汇安丰恒灵活配置混合型证券投资基金

2025 年中期报告

2025 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:上海浦东发展银行股份有限公司

送出日期:2025 年 08 月 30 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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2025年8月29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2025年1月1日起至2025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 6
2.4 信息披露方式 6
2.5 其他相关资料 6
§3 主要财务指标和基金净值表现 7
3.1 主要会计数据和财务指标 7
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 14
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 15
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 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 19
6.4 报表附注 21
§7 投资组合报告 45
7.1 期末基金资产组合情况 45
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 46
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 46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 72
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 74
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 75
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 75
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 75
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 75
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 76
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 76
7.12 投资组合报告附注 76
§8 基金份额持有人信息 77

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 77
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 77
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 78
§9 开放式基金份额变动 78
§10 重大事件揭示 78
10.1 基金份额持有人大会决议 78
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 78
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 78
10.4 基金投资策略的改变 79
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 79
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 79
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 79
10.8 其他重大事件 80
§11 影响投资者决策的其他重要信息 81
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 81
§12 备查文件目录 81
12.1 备查文件目录 81
12.2 存放地点 81
12.3 查阅方式 81

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	汇安丰恒灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	汇安丰恒混合	
基金主代码	003845	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017年03月13日	
基金管理人	汇安基金管理有限责任公司	
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	358,380,176.34份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	汇安丰恒混合A	汇安丰恒混合C
下属分级基金的交易代码	003845	003846
报告期末下属分级基金的份额总额	6,665,022.69份	351,715,153.65份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在深入的基本面研究的基础上，通过灵活的资产配置、策略配置与严谨的风险管理，力争实现基金资产的持续稳定增值。
投资策略	本基金通过合理稳健的资产配置策略，进行积极主动的股票投资和债券投资，把握中国经济增长和资本市场发展机遇，严格控制下行风险，力争实现基金份额净值的长期平稳增长。 本基金投资策略主要包括资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、股指期货和国债期货投资策略、权证投资策略、存托凭证投资策略等。
业绩比较基准	中证中信证券量化债股优选稳健策略指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5%
风险收益特征	本基金为混合型基金，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。

注：自2024年3月15日起，本基金的业绩比较基准由原来的“沪深300指数收益率×50%+上证国债指数收益率×50%”修改为“中证中信证券量化债股优选稳健策略指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5%”

2.3 基金管理人和基金托管人

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

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金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(2025年01月01日-2025年06月30日)	
	汇安丰恒混合A	汇安丰恒混合C
本期已实现收益	93,471.67	6,397,350.66
本期利润	94,167.58	5,126,214.96
加权平均基金份额本期利润	0.0137	0.0109
本期加权平均净值利润率	1.46%	1.07%
本期基金份额净值增长率	1.65%	1.60%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025年06月30日)	
期末可供分配利润	-2,853,256.94	-125,724,149.90
期末可供分配基金份额利润	-0.4281	-0.3575
期末基金资产净值	6,328,388.64	362,194,197.29
期末基金份额净值	0.9495	1.0298
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	-5.05%	2.98%

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

汇安丰恒混合A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.13%	0.09%	0.68%	0.12%	0.45%	-0.03%
过去三个月	1.94%	0.10%	0.93%	0.13%	1.01%	-0.03%
过去六个月	1.65%	0.11%	1.46%	0.13%	0.19%	-0.02%
过去一年	5.57%	0.16%	4.60%	0.17%	0.97%	-0.01%
过去三年	-6.55%	0.49%	-2.58%	0.38%	-3.97%	0.11%
自基金合同生效起至今	-5.05%	0.60%	26.30%	0.54%	-31.35%	0.06%

汇安丰恒混合C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.12%	0.09%	0.68%	0.12%	0.44%	-0.03%
过去三个月	1.92%	0.10%	0.93%	0.13%	0.99%	-0.03%
过去六个月	1.60%	0.11%	1.46%	0.13%	0.14%	-0.02%
过去一年	5.48%	0.16%	4.60%	0.17%	0.88%	-0.01%
过去三年	-6.78%	0.49%	-2.58%	0.38%	-4.20%	0.11%
自基金合同生效起至今	2.98%	0.62%	26.30%	0.54%	-23.32%	0.08%

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

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注：①本报告期，本基金投资比例符合基金合同要求。

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

§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2025年6月30日，公司旗下管理68只公募基金

汇安嘉源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

汇安嘉裕纯债债券型证券投资基金

汇安多策略灵活配置混合型证券投资基金

汇安资产轮动灵活配置混合型证券投资基金

汇安裕华纯债定期开放债券型发起式证券投资基金

汇安成长优选灵活配置混合型证券投资基金

汇安稳裕债券型证券投资基金

汇安趋势动力股票型证券投资基金

汇安量化优选灵活配置混合型证券投资基金

汇安裕阳三年持有期混合型证券投资基金

汇安短债债券型证券投资基金

汇安嘉鑫纯债债券型证券投资基金

富时中国A50交易型开放式指数证券投资基金

汇安核心成长混合型证券投资基金

汇安鼎利纯债债券型证券投资基金

汇安多因子混合型证券投资基金

汇安行业龙头混合型证券投资基金

汇安中短债债券型证券投资基金

汇安嘉诚债券型证券投资基金

汇安量化先锋混合型证券投资基金

汇安中债-广西壮族自治区公司信用类债券指数证券投资基金

汇安宜创量化精选混合型证券投资基金

汇安嘉盛纯债债券型证券投资基金

汇安信利债券型证券投资基金

汇安裕和纯债债券型证券投资基金

汇安上证证券交易型开放式指数证券投资基金

汇安嘉利混合型证券投资基金
汇安核心资产混合型证券投资基金
汇安裕鑫12个月定期开放纯债债券型发起式证券投资基金
汇安价值蓝筹混合型证券投资基金
汇安消费龙头混合型证券投资基金
汇安恒鑫12个月定期开放纯债债券型发起式证券投资基金
汇安中证500指数增强型证券投资基金
汇安泓阳三年持有期混合型证券投资基金
汇安恒利39个月定期开放纯债债券型证券投资基金
汇安盛鑫三年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金
汇安嘉盈一年持有期债券型证券投资基金
汇安均衡优选混合型证券投资基金
汇安核心价值混合型证券投资基金
汇安鑫利优选混合型证券投资基金
汇安泓利一年持有期混合型证券投资基金
汇安鑫泽稳健一年持有期混合型证券投资基金
汇安信泰稳健一年持有期混合型证券投资基金
汇安优势企业精选混合型证券投资基金
汇安永利30天持有期短债债券型证券投资基金
汇安润阳三年持有期混合型证券投资基金
汇安永福90天持有期中短债债券型证券投资基金
汇安裕同纯债债券型证券投资基金
汇安添利18个月持有期混合型证券投资基金
汇安远见成长混合型证券投资基金
汇安品质优选混合型证券投资基金
汇安价值先锋混合型证券投资基金
汇安裕盈纯债债券型证券投资基金
汇安裕泰纯债债券型证券投资基金
汇安中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金
汇安均衡成长混合型证券投资基金
汇安行业优选混合型证券投资基金
汇安中债0-3年政策性金融债指数证券投资基金
汇安景气成长混合型证券投资基金
汇安中证A500指数证券投资基金
汇安裕宏利率债债券型证券投资基金

汇安聚利债券型证券投资基金

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	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
金鸿峰	多策略组基金经理、本基金的基金经理	2021-07-13	-	9年	金鸿峰女士，中央财经大学国防经济学硕士研究生，9年证券、基金行业从业经验。曾任北京市农产品电子商务公司市场部经理，2016年5月加入汇安基金管理有限责任公司，现任多策略组基金经理。 2021年7月23日至2022年7月28日，任汇安嘉裕纯债债券型证券投资基金基金经理；2021年8月4日至2022年8月16日，任汇安裕和纯债债券型证券投资基金基金经理；2021年7月13日至2025年3月4日，任汇安中债-广西壮族自治区公司信用类债券指数证券投资基金基金经理；2021年7月13日至今，任汇安嘉汇纯债债券型证券投资基金基金经理；2021年7月13日至今，任汇安丰恒灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2021年7月23日至今，任汇安嘉源纯债债券型证券投资基金基金经理；2021

					年7月28日至今，任汇安嘉鑫纯债债券型证券投资基金基金经理；2021年7月28日至今，任汇安鼎利纯债债券型证券投资基金基金经理；2021年8月4日至今，任汇安嘉盛纯债债券型证券投资基金基金经理；2022年8月16日至今，任汇安稳裕债券型证券投资基金基金经理；2022年11月8日至今，任汇安裕泰纯债债券型证券投资基金基金经理；2024年9月25日至今，任汇安中债0-3年政策性金融债指数证券投资基金基金经理；2025年3月4日至今，任汇安嘉盈一年持有期债券型证券投资基金基金经理。

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。

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遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

2025年一季度，利率债短端收益率率先上行，而长端收益率继续下行，且创新低，此后开始调整。一季度降准降息预期降低，叠加央行对流动性的态度较为谨慎，导致市场流动性偏紧。降准降息预期逐步修正的过程中，利率债和信用债的收益率均大幅度调整。债市曲线整体走平。二季度，债市在关税扰动的影响下，利率债收益率快速下行，信用利差随后开始压缩。此后债市进入窄幅波动的行情。本产品债券部分持有中高等级信用债，并以配置策略为主，并根据申赎情况灵活调整杠杆和久期。权益部分的配置较为分散。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末汇安丰恒混合A基金份额净值为0.9495元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为1.65%，同期业绩比较基准收益率为1.46%；截至报告期末汇安丰恒混合C基金份额净值为1.0298元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为1.60%，同期业绩比较基准收益率为1.46%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

今年我国经济形势总体平稳、稳中向好，基本面数据和价格指标均有亮点，但当前内外部压力依然较大。外部环境复杂多变，内部产需分化。下半年有望出台更多的增量政策。同时继续关注反内卷、扩内需、促改革等举措。稳地产有望继续加力提效。对债市的判断依然是低位窄幅波动的态势。基本面和价格指标以及相对宽松的流动性环境不

支持债市大幅度调整，但风险偏好的缓慢抬升以及资金价格的坚挺，让收益率的下行空间受阻。这个也在一定程度上限制了信用债的进一步下行空间。

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

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对汇安丰恒灵活配置混合型证券投资基金的投资运作

进行了监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支以及利润分配等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：汇安丰恒灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2025年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2025年06月30日	上年度末 2024年12月31日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	20,016,202.12	30,928,654.51
结算备付金		1,025.78	1,025.78
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	414,304,039.11	490,760,463.51
其中：股票投资		71,446,435.62	39,225,075.48
基金投资		-	-
债券投资		342,857,603.49	451,535,388.03
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	-	-
应收清算款		-	-

应收股利		-	-
应收申购款		2,399,102.78	27,440,058.96
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		436,720,369.79	549,130,202.76
负债和净资产	**附注号**	本期末 2025年06月30日	上年度末 2024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		60,199,398.00	-1,056.10
应付清算款		-	-
应付赎回款		7,622,270.69	8,001,698.28
应付管理人报酬		194,392.13	237,869.36
应付托管费		32,398.66	39,644.91
应付销售服务费		31,876.62	39,210.58
应付投资顾问费		-	-
应交税费		28,514.70	46,094.26
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	88,933.06	192,314.32
负债合计		68,197,783.86	8,555,775.61
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	358,380,176.34	533,816,892.76
未分配利润	6.4.7.8	10,142,409.59	6,757,534.39
净资产合计		368,522,585.93	540,574,427.15
负债和净资产总计		436,720,369.79	549,130,202.76

注：报告截止日2025年6月30日，基金份额总额358,380,176.34份，其中汇安丰恒混合A基金份额净值0.9495元，份额总额6,665,022.69份；汇安丰恒混合C基金份额净值1.0298元，份额总额351,715,153.65份。

6.2 利润表

会计主体：汇安丰恒灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2025年01月01日至2025年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2025年01月01日至2025年06月30日	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年06月30日
一、营业总收入		7,838,138.93	37,045,142.37
1.利息收入		35,262.38	346,640.66
其中：存款利息收入	6.4.7.9	35,262.38	287,266.71
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	59,373.95
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		8,832,026.26	25,878,842.05
其中：股票投资收益	6.4.7.10	1,903,859.98	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	6,011,086.13	25,878,842.05
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	917,080.15	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-1,270,439.79	9,957,841.44
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-

5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	241,290.08	861,818.22
减：二、营业总支出		2,617,756.39	5,908,440.68
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	1,445,918.11	3,683,470.97
2.托管费	6.4.10.2.2	240,986.27	613,911.90
3.销售服务费	6.4.10.2.3	237,774.66	612,051.10
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		557,896.98	819,735.45
其中：卖出回购金融资产支出		557,896.98	819,735.45
6.信用减值损失		-	-
7.税金及附加		24,745.29	59,009.14
8.其他费用	6.4.7.18	110,435.08	120,262.12
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		5,220,382.54	31,136,701.69
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		5,220,382.54	31,136,701.69
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		5,220,382.54	31,136,701.69

6.3 净资产变动表

会计主体：汇安丰恒灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2025年01月01日至2025年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 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	533,816,892.76	6,757,534.39	540,574,427.15
二、本期期初净资	533,816,892.76	6,757,534.39	540,574,427.15

产			
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-175,436,716.42	3,384,875.20	-172,051,841.22
（一）、综合收益总额	-	5,220,382.54	5,220,382.54
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-175,436,716.42	-1,835,507.34	-177,272,223.76
其中：1.基金申购款	565,123,883.13	9,258,627.71	574,382,510.84
2.基金赎回款	-740,560,599.55	-11,094,135.05	-751,654,734.60
（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	358,380,176.34	10,142,409.59	368,522,585.93
项 目	上年度可比期间 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	307,802,564.68	-15,182,734.33	292,619,830.35
二、本期期初净资产	307,802,564.68	-15,182,734.33	292,619,830.35
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	891,663,349.67	-13,773,623.57	877,889,726.10
（一）、综合收益总额	-	31,136,701.69	31,136,701.69

（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）	891,663,349.67	-44,910,325.26	846,753,024.41
其中：1.基金申购款	4,302,389,485.18	-160,732,279.01	4,141,657,206.17
2.基金赎回款	-3,410,726,135.51	115,821,953.75	-3,294,904,181.76
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	1,199,465,914.35	-28,956,357.90	1,170,509,556.45

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

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

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《汇安丰恒灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票) 、存托凭证、债券(包括国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、可转换债券、中小企业私募债等)、债券回购、同业存单、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。 本基金的投资组合比例为：股票资产投资比例为基金资产的0-95%；每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值的5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等；权证、股指期货、国债期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的原业绩比较基准为：沪深300指数收益率×50%+上证国债指数收益率×50%，根据本基金的基金管理人汇安基金管理有限责任公司于2024年3月15日发布的《汇安基金管理有限责任公司关于汇安丰恒灵活配置混合型证券投资基金变更业绩比较基准并修改基金合同的公告》，本基金的业绩比较基准自2024年3月15日变更为：中证中信证券量化债股优选稳健策略指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5%。

本财务报表由本基金的基金管理人汇安基金管理有限责任公司于2025年8月28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》、《汇安丰恒灵活配置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2025年6月30日的财务状况以及2025年1月1日至2025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 2025年06月30日
活期存款	768,902.32
等于：本金	768,526.69
加：应计利息	375.63
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	19,247,299.80
等于：本金	19,247,099.70
加：应计利息	200.10
减：坏账准备	-
合计	20,016,202.12

注：其他存款本期末余额为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025年06月30日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		69,095,652.45	-	71,446,435.62	2,350,783.17
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	189,114,683.38	2,225,847.68	194,371,847.68	3,031,316.62
	银行间市场	144,558,465.74	1,861,755.81	148,485,755.81	2,065,534.26
	合计	333,673,149.12	4,087,603.49	342,857,603.49	5,096,850.88
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		402,768,801.57	4,087,603.49	414,304,039.11	7,447,634.05

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

无。

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 2025年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	125.08
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	1,152.50
其中：交易所市场	-
银行间市场	1,152.50
应付利息	-
预提费用-审计费	24,795.19
预提费用-信息披露费	59,507.37
其他应付	3,352.92
合计	88,933.06

6.4.7.7 实收基金

6.4.7.7.1 汇安丰恒混合A

金额单位：人民币元

项目 (汇安丰恒混合A)	本期 2025年01月01日至2025年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	6,363,004.57	6,363,004.57
本期申购	4,450,941.72	4,450,941.72

本期赎回（以“-”号填列）	-4,148,923.60	-4,148,923.60
本期末	6,665,022.69	6,665,022.69

6.4.7.7.2 汇安丰恒混合C

金额单位：人民币元

项目 (汇安丰恒混合C)	本期 2025年01月01日至2025年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	527,453,888.19	527,453,888.19
本期申购	560,672,941.41	560,672,941.41
本期赎回（以“-”号填列）	-736,411,675.95	-736,411,675.95
本期末	351,715,153.65	351,715,153.65

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 汇安丰恒混合A

单位：人民币元

项目 (汇安丰恒混合A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-2,811,123.22	2,391,973.55	-419,149.67
本期期初	-2,811,123.22	2,391,973.55	-419,149.67
本期利润	93,471.67	695.91	94,167.58
本期基金份额交易产生的变动数	-135,605.39	123,953.43	-11,651.96
其中：基金申购款	-1,956,553.48	1,679,042.00	-277,511.48
基金赎回款	1,820,948.09	-1,555,088.57	265,859.52
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-2,853,256.94	2,516,622.89	-336,634.05

6.4.7.8.2 汇安丰恒混合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

(汇安丰恒混合C)			
上年度末	-196,120,765.21	203,297,449.27	7,176,684.06
本期期初	-196,120,765.21	203,297,449.27	7,176,684.06
本期利润	6,397,350.66	-1,271,135.70	5,126,214.96
本期基金份额交易产生的变动数	63,999,264.65	-65,823,120.03	-1,823,855.38
其中：基金申购款	-205,933,233.69	215,469,372.88	9,536,139.19
基金赎回款	269,932,498.34	-281,292,492.91	-11,359,994.57
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-125,724,149.90	136,203,193.54	10,479,043.64

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年06月30日
活期存款利息收入	28,248.78
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	7,013.60
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	35,262.38

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 2025年01月01日至2025年06月30日
卖出股票成交总额	98,061,849.10
减：卖出股票成本总额	95,993,472.39
减：交易费用	164,516.73
买卖股票差价收入	1,903,859.98

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 2025年01月01日至2025年06月30日
债券投资收益——利息收入	7,571,719.32
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-1,560,633.19
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	6,011,086.13

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 2025年01月01日至2025年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	215,725,088.21
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	212,114,751.27
减：应计利息总额	5,155,606.57
减：交易费用	15,363.56
买卖债券差价收入	-1,560,633.19

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 2025年01月01日至2025年06月30日
股票投资产生的股利收益	917,080.15
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	917,080.15

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025年01月01日至2025年06月30日
1.交易性金融资产	-1,270,439.79
——股票投资	122,622.91
——债券投资	-1,393,062.70
——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	-1,270,439.79

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期

	2025年01月01日至2025年06月30日
基金赎回费收入	241,285.10
转换费收入	4.98
合计	241,290.08

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年06月30日
审计费用	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
汇划手续费	7,532.52
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	110,435.08

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
上海浦东发展银行股份有限公司	基金托管人

何斌	基金管理人的股东
秦军	基金管理人的股东
郭小峰	基金管理人的股东
任建辉	基金管理人的股东
刘强	基金管理人的股东
郭兆强	基金管理人的股东
尹喜杰	基金管理人的股东
王福德	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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 2025年01月01日至2025年06月30日	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,445,918.11	3,683,470.97

其中：应支付销售机构的客户维护费	642,805.30	1,442,443.36
应支付基金管理人的净管理费	803,112.81	2,241,027.61

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

其计算公式为：日基金管理人报酬＝前一日基金资产净值×0.6%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年06月30日	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	240,986.27	613,911.90

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

日托管费＝前一日基金资产净值×0.10%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

无。

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

日销售服务费＝前一日C类基金份额的基金资产净值× 0.10% / 当年天数。

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 2025年01月01日至2025年06月30日		上年度可比期间 2024年01月01日至2024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
上海浦东发展银行股份有限公司	768,902.32	28,248.78	33,194,827.21	246,449.84

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

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（2025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

截至本报告期末2025年06月30日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额60,199,398.00元，截至2025年07月01日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

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上海浦东发展银行股份有限公司及券商结算账户，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

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 2025年06月30日	上年度末 2024年12月31日
AAA	208,319,332.25	197,713,390.33
AAA以下	30,975,386.31	97,334,365.47
未评级	103,562,884.93	156,487,632.23

合计	342,857,603.49	451,535,388.03

注：未评级债券为公司债、中期票据、国债。

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2025年06月30日，除卖出回购金融资产款余额中有60,199,398.00元将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他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，因此账面余额约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时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家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2025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2025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2025年06月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	20,016,202.12	-	-	-	20,016,202.12
结算备付金	1,025.78	-	-	-	1,025.78
交易性金融资产	68,693,794.53	103,963,076.16	170,200,732.80	71,446,435.62	414,304,039.11
应收申购款	-	-	-	2,399,102.78	2,399,102.78
资产总计	88,711,022.43	103,963,076.16	170,200,732.80	73,845,538.40	436,720,369.79
负债					
卖出回购金融资产款	60,199,398.00	-	-	-	60,199,398.00
应付赎回款	-	-	-	7,622,270.69	7,622,270.69
应付管理人报酬	-	-	-	194,392.13	194,392.13
应付托管费	-	-	-	32,398.66	32,398.66
应付销售服务费	-	-	-	31,876.62	31,876.62

应交税费	-	-	-	28,514.70	28,514.70
其他负债	-	-	-	88,933.06	88,933.06
负债总计	60,199,398.00	-	-	7,998,385.86	68,197,783.86
利率敏感度缺口	28,511,624.43	103,963,076.16	170,200,732.80	65,847,152.54	368,522,585.93
上年度末2024年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	30,928,654.51	-	-	-	30,928,654.51
结算备付金	1,025.78	-	-	-	1,025.78
交易性金融资产	115,987,381.82	144,396,045.74	191,151,960.47	39,225,075.48	490,760,463.51
应收申购款	-	-	-	27,440,058.96	27,440,058.96
资产总计	146,917,062.11	144,396,045.74	191,151,960.47	66,665,134.44	549,130,202.76
负债					
卖出回购金融资产款	-1,056.10	-	-	-	-1,056.10
应付赎回款	-	-	-	8,001,698.28	8,001,698.28

应付管理人报酬	-	-	-	237,869.36	237,869.36
应付托管费	-	-	-	39,644.91	39,644.91
应付销售服务费	-	-	-	39,210.58	39,210.58
应交税费	-	-	-	46,094.26	46,094.26
其他负债	-	-	-	192,314.32	192,314.32
负债总计	-1,056.10	-	-	8,556,831.71	8,555,775.61
利率敏感度缺口	146,918,118.21	144,396,045.74	191,151,960.47	58,108,302.73	540,574,427.15

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2025年06月30日	上年度末 2024年12月31日
	市场利率下降25个基点	4,230,264.18	5,044,557.81
	市场利率上升25个基点	-4,123,703.79	-4,894,710.50

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票资产投资比例为基金资产的0-95%，每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值的5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；权证、股指期货、国债期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

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 2025年06月30日		上年度末 2024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	71,446,435.62	19.39	39,225,075.48	7.26
交易性金融资产－基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产－债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产－贵金属投	-	-	-	-

资				
衍生金融资产－权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	71,446,435.62	19.39	39,225,075.48	7.26

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于2025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资产净值的比例为19.39%(2024年12月31日：7.26%)，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响(2024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 2025年06月30日	上年度末 2024年12月31日
第一层次	71,446,435.62	39,212,801.48
第二层次	342,857,603.49	451,547,662.03
第三层次	-	-
合计	414,304,039.11	490,760,463.51

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2025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(2024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	71,446,435.62	16.36
	其中：股票	71,446,435.62	16.36
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	342,857,603.49	78.51
	其中：债券	342,857,603.49	78.51
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	20,017,227.90	4.58
8	其他各项资产	2,399,102.78	0.55

9	合计	436,720,369.79	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	258,347.00	0.07
B	采矿业	5,548,490.50	1.51
C	制造业	33,114,353.21	8.99
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,742,903.00	0.74
E	建筑业	1,286,060.00	0.35
F	批发和零售业	1,265,164.00	0.34
G	交通运输、仓储和邮政业	2,156,551.00	0.59
H	住宿和餐饮业	136,224.00	0.04
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,112,195.47	1.12
J	金融业	18,012,952.62	4.89
K	房地产业	881,720.00	0.24
L	租赁和商务服务业	528,308.80	0.14
M	科学研究和技术服务业	294,700.82	0.08
N	水利、环境和公共设施管理业	160,180.00	0.04
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	45,594.00	0.01
Q	卫生和社会工作	243,912.20	0.07
R	文化、体育和娱乐业	529,686.00	0.14
S	综合	129,093.00	0.04
	合计	71,446,435.62	19.39

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	601288	农业银行	518,500	3,048,780.00	0.83
2	601398	工商银行	294,000	2,231,460.00	0.61
3	600519	贵州茅台	1,300	1,832,376.00	0.50
4	601857	中国石油	182,200	1,557,810.00	0.42
5	601988	中国银行	231,100	1,298,782.00	0.35
6	601628	中国人寿	23,600	972,084.00	0.26
7	601658	邮储银行	144,500	790,415.00	0.21
8	601728	中国电信	97,700	757,175.00	0.21
9	601088	中国神华	17,500	709,450.00	0.19
10	600028	中国石化	105,400	594,456.00	0.16
11	600900	长江电力	17,300	521,422.00	0.14
12	601138	工业富联	20,400	436,152.00	0.12
13	601998	中信银行	50,300	427,550.00	0.12
14	601318	中国平安	7,500	416,100.00	0.11
15	601166	兴业银行	17,100	399,114.00	0.11
16	002594	比亚迪	1,200	398,292.00	0.11
17	600418	江淮汽车	9,900	396,891.00	0.11
18	601319	中国人保	39,700	345,787.00	0.09
19	000858	五 粮 液	2,800	332,920.00	0.09
20	601211	国泰海通	16,962	324,991.92	0.09
21	601899	紫金矿业	15,900	310,050.00	0.08
22	600809	山西汾酒	1,700	299,863.00	0.08
23	600276	恒瑞医药	5,400	280,260.00	0.08
24	600030	中信证券	9,500	262,390.00	0.07
25	002625	光启技术	6,500	259,870.00	0.07
26	601816	京沪高铁	45,000	258,750.00	0.07
27	002384	东山精密	6,600	249,282.00	0.07
28	601328	交通银行	31,100	248,800.00	0.07

29	601601	中国太保	6,200	232,562.00	0.06
30	600036	招商银行	4,900	225,155.00	0.06
31	601668	中国建筑	38,600	222,722.00	0.06
32	603288	海天味业	5,700	221,787.00	0.06
33	600988	赤峰黄金	8,800	218,944.00	0.06
34	600887	伊利股份	7,800	217,464.00	0.06
35	600839	四川长虹	21,100	205,092.00	0.06
36	601555	东吴证券	22,600	197,750.00	0.05
37	603893	瑞芯微	1,300	197,418.00	0.05
38	601162	天风证券	39,900	196,707.00	0.05
39	000988	华工科技	4,100	192,741.00	0.05
40	600025	华能水电	20,000	191,000.00	0.05
41	601818	光大银行	45,300	187,995.00	0.05
42	000333	美的集团	2,600	187,720.00	0.05
43	601225	陕西煤业	9,400	180,856.00	0.05
44	600398	海澜之家	25,800	179,568.00	0.05
45	601933	永辉超市	36,600	179,340.00	0.05
46	002371	北方华创	400	176,884.00	0.05
47	300750	宁德时代	700	176,554.00	0.05
48	302132	中航成飞	2,000	175,880.00	0.05
49	002517	恺英网络	9,000	173,790.00	0.05
50	601066	中信建投	7,200	173,160.00	0.05
51	600536	中国软件	3,700	173,049.00	0.05
52	300502	新易盛	1,360	172,747.20	0.05
53	603160	汇顶科技	2,400	170,472.00	0.05
54	600050	中国联通	31,900	170,346.00	0.05
55	600760	中航沈飞	2,900	169,998.00	0.05
56	600104	上汽集团	10,500	168,525.00	0.05
57	601168	西部矿业	10,100	167,963.00	0.05
58	600096	云天化	7,600	166,972.00	0.05
59	600406	国电南瑞	7,300	163,593.00	0.04

60	002415	海康威视	5,700	158,061.00	0.04
61	601577	长沙银行	15,900	158,046.00	0.04
62	601108	财通证券	19,800	156,618.00	0.04
63	603993	洛阳钼业	18,600	156,612.00	0.04
64	601766	中国中车	22,200	156,288.00	0.04
65	601985	中国核电	16,600	154,712.00	0.04
66	605499	东鹏饮料	490	153,884.50	0.04
67	600885	宏发股份	6,860	153,046.60	0.04
68	601216	君正集团	27,700	152,904.00	0.04
69	600352	浙江龙盛	14,900	151,384.00	0.04
70	600016	民生银行	31,300	148,675.00	0.04
71	600309	万华化学	2,700	146,502.00	0.04
72	603228	景旺电子	3,500	146,440.00	0.04
73	002558	巨人网络	6,200	146,010.00	0.04
74	600018	上港集团	25,400	145,034.00	0.04
75	603606	东方电缆	2,800	144,788.00	0.04
76	600497	驰宏锌锗	27,300	144,417.00	0.04
77	600862	中航高科	5,500	143,440.00	0.04
78	002294	信立泰	3,000	141,990.00	0.04
79	601633	长城汽车	6,600	141,768.00	0.04
80	600895	张江高科	5,500	141,350.00	0.04
81	600436	片仔癀	700	140,007.00	0.04
82	600019	宝钢股份	21,200	139,708.00	0.04
83	600109	国金证券	15,800	138,566.00	0.04
84	000568	泸州老窖	1,200	136,080.00	0.04
85	603979	金诚信	2,900	134,676.00	0.04
86	600690	海尔智家	5,400	133,812.00	0.04
87	600177	雅戈尔	18,200	132,860.00	0.04
88	002340	格林美	20,900	132,715.00	0.04
89	603596	伯特利	2,500	131,725.00	0.04
90	002352	顺丰控股	2,700	131,652.00	0.04

91	000001	平安银行	10,900	131,563.00	0.04
92	601611	中国核建	14,300	131,417.00	0.04
93	601077	渝农商行	18,200	129,948.00	0.04
94	600879	航天电子	12,400	129,828.00	0.04
95	600066	宇通客车	5,200	129,272.00	0.04
96	600673	东阳光	11,100	129,093.00	0.04
97	601128	常熟银行	17,510	129,048.70	0.04
98	601336	新华保险	2,200	128,700.00	0.03
99	600873	梅花生物	12,000	128,280.00	0.03
100	000066	中国长城	8,600	127,280.00	0.03
101	600298	安琪酵母	3,600	126,612.00	0.03
102	002273	水晶光电	6,300	125,811.00	0.03
103	600350	山东高速	11,800	125,788.00	0.03
104	600580	卧龙电驱	6,360	125,737.20	0.03
105	603529	爱玛科技	3,600	123,840.00	0.03
106	002261	拓维信息	4,000	123,800.00	0.03
107	601939	建设银行	13,100	123,664.00	0.03
108	600999	招商证券	7,000	123,130.00	0.03
109	600989	宝丰能源	7,600	122,664.00	0.03
110	601229	上海银行	11,500	122,015.00	0.03
111	601888	中国中免	2,000	121,940.00	0.03
112	601615	明阳智能	10,600	121,794.00	0.03
113	600549	厦门钨业	5,800	121,336.00	0.03
114	002195	岩山科技	21,500	121,045.00	0.03
115	300476	胜宏科技	900	120,942.00	0.03
116	601169	北京银行	17,700	120,891.00	0.03
117	688256	寒武纪	200	120,300.00	0.03
118	600031	三一重工	6,700	120,265.00	0.03
119	600015	华夏银行	15,200	120,232.00	0.03
120	600118	中国卫星	4,200	119,994.00	0.03
121	000997	新 大 陆	3,700	119,806.00	0.03

122	600660	福耀玻璃	2,100	119,721.00	0.03
123	600060	海信视像	5,200	119,704.00	0.03
124	002202	金风科技	11,600	118,900.00	0.03
125	002595	豪迈科技	2,000	118,440.00	0.03
126	002475	立讯精密	3,400	117,946.00	0.03
127	601696	中银证券	11,000	117,590.00	0.03
128	601881	中国银河	6,800	116,620.00	0.03
129	601567	三星医疗	5,200	116,584.00	0.03
130	600143	金发科技	11,300	116,503.00	0.03
131	601990	南京证券	14,300	115,544.00	0.03
132	002156	通富微电	4,500	115,290.00	0.03
133	601012	隆基绿能	7,600	114,152.00	0.03
134	601009	南京银行	9,800	113,876.00	0.03
135	002532	天山铝业	13,700	113,847.00	0.03
136	601995	中金公司	3,200	113,152.00	0.03
137	600369	西南证券	26,000	113,100.00	0.03
138	002128	电投能源	5,700	112,746.00	0.03
139	002966	苏州银行	12,800	112,384.00	0.03
140	000831	中国稀土	3,100	111,972.00	0.03
141	603259	药明康德	1,600	111,280.00	0.03
142	603298	杭叉集团	5,300	111,035.00	0.03
143	600153	建发股份	10,700	110,959.00	0.03
144	600905	三峡能源	26,000	110,760.00	0.03
145	600150	中国船舶	3,400	110,636.00	0.03
146	601688	华泰证券	6,200	110,422.00	0.03
147	603939	益丰药房	4,500	110,115.00	0.03
148	600968	海油发展	26,900	109,752.00	0.03
149	603087	甘李药业	2,000	109,560.00	0.03
149	601006	大秦铁路	16,600	109,560.00	0.03
151	601198	东兴证券	9,800	109,270.00	0.03
152	002281	光迅科技	2,200	108,504.00	0.03

153	002353	杰瑞股份	3,100	108,500.00	0.03
154	601233	桐昆股份	10,200	108,120.00	0.03
155	600521	华海药业	5,800	108,054.00	0.03
156	600765	中航重机	6,400	108,032.00	0.03
157	601717	中创智领	6,500	108,030.00	0.03
158	600909	华安证券	18,500	107,855.00	0.03
159	002078	太阳纸业	8,000	107,680.00	0.03
160	600704	物产中大	20,300	106,981.00	0.03
161	002223	鱼跃医疗	3,000	106,800.00	0.03
162	000783	长江证券	15,400	106,722.00	0.03
163	600901	江苏金租	17,600	106,656.00	0.03
164	600699	均胜电子	6,100	106,384.00	0.03
165	600886	国投电力	7,200	106,128.00	0.03
166	002185	华天科技	10,500	106,050.00	0.03
167	603019	中科曙光	1,500	105,600.00	0.03
168	601390	中国中铁	18,800	105,468.00	0.03
169	600392	盛和资源	8,000	105,360.00	0.03
170	601958	金钼股份	9,600	105,024.00	0.03
171	601997	贵阳银行	16,800	104,832.00	0.03
172	603486	科沃斯	1,800	104,814.00	0.03
173	002465	海格通信	7,500	104,550.00	0.03
174	603345	安井食品	1,300	104,546.00	0.03
175	600415	小商品城	5,000	103,400.00	0.03
176	601179	中国西电	16,700	102,538.00	0.03
177	002028	思源电气	1,400	102,074.00	0.03
178	002797	第一创业	14,400	101,952.00	0.03
179	603737	三棵树	2,760	101,706.00	0.03
180	600435	北方导航	6,500	101,335.00	0.03
181	601155	新城控股	7,400	101,232.00	0.03
182	600637	东方明珠	13,500	100,845.00	0.03
183	600126	杭钢股份	11,200	100,800.00	0.03

184	601600	中国铝业	14,200	99,968.00	0.03
185	002673	西部证券	12,600	99,288.00	0.03
186	000728	国元证券	12,500	98,625.00	0.03
187	600486	扬农化工	1,700	98,600.00	0.03
188	000887	中鼎股份	5,600	98,504.00	0.03
189	002142	宁波银行	3,600	98,496.00	0.03
190	002414	高德红外	9,500	97,375.00	0.03
191	603568	伟明环保	5,100	97,308.00	0.03
192	600038	中直股份	2,500	97,025.00	0.03
193	600079	人福医药	4,600	96,508.00	0.03
194	600141	兴发集团	4,700	96,491.00	0.03
195	600795	国电电力	19,800	95,832.00	0.03
196	600535	天士力	6,100	95,465.00	0.03
197	002155	湖南黄金	5,330	95,140.50	0.03
198	003816	中国广核	26,100	95,004.00	0.03
199	000651	格力电器	2,100	94,332.00	0.03
200	603885	吉祥航空	7,000	94,290.00	0.03
201	601456	国联民生	9,100	94,185.00	0.03
202	600346	恒力石化	6,600	94,116.00	0.03
203	603179	新泉股份	2,000	93,940.00	0.03
204	600390	五矿资本	16,100	93,863.00	0.03
205	002472	双环传动	2,800	93,772.00	0.03
206	600095	湘财股份	9,300	93,279.00	0.03
207	002738	中矿资源	2,900	93,264.00	0.03
208	600998	九州通	18,100	93,034.00	0.03
209	002653	海思科	2,200	92,884.00	0.03
210	002624	完美世界	6,100	92,537.00	0.03
211	600498	烽火通信	4,400	92,532.00	0.03
212	601231	环旭电子	6,300	92,169.00	0.03
213	600995	南网储能	9,400	91,932.00	0.02
214	002444	巨星科技	3,600	91,836.00	0.02

215	601919	中远海控	6,100	91,744.00	0.02
216	601880	辽港股份	61,100	91,650.00	0.02
217	600208	衢州发展	30,900	91,464.00	0.02
218	603379	三美股份	1,900	91,428.00	0.02
219	600863	内蒙华电	22,100	90,831.00	0.02
220	600926	杭州银行	5,400	90,828.00	0.02
221	601111	中国国航	11,500	90,735.00	0.02
222	601800	中国交建	10,200	90,678.00	0.02
223	002850	科达利	800	90,536.00	0.02
224	600941	中国移动	800	90,040.00	0.02
225	002436	兴森科技	6,800	90,032.00	0.02
226	601186	中国铁建	11,200	89,712.00	0.02
227	601689	拓普集团	1,895	89,538.75	0.02
228	600663	陆家嘴	10,100	89,486.00	0.02
229	600547	山东黄金	2,800	89,404.00	0.02
230	000423	东阿阿胶	1,700	88,910.00	0.02
231	600021	上海电力	10,100	88,779.00	0.02
232	600893	航发动力	2,300	88,642.00	0.02
233	600763	通策医疗	2,140	88,339.20	0.02
234	601058	赛轮轮胎	6,700	87,904.00	0.02
235	002244	滨江集团	9,000	87,750.00	0.02
236	002008	大族激光	3,600	87,732.00	0.02
237	000893	亚钾国际	2,900	87,406.00	0.02
238	601000	唐山港	21,500	87,290.00	0.02
239	600563	法拉电子	800	87,272.00	0.02
240	002138	顺络电子	3,100	87,172.00	0.02
241	600039	四川路桥	8,800	87,120.00	0.02
241	000932	华菱钢铁	19,800	87,120.00	0.02
243	600008	首创环保	28,800	86,976.00	0.02
244	600583	海油工程	15,900	86,814.00	0.02
245	000729	燕京啤酒	6,700	86,631.00	0.02

246	603129	春风动力	400	86,600.00	0.02
247	600348	华阳股份	13,000	86,580.00	0.02
248	601100	恒立液压	1,200	86,400.00	0.02
249	600517	国网英大	16,800	85,680.00	0.02
250	000958	电投产融	12,500	85,500.00	0.02
251	600166	福田汽车	31,300	84,823.00	0.02
252	603156	养元饮品	4,000	84,640.00	0.02
253	600282	南钢股份	20,100	84,420.00	0.02
254	600048	保利发展	10,400	84,240.00	0.02
255	600170	上海建工	35,000	83,650.00	0.02
256	600155	华创云信	12,000	83,520.00	0.02
257	000519	中兵红箭	3,800	83,182.00	0.02
258	600867	通化东宝	10,100	82,820.00	0.02
259	601928	凤凰传媒	7,400	82,658.00	0.02
260	002065	东华软件	8,600	82,560.00	0.02
261	002152	广电运通	6,100	81,984.00	0.02
262	002736	国信证券	7,100	81,792.00	0.02
263	600820	隧道股份	13,400	81,740.00	0.02
264	600380	健康元	7,400	81,622.00	0.02
265	000960	锡业股份	5,300	81,090.00	0.02
266	000738	航发控制	3,900	80,925.00	0.02
267	600582	天地科技	13,500	80,865.00	0.02
268	600598	北大荒	5,600	80,752.00	0.02
269	600674	川投能源	5,000	80,200.00	0.02
270	000878	云南铜业	6,300	80,136.00	0.02
271	002739	万达电影	7,000	80,010.00	0.02
272	601061	中信金属	10,100	79,891.00	0.02
273	600516	方大炭素	17,200	79,808.00	0.02
274	601866	中远海发	32,200	79,534.00	0.02
275	002568	百润股份	3,100	79,391.00	0.02
276	601966	玲珑轮胎	5,400	79,218.00	0.02

277	600859	王府井	5,700	79,173.00	0.02
278	600566	济川药业	3,000	78,990.00	0.02
279	688777	中控技术	1,758	78,951.78	0.02
280	600511	国药股份	2,700	78,732.00	0.02
281	600499	科达制造	8,000	78,400.00	0.02
282	600483	福能股份	8,100	78,084.00	0.02
283	600131	国网信通	4,400	77,880.00	0.02
284	600655	豫园股份	14,000	77,700.00	0.02
285	600489	中金黄金	5,300	77,539.00	0.02
286	600529	山东药玻	3,500	77,490.00	0.02
287	601598	中国外运	15,600	76,908.00	0.02
288	600707	彩虹股份	11,900	76,874.00	0.02
289	000021	深科技	4,100	76,834.00	0.02
290	603501	豪威集团	600	76,590.00	0.02
291	603816	顾家家居	3,000	76,560.00	0.02
291	603589	口子窖	2,200	76,560.00	0.02
293	600487	亨通光电	5,000	76,500.00	0.02
294	600004	白云机场	8,400	76,440.00	0.02
295	002939	长城证券	9,100	76,258.00	0.02
296	600029	南方航空	12,900	76,110.00	0.02
297	601212	白银有色	24,300	76,059.00	0.02
298	600378	昊华科技	2,800	75,796.00	0.02
299	600010	包钢股份	41,900	75,001.00	0.02
300	600011	华能国际	10,500	74,970.00	0.02
301	600970	中材国际	8,700	74,646.00	0.02
302	603605	珀莱雅	900	74,511.00	0.02
303	600872	中炬高新	3,900	74,100.00	0.02
304	600754	锦江酒店	3,300	74,052.00	0.02
305	002064	华峰化学	11,200	74,032.00	0.02
306	000400	许继电气	3,400	74,018.00	0.02
307	600416	湘电股份	5,500	73,920.00	0.02

308	000009	中国宝安	8,300	73,704.00	0.02
309	601098	中南传媒	5,600	73,472.00	0.02
310	601016	节能风电	25,400	73,406.00	0.02
311	600009	上海机场	2,300	73,071.00	0.02
312	600188	兖矿能源	6,000	73,020.00	0.02
313	002262	恩华药业	3,500	72,730.00	0.02
314	601666	平煤股份	9,800	72,618.00	0.02
315	605358	立昂微	3,100	72,230.00	0.02
316	600111	北方稀土	2,900	72,210.00	0.02
317	600884	杉杉股份	7,600	71,896.00	0.02
318	600737	中粮糖业	7,600	71,820.00	0.02
319	000750	国海证券	17,400	71,688.00	0.02
320	300395	菲利华	1,400	71,540.00	0.02
321	000034	神州数码	1,900	71,516.00	0.02
322	603338	浙江鼎力	1,500	71,100.00	0.02
322	603260	合盛硅业	1,500	71,100.00	0.02
324	002409	雅克科技	1,300	71,097.00	0.02
325	600023	浙能电力	13,400	71,020.00	0.02
326	600585	海螺水泥	3,300	70,851.00	0.02
327	002044	美年健康	13,700	70,418.00	0.02
328	600739	辽宁成大	6,400	70,400.00	0.02
329	601838	成都银行	3,500	70,350.00	0.02
330	002311	海大集团	1,200	70,308.00	0.02
331	002080	中材科技	3,600	70,200.00	0.02
332	601868	中国能建	31,400	70,022.00	0.02
333	600848	上海临港	7,700	69,839.00	0.02
334	000623	吉林敖东	4,100	69,495.00	0.02
335	002958	青农商行	19,200	69,312.00	0.02
336	000166	申万宏源	13,600	68,272.00	0.02
337	600808	马钢股份	19,700	67,965.00	0.02
338	600938	中国海油	2,600	67,886.00	0.02

339	002683	广东宏大	2,000	67,880.00	0.02
340	603658	安图生物	1,800	67,500.00	0.02
341	300760	迈瑞医疗	300	67,425.00	0.02
342	600959	江苏有线	19,500	67,080.00	0.02
343	600745	闻泰科技	2,000	67,060.00	0.02
344	002926	华西证券	7,500	67,050.00	0.02
345	601118	海南橡胶	14,200	67,024.00	0.02
346	000538	云南白药	1,200	66,948.00	0.02
347	001979	招商蛇口	7,600	66,652.00	0.02
348	601788	光大证券	3,700	66,526.00	0.02
349	603077	和邦生物	38,000	66,500.00	0.02
350	603786	科博达	1,200	66,492.00	0.02
351	000563	陕国投 A	18,500	66,045.00	0.02
352	603927	中科软	3,400	65,756.00	0.02
353	600271	航天信息	7,100	65,604.00	0.02
354	600977	中国电影	6,100	65,392.00	0.02
355	601360	三六零	6,400	65,280.00	0.02
356	601669	中国电建	13,400	65,258.00	0.02
357	603712	七一二	3,100	65,131.00	0.02
358	000630	铜陵有色	19,500	65,130.00	0.02
359	603858	步长制药	4,000	64,960.00	0.02
360	600764	中国海防	1,900	64,600.00	0.02
361	002304	洋河股份	1,000	64,550.00	0.02
362	601228	广州港	19,900	64,277.00	0.02
363	600115	中国东航	15,900	64,077.00	0.02
364	601106	中国一重	22,800	63,840.00	0.02
365	601608	中信重工	14,600	63,802.00	0.02
366	000987	越秀资本	9,300	63,798.00	0.02
367	600438	通威股份	3,800	63,650.00	0.02
368	600062	华润双鹤	3,400	63,444.00	0.02
369	603688	石英股份	1,800	63,396.00	0.02

370	600329	达仁堂	1,900	63,384.00	0.02
371	000933	神火股份	3,800	63,232.00	0.02
372	000027	深圳能源	9,900	63,162.00	0.02
373	001289	龙源电力	3,900	63,102.00	0.02
374	600958	东方证券	6,500	62,920.00	0.02
375	600546	山煤国际	7,200	62,856.00	0.02
376	600299	安迪苏	6,500	62,725.00	0.02
377	000703	恒逸石化	10,600	62,328.00	0.02
378	300207	欣旺达	3,100	62,186.00	0.02
379	600258	首旅酒店	4,400	62,172.00	0.02
380	000039	中集集团	7,900	62,094.00	0.02
381	300765	新诺威	1,200	62,028.00	0.02
382	603233	大参林	3,800	61,940.00	0.02
383	002432	九安医疗	1,700	61,931.00	0.02
384	002670	国盛金控	4,100	61,705.00	0.02
385	000921	海信家电	2,400	61,680.00	0.02
386	000513	丽珠集团	1,700	61,268.00	0.02
387	601021	春秋航空	1,100	61,215.00	0.02
388	000617	中油资本	8,300	60,590.00	0.02
389	000776	广发证券	3,600	60,516.00	0.02
390	603444	吉比特	200	60,390.00	0.02
391	600316	洪都航空	1,600	60,320.00	0.02
392	600183	生益科技	2,000	60,300.00	0.02
393	300054	鼎龙股份	2,100	60,228.00	0.02
394	300017	网宿科技	5,600	60,032.00	0.02
395	601916	浙商银行	17,700	60,003.00	0.02
396	002407	多氟多	4,900	59,731.00	0.02
397	600612	老凤祥	1,200	59,700.00	0.02
398	601019	山东出版	6,300	59,661.00	0.02
399	688506	百利天恒	200	59,224.00	0.02
400	600528	中铁工业	8,000	59,040.00	0.02

401	603883	老百姓	2,800	58,828.00	0.02
402	000883	湖北能源	13,000	58,630.00	0.02
403	002385	大北农	14,500	58,580.00	0.02
404	000629	钒钛股份	22,800	58,368.00	0.02
405	002056	横店东磁	4,100	58,015.00	0.02
406	600056	中国医药	5,600	57,904.00	0.02
407	300059	东方财富	2,500	57,825.00	0.02
408	002203	海亮股份	5,600	57,792.00	0.02
409	600927	永安期货	3,900	57,759.00	0.02
410	002945	华林证券	4,000	57,480.00	0.02
411	603728	鸣志电器	1,000	57,470.00	0.02
412	000683	博源化工	11,900	57,001.00	0.02
413	601901	方正证券	7,200	56,952.00	0.02
414	601238	广汽集团	7,600	56,924.00	0.02
415	603290	斯达半导	700	56,889.00	0.02
416	601665	齐鲁银行	9,000	56,880.00	0.02
417	300866	安克创新	500	56,800.00	0.02
418	002025	航天电器	1,100	56,551.00	0.02
419	000963	华东医药	1,400	56,504.00	0.02
420	002423	中粮资本	4,600	56,258.00	0.02
421	688111	金山办公	200	56,010.00	0.02
422	002439	启明星辰	3,500	55,965.00	0.02
423	000830	鲁西化工	5,400	55,620.00	0.02
424	603799	华友钴业	1,500	55,530.00	0.02
425	600372	中航机载	4,600	55,476.00	0.02
426	300002	神州泰岳	4,700	55,460.00	0.02
427	601607	上海医药	3,100	55,428.00	0.02
428	601099	太平洋	14,100	55,413.00	0.02
429	600132	重庆啤酒	1,000	55,100.00	0.01
430	603899	晨光股份	1,900	55,081.00	0.01
431	601965	中国汽研	3,100	55,025.00	0.01

432	300058	蓝色光标	8,380	54,972.80	0.01
433	000625	长安汽车	4,300	54,868.00	0.01
434	600803	新奥股份	2,900	54,810.00	0.01
435	603650	彤程新材	1,700	54,655.00	0.01
436	002493	荣盛石化	6,600	54,648.00	0.01
437	600801	华新水泥	4,600	54,464.00	0.01
438	002938	鹏鼎控股	1,700	54,451.00	0.01
439	000591	太阳能	12,400	54,436.00	0.01
440	002984	森麒麟	2,900	54,375.00	0.01
441	600339	中油工程	16,600	54,282.00	0.01
442	603882	金域医学	1,900	54,264.00	0.01
443	000598	兴蓉环境	7,500	54,075.00	0.01
444	000060	中金岭南	11,800	54,044.00	0.01
445	002756	永兴材料	1,700	53,975.00	0.01
446	300136	信维通信	2,400	53,760.00	0.01
447	601127	赛力斯	400	53,728.00	0.01
448	000895	双汇发展	2,200	53,702.00	0.01
449	600325	华发股份	11,000	53,570.00	0.01
450	000723	美锦能源	12,400	53,568.00	0.01
451	603707	健友股份	4,800	53,520.00	0.01
452	603225	新凤鸣	5,000	53,250.00	0.01
453	603456	九洲药业	3,500	53,235.00	0.01
454	003031	中瓷电子	1,000	53,210.00	0.01
455	601568	北元集团	12,800	53,120.00	0.01
456	601636	旗滨集团	10,600	53,106.00	0.01
457	002821	凯莱英	600	52,950.00	0.01
458	000050	深天马 A	6,200	52,824.00	0.01
459	001965	招商公路	4,400	52,800.00	0.01
460	300251	光线传媒	2,600	52,702.00	0.01
461	600196	复星医药	2,100	52,689.00	0.01
462	603000	人民网	2,600	52,546.00	0.01

463	600919	江苏银行	4,400	52,536.00	0.01
464	600967	内蒙一机	2,700	52,245.00	0.01
465	000636	风华高科	3,800	52,212.00	0.01
466	001286	陕西能源	6,000	52,200.00	0.01
467	688122	西部超导	1,005	52,139.40	0.01
468	600755	厦门国贸	8,600	52,030.00	0.01
469	601158	重庆水务	11,200	51,968.00	0.01
470	688017	绿的谐波	416	51,954.24	0.01
471	601618	中国中冶	17,400	51,852.00	0.01
472	600741	华域汽车	2,900	51,185.00	0.01
473	603195	公牛集团	1,060	51,145.00	0.01
474	600928	西安银行	13,000	50,960.00	0.01
475	002085	万丰奥威	3,200	50,848.00	0.01
476	603986	兆易创新	400	50,612.00	0.01
477	600570	恒生电子	1,500	50,310.00	0.01
478	601872	招商轮船	8,000	50,080.00	0.01
479	600361	创新新材	12,500	49,875.00	0.01
480	600500	中化国际	13,000	49,790.00	0.01
481	002027	分众传媒	6,800	49,640.00	0.01
482	688180	君实生物	1,458	49,542.84	0.01
483	603056	德邦股份	3,100	49,352.00	0.01
484	002487	大金重工	1,500	49,350.00	0.01
485	600373	中文传媒	4,800	49,296.00	0.01
486	600362	江西铜业	2,100	49,203.00	0.01
487	601989	中国重工	10,600	49,184.00	0.01
488	300012	华测检测	4,200	49,098.00	0.01
489	000709	河钢股份	22,700	49,032.00	0.01
490	002120	韵达股份	7,300	48,910.00	0.01
491	603392	万泰生物	800	48,800.00	0.01
492	600600	青岛啤酒	700	48,622.00	0.01
493	002429	兆驰股份	11,100	48,618.00	0.01

494	002430	杭氧股份	2,500	48,550.00	0.01
495	600875	东方电气	2,900	48,546.00	0.01
496	605117	德业股份	920	48,447.20	0.01
497	002841	视源股份	1,400	48,440.00	0.01
498	002179	中航光电	1,200	48,432.00	0.01
499	688047	龙芯中科	359	47,887.01	0.01
500	000725	京东方 A	12,000	47,880.00	0.01
501	600007	中国国贸	2,300	47,334.00	0.01
502	000998	隆平高科	4,800	47,280.00	0.01
503	600845	宝信软件	2,000	47,240.00	0.01
504	002299	圣农发展	3,300	47,157.00	0.01
505	600606	绿地控股	28,900	47,107.00	0.01
506	601898	中煤能源	4,300	47,042.00	0.01
507	000408	藏格矿业	1,100	46,937.00	0.01
508	600129	太极集团	2,200	46,882.00	0.01
509	600085	同仁堂	1,300	46,878.00	0.01
510	002019	亿帆医药	3,600	46,764.00	0.01
511	603369	今世缘	1,200	46,716.00	0.01
512	300373	扬杰科技	900	46,710.00	0.01
513	600061	国投资本	6,200	46,624.00	0.01
514	000425	徐工机械	6,000	46,620.00	0.01
515	002603	以岭药业	3,300	46,530.00	0.01
516	000768	中航西飞	1,700	46,478.00	0.01
517	601139	深圳燃气	7,300	46,428.00	0.01
518	601992	金隅集团	30,500	46,360.00	0.01
519	002714	牧原股份	1,100	46,211.00	0.01
520	000967	盈峰环境	6,600	45,870.00	0.01
521	300037	新宙邦	1,300	45,760.00	0.01
522	002607	中公教育	14,900	45,594.00	0.01
523	000825	太钢不锈	12,700	45,593.00	0.01
524	300001	特锐德	1,900	45,543.00	0.01

525	000063	中兴通讯	1,400	45,486.00	0.01
526	600233	圆通速递	3,500	45,115.00	0.01
527	600027	华电国际	8,200	44,854.00	0.01
528	002507	涪陵榨菜	3,500	44,765.00	0.01
529	002831	裕同科技	1,900	44,498.00	0.01
530	300699	光威复材	1,400	44,338.00	0.01
531	300383	光环新网	3,100	44,330.00	0.01
532	000002	万 科Ａ	6,900	44,298.00	0.01
533	000426	兴业银锡	2,800	44,240.00	0.01
534	000301	东方盛虹	5,300	44,149.00	0.01
535	600089	特变电工	3,700	44,141.00	0.01
536	600588	用友网络	3,300	44,121.00	0.01
537	601808	中海油服	3,200	44,032.00	0.01
538	002268	电科网安	2,400	43,896.00	0.01
539	300474	景嘉微	600	43,800.00	0.01
540	600685	中船防务	1,600	43,504.00	0.01
541	300724	捷佳伟创	800	43,440.00	0.01
542	688521	芯原股份	450	43,425.00	0.01
543	601236	红塔证券	5,100	43,197.00	0.01
544	601877	正泰电器	1,900	43,073.00	0.01
545	600688	上海石化	15,100	43,035.00	0.01
546	601001	晋控煤业	3,500	42,770.00	0.01
547	000032	深桑达Ａ	2,100	42,483.00	0.01
548	600918	中泰证券	6,600	42,438.00	0.01
549	000708	中信特钢	3,600	42,336.00	0.01
550	601117	中国化学	5,500	42,185.00	0.01
551	002373	千方科技	4,500	41,850.00	0.01
552	002508	老板电器	2,200	41,822.00	0.01
553	000959	首钢股份	12,300	41,820.00	0.01
554	600312	平高电气	2,700	41,553.00	0.01
555	601878	浙商证券	3,800	41,458.00	0.01

556	600377	宁沪高速	2,700	41,418.00	0.01
557	300003	乐普医疗	3,000	41,340.00	0.01
558	002266	浙富控股	13,400	41,272.00	0.01
559	600426	华鲁恒升	1,900	41,173.00	0.01
560	003022	联泓新科	2,600	41,158.00	0.01
561	601377	兴业证券	6,600	40,854.00	0.01
562	601858	中国科传	2,100	40,845.00	0.01
563	002153	石基信息	4,700	40,702.00	0.01
564	000778	新兴铸管	10,900	40,548.00	0.01
565	000818	航锦科技	1,800	40,500.00	0.01
566	300803	指南针	500	40,330.00	0.01
567	002410	广联达	3,000	40,230.00	0.01
568	000338	潍柴动力	2,600	39,988.00	0.01
569	688385	复旦微电	808	39,810.16	0.01
570	002318	久立特材	1,700	39,763.00	0.01
571	600460	士兰微	1,600	39,712.00	0.01
572	688072	拓荆科技	258	39,657.18	0.01
573	603833	欧派家居	700	39,515.00	0.01
574	000937	冀中能源	6,800	39,100.00	0.01
575	600219	南山铝业	10,100	38,683.00	0.01
576	300999	金龙鱼	1,300	38,389.00	0.01
577	002230	科大讯飞	800	38,304.00	0.01
578	000155	川能动力	3,900	38,298.00	0.01
579	301236	软通动力	700	38,248.00	0.01
580	688012	中微公司	208	37,918.40	0.01
581	002572	索菲亚	2,700	37,827.00	0.01
582	688213	思特威	370	37,821.40	0.01
583	600176	中国巨石	3,300	37,620.00	0.01
584	002368	太极股份	1,600	37,472.00	0.01
585	600985	淮北矿业	3,300	37,422.00	0.01
586	002240	盛新锂能	2,900	37,352.00	0.01

587	002690	美亚光电	2,200	37,114.00	0.01
588	600720	中交设计	4,800	37,104.00	0.01
589	688249	晶合集成	1,821	36,911.67	0.01
590	600332	白云山	1,400	36,904.00	0.01
591	688188	柏楚电子	280	36,864.80	0.01
592	688005	容百科技	1,633	36,448.56	0.01
593	000898	鞍钢股份	15,700	36,424.00	0.01
594	000739	普洛药业	2,600	36,400.00	0.01
595	002372	伟星新材	3,500	36,260.00	0.01
596	002001	新 和 成	1,700	36,159.00	0.01
597	000938	紫光股份	1,500	35,985.00	0.01
598	603868	飞科电器	1,000	35,870.00	0.01
599	688120	华海清科	212	35,764.40	0.01
600	002074	国轩高科	1,100	35,706.00	0.01
601	601298	青岛港	4,100	35,629.00	0.01
602	000977	浪潮信息	700	35,616.00	0.01
603	300339	润和软件	700	35,581.00	0.01
604	603826	坤彩科技	1,800	35,226.00	0.01
605	688271	联影医疗	275	35,128.50	0.01
606	600026	中远海能	3,400	35,122.00	0.01
607	300073	当升科技	800	35,096.00	0.01
608	301308	江波龙	400	34,996.00	0.01
609	688052	纳芯微	200	34,898.00	0.01
610	601918	新集能源	5,400	34,884.00	0.01
611	600295	鄂尔多斯	4,000	34,840.00	0.01
612	300628	亿联网络	1,000	34,760.00	0.01
613	600161	天坛生物	1,800	34,542.00	0.01
614	000786	北新建材	1,300	34,424.00	0.01
615	600160	巨化股份	1,200	34,416.00	0.01
616	000999	华润三九	1,100	34,408.00	0.01
617	000559	万向钱潮	4,400	33,660.00	0.01

618	300285	国瓷材料	1,900	32,965.00	0.01
619	301498	乖宝宠物	300	32,811.00	0.01
620	000537	中绿电	3,900	32,604.00	0.01
621	688772	珠海冠宇	2,265	32,366.85	0.01
622	603296	华勤技术	400	32,272.00	0.01
623	002408	齐翔腾达	7,200	32,256.00	0.01
624	002531	天顺风能	4,500	32,130.00	0.01
625	688375	国博电子	535	32,105.35	0.01
626	002497	雅化集团	2,800	31,920.00	0.01
627	000539	粤电力Ａ	7,000	31,780.00	0.01
628	601699	潞安环能	3,000	31,650.00	0.01
629	300604	长川科技	700	31,437.00	0.01
630	300748	金力永磁	1,300	30,992.00	0.01
631	002920	德赛西威	300	30,639.00	0.01
632	300568	星源材质	2,400	30,432.00	0.01
633	688065	凯赛生物	646	30,426.60	0.01
634	002460	赣锋锂业	900	30,393.00	0.01
635	688469	芯联集成	6,357	30,322.89	0.01
636	002241	歌尔股份	1,300	30,316.00	0.01
637	688220	翱捷科技	382	29,910.60	0.01
638	603185	弘元绿能	2,000	29,700.00	0.01
639	300308	中际旭创	200	29,172.00	0.01
640	688002	睿创微纳	418	29,142.96	0.01
641	000792	盐湖股份	1,700	29,036.00	0.01
642	688538	和辉光电	12,399	29,013.66	0.01
643	601865	福莱特	1,900	28,899.00	0.01
644	000807	云铝股份	1,800	28,764.00	0.01
645	300763	锦浪科技	500	28,695.00	0.01
646	601698	中国卫通	1,400	28,658.00	0.01
647	603806	福斯特	2,200	28,512.00	0.01
648	002506	协鑫集成	10,600	28,302.00	0.01

649	002557	洽洽食品	1,300	28,106.00	0.01
650	000403	派林生物	1,550	28,101.50	0.01
651	688525	佰维存储	414	27,903.60	0.01
652	688536	思瑞浦	200	27,744.00	0.01
653	300223	北京君正	400	27,680.00	0.01
654	002867	周大生	2,100	27,678.00	0.01
655	002555	三七互娱	1,600	27,664.00	0.01
656	300033	同花顺	100	27,301.00	0.01
657	002563	森马服饰	5,100	26,826.00	0.01
658	000596	古井贡酒	200	26,630.00	0.01
659	688099	晶晨股份	375	26,628.75	0.01
660	300919	中伟股份	800	26,304.00	0.01
661	000401	冀东水泥	6,000	26,280.00	0.01
662	688278	特宝生物	364	26,248.04	0.01
663	002648	卫星化学	1,500	25,995.00	0.01
664	601136	首创证券	1,300	25,844.00	0.01
665	300124	汇川技术	400	25,828.00	0.01
666	300144	宋城演艺	3,000	25,650.00	0.01
667	600399	抚顺特钢	4,900	25,578.00	0.01
668	603556	海兴电力	1,000	25,470.00	0.01
669	300253	卫宁健康	2,400	25,440.00	0.01
670	300487	蓝晓科技	500	25,150.00	0.01
671	000100	TCL科技	5,800	25,114.00	0.01
672	000733	振华科技	500	25,025.00	0.01
673	601799	星宇股份	200	25,000.00	0.01
674	300676	华大基因	500	24,885.00	0.01
675	688301	奕瑞科技	280	24,530.80	0.01
676	000876	新 希 望	2,600	24,388.00	0.01
677	688114	华大智造	374	24,246.42	0.01
678	688520	神州细胞	405	24,239.25	0.01
679	688819	天能股份	870	24,151.20	0.01

680	688361	中科飞测	286	24,078.34	0.01
681	300024	机器人	1,400	24,052.00	0.01
682	688981	中芯国际	272	23,982.24	0.01
683	002936	郑州银行	11,600	23,896.00	0.01
684	000157	中联重科	3,300	23,859.00	0.01
685	300529	健帆生物	1,100	23,727.00	0.01
686	300677	英科医疗	1,000	23,680.00	0.01
687	300146	汤臣倍健	2,100	23,604.00	0.01
688	002812	恩捷股份	800	23,432.00	0.01
689	300558	贝达药业	400	23,180.00	0.01
690	300496	中科创达	400	22,888.00	0.01
691	688563	航材股份	403	22,821.89	0.01
692	688082	盛美上海	200	22,788.00	0.01
693	300601	康泰生物	1,500	22,785.00	0.01
694	688475	萤石网络	718	22,631.36	0.01
695	688234	天岳先进	386	22,600.30	0.01
696	300009	安科生物	2,700	22,599.00	0.01
697	002236	大华股份	1,400	22,232.00	0.01
698	688363	华熙生物	431	22,131.85	0.01
699	301358	湖南裕能	700	21,833.00	0.01
700	300070	碧水源	4,800	21,600.00	0.01
701	600022	山东钢铁	16,400	21,320.00	0.01
702	000800	一汽解放	3,100	21,266.00	0.01
703	688172	燕东微	1,075	21,134.50	0.01
704	002050	三花智控	800	21,104.00	0.01
705	300118	东方日升	2,200	21,076.00	0.01
706	600315	上海家化	1,000	21,070.00	0.01
707	300390	天华新能	1,100	20,977.00	0.01
708	300751	迈为股份	300	20,868.00	0.01
709	300088	长信科技	3,500	20,860.00	0.01
710	688561	奇安信	613	20,829.74	0.01

711	600482	中国动力	900	20,763.00	0.01
712	300888	稳健医疗	500	20,550.00	0.01
713	300274	阳光电源	300	20,331.00	0.01
714	600584	长电科技	600	20,214.00	0.01
715	300433	蓝思科技	900	20,070.00	0.01
716	688032	禾迈股份	200	19,972.00	0.01
717	000983	山西焦煤	3,100	19,840.00	0.01
718	603517	绝味食品	1,300	19,825.00	0.01
719	688425	铁建重工	4,770	19,461.60	0.01
720	002466	天齐锂业	600	19,224.00	0.01
721	688331	荣昌生物	317	19,178.50	0.01
722	603218	日月股份	1,500	19,035.00	0.01
723	002007	华兰生物	1,200	18,804.00	0.01
724	000785	居然智家	6,100	18,605.00	0.01
725	300567	精测电子	300	18,183.00	0.00
726	002709	天赐材料	1,000	18,120.00	0.00
727	002601	龙佰集团	1,100	17,831.00	0.00
728	300957	贝泰妮	400	17,688.00	0.00
729	300896	爱美客	100	17,481.00	0.00
730	300015	爱尔眼科	1,400	17,472.00	0.00
731	300140	节能环境	2,800	17,276.00	0.00
732	002271	东方雨虹	1,600	17,168.00	0.00
733	300498	温氏股份	1,000	17,080.00	0.00
734	002463	沪电股份	400	17,032.00	0.00
735	300595	欧普康视	1,100	16,797.00	0.00
736	688295	中复神鹰	806	16,764.80	0.00
737	601828	美凯龙	5,800	16,762.00	0.00
738	688248	南网科技	517	16,264.82	0.00
739	688008	澜起科技	197	16,154.00	0.00
740	002129	TCL中环	2,100	16,128.00	0.00
741	003035	南网能源	3,500	16,065.00	0.00

742	002459	晶澳科技	1,600	15,968.00	0.00
743	688567	孚能科技	1,096	15,892.00	0.00
744	000156	华数传媒	2,000	15,880.00	0.00
745	002865	钧达股份	400	15,600.00	0.00
746	600481	双良节能	3,200	15,424.00	0.00
747	300142	沃森生物	1,400	15,400.00	0.00
748	300296	利亚德	2,500	15,250.00	0.00
749	300212	易华录	700	15,232.00	0.00
750	000975	山金国际	800	15,152.00	0.00
751	603659	璞泰来	800	15,024.00	0.00
752	300442	润泽科技	300	14,859.00	0.00
753	688036	传音控股	186	14,824.20	0.00
754	688281	华秦科技	244	14,764.44	0.00
755	603127	昭衍新药	700	14,721.00	0.00
756	002422	科伦药业	400	14,368.00	0.00
757	002180	纳思达	600	13,764.00	0.00
758	300014	亿纬锂能	300	13,743.00	0.00
759	301267	华厦眼科	700	13,419.00	0.00
760	600732	爱旭股份	1,000	13,100.00	0.00
761	002791	坚朗五金	600	12,840.00	0.00
762	300450	先导智能	500	12,425.00	0.00
763	688187	时代电气	291	12,411.15	0.00
764	301269	华大九天	100	12,388.00	0.00
765	688153	唯捷创芯	385	11,938.85	0.00
766	300682	朗新集团	500	11,750.00	0.00
767	300661	圣邦股份	160	11,643.20	0.00
768	603317	天味食品	1,000	11,120.00	0.00
769	300438	鹏辉能源	400	11,044.00	0.00
770	002916	深南电路	100	10,781.00	0.00
771	300979	华利集团	200	10,514.00	0.00
772	300573	兴齐眼药	200	10,358.00	0.00

773	300408	三环集团	300	10,020.00	0.00
774	000661	长春高新	100	9,918.00	0.00
775	688390	固德威	217	9,428.65	0.00
776	688516	奥特维	282	9,373.68	0.00
777	002252	上海莱士	1,300	8,931.00	0.00
778	688223	晶科能源	1,513	7,852.47	0.00
779	688276	百克生物	371	7,791.00	0.00
780	688126	沪硅产业	416	7,787.52	0.00
781	300759	康龙化成	300	7,362.00	0.00
782	300782	卓胜微	100	7,137.00	0.00
783	688009	中国通号	1,325	6,810.50	0.00
784	002518	科士达	300	6,777.00	0.00
785	300418	昆仑万维	200	6,726.00	0.00
786	002049	紫光国微	100	6,586.00	0.00
787	688303	大全能源	300	6,396.00	0.00
788	300357	我武生物	300	6,192.00	0.00
789	688041	海光信息	42	5,934.18	0.00
790	300122	智飞生物	300	5,877.00	0.00
791	300832	新产业	100	5,672.00	0.00
792	300316	晶盛机电	200	5,430.00	0.00
793	300776	帝尔激光	100	5,321.00	0.00
794	688472	阿特斯	557	5,096.55	0.00
795	000031	大悦城	1,700	4,505.00	0.00
796	688599	天合光能	307	4,460.71	0.00
797	300413	芒果超媒	200	4,364.00	0.00
798	688779	五矿新能	581	3,160.64	0.00
799	603305	旭升集团	200	2,610.00	0.00
800	300861	美畅股份	100	2,033.00	0.00
801	688396	华润微	41	1,933.56	0.00

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	3,404,560.00	0.63
2	601398	工商银行	3,309,568.00	0.61
3	601288	农业银行	2,999,553.00	0.55
4	601857	中国石油	2,417,649.00	0.45
5	601988	中国银行	2,042,657.00	0.38
6	300750	宁德时代	1,738,460.00	0.32
7	601628	中国人寿	1,464,785.00	0.27
8	601088	中国神华	1,147,920.00	0.21
9	600028	中国石化	1,058,679.00	0.20
10	601728	中国电信	1,048,961.00	0.19
11	601318	中国平安	986,330.00	0.18
12	002594	比亚迪	958,773.00	0.18
13	600036	招商银行	946,067.00	0.18
14	000333	美的集团	862,489.00	0.16
15	000858	五 粮 液	852,076.00	0.16
16	601166	兴业银行	773,533.00	0.14
17	601658	邮储银行	766,187.00	0.14
18	601138	工业富联	743,512.00	0.14
19	600900	长江电力	740,999.00	0.14
20	601899	紫金矿业	600,859.00	0.11

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	600519	贵州茅台	2,839,741.00	0.53
2	601398	工商银行	2,593,514.00	0.48
3	601857	中国石油	1,869,516.00	0.35
4	300750	宁德时代	1,635,352.00	0.30
5	601988	中国银行	1,627,663.00	0.30
6	601288	农业银行	1,500,259.00	0.28
7	600036	招商银行	1,151,324.00	0.21
8	601628	中国人寿	1,143,076.00	0.21
9	002594	比亚迪	950,048.00	0.18
10	601088	中国神华	897,149.00	0.17
11	601728	中国电信	825,261.00	0.15
12	600028	中国石化	800,657.00	0.15
13	601318	中国平安	782,516.00	0.14
14	000333	美的集团	782,175.00	0.14
15	000858	五 粮 液	772,404.00	0.14
16	601166	兴业银行	622,802.00	0.12
17	600900	长江电力	617,323.00	0.11
18	601138	工业富联	567,274.00	0.10
19	300059	东方财富	500,656.00	0.09
20	601899	紫金矿业	500,261.00	0.09

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	128,092,209.62
卖出股票收入（成交）总额	98,061,849.10

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,188,390.68	2.76
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	215,361,913.44	58.44
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	61,595,293.15	16.71
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	55,712,006.22	15.12
10	合计	342,857,603.49	93.04

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	2105765	21吉林债33	300,000	34,562,103.26	9.38
2	149763	21嘉投03	300,000	34,449,904.11	9.35
3	240411	23渝富04	200,000	24,114,019.73	6.54
4	137970	22锡建G2	200,000	22,727,653.70	6.17
5	148343	23深铁05	200,000	21,583,408.22	5.86

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

本基金本报告期未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

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

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	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	2,399,102.78
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,399,102.78

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
汇安丰恒混合A	272	24,503.76	0.00	0.00%	6,665,022.69	100.00%
汇安丰恒混合C	4,347	80,909.86	27,036,036.10	7.69%	324,679,117.55	92.31%
合计	4,602	77,874.88	27,036,036.10	7.54%	331,344,140.24	92.46%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	汇安丰恒混合A	324,828.32	4.8736%
	汇安丰恒混合C	102,764.36	0.0292%
	合计	427,592.68	0.1193%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	汇安丰恒混合A	0~10
	汇安丰恒混合C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	汇安丰恒混合A	0
	汇安丰恒混合C	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	汇安丰恒混合A	汇安丰恒混合C
基金合同生效日(2017年03月13日)基金份额总额	195,086,316.11	5,000,000.00
本报告期期初基金份额总额	6,363,004.57	527,453,888.19
本报告期基金总申购份额	4,450,941.72	560,672,941.41
减：本报告期基金总赎回份额	4,148,923.60	736,411,675.95
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	6,665,022.69	351,715,153.65

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2024年9月14日起至今聘任容诚会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务，本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，本基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，未发生基金托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情形。

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	
中信证券	2	225,819,273.60	100.00%	178,550.95	100.00%	-

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

1）经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；

2）具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施稳定、响应支持及时、能满足公募基金采用券商交易模式进行证券交易和结算的需要；

3）具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：券商基本面评价（财务状况、经营状况）、券商研究机构评价（报告质量、及时性和数量）、券商每日信息评价（及时性和有效性）和券商协作表现评价等四个方面。

（2）基金交易单元的选择程序如下：

1）本基金管理人根据上述标准测试并考察后确定选用交易单元的证券经营机构；

2）本基金管理人和被选中的证券经营机构签订证券经纪服务协议。

（3）交易单元变更情况

本基金本报告期内无交易单元变更。

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
中信证券	64,105,500.00	100.00%	6,442,300,000.00	100.00%	-	-	-	-

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	2025-01-13
2	汇安丰恒灵活配置混合型证券投资基金2024年第4季度报告	规定报刊和/或公司网站	2025-01-22
3	汇安丰恒灵活配置混合型证券投资基金2024年年度报告	规定报刊和/或公司网站	2025-03-31
4	汇安基金管理有限责任公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2024年度）	规定报刊和/或公司网站	2025-03-31

5	汇安丰恒灵活配置混合型证券投资基金2025年第1季度报告	规定报刊和/或公司网站	2025-04-22
6	汇安基金管理有限责任公司关于网上直销平台系统维护的公告	规定报刊和/或公司网站	2025-05-23

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

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

二〇二五年八月三十日