.97 |

### 6.3 净资产变动表

会计主体：汇安嘉利混合型证券投资基金

本报告期：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

| 项目                                       | 本期<br>2024年01月01日至2024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                                | 116,299,259.95                | -4,013,770.73 | 112,285,489.22 |
| 二、本期期初净资产                                | 116,299,259.95                | -4,013,770.73 | 112,285,489.22 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                     | -8,460,907.11                 | 836,816.17    | -7,624,090.94  |
| （一）、综合收益总额                               | -                             | 550,245.31    | 550,245.31     |
| （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）      | -8,460,907.11                 | 286,570.86    | -8,174,336.25  |
| 其中：1.基金申购款                               | 144,762.55                    | -5,597.35     | 139,165.20     |
| 2.基金赎回款                                  | -8,605,669.66                 | 292,168.21    | -8,313,501.45  |
| （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                                | 107,838,352.84                     | -3,176,954.56 | 104,661,398.28 |
| 项目                                       | 上年度可比期间<br>2023年01月01日至2023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                                | 179,708,474.04                     | 4,613,484.33  | 184,321,958.37 |
| 二、本期期初净资产                                | 179,708,474.04                     | 4,613,484.33  | 184,321,958.37 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                     | -41,826,572.94                     | -1,718,416.17 | -43,544,989.11 |
| （一）、综合收益总额                               | -                                  | 541,900.97    | 541,900.97     |
| （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）      | -41,826,572.94                     | -2,260,317.14 | -44,086,890.08 |
| 其中：1.基金申购款                               | 885,672.36                         | 50,813.20     | 936,485.56     |
| 2.基金赎回款                                  | -42,712,245.30                     | -2,311,130.34 | -45,023,375.64 |
| （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                                | 137,881,901.10                     | 2,895,068.16  | 140,776,969.26 |

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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

汇安嘉利混合型证券投资基金(原名为汇安嘉利一年封闭运作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[2020]329号《关于准予汇安嘉利一年封闭运作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《汇安嘉利一年封闭运作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1,827,411,200.61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(2020)第0302号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《汇安嘉利一年封闭运作混合型证券投资基金基金合同》于2020年4月21日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,827,879,421.63份基金份额,其中认购资金利息折合468,221.02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,基金托管人为中国光大银行股份有限公司。

本基金在基金合同生效之日起一年的期间内封闭式运作。封闭期为自基金合同生效之日起至一年后对应日的前一日(含该日)止,若一年后该对应日为非工作日或不存在该对应日的,封闭期到期日相应顺延。封闭期内,基金份额保持不变,基金份额持有人不得申请申购或赎回本基金。封闭期届满后,本基金转为开放式运作,基金名称相应变更为“汇安嘉利混合型证券投资基金”。

根据《汇安嘉利一年封闭运作混合型证券投资基金基金合同》、《汇安嘉利一年封闭运作混合型证券投资基金招募说明书》,以及本基金的基金管理人于2021年4月13日发布的《关于修订汇安嘉利一年封闭运作混合型证券投资基金基金合同、托管协议的公告》和《汇安嘉利一年封闭运作混合型证券投资基金封闭期结束转换为开放式运作、变更基金名称及开放日常申购、赎回、转换、定期定额投资业务公告》,本基金的封闭期于2021年4月20日届满,自2021年4月21日起转为开放式运作,基金名称相应变更为“汇安嘉利混合型证券投资基金”,《汇安嘉利一年封闭运作混合型证券投资基金基金合同》自2021年4月21日起失效,《汇安嘉利混合型证券投资基金基金合同》于同日起生效。

根据《汇安嘉利混合型证券投资基金基金合同》和《汇安嘉利混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定,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《汇安嘉利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(包含主板、中小板、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、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、超短期融资券、可转换债券、可交换债券等)、债券回购、同业存单、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、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。在条件许可的情况下，基金管理人可在不改变本基金既有投资目标、策略和风险收益特征并在控制风险的前提下，根据相关法律法规，参与融资业务，不需要召开基金份额持有人大会。本基金投资于股票资产占基金资产的比例为0%-30%；封闭期内，本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；封闭期届满转为开放式运作后，本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值的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。本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率×15%+中债综合财富指数收益率×85%。

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2024年8月29日批准报出。

#### 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》、《汇安嘉利混合型证券投资基金基金合同》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。

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

本基金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6月30日的财务状况以及2024年1月1日至2024年6月30日的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

#### 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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 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。

##### 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[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。

## 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<br>2024年06月30日 |
|---------------|--------------------|
| 活期存款          | 1,245,059.29       |
| 等于: 本金        | 1,244,691.66       |
| 加: 应计利息       | 367.63             |
| 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          | -                  |
| 等于: 本金        | -                  |
| 加: 应计利息       | -                  |
| 减: 坏账准备       | -                  |
| 合计            | 1,245,059.29       |

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            |       | 本期末<br>2024年06月30日 |              |                |             |
|---------------|-------|--------------------|--------------|----------------|-------------|
|               |       | 成本                 | 应计利息         | 公允价值           | 公允价值变动      |
| 股票            |       | 8,869,956.49       | -            | 8,104,709.60   | -765,246.89 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 |       | -                  | -            | -              | -           |
| 债券            | 交易所市场 | 67,982,950.97      | 653,057.33   | 68,773,988.23  | 137,979.93  |
|               | 银行间市场 | 25,172,604.18      | 619,256.83   | 26,295,756.83  | 503,895.82  |
|               | 合计    | 93,155,555.15      | 1,272,314.16 | 95,069,745.06  | 641,875.75  |
| 资产支持证券        |       | -                  | -            | -              | -           |
| 基金            |       | -                  | -            | -              | -           |
| 其他            |       | -                  | -            | -              | -           |
| 合计            |       | 102,025,511.64     | 1,272,314.16 | 103,174,454.66 | -123,371.14 |

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

### 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<br>2024年06月30日 |           |
|-------|--------------------|-----------|
|       | 账面余额               | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | 1,000,000.00       | -         |
| 银行间市场 | -                  | -         |
| 合计    | 1,000,000.00       | -         |

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

### 6.4.7.5 其他资产

无。

### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2024年06月30日 |
|-------------|--------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                  |
| 应付赎回费       | 0.40               |
| 应付证券出借违约金   | -                  |
| 应付交易费用      | 7,867.53           |
| 其中：交易所市场    | 7,692.53           |
| 银行间市场       | 175.00             |
| 应付利息        | -                  |
| 预提费用-审计费    | 24,863.02          |
| 预提费用-信息披露费  | 179,672.34         |
| 合计          | 212,403.29         |

### 6.4.7.7 实收基金

#### 6.4.7.7.1 汇安嘉利混合A

金额单位：人民币元

| 项目<br>(汇安嘉利混合A) | 本期<br>2024年01月01日至2024年06月30日 |               |
|-----------------|-------------------------------|---------------|
|                 | 基金份额（份）                       | 账面金额          |
| 上年度末            | 91,819,936.49                 | 91,819,936.49 |
| 本期申购            | 58,167.56                     | 58,167.56     |
| 本期赎回（以“-”号填列）   | -6,254,470.90                 | -6,254,470.90 |
| 本期末             | 85,623,633.15                 | 85,623,633.15 |

#### 6.4.7.7.2 汇安嘉利混合C

金额单位：人民币元

| 项目<br>(汇安嘉利混合C) | 本期<br>2024年01月01日至2024年06月30日 |
|-----------------|-------------------------------|
|-----------------|-------------------------------|

|               | 基金份额（份）       | 账面金额          |
|---------------|---------------|---------------|
| 上年度末          | 24,479,323.46 | 24,479,323.46 |
| 本期申购          | 86,594.99     | 86,594.99     |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -2,351,198.76 | -2,351,198.76 |
| 本期末           | 22,214,719.69 | 22,214,719.69 |

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

### 6.4.7.8 未分配利润

#### 6.4.7.8.1 汇安嘉利混合A

单位：人民币元

| 项目<br>(汇安嘉利混合A) | 已实现部分         | 未实现部分        | 未分配利润合计       |
|-----------------|---------------|--------------|---------------|
| 上年度末            | -4,382,870.15 | 1,488,946.30 | -2,893,923.85 |
| 本期期初            | -4,382,870.15 | 1,488,946.30 | -2,893,923.85 |
| 本期利润            | -963,024.80   | 1,435,061.02 | 472,036.22    |
| 本期基金份额交易产生的变动数  | 377,448.08    | -191,976.36  | 185,471.72    |
| 其中：基金申购款        | -3,514.12     | 1,716.88     | -1,797.24     |
| 基金赎回款           | 380,962.20    | -193,693.24  | 187,268.96    |
| 本期已分配利润         | -             | -            | -             |
| 本期末             | -4,968,446.87 | 2,732,030.96 | -2,236,415.91 |

#### 6.4.7.8.2 汇安嘉利混合C

单位：人民币元

| 项目<br>(汇安嘉利混合C) | 已实现部分         | 未实现部分      | 未分配利润合计       |
|-----------------|---------------|------------|---------------|
| 上年度末            | -1,511,052.75 | 391,205.87 | -1,119,846.88 |
| 本期期初            | -1,511,052.75 | 391,205.87 | -1,119,846.88 |
| 本期利润            | -301,442.08   | 379,651.17 | 78,209.09     |
| 本期基金份额交易产生的变动数  | 173,442.28    | -72,343.14 | 101,099.14    |
| 其中：基金申购款        | -6,956.85     | 3,156.74   | -3,800.11     |

|         |               |            |             |
|---------|---------------|------------|-------------|
| 基金赎回款   | 180,399.13    | -75,499.88 | 104,899.25  |
| 本期已分配利润 | -             | -          | -           |
| 本期末     | -1,639,052.55 | 698,513.90 | -940,538.65 |

#### 6.4.7.9 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06月30日 |  |
| 活期存款利息收入  | 5,677.17                |  |
| 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 | 4,384.42                |  |
| 其他        | 165.27                  |  |
| 合计        | 10,226.86               |  |

#### 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                      |  |
|------------|-------------------------|--|
|            | 2024年01月01日至2024年06月30日 |  |
| 卖出股票成交总额   | 13,625,981.19           |  |
| 减：卖出股票成本总额 | 15,213,114.55           |  |
| 减：交易费用     | 23,072.52               |  |
| 买卖股票差价收入   | -1,610,205.88           |  |

##### 6.4.7.10.2 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

#### 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 |
|----|----|
|----|----|

|                              | 2024年01月01日至2024年06月30日 |
|------------------------------|-------------------------|
| 债券投资收益——利息收入                 | 1,105,514.52            |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | -173,144.78             |
| 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                           | 932,369.74              |

#### 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                      |
|------------------------|-------------------------|
|                        | 2024年01月01日至2024年06月30日 |
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额   | 58,142,646.51           |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 57,607,252.29           |
| 减：应计利息总额               | 706,360.00              |
| 减：交易费用                 | 2,179.00                |
| 买卖债券差价收入               | -173,144.78             |

#### 6.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

#### 6.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

#### 6.4.7.12 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

##### 6.4.7.12.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

**6.4.7.12.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入**

无。

**6.4.7.12.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入**

无。

**6.4.7.13 贵金属投资收益**

**6.4.7.13.1 贵金属投资收益项目构成**

无。

**6.4.7.13.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

无。

**6.4.7.13.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

无。

**6.4.7.13.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

无。

**6.4.7.14 衍生工具收益**

**6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

无。

**6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益**

无。

**6.4.7.15 股利收益**

单位：人民币元

| 项目            | 本期                      |
|---------------|-------------------------|
|               | 2024年01月01日至2024年06月30日 |
| 股票投资产生的股利收益   | 134,531.67              |
| 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          | 134,531.67 |

**6.4.7.16 公允价值变动收益**

单位：人民币元

| 项目名称                   | 本期<br>2024年01月01日至2024年06月30日 |
|------------------------|-------------------------------|
| 1.交易性金融资产              | 1,814,712.19                  |
| ——股票投资                 | 782,509.85                    |
| ——债券投资                 | 1,032,202.34                  |
| ——资产支持证券投资             | -                             |
| ——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                     | 1,814,712.19                  |

**6.4.7.17 其他收入**

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2024年01月01日至2024年06月30日 |
|---------|-------------------------------|
| 基金赎回费收入 | 120.62                        |
| 合计      | 120.62                        |

**6.4.7.18 其他费用**

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2024年01月01日至2024年06月30日 |
|----|-------------------------------|
|----|-------------------------------|



|           |            |
|-----------|------------|
| 审计费用      | 24,863.02  |
| 信息披露费     | 59,672.34  |
| 证券出借违约金   | -          |
| 账户维护费-中债登 | 9,000.00   |
| 其他        | 600.00     |
| 账户维护费-上清所 | 9,000.00   |
| 合计        | 103,135.36 |

#### 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

无。

##### 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             |
|--------------|---------------------|
| 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 |
| 中国光大银行股份有限公司 | 基金托管人、基金销售机构        |
| 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。

#### 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 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<br>2024年01月01日至20<br>24年06月30日 | 上年度可比期间<br>2023年01月01日至20<br>23年06月30日 |
|------------------|-----------------------------------|--|
| 当期发生的基金应支付的管理费   | 541,348.99                        | 808,015.24                             |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 217,332.72                        | 323,058.70                             |
| 应支付基金管理人的净管理费    | 324,016.27                        | 484,956.54                             |

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1.00%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×1.00%/当年天数。

###### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2024年01月01日至2024 | 上年度可比期间<br>2023年01月01日至2023 |
|----|------------------------|-----------------------------|
|----|------------------------|-----------------------------|

|                | 年06月30日   | 年06月30日    |
|----------------|-----------|------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 81,202.29 | 121,202.30 |

注：支付基金托管人中国光大银行股份有限公司的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。其计算公式为：

日托管费 = 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<br>2024年01月01日至2024年06月30日      |           |           |
|----------------|------------------------------------|-----------|-----------|
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                   |           |           |
|                | 汇安嘉利混合A                            | 汇安嘉利混合C   | 合计        |
| 光大银行股份有限公司     | 0.00                               | 41,584.83 | 41,584.83 |
| 汇安基金管理有限责任公司   | 0.00                               | 0.00      | 0.00      |
| 合计             | 0.00                               | 41,584.83 | 41,584.83 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间<br>2023年01月01日至2023年06月30日 |           |           |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                   |           |           |
|                | 汇安嘉利混合A                            | 汇安嘉利混合C   | 合计        |
| 中国光大银行股份有限公司   | 0.00                               | 51,864.84 | 51,864.84 |
| 汇安基金管理有限责任公司   | 0.00                               | 736.63    | 736.63    |
| 合计             | 0.00                               | 52,601.47 | 52,601.47 |

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0.40%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：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日C类基金份额的基金资产净值} \times 0.40\% / \text{当年天数}。$$

#### 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

无。

#### 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<br>2024年01月01日至2024年06月30日 |          | 上年度可比期间<br>2023年01月01日至2023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    |
| 中国光大银行股份有限公司 | 1,245,059.29                  | 5,677.17 | 1,271,847.11                       | 11,764.23 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国光大银行股份有限公司保管，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（2024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**

##### **6.4.13.1 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。

#### 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中国光大银行股份有限公司，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。

##### 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<br>2024年06月30日 | 上年度末<br>2023年12月31日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| A-1    | -                  | -                   |

|       |               |               |
|-------|---------------|---------------|
| A-1以下 | -             | -             |
| 未评级   | 10,156,150.69 | 10,052,328.77 |
| 合计    | 10,156,150.69 | 10,052,328.77 |

注：未评级债券为国债。

#### 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

无。

#### 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<br>2024年06月30日 | 上年度末<br>2023年12月31日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| AAA    | 1,304,339.33       | 6,298,239.87        |
| AAA以下  | 16,389,684.26      | 10,581,447.70       |
| 未评级    | 67,219,570.78      | 57,855,593.91       |
| 合计     | 84,913,594.37      | 74,735,281.48       |

注：未评级债券为国债、政策性金融债、中期票据。

#### 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。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 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

#### 6.4.13.3.2 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2024年06月30日，本基金无流动性受限资产。

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06月30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。

#### 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。

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、存出保证金和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。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2024年<br>06月30<br>日 | 1年以内          | 1-5年          | 5年以上 | 不计息          | 合计             |
|----------------------------|---------------|---------------|------|--------------|----------------|
| 资产                         |               |               |      |              |                |
| 货币资金                       | 1,245,059.29  | -             | -    | -            | 1,245,059.29   |
| 结算备付金                      | 163,910.44    | -             | -    | -            | 163,910.44     |
| 存出保证金                      | 14,451.14     | -             | -    | -            | 14,451.14      |
| 交易性                        | 27,332,347.98 | 67,737,397.08 | -    | 8,104,709.60 | 103,174,454.66 |

|          |               |               |      |              |                |
|----------|---------------|---------------|------|--------------|----------------|
| 金融资产     |               |               |      |              |                |
| 买入返售金融资产 | 1,000,000.00  | -             | -    | -            | 1,000,000.00   |
| 应收申购款    | -             | -             | -    | 20,114.00    | 20,114.00      |
| 资产总计     | 29,755,768.85 | 67,737,397.08 | -    | 8,124,823.60 | 105,617,989.53 |
| 负债       |               |               |      |              |                |
| 应付清算款    | -             | -             | -    | 566,650.64   | 566,650.64     |
| 应付赎回款    | -             | -             | -    | 69,119.61    | 69,119.61      |
| 应付管理人报酬  | -             | -             | -    | 87,202.23    | 87,202.23      |
| 应付托管费    | -             | -             | -    | 13,080.33    | 13,080.33      |
| 应付销售服务费  | -             | -             | -    | 7,171.41     | 7,171.41       |
| 应交税费     | -             | -             | -    | 963.74       | 963.74         |
| 其他负债     | -             | -             | -    | 212,403.29   | 212,403.29     |
| 负债总计     | -             | -             | -    | 956,591.25   | 956,591.25     |
| 利率敏感度缺口  | 29,755,768.85 | 67,737,397.08 | -    | 7,168,232.35 | 104,661,398.28 |
| 上年度末     | 1年以内          | 1-5年          | 5年以上 | 不计息          | 合计             |

|                     |               |               |   |               |                |
|---------------------|---------------|---------------|---|---------------|----------------|
| 2023年<br>12月31<br>日 |               |               |   |               |                |
| 资产                  |               |               |   |               |                |
| 货币资金                | 558,285.28    | -             | - | -             | 558,285.28     |
| 结算备<br>付金           | 618,837.18    | -             | - | -             | 618,837.18     |
| 存出保<br>证金           | 46,480.44     | -             | - | -             | 46,480.44      |
| 交易性<br>金融资产         | 30,460,222.48 | 54,327,387.77 | - | 15,838,043.10 | 100,625,653.35 |
| 买入返<br>售金融<br>资产    | 11,010,463.82 | -             | - | -             | 11,010,463.82  |
| 应收申<br>购款           | -             | -             | - | 525.99        | 525.99         |
| 资产总<br>计            | 42,694,289.20 | 54,327,387.77 | - | 15,838,569.09 | 112,860,246.06 |
| 负债                  |               |               |   |               |                |
| 应付赎<br>回款           | -             | -             | - | 277,921.85    | 277,921.85     |
| 应付管<br>理人报<br>酬     | -             | -             | - | 96,544.15     | 96,544.15      |
| 应付托<br>管费           | -             | -             | - | 14,481.64     | 14,481.64      |
| 应付销<br>售服务<br>费     | -             | -             | - | 7,964.44      | 7,964.44       |
| 应交税                 | -             | -             | - | 616.35        | 616.35         |

|         |               |               |   |               |                |
|---------|---------------|---------------|---|---------------|----------------|
| 费       |               |               |   |               |                |
| 其他负债    | -             | -             | - | 177,228.41    | 177,228.41     |
| 负债总计    | -             | -             | - | 574,756.84    | 574,756.84     |
| 利率敏感度缺口 | 42,694,289.20 | 54,327,387.77 | - | 15,263,812.25 | 112,285,489.22 |

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<br>(单位：人民币元) |                     |
|    |                    | 本期末<br>2024年06月30日              | 上年度末<br>2023年12月31日 |
|    | 市场利率下降25个基点        | 516,377.63                      | 466,187.25          |
|    | 市场利率上升25个基点        | -510,345.39                     | -460,780.58         |

#### 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债券和因可转换债券、可交换债券转股所形成的股票，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。本基金投资于股票资产占基金资产的比例为0%—30%。本基金封闭期届满转为开放式运作后，每个交易日日终在扣除股指期货合约和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一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%，在封闭期间，本基金不受上述5%的限制，但每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金。其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。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。

#### 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<br>2024年06月30日 |                          | 上年度末<br>2023年12月31日 |                          |
|---------------|--------------------|--------------------------|---------------------|--------------------------|
|               | 公允价值               | 占基金<br>资产净<br>值比例<br>(%) | 公允价值                | 占基金<br>资产净<br>值比例<br>(%) |
| 交易性金融资产—股票投资  | 8,104,709.60       | 7.74                     | 15,838,043.10       | 14.11                    |
| 交易性金融资产—基金投资  | -                  | -                        | -                   | -                        |
| 交易性金融资产—债券投资  | 17,694,023.59      | 16.91                    | 16,879,687.57       | 15.03                    |
| 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            | 25,798,733.19      | 24.65                    | 32,717,730.67       | 29.14                    |

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 假设 | 除沪深300指数以外的其他变量保持不变 |                             |                     |
|----|---------------------|-----------------------------|---------------------|
| 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<br>2024年06月30日          | 上年度末<br>2023年12月31日 |
|    | 沪深300指数上升5%         | -                           | 781,731.73          |
|    | 沪深300指数下降5%         | -                           | -781,731.73         |

#### 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<br>2024年06月30日 | 上年度末<br>2023年12月31日 |
|---------------|--------------------|---------------------|
| 第一层次          | 25,798,733.19      | 32,717,730.67       |
| 第二层次          | 77,375,721.47      | 67,907,922.68       |
| 第三层次          | -                  | -                   |
| 合计            | 103,174,454.66     | 100,625,653.35      |

###### 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。

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。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2024年6月30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)。

#### 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

截至资产负债表日本基金无需要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              | 8,104,709.60   | 7.67         |
|    | 其中：股票             | 8,104,709.60   | 7.67         |
| 2  | 基金投资              | -              | -            |
| 3  | 固定收益投资            | 95,069,745.06  | 90.01        |
|    | 其中：债券             | 95,069,745.06  | 90.01        |
|    | 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          | 1,000,000.00   | 0.95         |
|    | 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      | 1,408,969.73   | 1.33         |
| 8  | 其他各项资产            | 34,565.14      | 0.03         |
| 9  | 合计                | 105,617,989.53 | 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              | 1,121,100.00 | 1.07         |
| C  | 制造业              | 6,190,860.60 | 5.92         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 255,249.00   | 0.24         |
| 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  | 537,500.00   | 0.51         |
| J  | 金融业              | -            | -            |
| 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               | 8,104,709.60 | 7.74         |

### 7.2.2 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。

## 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  | 600938 | 中国海油  | 18,000 | 594,000.00 | 0.57 |
| 2  | 600519 | 贵州茅台  | 400    | 586,956.00 | 0.56 |
| 3  | 603658 | 安图生物  | 12,200 | 562,054.00 | 0.54 |
| 4  | 600941 | 中国移动  | 5,000  | 537,500.00 | 0.51 |
| 5  | 601899 | 紫金矿业  | 30,000 | 527,100.00 | 0.50 |
| 6  | 600309 | 万华化学  | 6,300  | 509,418.00 | 0.49 |
| 7  | 600079 | 人福医药  | 28,300 | 485,911.00 | 0.46 |
| 8  | 600887 | 伊利股份  | 16,000 | 413,440.00 | 0.40 |
| 9  | 600563 | 法拉电子  | 5,400  | 411,372.00 | 0.39 |
| 10 | 300750 | 宁德时代  | 2,000  | 360,060.00 | 0.34 |
| 11 | 603868 | 飞科电器  | 9,000  | 345,600.00 | 0.33 |
| 12 | 603596 | 伯特利   | 8,540  | 332,206.00 | 0.32 |
| 13 | 002959 | 小熊电器  | 6,700  | 322,337.00 | 0.31 |
| 14 | 002594 | 比亚迪   | 1,200  | 300,300.00 | 0.29 |
| 15 | 300866 | 安克创新  | 4,160  | 296,233.60 | 0.28 |
| 16 | 603338 | 浙江鼎力  | 4,800  | 290,016.00 | 0.28 |
| 17 | 600023 | 浙能电力  | 35,900 | 255,249.00 | 0.24 |
| 18 | 002032 | 苏泊尔   | 4,700  | 235,470.00 | 0.22 |
| 19 | 300633 | 开立医疗  | 5,900  | 233,522.00 | 0.22 |
| 20 | 002129 | TCL中环 | 25,000 | 216,250.00 | 0.21 |
| 21 | 300628 | 亿联网络  | 4,300  | 158,111.00 | 0.15 |
| 22 | 002466 | 天齐锂业  | 4,400  | 131,604.00 | 0.13 |

## 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  | 600309 | 万华化学 | 931,729.00 | 0.83           |

|    |        |      |            |      |
|----|--------|------|------------|------|
| 2  | 002594 | 比亚迪  | 537,304.00 | 0.48 |
| 3  | 600519 | 贵州茅台 | 513,258.00 | 0.46 |
| 4  | 600563 | 法拉电子 | 474,711.00 | 0.42 |
| 5  | 600887 | 伊利股份 | 432,491.00 | 0.39 |
| 6  | 603868 | 飞科电器 | 432,233.00 | 0.38 |
| 7  | 002959 | 小熊电器 | 430,306.00 | 0.38 |
| 8  | 300750 | 宁德时代 | 412,813.20 | 0.37 |
| 9  | 603596 | 伯特利  | 326,100.00 | 0.29 |
| 10 | 603658 | 安图生物 | 323,379.00 | 0.29 |
| 11 | 603338 | 浙江鼎力 | 318,330.00 | 0.28 |
| 12 | 002032 | 苏泊尔  | 269,244.00 | 0.24 |
| 13 | 300866 | 安克创新 | 268,318.00 | 0.24 |
| 14 | 600036 | 招商银行 | 217,285.00 | 0.19 |
| 15 | 300633 | 开立医疗 | 217,036.00 | 0.19 |
| 16 | 600031 | 三一重工 | 216,489.00 | 0.19 |
| 17 | 002466 | 天齐锂业 | 214,710.00 | 0.19 |
| 18 | 300628 | 亿联网络 | 161,535.00 | 0.14 |

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。

#### 7.4.2 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  | 600941 | 中国移动 | 2,076,301.33 | 1.85           |
| 2  | 600938 | 中国海油 | 1,421,601.00 | 1.27           |
| 3  | 601899 | 紫金矿业 | 987,125.00   | 0.88           |
| 4  | 600988 | 赤峰黄金 | 744,214.00   | 0.66           |
| 5  | 603889 | 新澳股份 | 578,754.00   | 0.52           |
| 6  | 600027 | 华电国际 | 558,610.00   | 0.50           |

|    |        |      |            |      |
|----|--------|------|------------|------|
| 7  | 002959 | 小熊电器 | 515,972.00 | 0.46 |
| 8  | 603658 | 安图生物 | 488,495.00 | 0.44 |
| 9  | 600519 | 贵州茅台 | 484,186.00 | 0.43 |
| 10 | 300316 | 晶盛机电 | 436,006.00 | 0.39 |
| 11 | 002585 | 双星新材 | 434,368.00 | 0.39 |
| 12 | 603486 | 科沃斯  | 423,141.00 | 0.38 |
| 13 | 688308 | 欧科亿  | 413,976.02 | 0.37 |
| 14 | 600309 | 万华化学 | 356,720.00 | 0.32 |
| 15 | 603529 | 爱玛科技 | 348,422.00 | 0.31 |
| 16 | 688120 | 华海清科 | 347,223.04 | 0.31 |
| 17 | 600023 | 浙能电力 | 343,680.00 | 0.31 |
| 18 | 603345 | 安井食品 | 337,040.00 | 0.30 |
| 19 | 600600 | 青岛啤酒 | 334,240.00 | 0.30 |
| 20 | 688072 | 拓荆科技 | 311,195.15 | 0.28 |

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。

#### 7.4.3 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 | 6,697,271.20  |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 13,625,981.19 |

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      | 51,079,964.64 | 48.80        |
| 2  | 央行票据      | -             | -            |
| 3  | 金融债券      | 20,834,076.50 | 19.91        |
|    | 其中：政策性金融债 | 20,834,076.50 | 19.91        |
| 4  | 企业债券      | -             | -            |

|    |           |               |       |
|----|-----------|---------------|-------|
| 5  | 企业短期融资券   | -             | -     |
| 6  | 中期票据      | 5,461,680.33  | 5.22  |
| 7  | 可转债(可交换债) | 17,694,023.59 | 16.91 |
| 8  | 同业存单      | -             | -     |
| 9  | 其他        | -             | -     |
| 10 | 合计        | 95,069,745.06 | 90.84 |

### 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  | 230415 | 23农发15 | 200,000 | 20,834,076.50 | 19.91        |
| 2  | 019696 | 23国债03 | 189,000 | 19,309,487.92 | 18.45        |
| 3  | 019725 | 23国债22 | 130,000 | 13,548,528.77 | 12.95        |
| 4  | 019709 | 23国债16 | 100,000 | 10,156,150.69 | 9.70         |
| 5  | 019739 | 24国债08 | 80,000  | 8,065,797.26  | 7.71         |

### 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

本基金本报告期末未持有股指期货。

### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

#### 7.11.2 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。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1 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中，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。

### 7.12.2 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。

### 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 | 14,451.14 |
| 2  | 应收清算款 | -         |
| 3  | 应收股利  | -         |
| 4  | 应收利息  | -         |
| 5  | 应收申购款 | 20,114.00 |
| 6  | 其他应收款 | -         |
| 7  | 待摊费用  | -         |
| 8  | 其他    | -         |
| 9  | 合计    | 34,565.14 |

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码   | 债券名称 | 公允价值         | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|--------------|---------------|
| 1  | 118000 | 嘉元转债 | 1,057,488.83 | 1.01          |
| 2  | 127020 | 中金转债 | 1,003,334.81 | 0.96          |
| 3  | 123179 | 立高转债 | 958,651.93   | 0.92          |
| 4  | 127044 | 蒙娜转债 | 721,102.46   | 0.69          |
| 5  | 123113 | 仙乐转债 | 693,000.00   | 0.66          |
| 6  | 123158 | 宙邦转债 | 656,133.57   | 0.63          |

|    |        |        |            |      |
|----|--------|--------|------------|------|
| 7  | 113657 | 再22转债  | 619,256.08 | 0.59 |
| 8  | 118015 | 芯海转债   | 539,363.45 | 0.52 |
| 9  | 123133 | 佩蒂转债   | 534,483.52 | 0.51 |
| 10 | 113640 | 苏利转债   | 533,990.45 | 0.51 |
| 11 | 113044 | 大秦转债   | 523,153.17 | 0.50 |
| 12 | 132026 | G三峡EB2 | 517,826.30 | 0.49 |
| 13 | 127085 | 韵达转债   | 513,070.72 | 0.49 |
| 14 | 118013 | 道通转债   | 501,348.22 | 0.48 |
| 15 | 118009 | 华锐转债   | 495,720.58 | 0.47 |
| 16 | 113659 | 莱克转债   | 423,983.44 | 0.41 |
| 17 | 118022 | 锂科转债   | 417,666.60 | 0.40 |
| 18 | 113625 | 江山转债   | 408,019.23 | 0.39 |
| 19 | 118037 | 上声转债   | 388,907.28 | 0.37 |
| 20 | 118038 | 金宏转债   | 316,743.72 | 0.30 |
| 21 | 113624 | 正川转债   | 308,400.35 | 0.29 |
| 22 | 110089 | 兴发转债   | 278,700.02 | 0.27 |
| 23 | 110076 | 华海转债   | 273,677.87 | 0.26 |
| 24 | 123121 | 帝尔转债   | 269,002.79 | 0.26 |
| 25 | 110085 | 通22转债  | 263,359.86 | 0.25 |
| 26 | 127051 | 博杰转债   | 261,000.77 | 0.25 |
| 27 | 113047 | 旗滨转债   | 260,971.56 | 0.25 |
| 28 | 127038 | 国微转债   | 259,296.75 | 0.25 |
| 29 | 123210 | 信服转债   | 245,538.88 | 0.23 |
| 30 | 113064 | 东材转债   | 231,644.46 | 0.22 |
| 31 | 127088 | 赫达转债   | 206,904.77 | 0.20 |
| 32 | 118032 | 建龙转债   | 177,832.73 | 0.17 |
| 33 | 113669 | 景23转债  | 150,852.14 | 0.14 |
| 34 | 113045 | 环旭转债   | 149,674.23 | 0.14 |
| 35 | 118033 | 华特转债   | 137,479.29 | 0.13 |
| 36 | 127074 | 麦米转2   | 136,692.87 | 0.13 |
| 37 | 123115 | 捷捷转债   | 135,097.45 | 0.13 |

|    |        |       |            |      |
|----|--------|-------|------------|------|
| 38 | 127031 | 洋丰转债  | 133,877.61 | 0.13 |
| 39 | 113638 | 台21转债 | 133,391.01 | 0.13 |
| 40 | 118024 | 冠宇转债  | 132,681.31 | 0.13 |
| 41 | 123124 | 晶瑞转2  | 132,031.08 | 0.13 |
| 42 | 123109 | 昌红转债  | 132,005.63 | 0.13 |
| 43 | 113677 | 华懋转债  | 132,004.84 | 0.13 |
| 44 | 118006 | 阿拉转债  | 130,948.87 | 0.13 |
| 45 | 113542 | 好客转债  | 129,266.96 | 0.12 |
| 46 | 123093 | 金陵转债  | 129,037.19 | 0.12 |
| 47 | 113627 | 太平转债  | 126,370.90 | 0.12 |
| 48 | 123169 | 正海转债  | 125,399.34 | 0.12 |
| 49 | 113664 | 大元转债  | 125,097.48 | 0.12 |
| 50 | 113641 | 华友转债  | 124,804.43 | 0.12 |
| 51 | 128144 | 利民转债  | 121,963.17 | 0.12 |
| 52 | 118042 | 奥维转债  | 118,386.76 | 0.11 |
| 53 | 123145 | 药石转债  | 70,182.64  | 0.07 |

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

### 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<br>级别 | 持<br>有<br>人<br>户<br>数<br>(户) | 户均持有的<br>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<br>份额<br>比例 | 持有份额  | 占总份<br>额比例 |
|          |                              |               |       |                |       |            |

|         |       |           |      |       |                |         |
|---------|-------|-----------|------|-------|----------------|---------|
| 汇安嘉利混合A | 1,439 | 59,502.18 | 0.00 | 0.00% | 85,623,633.15  | 100.00% |
| 汇安嘉利混合C | 1,446 | 15,362.88 | 0.00 | 0.00% | 22,214,719.69  | 100.00% |
| 合计      | 2,819 | 38,254.12 | 0.00 | 0.00% | 107,838,352.84 | 100.00% |

### 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<br>(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 | 汇安嘉利混合A | 19.88         | 0.0000%  |
|                  | 汇安嘉利混合C | 180.42        | 0.0008%  |
|                  | 合计      | 200.30        | 0.0002%  |

### 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<br>(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 | 汇安嘉利混合A | 0                     |
|                                | 汇安嘉利混合C | 0                     |
|                                | 合计      | 0                     |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 汇安嘉利混合A | 0                     |
|                                | 汇安嘉利混合C | 0                     |
|                                | 合计      | 0                     |

### §9 开放式基金份额变动

单位：份

|  |         |         |
|--|---------|---------|
|  | 汇安嘉利混合A | 汇安嘉利混合C |
|--|---------|---------|



|                            |                  |               |
|----------------------------|------------------|---------------|
| 基金合同生效日(2020年04月21日)基金份额总额 | 1,827,846,911.25 | 32,510.38     |
| 本报告期期初基金份额总额               | 91,819,936.49    | 24,479,323.46 |
| 本报告期基金总申购份额                | 58,167.56        | 86,594.99     |
| 减：本报告期基金总赎回份额              | 6,254,470.90     | 2,351,198.76  |
| 本报告期基金拆分变动份额               | -                | -             |
| 本报告期期末基金份额总额               | 85,623,633.15    | 22,214,719.69 |

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

## §10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本基金在报告期内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。

### 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

本基金在报告期内基金投资策略没有改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

自本基金成立日（2020年4月21日）起至今聘任普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金提供审计服务，本报告期内未发生变动。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 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，基金管理人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

## 10.7.1 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 |    |
| 广发证券   | 1      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 华创证券   | 1      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 申万宏源证券 | 1      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 银河证券   | 1      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 英大证券   | 1      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 长江证券   | 2      | 1,650,181.20  | 8.12%        | 1,214.40  | 8.12%      | -  |
| 川财证券   | 2      | 11,985,687.19 | 58.98%       | 8,819.94  | 58.97%     | -  |
| 东方财富证券 | 2      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 东兴证券   | 2      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 国信证券   | 2      | 2,164,152.00  | 10.65%       | 1,592.63  | 10.65%     | -  |
| 中泰证券   | 2      | -             | -            | -         | -          | -  |

|          |   |              |        |          |        |   |
|----------|---|--------------|--------|----------|--------|---|
| 中信<br>证券 | 2 | 4,523,232.00 | 22.26% | 3,328.65 | 22.26% | - |
|----------|---|--------------|--------|----------|--------|---|

注：

选择专用席位的标准和程序：

(1) 选择标准

- 1、综合实力较强、市场信誉良好；
- 2、财务状况良好，经营状况稳健；
- 3、经营行为规范，具备健全的内部控制制度；
- 4、研究实力较强，并能够第一时间提供丰富的高质量研究咨询报告，并能根据特定要求提供定制研究报告；能够积极进行业务交流，定期进行观点交流和路演；能够提供实地调研等多种类型的研究服务；
- 5、具有佣金费率优势，具备支持交易的安全、稳定、便捷、高效的通讯条件和交易环境，能提供全面的交易信息服务；
- 6、从制度上和技术上保证管理人租用交易单元的交易信息严格保密。

(2) 选择程序

- 1、本基金管理人根据上述标准进行评估并确定选用的券商。
- 2、本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议。

(3) 交易单元变更情况

本基金本报告期内新增交易单元:长江证券1个、中信证券2个,退租交易单元:长江证券1个、申万宏源证券1个。

### 10.7.2 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 |
| 广发证券 | -    | -            | -      | -              | -    | -            | -    | -            |
| 华创证券 | -    | -            | -      | -              | -    | -            | -    | -            |
| 申万宏源 | -    | -            | -      | -              | -    | -            | -    | -            |

|        |               |        |                |        |   |   |   |   |
|--------|---------------|--------|----------------|--------|---|---|---|---|
| 证券     |               |        |                |        |   |   |   |   |
| 银河证券   | -             | -      | -              | -      | - | - | - | - |
| 英大证券   | -             | -      | 21,000,000.00  | 4.27%  | - | - | - | - |
| 长江证券   | 7,288,987.27  | 7.40%  | -              | -      | - | - | - | - |
| 川财证券   | 54,565,913.03 | 55.40% | 456,800,000.00 | 92.88% | - | - | - | - |
| 东方财富证券 | -             | -      | -              | -      | - | - | - | - |
| 东兴证券   | -             | -      | -              | -      | - | - | - | - |
| 国信证券   | 6,610,124.57  | 6.71%  | -              | -      | - | - | - | - |
| 中泰证券   | -             | -      | -              | -      | - | - | - | - |
| 中信证券   | 30,028,823.92 | 30.49% | 14,000,000.00  | 2.85%  | - | - | - | - |

### 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  | 汇安嘉利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  | 汇安嘉利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 |
| 4  | 汇安嘉利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 | 2024-04-19 |
| 5  | 汇安嘉利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 | 2024-04-19 |
| 6  | 汇安嘉利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 |

|   |                           |             |            |
|---|---------------------------|-------------|------------|
| 7 | 汇安嘉利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 |
|---|---------------------------|-------------|------------|

## §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。

## §12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会批准汇安嘉利一年封闭运作混合型证券投资基金募集的文件
- (2) 《汇安嘉利混合型证券投资基金基金合同》
- (3) 《汇安嘉利混合型证券投资基金招募说明书》
- (4) 《汇安嘉利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

### 12.2 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

### 12.3 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  
二〇二四年八月三十一日