

# 汇安嘉盈一年持有期债券型证券投资基金

## 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:中国邮政储蓄银行股份有限公司

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。

基金托管人中国邮政储蓄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	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	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	15
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	15
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	16
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	16
§5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	17
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	17
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	17
6.1 资产负债表	17
6.2 利润表	19
6.3 净资产变动表	21
6.4 报表附注	23
§7 投资组合报告	48
7.1 期末基金资产组合情况	48
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	49
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	50
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	71
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	73
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	73
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	74
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	74
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	74
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	74
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	74
7.12 投资组合报告附注	74
§8 基金份额持有人信息	75

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	75
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	76
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 .....	76
§9 开放式基金份额变动 .....	77
§10 重大事件揭示 .....	77
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	77
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 .....	78
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	78
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 .....	78
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	78
10.8 其他重大事件 .....	79
§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	汇安嘉盈一年持有期债券型证券投资基金		
基金简称	汇安嘉盈一年持有期债券		
基金主代码	007315		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2021年02月02日		
基金管理人	汇安基金管理有限责任公司		
基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	15,152,436.29份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称	汇安嘉盈一年持有期债券A	汇安嘉盈一年持有期债券C	汇安嘉盈一年持有期债券E
下属分级基金的交易代码	007315	010270	023953
报告期末下属分级基金的份额总额	8,636,294.10份	6,516,031.95份	110.24份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险并保证充分流动性的前提下，通过积极主动的资产管理，力争为投资者提供稳健持续增长的投资收益。
投资策略	本基金的主要投资策略包括资产配置策略、固定收益类金融工具投资策略、资产支持证券投资策略、股票投资策略、国债期货投资策略。
业绩比较基准	中债综合指数收益率*90%+沪深300指数收益率*10%
风险收益特征	本基金为债券型基金，其风险收益水平高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

### 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	中国邮政储蓄银行股份有限

			公司
信息披露负责人	姓名	郭冬青	张立学
	联系电话	010-56711600	010-68858113
	电子邮箱	guodq@huianfund.cn	zhanglixue@psbcoa.com.cn
客户服务电话		010-56711690	95580
传真		010-56711640	010-86353609
注册地址		上海市虹口区欧阳路218弄1号2楼215室	北京市西城区金融大街3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	北京市西城区金融大街3号A座
邮政编码		100007	100808
法定代表人		刘强	郑国雨

## 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 (2025年01月01日-2025年06月30日)		
	汇安嘉盈一 年持有期债 券A	汇安嘉盈一 年持有期债 券C	汇安嘉盈一 年持有期债 券E
本期已实现收益	134,230.78	89,731.55	0.28
本期利润	101,260.73	64,719.03	0.97
加权平均基金份额本期利润	0.0113	0.0095	0.0094
本期加权平均净值利润率	1.25%	1.06%	1.04%
本期基金份额净值增长率	1.28%	1.08%	0.97%
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	-985,619.68	-846,311.90	-12.55
期末可供分配基金份额利润	-0.1141	-0.1299	-0.1138
期末基金资产净值	7,907,436.05	5,861,466.14	100.97
期末基金份额净值	0.9156	0.8995	0.9159
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	-8.44%	-10.05%	0.97%

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

汇安嘉盈一年持有期债券A

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标	业绩比较 基准收益	业绩比较 基准收益	①-③	②-④
----	--------------	--------------	--------------	--------------	-----	-----

		准差②	率③	率标准差④		
过去一个月	0.77%	0.11%	0.53%	0.05%	0.24%	0.06%
过去三个月	0.67%	0.14%	1.12%	0.08%	-0.45%	0.06%
过去六个月	1.28%	0.33%	-0.06%	0.10%	1.34%	0.23%
过去一年	1.44%	0.40%	3.67%	0.13%	-2.23%	0.27%
过去三年	-12.63%	0.38%	5.45%	0.11%	-18.08%	0.27%
自基金合同生效起至今	-8.44%	0.32%	6.01%	0.12%	-14.45%	0.20%

汇安嘉盈一年持有期债券C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.74%	0.10%	0.53%	0.05%	0.21%	0.05%
过去三个月	0.57%	0.14%	1.12%	0.08%	-0.55%	0.06%
过去六个月	1.08%	0.33%	-0.06%	0.10%	1.14%	0.23%
过去一年	1.03%	0.40%	3.67%	0.13%	-2.64%	0.27%
过去三年	-13.68%	0.38%	5.45%	0.11%	-19.13%	0.27%
自基金合同生效起至今	-10.05%	0.32%	6.01%	0.12%	-16.06%	0.20%

汇安嘉盈一年持有期债券E

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.76%	0.11%	0.53%	0.05%	0.23%	0.06%
自基金合同生效起至今	0.97%	0.09%	0.72%	0.06%	0.25%	0.03%

注：本基金自2025年4月23日起增设E类份额。



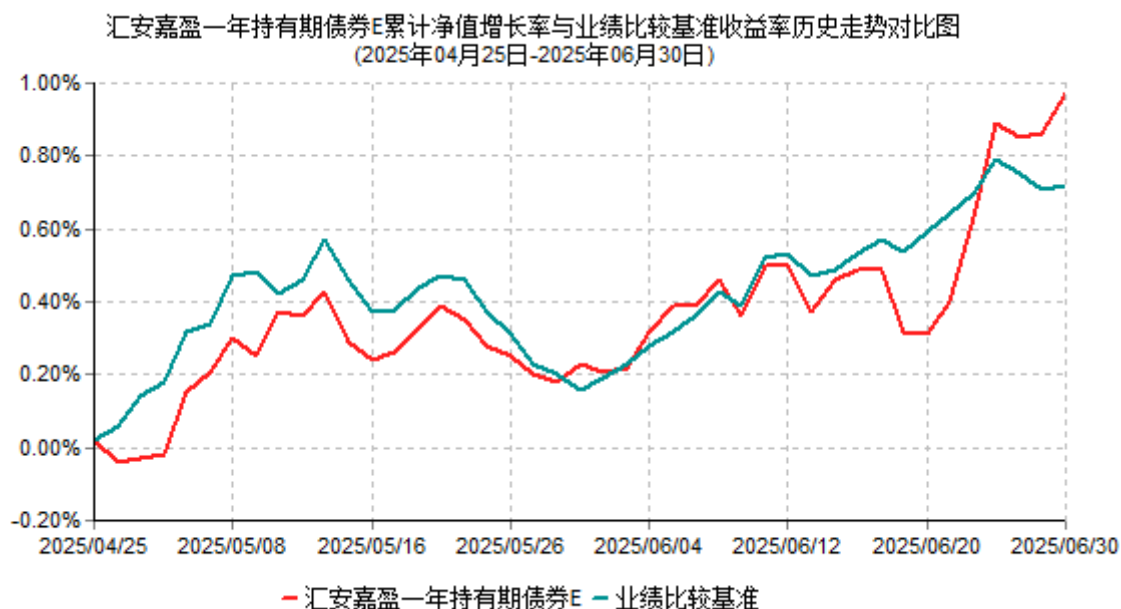
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益 率变动的比较

汇安嘉盈一年持有期债券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  
(2021年02月02日-2025年06月30日)



汇安嘉盈一年持有期债券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  
(2021年02月02日-2025年06月30日)





注：①本报告期，本基金投资比例符合基金合同要求。

②本基金自2025年4月23日起增设E类份额。

## §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	2025- 03-04	-	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

				<p>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；20</p>
--	--	--	--	---

					25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。
杨坤河	绝对收益组基金经理、本基金的基金经理	2022-07-27	2025-03-04	9年	杨坤河先生，清华大学管理科学与工程硕士研究生，9年证券、基金行业从业经验。曾任中国五矿集团公司黑流中心风控主管、高级业务经理；东北证券股份有限公司研究所分析师；太平洋证券股份有限公司研究院首席分析师，2021年2月加入汇安基金管理有限责任公司，担任绝对收益组基金经理。2023年2月2日至2024年11月20日，任汇安嘉诚债券型证券投资基金基金经理；2021年9月27日至2024年12月23日，任汇安信利债券型证券投资基金基金经理；2022年7月27日至2025年3月4日，任汇安嘉盈一年持有期债券型证券投资基金基金经理；2024年7月19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；2024年11月14日至今，任汇安量化先锋混合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。本产品规模较小，债券部分以交易所国债为主，并根据申赎情况灵活调整杠杆和久期。权益部分仓位中枢在12%左右，配置较为分散。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末汇安嘉盈一年持有期债券A基金份额净值为0.9156元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为1.28%，同期业绩比较基准收益率为-0.06%；截至报告期末汇安嘉盈一年持有期债券C基金份额净值为0.8995元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为1.08%，同期业绩比较基准收益率为-0.06%；截至报告期末汇安嘉盈一年持有期债券E基金份额净值为0.9159元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.97%，同期业绩比较基准收益率为0.72%。

#### 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数均有亮点，但当前内外部压力依然较大。外部环境复杂多变，内部供需分化。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。基本面和价格指数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

截至报告期末，本基金连续超过六十个工作日基金资产净值低于五千万元，本基金管理人已按法规要求向证监会报送解决方案。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的情形。为减轻基金固定费用支出给投资者造成的负担，切实保障基金份额持有人利益，2024年07月01日至本报告期末由基金管理人承担本基金相关固定费用（包括审计费、信息披露费等）。

§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，中国邮政储蓄银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在汇安嘉盈一年持有期债券型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内，本基金未进行利润分配。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§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：汇安嘉盈一年持有期债券型证券投资基金

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	71,605.71	30,182.20
结算备付金		8,448.67	269,054.85

存出保证金		9,217.23	13,058.02
交易性金融资产	6.4.7.2	13,694,268.86	15,499,363.77
其中：股票投资		2,509,672.10	2,904,039.80
基金投资		-	-
债券投资		11,184,596.76	12,595,323.97
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	-	-28.55
应收清算款		-	1,434,534.49
应收股利		-	-
应收申购款		50.00	229.89
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		13,783,590.47	17,246,394.67
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2025年06月30日</b>	<b>上年度末 2024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		-	2,499,830.49
应付清算款		0.02	-
应付赎回款		629.37	7,385.02
应付管理人报酬		9,091.40	10,056.69
应付托管费		1,818.31	2,011.35
应付销售服务费		1,926.25	2,186.23
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	82.05

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	1,121.96	19,490.90
负债合计		14,587.31	2,541,042.73
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	15,152,436.29	16,378,456.41
未分配利润	6.4.7.8	-1,383,433.13	-1,673,104.47
净资产合计		13,769,003.16	14,705,351.94
负债和净资产总计		13,783,590.47	17,246,394.67

注：报告截止日2025年6月30日，基金份额总额15,152,436.29份，其中汇安嘉盈一年持有期债券A基金份额净值0.9156元，份额总额8,636,294.10份；汇安嘉盈一年持有期债券C基金份额净值0.8995元，份额总额6,516,031.95份；汇安嘉盈一年持有期债券E基金份额净值0.9159元，份额总额110.24份。

6.2 利润表

会计主体：汇安嘉盈一年持有期债券型证券投资基金

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202 4年06月30日
一、营业总收入		252,474.11	78,230.96
1.利息收入		1,803.16	4,518.19
其中：存款利息收入	6.4.7.9	1,160.18	2,079.27
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		642.98	2,438.92
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-” 填列）		308,652.83	-92,466.52

其中：股票投资收益	6.4.7.10	137,174.51	-234,001.31
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	147,772.51	113,974.11
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	23,705.81	27,560.68
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	-57,981.88	166,179.29
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	-	-
<b>减：二、营业总支出</b>		86,493.38	142,929.07
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	56,341.05	68,131.15
2.托管费	6.4.10.2.2	11,268.24	13,626.19
3.销售服务费	6.4.10.2.3	12,082.01	15,815.02
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		6,781.89	7,493.17
其中：卖出回购金融资产 支出		6,781.89	7,493.17
6.信用减值损失		-	-
7.税金及附加		20.19	19.06
8.其他费用	6.4.7.18	-	37,844.48
<b>三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）</b>		165,980.73	-64,698.11
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-” 号填列）</b>		165,980.73	-64,698.11

五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		165,980.73	-64,698.11

6.3 净资产变动表

会计主体：汇安嘉盈一年持有期债券型证券投资基金

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	16,378,456.41	-1,673,104.47	14,705,351.94
二、本期期初净资产	16,378,456.41	-1,673,104.47	14,705,351.94
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-1,226,020.12	289,671.34	-936,348.78
（一）、综合收益总额	-	165,980.73	165,980.73
（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）	-1,226,020.12	123,690.61	-1,102,329.51
其中：1.基金申购款	161,904.18	-16,260.49	145,643.69
2.基金赎回款	-1,387,924.30	139,951.10	-1,247,973.20
（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	15,152,436.29	-1,383,433.13	13,769,003.16
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	19,963,520.65	-1,989,084.87	17,974,435.78
二、本期期初净资产	19,963,520.65	-1,989,084.87	17,974,435.78
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-1,809,113.52	118,438.39	-1,690,675.13
（一）、综合收益总额	-	-64,698.11	-64,698.11
（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）	-1,809,113.52	183,136.50	-1,625,977.02
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-1,809,113.52	183,136.50	-1,625,977.02
（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	18,154,407.13	-1,870,646.48	16,283,760.65

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

汇安嘉盈一年持有期债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2019]666号《关于准予汇安鼎信三个月定期开放纯债债券型证券投资基金注册的批复》和[2020]2156号《关于准予汇安鼎信三个月定期开放纯债券投资基金变更注册的批复》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《汇安嘉盈一年持有期债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集256,503,399.67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(2021)第0155号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《汇安嘉盈一年持有期债券型证券投资基金基金合同》于2021年2月2日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为256,597,544.94份基金份额,其中认购资金利息折合94,145.27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,基金托管人为中国邮政储蓄银行股份有限公司。

根据《关于汇安嘉盈一年持有期债券型证券投资基金增设E类基金份额并修改基金合同及托管协议等事项的公告》、《汇安嘉盈一年持有期债券型证券投资基金基金合同》和《汇安嘉盈一年持有期债券型证券投资基金招募说明书》的规定,本基金自2025年4月23日起增设E类基金份额,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。在投资人认购/申购基金时收取认购/申购费用,且从本类别基金资产净值中不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,且从本类别基金资产净值中计提销售服务费的基金份额,称为C类基金份额、E类基金份额;C类基金份额和E类基金份额收取不同的销售服务费。本基金A类基金份额、C类基金份额和E类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同,本基金A类基金份额、C类基金份额和E类基金份额将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。

本基金每份基金份额设置1年锁定持有期。锁定持有期到期后进入开放持有期,每份基金份额自开放持有期首日起才能办理赎回及转换转出业务。锁定持有期指基金合同生效日(对认购份额而言,下同)、基金份额申购确认日(对申购份额而言,下同)或基金份额转换转入确认日(对转换转入份额而言,下同)起(即锁定持有期起始日),至基金合同生效日、基金份额申购确认日或基金份额转换转入确认日次1年的年度对日的前一日(含当日,即锁定持有期到期日)之间的区间,若该年度对日为非工作日或不存在对应日期的,则顺延至下一个工作日。基金份额在锁定持有期内不办理赎回及转换转出业务。每份基

金份额的锁定持有期结束后即进入开放持有期，开放持有期首日为锁定持有期到期日下一个工作日，即基金合同生效日、基金份额申购确认日或基金份额转换转入确认日次1年的年度对日。每份基金份额在开放持有期期间的开放日可以办理赎回及转换转出业务。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《汇安嘉盈一年持有期债券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或注册上市的股票)、债券(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、地方政府债、政府机构债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、可转换债券(含可分离交易可转债)、可交换债券)、债券回购、资产支持证券、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、国债期货，以及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金仅投资于债项评级为AA(含)以上的信用债券，如无债项评级则主体评级在AA(含)以上。本基金的投资组合比例为：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%；每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：中债综合指数收益率 $\times$ 90%+沪深300指数收益率 $\times$ 10%。

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》、《汇安嘉盈一年持有期债券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。

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定，开放式基金在基金合同生效后，连续60个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5,000万元情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。于2025年6月30日，本基金出现连续60个工作日基金资产净值低于5,000万元的情形，本基金的基金管理人已向中国证监会报告并在评估后续处理方案，故本财务报表仍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	71,605.71
等于：本金	71,581.28
加：应计利息	24.43
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	71,605.71

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		2,489,452.78	-	2,509,672.10	20,219.32
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	11,014,610.20	102,596.76	11,184,596.76	67,389.80
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	11,014,610.20	102,596.76	11,184,596.76	67,389.80
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		13,504,062.98	102,596.76	13,694,268.86	87,609.12

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	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	1,121.96
其中：交易所市场	1,121.96
银行间市场	-
应付利息	-
合计	1,121.96

6.4.7.7 实收基金

6.4.7.7.1 汇安嘉盈一年持有期债券A

金额单位：人民币元

项目 (汇安嘉盈一年持有期债券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	9,196,790.05	9,196,790.05
本期申购	88,043.75	88,043.75
本期赎回（以“-”号填列）	-648,539.70	-648,539.70
本期末	8,636,294.10	8,636,294.10

6.4.7.7.2 汇安嘉盈一年持有期债券C

金额单位：人民币元

项目 (汇安嘉盈一年持有期债券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	7,181,666.36	7,181,666.36
本期申购	73,750.19	73,750.19
本期赎回（以“-”号填列）	-739,384.60	-739,384.60
本期末	6,516,031.95	6,516,031.95

6.4.7.7.3 汇安嘉盈一年持有期债券E

金额单位：人民币元

项目 (汇安嘉盈一年持有期债券E)	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	-	-
本期申购	110.24	110.24
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	110.24	110.24

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 汇安嘉盈一年持有期债券A

单位：人民币元

项目 (汇安嘉盈一年持有期 债券A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-1,188,077.97	305,428.70	-882,649.27
本期期初	-1,188,077.97	305,428.70	-882,649.27
本期利润	134,230.78	-32,970.05	101,260.73
本期基金份额交易产生的变动数	68,227.51	-15,697.02	52,530.49
其中：基金申购款	-11,397.79	3,117.65	-8,280.14
基金赎回款	79,625.30	-18,814.67	60,810.63
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-985,619.68	256,761.63	-728,858.05

6.4.7.8.2 汇安嘉盈一年持有期债券C

单位：人民币元

项目 (汇安嘉盈一年持有期 债券C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-1,026,409.15	235,953.95	-790,455.20
本期期初	-1,026,409.15	235,953.95	-790,455.20
本期利润	89,731.55	-25,012.52	64,719.03
本期基金份额交易产 生的变动数	90,365.70	-19,195.34	71,170.36
其中：基金申购款	-10,470.49	2,500.38	-7,970.11
基金赎回款	100,836.19	-21,695.72	79,140.47
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-846,311.90	191,746.09	-654,565.81

6.4.7.8.3 汇安嘉盈一年持有期债券E

单位：人民币元

项目 (汇安嘉盈一年持有期 债券E)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	0.28	0.69	0.97
本期基金份额交易产 生的变动数	-12.83	2.59	-10.24
其中：基金申购款	-12.83	2.59	-10.24
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-12.55	3.28	-9.27

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	863.85
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	275.22
其他	21.11
合计	1,160.18

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	12,516,241.05
减：卖出股票成本总额	12,360,746.50
减：交易费用	18,320.04
买卖股票差价收入	137,174.51

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	99,264.74
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	48,507.77
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-

合计	147,772.51
----	------------

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	14,562,989.24
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	14,403,294.78
减：应计利息总额	110,768.19
减：交易费用	418.50
买卖债券差价收入	48,507.77

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	23,705.81
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	23,705.81

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	-57,981.88
——股票投资	-13,944.92
——债券投资	-44,036.96
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-57,981.88

**6.4.7.17 其他收入**

无。

**6.4.7.18 其他费用**

无。

**6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明**

**6.4.8.1 或有事项**

无。

**6.4.8.2 资产负债表日后事项**

无。

**6.4.9 关联方关系**

**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
中国邮政储蓄银行股份有限公司	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 2025年01月01日至20 25年06月30日	上年度可比期间 2024年01月01日至20 24年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	56,341.05	68,131.15
其中：应支付销售机构的客户维护费	28,157.52	31,976.02
应支付基金管理人的净管理费	28,183.53	36,155.13

注：支付基金管理人汇安基金管理有限责任公司的管理人报酬按前一日基金资产净值0.80%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：

日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.80%/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	11,268.24	13,626.19

注：支付基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值0.16%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×0.16%/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 2025年01月01日至2025年06月30日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	汇安嘉盈一年持有 期债券A	汇安嘉盈一年持有 期债券C	汇安嘉盈一年持有 期债券E	合计
汇安基金 管理有限 责任公司	0.00	0.17	0.00	0.17
中国邮政 储蓄银行 股份有限	0.00	1,851.73	0.00	1,851. 73

公司				
合计	0.00	1,851.90	0.00	1,851.90
获得销售服务费的各关联方名称	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销售服务费			
	汇安嘉盈一年持有期债券A	汇安嘉盈一年持有期债券C	汇安嘉盈一年持有期债券E	合计
中国邮政储蓄银行股份有限公司	0.00	2,514.38	0.00	2,514.38
汇安基金管理有限责任公司	0.00	0.19	0.00	0.19
合计	0.00	2,514.57	0.00	2,514.57

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日C类基金份额和E类基金份额的基金资产净值的约定年费率计提，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。C类基金份额和E类基金份额约定的销售服务费年费率分别为0.40%和0.10%。其计算公式为：日销售服务费=前一日C/E类基金份额的基金资产净值×约定年费率/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
中国邮政储蓄银行股份有限公司	71,605.71	863.85	114,258.19	634.32

注：本基金的银行存款由基金托管人中国邮政储蓄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

于本报告期内，基金管理人自主承担本基金部分审计费等固定费用。

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**

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**

本基金为债券型基金，其长期平均风险和预期收益率低于股票基金、混合基金，高于货币市场基金。

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邮政储蓄银行股份有限公司，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 2025年06月30日	上年度末 2024年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	1,215,246.90	1,012,633.97
合计	1,215,246.90	1,012,633.97

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 2025年06月30日	上年度末 2024年12月31日
AAA	-	5,013,595.57
AAA以下	-	1,385,711.97



未评级	9,969,349.86	5,183,382.46
合计	9,969,349.86	11,582,690.00

注：未评级债券为国债。

**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依据基金合同约定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，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(所有者权益)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综合持仓集中度指标、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。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，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	71,605.71	-	-	-	71,605.71
结算备付金	8,448.67	-	-	-	8,448.67
存出保证金	9,217.23	-	-	-	9,217.23
交易性金融资产	1,215,246.90	9,969,349.86	-	2,509,672.10	13,694,268.86
应收申购款	-	-	-	50.00	50.00
资产总计	1,304,518.51	9,969,349.86	-	2,509,722.10	13,783,590.47
负债					
应付清算款	-	-	-	0.02	0.02
应付赎回款	-	-	-	629.37	629.37
应付管理人报酬	-	-	-	9,091.40	9,091.40
应付托管费	-	-	-	1,818.31	1,818.31
应付销售服务	-	-	-	1,926.25	1,926.25

费					
其他负债	-	-	-	1,121.96	1,121.96
负债总计	-	-	-	14,587.31	14,587.31
利率敏感度缺口	1,304,518.51	9,969,349.86	-	2,495,134.79	13,769,003.16
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	30,182.20	-	-	-	30,182.20
结算备付金	269,054.85	-	-	-	269,054.85
存出保证金	13,058.02	-	-	-	13,058.02
交易性金融资产	7,142,387.70	5,452,936.27	-	2,904,039.80	15,499,363.77
买入返售金融资产	-28.55	-	-	-	-28.55
应收清算款	-	-	-	1,434,534.49	1,434,534.49
应收申购款	-	-	-	229.89	229.89
资产总计	7,454,654.22	5,452,936.27	-	4,338,804.18	17,246,394.67

负债					
卖出回购金融资产款	2,499,830.49	-	-	-	2,499,830.49
应付赎回款	-	-	-	7,385.02	7,385.02
应付管理人报酬	-	-	-	10,056.69	10,056.69
应付托管费	-	-	-	2,011.35	2,011.35
应付销售服务费	-	-	-	2,186.23	2,186.23
应交税费	-	-	-	82.05	82.05
其他负债	-	-	-	19,490.90	19,490.90
负债总计	2,499,830.49	-	-	41,212.24	2,541,042.73
利率敏感度缺口	4,954,823.73	5,452,936.27	-	4,297,591.94	14,705,351.94

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	53,964.21	35,179.75

	市场利率上升25个基点	-53,493.85	-34,825.03
--	-------------	------------	------------

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。本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%，每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。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 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	2,509,672.10	18.23	2,904,039.80	19.75
交易性金融资	-	-	-	-

产－基金投资				
交易性金融资产－债券投资	-	-	6,399,307.54	43.52
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	2,509,672.10	18.23	9,303,347.34	63.27

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深300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 2025年06月30日	上年度末 2024年12月31日
	沪深300指数上升5%	133,815.76	237,504.29
	沪深300指数下降5%	-133,815.76	-237,504.29

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	2,509,672.10	9,303,347.34
第二层次	11,184,596.76	6,196,016.43
第三层次	-	-
合计	13,694,268.86	15,499,363.77

**6.4.14.2 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	2,509,672.10	18.21
	其中：股票	2,509,672.10	18.21
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	11,184,596.76	81.14



	其中：债券	11,184,596.76	81.14
	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	80,054.38	0.58
8	其他各项资产	9,267.23	0.07
9	合计	13,783,590.47	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	20,062.00	0.15
B	采矿业	115,299.50	0.84
C	制造业	1,438,730.70	10.45
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	89,455.00	0.65
E	建筑业	36,416.00	0.26
F	批发和零售业	34,100.00	0.25
G	交通运输、仓储和邮政业	62,252.00	0.45
H	住宿和餐饮业	3,657.00	0.03
I	信息传输、软件和信息技术服务业	144,800.00	1.05
J	金融业	459,967.10	3.34
K	房地产业	22,905.00	0.17
L	租赁和商务服务业	23,376.80	0.17
M	科学研究和技术服务业	22,564.00	0.16
N	水利、环境和公共设施管理业	4,490.00	0.03
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	2,448.00	0.02

Q	卫生和社会工作	13,298.00	0.10
R	文化、体育和娱乐业	13,525.00	0.10
S	综合	2,326.00	0.02
	合计	2,509,672.10	18.23

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	600519	贵州茅台	100	140,952.00	1.02
2	300750	宁德时代	200	50,444.00	0.37
3	601318	中国平安	700	38,836.00	0.28
4	600036	招商银行	800	36,760.00	0.27
5	002594	比亚迪	100	33,191.00	0.24
6	688041	海光信息	200	28,258.00	0.21
7	600900	长江电力	800	24,112.00	0.18
8	601166	兴业银行	1,000	23,340.00	0.17
9	000333	美的集团	300	21,660.00	0.16
10	601899	紫金矿业	1,100	21,450.00	0.16
11	600030	中信证券	700	19,334.00	0.14
12	300059	东方财富	800	18,504.00	0.13
13	688981	中芯国际	200	17,634.00	0.13
14	601398	工商银行	2,300	17,457.00	0.13
15	600276	恒瑞医药	300	15,570.00	0.11
16	300308	中际旭创	100	14,586.00	0.11
17	603259	药明康德	200	13,910.00	0.10
18	000651	格力电器	300	13,476.00	0.10
19	300476	胜宏科技	100	13,438.00	0.10

20	601127	赛力斯	100	13,432.00	0.10
21	601211	国泰海通	700	13,412.00	0.10
22	601328	交通银行	1,600	12,800.00	0.09
23	603501	豪威集团	100	12,765.00	0.09
24	300502	新易盛	100	12,702.00	0.09
25	601288	农业银行	2,100	12,348.00	0.09
26	600418	江淮汽车	300	12,027.00	0.09
27	600919	江苏银行	1,000	11,940.00	0.09
28	000858	五 粮 液	100	11,890.00	0.09
29	689009	九号公司	200	11,834.00	0.09
30	601816	京沪高铁	2,000	11,500.00	0.08
31	000568	泸州老窖	100	11,340.00	0.08
32	600941	中国移动	100	11,255.00	0.08
33	600887	伊利股份	400	11,152.00	0.08
34	600000	浦发银行	800	11,104.00	0.08
35	002475	立讯精密	300	10,407.00	0.08
36	000725	京东方 A	2,500	9,975.00	0.07
37	002352	顺丰控股	200	9,752.00	0.07
38	000988	华工科技	200	9,402.00	0.07
39	302132	中航成飞	100	8,794.00	0.06
40	002714	牧原股份	200	8,402.00	0.06
41	002415	海康威视	300	8,319.00	0.06
42	601088	中国神华	200	8,108.00	0.06
43	601668	中国建筑	1,400	8,078.00	0.06
44	600016	民生银行	1,700	8,075.00	0.06
45	300803	指南针	100	8,066.00	0.06
46	002625	光启技术	200	7,996.00	0.06
47	601988	中国银行	1,400	7,868.00	0.06
48	601728	中国电信	1,000	7,750.00	0.06
49	002384	东山精密	200	7,554.00	0.05
50	601601	中国太保	200	7,502.00	0.05

51	600988	赤峰黄金	300	7,464.00	0.05
52	600690	海尔智家	300	7,434.00	0.05
53	300474	景嘉微	100	7,300.00	0.05
54	000001	平安银行	600	7,242.00	0.05
55	600031	三一重工	400	7,180.00	0.05
56	603160	汇顶科技	100	7,103.00	0.05
57	603019	中科曙光	100	7,040.00	0.05
58	300223	北京君正	100	6,920.00	0.05
59	601857	中国石油	800	6,840.00	0.05
60	300498	温氏股份	400	6,832.00	0.05
61	601169	北京银行	1,000	6,830.00	0.05
62	300274	阳光电源	100	6,777.00	0.05
63	600406	国电南瑞	300	6,723.00	0.05
64	002049	紫光国微	100	6,586.00	0.05
65	600150	中国船舶	200	6,508.00	0.05
66	000063	中兴通讯	200	6,498.00	0.05
67	300124	汇川技术	100	6,457.00	0.05
68	601138	工业富联	300	6,414.00	0.05
69	002261	拓维信息	200	6,190.00	0.04
70	000338	潍柴动力	400	6,152.00	0.04
71	002966	苏州银行	700	6,146.00	0.04
72	601888	中国中免	100	6,097.00	0.04
73	601919	中远海控	400	6,016.00	0.04
74	601012	隆基绿能	400	6,008.00	0.04
75	002595	豪迈科技	100	5,922.00	0.04
76	600050	中国联通	1,100	5,874.00	0.04
77	600760	中航沈飞	100	5,862.00	0.04
78	002311	海大集团	100	5,859.00	0.04
79	600839	四川长虹	600	5,832.00	0.04
80	002517	恺英网络	300	5,793.00	0.04
81	601225	陕西煤业	300	5,772.00	0.04

82	300496	中科创达	100	5,722.00	0.04
83	600660	福耀玻璃	100	5,701.00	0.04
84	600028	中国石化	1,000	5,640.00	0.04
85	601766	中国中车	800	5,632.00	0.04
86	000100	TCL科技	1,300	5,629.00	0.04
87	601985	中国核电	600	5,592.00	0.04
88	000538	云南白药	100	5,579.00	0.04
89	603087	甘李药业	100	5,478.00	0.04
90	002142	宁波银行	200	5,472.00	0.04
91	002409	雅克科技	100	5,469.00	0.04
92	301236	软通动力	100	5,464.00	0.04
93	300724	捷佳伟创	100	5,430.00	0.04
94	600309	万华化学	100	5,426.00	0.04
95	601162	天风证券	1,100	5,423.00	0.04
96	601688	华泰证券	300	5,343.00	0.04
97	600999	招商证券	300	5,277.00	0.04
98	002050	三花智控	200	5,276.00	0.04
99	603596	伯特利	100	5,269.00	0.04
100	601555	东吴证券	600	5,250.00	0.04
101	000423	东阿阿胶	100	5,230.00	0.04
102	300373	扬杰科技	100	5,190.00	0.04
103	603606	东方电缆	100	5,171.00	0.04
104	002025	航天电器	100	5,141.00	0.04
105	002156	通富微电	200	5,124.00	0.04
105	000792	盐湖股份	300	5,124.00	0.04
107	300395	菲利华	100	5,110.00	0.04
107	002027	分众传媒	700	5,110.00	0.04
109	000977	浪潮信息	100	5,088.00	0.04
110	300339	润和软件	100	5,083.00	0.04
111	002340	格林美	800	5,080.00	0.04
112	002195	岩山科技	900	5,067.00	0.04

113	600926	杭州银行	300	5,046.00	0.04
114	000733	振华科技	100	5,005.00	0.04
115	601168	西部矿业	300	4,989.00	0.04
116	601818	光大银行	1,200	4,980.00	0.04
116	600111	北方稀土	200	4,980.00	0.04
118	300442	润泽科技	100	4,953.00	0.04
119	002281	光迅科技	100	4,932.00	0.04
120	600104	上汽集团	300	4,815.00	0.03
121	000938	紫光股份	200	4,798.00	0.03
122	002230	科大讯飞	100	4,788.00	0.03
123	002294	信立泰	100	4,733.00	0.03
124	601939	建设银行	500	4,720.00	0.03
125	002558	巨人网络	200	4,710.00	0.03
126	603179	新泉股份	100	4,697.00	0.03
127	600536	中国软件	100	4,677.00	0.03
128	002241	歌尔股份	200	4,664.00	0.03
129	000425	徐工机械	600	4,662.00	0.03
130	601009	南京银行	400	4,648.00	0.03
131	603979	金诚信	100	4,644.00	0.03
132	601006	大秦铁路	700	4,620.00	0.03
133	600487	亨通光电	300	4,590.00	0.03
134	300014	亿纬锂能	100	4,581.00	0.03
135	600157	永泰能源	3,400	4,556.00	0.03
136	300604	长川科技	100	4,491.00	0.03
137	300136	信维通信	200	4,480.00	0.03
138	000066	中国长城	300	4,440.00	0.03
139	600096	云天化	200	4,394.00	0.03
140	300073	当升科技	100	4,387.00	0.03
141	600585	海螺水泥	200	4,294.00	0.03
142	300017	网宿科技	400	4,288.00	0.03
143	000408	藏格矿业	100	4,267.00	0.03

144	600905	三峡能源	1,000	4,260.00	0.03
145	002463	沪电股份	100	4,258.00	0.03
146	002797	第一创业	600	4,248.00	0.03
147	601229	上海银行	400	4,244.00	0.03
148	002653	海思科	100	4,222.00	0.03
149	603993	洛阳钼业	500	4,210.00	0.03
150	600079	人福医药	200	4,196.00	0.03
151	600879	航天电子	400	4,188.00	0.03
152	603228	景旺电子	100	4,184.00	0.03
152	600549	厦门钨业	200	4,184.00	0.03
154	002465	海格通信	300	4,182.00	0.03
155	600415	小商品城	200	4,136.00	0.03
156	600763	通策医疗	100	4,128.00	0.03
157	002202	金风科技	400	4,100.00	0.03
158	600352	浙江龙盛	400	4,064.00	0.03
159	300251	光线传媒	200	4,054.00	0.03
160	600048	保利发展	500	4,050.00	0.03
161	002185	华天科技	400	4,040.00	0.03
162	002078	太阳纸业	300	4,038.00	0.03
163	002179	中航光电	100	4,036.00	0.03
163	000963	华东医药	100	4,036.00	0.03
165	601838	成都银行	200	4,020.00	0.03
166	300207	欣旺达	200	4,012.00	0.03
167	002273	水晶光电	200	3,994.00	0.03
168	601577	长沙银行	400	3,976.00	0.03
169	002436	兴森科技	300	3,972.00	0.03
170	002128	电投能源	200	3,956.00	0.03
171	601108	财通证券	500	3,955.00	0.03
172	600019	宝钢股份	600	3,954.00	0.03
173	601099	太平洋	1,000	3,930.00	0.03
174	601390	中国中铁	700	3,927.00	0.03

175	603369	今世缘	100	3,893.00	0.03
176	603288	海天味业	100	3,891.00	0.03
177	600038	中直股份	100	3,881.00	0.03
178	600958	东方证券	400	3,872.00	0.03
179	600893	航发动力	100	3,854.00	0.03
180	000625	长安汽车	300	3,828.00	0.03
181	600316	洪都航空	100	3,770.00	0.03
182	000034	神州数码	100	3,764.00	0.03
183	000021	深科技	200	3,748.00	0.03
184	300015	爱尔眼科	300	3,744.00	0.03
185	601989	中国重工	800	3,712.00	0.03
186	603799	华友钴业	100	3,702.00	0.03
187	603737	三棵树	100	3,685.00	0.03
188	002432	九安医疗	100	3,643.00	0.03
189	000831	中国稀土	100	3,612.00	0.03
190	600085	同仁堂	100	3,606.00	0.03
191	000513	丽珠集团	100	3,604.00	0.03
192	002422	科伦药业	100	3,592.00	0.03
193	600089	特变电工	300	3,579.00	0.03
194	002223	鱼跃医疗	100	3,560.00	0.03
195	300002	神州泰岳	300	3,540.00	0.03
196	601995	中金公司	100	3,536.00	0.03
197	603688	石英股份	100	3,522.00	0.03
198	601600	中国铝业	500	3,520.00	0.03
198	300037	新宙邦	100	3,520.00	0.03
200	600298	安琪酵母	100	3,517.00	0.03
201	600109	国金证券	400	3,508.00	0.03
202	300012	华测检测	300	3,507.00	0.03
203	002353	杰瑞股份	100	3,500.00	0.03
204	600699	均胜电子	200	3,488.00	0.03
205	603589	口子窖	100	3,480.00	0.03



206	000783	长江证券	500	3,465.00	0.03
207	002841	视源股份	100	3,460.00	0.03
208	601615	明阳智能	300	3,447.00	0.03
209	300024	机器人	200	3,436.00	0.02
210	601933	永辉超市	700	3,430.00	0.02
211	600764	中国海防	100	3,400.00	0.02
212	002683	广东宏大	100	3,394.00	0.02
213	601916	浙商银行	1,000	3,390.00	0.02
213	000623	吉林敖东	200	3,390.00	0.02
215	002460	赣锋锂业	100	3,377.00	0.02
216	600765	中航重机	200	3,376.00	0.02
217	600584	长电科技	100	3,369.00	0.02
218	300418	昆仑万维	100	3,363.00	0.02
219	000776	广发证券	200	3,362.00	0.02
220	600570	恒生电子	100	3,354.00	0.02
221	600745	闻泰科技	100	3,353.00	0.02
222	600438	通威股份	200	3,350.00	0.02
223	002472	双环传动	100	3,349.00	0.02
224	601198	东兴证券	300	3,345.00	0.02
225	300408	三环集团	100	3,340.00	0.02
226	600329	达仁堂	100	3,336.00	0.02
227	601717	郑煤机	200	3,324.00	0.02
227	002532	天山铝业	400	3,324.00	0.02
229	300142	沃森生物	300	3,300.00	0.02
230	002487	大金重工	100	3,290.00	0.02
231	300919	中伟股份	100	3,288.00	0.02
232	002074	国轩高科	100	3,246.00	0.02
233	000997	新大陆	100	3,238.00	0.02
234	600989	宝丰能源	200	3,228.00	0.02
235	002738	中矿资源	100	3,216.00	0.02
236	000002	万科A	500	3,210.00	0.02

237	601696	中银证券	300	3,207.00	0.02
237	600873	梅花生物	300	3,207.00	0.02
239	002466	天齐锂业	100	3,204.00	0.02
240	002938	鹏鼎控股	100	3,203.00	0.02
241	600547	山东黄金	100	3,193.00	0.02
242	601233	桐昆股份	300	3,180.00	0.02
243	002085	万丰奥威	200	3,178.00	0.02
244	600009	上海机场	100	3,177.00	0.02
245	002756	永兴材料	100	3,175.00	0.02
246	601128	常熟银行	430	3,169.10	0.02
247	300699	光威复材	100	3,167.00	0.02
248	600015	华夏银行	400	3,164.00	0.02
249	000426	兴业银锡	200	3,160.00	0.02
250	000728	国元证券	400	3,156.00	0.02
251	002673	西部证券	400	3,152.00	0.02
252	600885	宏发股份	140	3,123.40	0.02
253	601997	贵阳银行	500	3,120.00	0.02
254	301358	湖南裕能	100	3,119.00	0.02
255	600435	北方导航	200	3,118.00	0.02
256	600153	建发股份	300	3,111.00	0.02
257	601377	兴业证券	500	3,095.00	0.02
258	600143	金发科技	300	3,093.00	0.02
259	002414	高德红外	300	3,075.00	0.02
260	000960	锡业股份	200	3,060.00	0.02
261	002624	完美世界	200	3,034.00	0.02
262	600183	生益科技	100	3,015.00	0.02
263	000893	亚钾国际	100	3,014.00	0.02
264	000166	申万宏源	600	3,012.00	0.02
265	600886	国投电力	200	2,948.00	0.02
266	600489	中金黄金	200	2,926.00	0.02
267	601669	中国电建	600	2,922.00	0.02

268	600177	雅戈尔	400	2,920.00	0.02
269	600511	国药股份	100	2,916.00	0.02
270	600795	国电电力	600	2,904.00	0.02
271	603899	晨光股份	100	2,899.00	0.02
272	000750	国海证券	700	2,884.00	0.02
273	002065	东华软件	300	2,880.00	0.02
274	600160	巨化股份	100	2,868.00	0.02
274	300054	鼎龙股份	100	2,868.00	0.02
276	688469	芯联集成	600	2,862.00	0.02
277	300383	光环新网	200	2,860.00	0.02
278	600118	中国卫星	100	2,857.00	0.02
279	603882	金域医学	100	2,856.00	0.02
280	002138	顺络电子	100	2,812.00	0.02
281	600398	海澜之家	400	2,784.00	0.02
282	601216	君正集团	500	2,760.00	0.02
283	300003	乐普医疗	200	2,756.00	0.02
284	000636	风华高科	200	2,748.00	0.02
285	000768	中航西飞	100	2,734.00	0.02
286	600685	中船防务	100	2,719.00	0.02
287	600378	昊华科技	100	2,707.00	0.02
288	600416	湘电股份	200	2,688.00	0.02
288	002152	广电运通	200	2,688.00	0.02
290	600010	包钢股份	1,500	2,685.00	0.02
291	002410	广联达	200	2,682.00	0.02
292	000009	中国宝安	300	2,664.00	0.02
293	000786	北新建材	100	2,648.00	0.02
294	600497	驰宏锌锗	500	2,645.00	0.02
295	000932	华菱钢铁	600	2,640.00	0.02
296	600332	白云山	100	2,636.00	0.02
297	600704	物产中大	500	2,635.00	0.02
298	600392	盛和资源	200	2,634.00	0.02

299	600566	济川药业	100	2,633.00	0.02
300	601058	赛轮轮胎	200	2,624.00	0.02
301	600938	中国海油	100	2,611.00	0.02
302	600369	西南证券	600	2,610.00	0.02
303	600862	中航高科	100	2,608.00	0.02
304	000729	燕京啤酒	200	2,586.00	0.02
305	600642	申能股份	300	2,580.00	0.02
306	600895	张江高科	100	2,570.00	0.02
306	002044	美年健康	500	2,570.00	0.02
306	000921	海信家电	100	2,570.00	0.02
309	002568	百润股份	100	2,561.00	0.02
310	603816	顾家家居	100	2,552.00	0.02
311	002444	巨星科技	100	2,551.00	0.02
312	601998	中信银行	300	2,550.00	0.02
313	000878	云南铜业	200	2,544.00	0.02
314	601665	齐鲁银行	400	2,528.00	0.02
315	002958	青农商行	700	2,527.00	0.02
316	002939	长城证券	300	2,514.00	0.02
317	600196	复星医药	100	2,509.00	0.02
318	300058	蓝色光标	380	2,492.80	0.02
319	600066	宇通客车	100	2,486.00	0.02
320	300450	先导智能	100	2,485.00	0.02
321	600460	士兰微	100	2,482.00	0.02
322	300759	康龙化成	100	2,454.00	0.02
323	002607	中公教育	800	2,448.00	0.02
324	603939	益丰药房	100	2,447.00	0.02
325	000895	双汇发展	100	2,441.00	0.02
326	002407	多氟多	200	2,438.00	0.02
327	002008	大族激光	100	2,437.00	0.02
328	601990	南京证券	300	2,424.00	0.02
328	600901	江苏金租	400	2,424.00	0.02

330	600115	中国东航	600	2,418.00	0.02
331	600372	中航机载	200	2,412.00	0.02
332	601066	中信建投	100	2,405.00	0.02
333	601186	中国铁建	300	2,403.00	0.02
334	300001	特锐德	100	2,397.00	0.02
335	300748	金力永磁	100	2,384.00	0.02
336	601901	方正证券	300	2,373.00	0.02
337	600580	卧龙电驱	120	2,372.40	0.02
338	300677	英科医疗	100	2,368.00	0.02
339	601111	中国国航	300	2,367.00	0.02
340	600845	宝信软件	100	2,362.00	0.02
341	600029	南方航空	400	2,360.00	0.02
342	000039	中集集团	300	2,358.00	0.02
343	000403	派林生物	130	2,356.90	0.02
344	600362	江西铜业	100	2,343.00	0.02
345	002831	裕同科技	100	2,342.00	0.02
345	002368	太极股份	100	2,342.00	0.02
347	002318	久立特材	100	2,339.00	0.02
348	600909	华安证券	400	2,332.00	0.02
348	600390	五矿资本	400	2,332.00	0.02
350	605358	立昂微	100	2,330.00	0.02
351	600673	东阳光	200	2,326.00	0.02
352	002155	湖南黄金	130	2,320.50	0.02
353	600482	中国动力	100	2,307.00	0.02
354	002736	国信证券	200	2,304.00	0.02
355	600060	海信视像	100	2,302.00	0.02
356	002180	纳思达	100	2,294.00	0.02
357	002739	万达电影	200	2,286.00	0.02
358	600176	中国巨石	200	2,280.00	0.02
359	601877	正泰电器	100	2,267.00	0.02
360	000818	航锦科技	100	2,250.00	0.02

361	300146	汤臣倍健	200	2,248.00	0.02
362	600754	锦江酒店	100	2,244.00	0.02
363	601567	三星医疗	100	2,242.00	0.02
364	600637	东方明珠	300	2,241.00	0.02
365	300433	蓝思科技	100	2,230.00	0.02
366	600529	山东药玻	100	2,214.00	0.02
367	600380	健康元	200	2,206.00	0.02
368	000519	中兵红箭	100	2,189.00	0.02
369	601958	金钼股份	200	2,188.00	0.02
370	601878	浙商证券	200	2,182.00	0.02
370	300413	芒果超媒	100	2,182.00	0.02
372	000400	许继电气	100	2,177.00	0.02
373	300212	易华录	100	2,176.00	0.02
374	000157	中联重科	300	2,169.00	0.02
375	600426	华鲁恒升	100	2,167.00	0.02
376	002557	洽洽食品	100	2,162.00	0.02
377	000723	美锦能源	500	2,160.00	0.02
378	300529	健帆生物	100	2,157.00	0.02
379	601633	长城汽车	100	2,148.00	0.02
380	600011	华能国际	300	2,142.00	0.02
381	600129	太极集团	100	2,131.00	0.02
382	002001	新 和 成	100	2,127.00	0.02
383	603156	养元饮品	100	2,116.00	0.02
384	600008	首创环保	700	2,114.00	0.02
385	600498	烽火通信	100	2,103.00	0.02
386	603883	老百姓	100	2,101.00	0.02
386	603712	七一二	100	2,101.00	0.02
388	603298	杭叉集团	100	2,095.00	0.02
389	600155	华创云信	300	2,088.00	0.02
390	002262	恩华药业	100	2,078.00	0.02
391	000738	航发控制	100	2,075.00	0.02

392	600208	衢州发展	700	2,072.00	0.02
393	601456	国联民生	200	2,070.00	0.02
394	002203	海亮股份	200	2,064.00	0.01
395	002252	上海莱士	300	2,061.00	0.01
396	000830	鲁西化工	200	2,060.00	0.01
397	600998	九州通	400	2,056.00	0.01
398	600863	内蒙华电	500	2,055.00	0.01
399	600141	兴发集团	100	2,053.00	0.01
400	000958	电投产融	300	2,052.00	0.01
401	601360	三六零	200	2,040.00	0.01
402	601000	唐山港	500	2,030.00	0.01
403	000032	深桑达 A	100	2,023.00	0.01
404	603000	人民网	100	2,021.00	0.01
405	002385	大北农	500	2,020.00	0.01
406	601868	中国能建	900	2,007.00	0.01
407	600095	湘财股份	200	2,006.00	0.01
408	600348	华阳股份	300	1,998.00	0.01
409	002064	华峰化学	300	1,983.00	0.01
410	600039	四川路桥	200	1,980.00	0.01
411	000998	隆平高科	200	1,970.00	0.01
412	000155	川能动力	200	1,964.00	0.01
413	600499	科达制造	200	1,960.00	0.01
414	300122	智飞生物	100	1,959.00	0.01
415	600995	南网储能	200	1,956.00	0.01
416	002244	滨江集团	200	1,950.00	0.01
416	002080	中材科技	100	1,950.00	0.01
418	002430	杭氧股份	100	1,942.00	0.01
419	603927	中科软	100	1,934.00	0.01
420	600483	福能股份	200	1,928.00	0.01
421	600161	天坛生物	100	1,919.00	0.01
422	000683	博源化工	400	1,916.00	0.01

423	600219	南山铝业	500	1,915.00	0.01
424	600170	上海建工	800	1,912.00	0.01
425	603568	伟明环保	100	1,908.00	0.01
426	300390	天华新能	100	1,907.00	0.01
427	601991	大唐发电	600	1,902.00	0.01
428	002508	老板电器	100	1,901.00	0.01
429	600872	中炬高新	100	1,900.00	0.01
430	600166	福田汽车	700	1,897.00	0.01
431	000975	山金国际	100	1,894.00	0.01
432	600884	杉杉股份	200	1,892.00	0.01
433	600803	新奥股份	100	1,890.00	0.01
433	600737	中粮糖业	200	1,890.00	0.01
435	603659	璞泰来	100	1,878.00	0.01
436	000876	新 希 望	200	1,876.00	0.01
437	002984	森麒麟	100	1,875.00	0.01
438	600062	华润双鹤	100	1,866.00	0.01
439	600521	华海药业	100	1,863.00	0.01
440	002373	千方科技	200	1,860.00	0.01
441	600516	方大炭素	400	1,856.00	0.01
442	600271	航天信息	200	1,848.00	0.01
443	601179	中国西电	300	1,842.00	0.01
444	601611	中国核建	200	1,838.00	0.01
445	000060	中金岭南	400	1,832.00	0.01
446	600820	隧道股份	300	1,830.00	0.01
447	002268	电科网安	100	1,829.00	0.01
448	600004	白云机场	200	1,820.00	0.01
448	003816	中国广核	500	1,820.00	0.01
450	600848	上海临港	200	1,814.00	0.01
451	002709	天赐材料	100	1,812.00	0.01
452	600126	杭钢股份	200	1,800.00	0.01
453	601788	光大证券	100	1,798.00	0.01



454	600582	天地科技	300	1,797.00	0.01
455	000629	钒钛股份	700	1,792.00	0.01
456	601607	上海医药	100	1,788.00	0.01
456	002926	华西证券	200	1,788.00	0.01
458	000563	陕国投 A	500	1,785.00	0.01
459	601800	中国交建	200	1,778.00	0.01
460	601965	中国汽研	100	1,775.00	0.01
461	600816	建元信托	600	1,770.00	0.01
461	600515	海南机场	500	1,770.00	0.01
461	600131	国网信通	100	1,770.00	0.01
464	600741	华域汽车	100	1,765.00	0.01
465	000703	恒逸石化	300	1,764.00	0.01
466	000887	中鼎股份	100	1,759.00	0.01
467	600021	上海电力	200	1,758.00	0.01
468	000591	太阳能	400	1,756.00	0.01
469	001979	招商蛇口	200	1,754.00	0.01
470	002429	兆驰股份	400	1,752.00	0.01
471	600546	山煤国际	200	1,746.00	0.01
472	601319	中国人保	200	1,742.00	0.01
473	300285	国瓷材料	100	1,735.00	0.01
474	601016	节能风电	600	1,734.00	0.01
475	002648	卫星化学	100	1,733.00	0.01
476	002555	三七互娱	100	1,729.00	0.01
477	600970	中材国际	200	1,716.00	0.01
478	601881	中国银河	100	1,715.00	0.01
479	601059	信达证券	100	1,710.00	0.01
479	300144	宋城演艺	200	1,710.00	0.01
481	000050	深天马 A	200	1,704.00	0.01
482	002690	美亚光电	100	1,687.00	0.01
483	600282	南钢股份	400	1,680.00	0.01
484	600875	东方电气	100	1,674.00	0.01

484	300009	安科生物	200	1,674.00	0.01
486	000630	铜陵有色	500	1,670.00	0.01
487	000301	东方盛虹	200	1,666.00	0.01
488	600655	豫园股份	300	1,665.00	0.01
489	002493	荣盛石化	200	1,656.00	0.01
490	601880	辽港股份	1,100	1,650.00	0.01
491	600867	通化东宝	200	1,640.00	0.01
492	600583	海油工程	300	1,638.00	0.01
493	603233	大参林	100	1,630.00	0.01
494	603858	步长制药	100	1,624.00	0.01
495	002601	龙佰集团	100	1,621.00	0.01
496	600674	川投能源	100	1,604.00	0.01
497	002439	启明星辰	100	1,599.00	0.01
498	000807	云铝股份	100	1,598.00	0.01
499	603056	德邦股份	100	1,592.00	0.01
500	600023	浙能电力	300	1,590.00	0.01
501	002236	大华股份	100	1,588.00	0.01
502	003022	联泓新科	100	1,583.00	0.01
503	603077	和邦生物	900	1,575.00	0.01
504	002007	华兰生物	100	1,567.00	0.01
505	600535	天士力	100	1,565.00	0.01
506	600312	平高电气	100	1,539.00	0.01
507	002129	TCL中环	200	1,536.00	0.01
508	601117	中国化学	200	1,534.00	0.01
509	600517	国网英大	300	1,530.00	0.01
509	000559	万向钱潮	200	1,530.00	0.01
511	300595	欧普康视	100	1,527.00	0.01
512	603456	九洲药业	100	1,521.00	0.01
512	601865	福莱特	100	1,521.00	0.01
514	300601	康泰生物	100	1,519.00	0.01
515	002670	国盛金控	100	1,505.00	0.01

516	600061	国投资本	200	1,504.00	0.01
517	601636	旗滨集团	300	1,503.00	0.01
518	601238	广汽集团	200	1,498.00	0.01
519	601618	中国中冶	500	1,490.00	0.01
520	000778	新兴铸管	400	1,488.00	0.01
521	603185	弘元绿能	100	1,485.00	0.01
522	601866	中远海发	600	1,482.00	0.01
522	601666	平煤股份	200	1,482.00	0.01
524	600927	永安期货	100	1,481.00	0.01
525	600528	中铁工业	200	1,476.00	0.01
526	601966	玲珑轮胎	100	1,467.00	0.01
527	601231	环旭电子	100	1,463.00	0.01
528	600325	华发股份	300	1,461.00	0.01
529	000617	中油资本	200	1,460.00	0.01
530	600598	北大荒	100	1,442.00	0.01
530	000598	兴蓉环境	200	1,442.00	0.01
532	002945	华林证券	100	1,437.00	0.01
533	000825	太钢不锈	400	1,436.00	0.01
534	002299	圣农发展	100	1,429.00	0.01
535	600346	恒力石化	100	1,426.00	0.01
536	601118	海南橡胶	300	1,416.00	0.01
537	002056	横店东磁	100	1,415.00	0.01
538	600258	首旅酒店	100	1,413.00	0.01
539	002603	以岭药业	100	1,410.00	0.01
540	688538	和辉光电	600	1,404.00	0.01
541	002572	索菲亚	100	1,401.00	0.01
542	000739	普洛药业	100	1,400.00	0.01
543	000967	盈峰环境	200	1,390.00	0.01
544	600859	王府井	100	1,389.00	0.01
545	600808	马钢股份	400	1,380.00	0.01
546	600959	江苏有线	400	1,376.00	0.01

547	000987	越秀资本	200	1,372.00	0.01
548	601155	新城控股	100	1,368.00	0.01
549	600906	财达证券	200	1,364.00	0.01
550	000883	湖北能源	300	1,353.00	0.01
551	300070	碧水源	300	1,350.00	0.01
552	603885	吉祥航空	100	1,347.00	0.01
552	600578	京能电力	300	1,347.00	0.01
554	002120	韵达股份	200	1,340.00	0.01
555	600588	用友网络	100	1,337.00	0.01
556	002867	周大生	100	1,318.00	0.01
557	601098	中南传媒	100	1,312.00	0.01
558	601608	中信重工	300	1,311.00	0.01
559	601156	东航物流	100	1,309.00	0.01
560	002019	亿帆医药	100	1,299.00	0.01
561	603806	福斯特	100	1,296.00	0.01
561	000709	河钢股份	600	1,296.00	0.01
563	601918	新集能源	200	1,292.00	0.01
563	600707	彩虹股份	200	1,292.00	0.01
565	600233	圆通速递	100	1,289.00	0.01
566	002240	盛新锂能	100	1,288.00	0.01
567	600918	中泰证券	200	1,286.00	0.01
568	000983	山西焦煤	200	1,280.00	0.01
569	002507	涪陵榨菜	100	1,279.00	0.01
570	000027	深圳能源	200	1,276.00	0.01
571	601872	招商轮船	200	1,252.00	0.01
572	600098	广州发展	200	1,250.00	0.01
573	300140	节能环保	200	1,234.00	0.01
574	002266	浙富控股	400	1,232.00	0.01
575	600968	海油发展	300	1,224.00	0.01
576	002423	中粮资本	100	1,223.00	0.01
577	601001	晋控煤业	100	1,222.00	0.01

578	000785	居然智家	400	1,220.00	0.01
579	600188	兖矿能源	100	1,217.00	0.01
580	600755	厦门国贸	200	1,210.00	0.01
581	601399	国机重装	400	1,200.00	0.01
581	001965	招商公路	100	1,200.00	0.01
583	600801	华新水泥	100	1,184.00	0.01
584	000708	中信特钢	100	1,176.00	0.01
585	600871	石化油服	600	1,170.00	0.01
586	000937	冀中能源	200	1,150.00	0.01
587	600500	中化国际	300	1,149.00	0.01
588	688387	信科移动	200	1,130.00	0.01
589	601106	中国一重	400	1,120.00	0.01
590	601928	凤凰传媒	100	1,117.00	0.01
591	603707	健友股份	100	1,115.00	0.01
592	600739	辽宁成大	100	1,100.00	0.01
593	601898	中煤能源	100	1,094.00	0.01
593	600027	华电国际	200	1,094.00	0.01
595	002271	东方雨虹	100	1,073.00	0.01
596	600977	中国电影	100	1,072.00	0.01
597	600350	山东高速	100	1,066.00	0.01
598	603225	新凤鸣	100	1,065.00	0.01
599	601699	潞安环能	100	1,055.00	0.01
600	600925	苏能股份	200	1,046.00	0.01
601	688223	晶科能源	200	1,038.00	0.01
602	002372	伟星新材	100	1,036.00	0.01
603	600056	中国医药	100	1,034.00	0.01
604	600026	中远海能	100	1,033.00	0.01
605	688009	中国通号	200	1,028.00	0.01
606	600373	中文传媒	100	1,027.00	0.01
607	001227	兰州银行	400	1,000.00	0.01
608	002459	晶澳科技	100	998.00	0.01

609	601598	中国外运	200	986.00	0.01
610	600339	中油工程	300	981.00	0.01
611	600606	绿地控股	600	978.00	0.01
612	600299	安迪苏	100	965.00	0.01
613	300118	东方日升	100	958.00	0.01
614	600025	华能水电	100	955.00	0.01
615	601019	山东出版	100	947.00	0.01
616	001203	大中矿业	100	945.00	0.01
617	601212	白银有色	300	939.00	0.01
618	000898	鞍钢股份	400	928.00	0.01
619	003035	南网能源	200	918.00	0.01
620	002408	齐翔腾达	200	896.00	0.01
621	600663	陆家嘴	100	886.00	0.01
622	000401	冀东水泥	200	876.00	0.01
623	600295	鄂尔多斯	100	871.00	0.01
624	001286	陕西能源	100	870.00	0.01
625	002153	石基信息	100	866.00	0.01
626	600688	上海石化	300	855.00	0.01
627	601236	红塔证券	100	847.00	0.01
628	000537	中绿电	100	836.00	0.01
629	601568	北元集团	200	830.00	0.01
630	688425	铁建重工	200	816.00	0.01
631	600361	创新新材	200	798.00	0.01
632	601061	中信金属	100	791.00	0.01
633	600928	西安银行	200	784.00	0.01
634	600720	中交设计	100	773.00	0.01
635	600956	新天绿能	100	772.00	0.01
636	601992	金隅集团	500	760.00	0.01
637	600032	浙江新能	100	756.00	0.01
638	002608	江苏国信	100	733.00	0.01
639	002531	天顺风能	100	714.00	0.01

640	000800	一汽解放	100	686.00	0.00
641	000959	首钢股份	200	680.00	0.00
642	601228	广州港	200	646.00	0.00
643	601139	深圳燃气	100	636.00	0.00
644	002563	森马服饰	100	526.00	0.00
645	601158	重庆水务	100	464.00	0.00
646	000539	粤电力 A	100	454.00	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	002966	苏州银行	384,069.40	2.61
2	600519	贵州茅台	302,176.00	2.05
3	688256	寒武纪	262,796.00	1.79
4	600941	中国移动	233,180.00	1.59
5	605499	东鹏饮料	227,112.00	1.54
6	688502	茂莱光学	212,560.00	1.45
7	600673	东阳光	206,018.00	1.40
8	688271	联影医疗	199,814.65	1.36
9	300347	泰格医药	184,070.00	1.25
10	688692	达梦数据	171,465.00	1.17
11	600415	小商品城	169,096.00	1.15
12	603306	华懋科技	144,111.00	0.98
13	000568	泸州老窖	143,999.00	0.98
14	002851	麦格米特	143,281.00	0.97
15	301165	锐捷网络	140,474.00	0.96
16	002403	爱仕达	139,345.00	0.95
17	603662	柯力传感	128,012.00	0.87

18	001328	登康口腔	125,851.00	0.86
19	600602	云赛智联	125,847.00	0.86
20	601107	四川成渝	106,400.00	0.72

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	408,647.00	2.78
2	002966	苏州银行	377,246.65	2.57
3	002594	比亚迪	353,457.80	2.40
4	688271	联影医疗	256,772.00	1.75
5	600012	皖通高速	252,841.00	1.72
6	688981	中芯国际	239,400.00	1.63
7	688256	寒武纪	229,082.87	1.56
8	605499	东鹏饮料	211,035.00	1.44
9	688692	达梦数据	199,304.00	1.36
10	688502	茂莱光学	198,180.00	1.35
11	300347	泰格医药	186,793.00	1.27
12	600673	东阳光	185,063.00	1.26
13	600694	大商股份	172,029.00	1.17
14	600415	小商品城	171,786.00	1.17
15	000988	华工科技	168,236.00	1.14
16	301165	锐捷网络	159,489.00	1.08
17	600519	贵州茅台	156,708.00	1.07
18	600398	海澜之家	152,743.00	1.04
19	600377	宁沪高速	150,900.00	1.03
20	002929	润建股份	149,548.00	1.02



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	11,980,323.72
卖出股票收入（成交）总额	12,516,241.05

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

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	11,184,596.76	81.23
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	11,184,596.76	81.23

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	019728	23国债25	21,000	2,159,911.56	15.69
2	019759	24国债22	17,000	1,716,439.23	12.47
3	019770	25国债05	16,000	1,610,088.77	11.69

4	019749	24国债15	12,000	1,215,246.90	8.83
5	019732	24国债01	10,000	1,041,743.56	7.57

**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	9,217.23
2	应收清算款	-

3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	50.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,267.23

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 嘉盈 一年 持有 期债 券A	1,303	6,628.01	0.00	0.00%	8,636,294.10	100.00%
汇安	3,7	1,743.19	0.00	0.00%	6,516,031.95	100.00%

嘉盈一年持有期债券C	38					
汇安嘉盈一年持有期债券E	1	110.24	0.00	0.00%	110.24	100.00%
合计	4,983	3,040.83	0.00	0.00%	15,152,436.29	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 (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	汇安嘉盈一年持有期债券A	109.60	0.0013%
	汇安嘉盈一年持有期债券C	0.00	0.0000%
	汇安嘉盈一年持有期债券E	110.24	100.0000%
	合计	219.84	0.0015%

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	汇安嘉盈一年持有期债券A	0
	汇安嘉盈一年持有期债券C	0
	汇安嘉盈一年持有期债券E	0

	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	汇安嘉盈一年持有期债券A	0
	汇安嘉盈一年持有期债券C	0
	汇安嘉盈一年持有期债券E	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	汇安嘉盈一年持有期债券A	汇安嘉盈一年持有期债券C	汇安嘉盈一年持有期债券E
基金合同生效日(2021年02月02日)基金份额总额	196,148,646.19	60,448,898.75	-
本报告期期初基金份额总额	9,196,790.05	7,181,666.36	-
本报告期基金总申购份额	88,043.75	73,750.19	110.24
减：本报告期基金总赎回份额	648,539.70	739,384.60	-
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	8,636,294.10	6,516,031.95	110.24

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

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关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	
国泰海通证券	2	24,120,476.37	100.00%	10,514.55	100.00%	-

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
国泰海通证券	25,238,687.72	100.00%	67,002,000.00	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	规定报刊和/或公司网站	2025-01-13

	过期身份证件及其他身份基本信息的公告		
2	汇安嘉盈一年持有期债券型证券投资基金2024年第4季度报告	规定报刊和/或公司网站	2025-01-22
3	汇安嘉盈一年持有期债券型证券投资基金基金经理变更公告	规定报刊和/或公司网站	2025-03-05
4	汇安嘉盈一年持有期债券型证券投资基金（2025年第1号）招募说明书（更新）	规定报刊和/或公司网站	2025-03-05
5	汇安嘉盈一年持有期债券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	2025-03-05
6	汇安嘉盈一年持有期债券型证券投资基金2024年年度报告	规定报刊和/或公司网站	2025-03-31
7	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
8	汇安嘉盈一年持有期债券型证券投资基金2025年第1季度报告	规定报刊和/或公司网站	2025-04-22
9	关于汇安嘉盈一年持有期债券型证券投资基金增设E类基金份额并修改基金合同及托管协议等事项的公告	规定报刊和/或公司网站	2025-04-23
10	汇安嘉盈一年持有期债券型证券投资基金基金合同	规定报刊和/或公司网站	2025-04-23
11	汇安嘉盈一年持有期债券型证券投资基金托管协议	规定报刊和/或公司网站	2025-04-23
12	汇安嘉盈一年持有期债券型	规定报刊和/或公司网站	2025-04-23



	证券投资基金（2025年第2号）招募说明书（更新）		
13	汇安嘉盈一年持有期债券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	2025-04-23
14	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嘉盈一年持有期债券型证券投资基金募集的文件
- （2）《汇安嘉盈一年持有期债券型证券投资基金基金合同》
- （3）《汇安嘉盈一年持有期债券型证券投资基金招募说明书》
- （4）《汇安嘉盈一年持有期债券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印件或复印件。

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