

汇安恒利 39 个月定期开放纯债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:浙商银行股份有限公司

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。

基金托管人浙商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5月27日起至2025年6月30日止（本基金自2025年5月27日起恢复运作）。

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 | 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合规守信情况的说明 | 14 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 | 14 |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 | 15 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 | 15 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 | 15 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 | 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 | 16 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 | 16 |
| 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 | 16 |
| 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 | 16 |
| §6 半年度财务会计报告（未经审计） | 16 |
| 6.1 资产负债表 | 16 |
| 6.2 利润表 | 18 |
| 6.3 净资产变动表 | 20 |
| 6.4 报表附注 | 22 |
| §7 投资组合报告 | 43 |
| 7.1 期末基金资产组合情况 | 43 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 | 44 |
| 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 | 44 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 | 44 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 | 44 |
| 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 | 45 |
| 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 | 45 |
| 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 | 45 |
| 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 | 45 |
| 7.10 本基金投资股指期货的投资政策 | 45 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 | 45 |
| 7.12 投资组合报告附注 | 46 |
| §8 基金份额持有人信息 | 46 |

| | |
|--|----|
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 46 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 46 |
| 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 | 47 |
| §9 开放式基金份额变动 | 47 |
| §10 重大事件揭示 | 47 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 | 47 |
| 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 | 47 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 47 |
| 10.4 基金投资策略的改变 | 48 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 | 48 |
| 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 | 48 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 | 48 |
| 10.8 其他重大事件 | 49 |
| §11 影响投资者决策的其他重要信息 | 51 |
| 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 | 51 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 | 51 |
| §12 备查文件目录 | 51 |
| 12.1 备查文件目录 | 51 |
| 12.2 存放地点 | 52 |
| 12.3 查阅方式 | 52 |

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|-------------------------|
| 基金名称 | 汇安恒利39个月定期开放纯债债券型证券投资基金 |
| 基金简称 | 汇安恒利39个月定开纯债债券 |
| 基金主代码 | 009305 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2020年12月18日 |
| 基金管理人 | 汇安基金管理有限责任公司 |
| 基金托管人 | 浙商银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 7,999,967,948.14份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|---|
| 投资目标 | 本基金在封闭期内采取买入持有到期投资策略，投资于剩余期限（或回售期限）不超过基金剩余封闭期的固定收益类工具，力争实现基金资产的长期稳健增值。 |
| 投资策略 | 本基金的投资策略包括： 1、封闭期投资策略 （1）封闭期配置策略 （2）信用债投资策略 （3）放大策略 （4）资产支持证券投资策略 （5）封闭期现金管理策略 2、开放期投资策略 |
| 业绩比较基准 | 在每个封闭期，本基金的业绩比较基准为该封闭期起始日公布的三年期定期存款利率（税后）+1.5% |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，其长期平均预期风险和预期收益率低于股票型基金和混合型基金，高于货币市场基金。 |

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 | 浙商银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 郭冬青 | 林彬 |
| | 联系电话 | 010-56711600 | 0571-88269636 |
| | 电子邮箱 | guodq@huianfund.cn | zsyhzctgb@czbank.com |
| 客户服务电话 | | 010-56711690 | 95527 |
| 传真 | | 010-56711640 | 0571-88268688 |
| 注册地址 | | 上海市虹口区欧阳路218弄1号2楼215室 | 杭州市萧山区鸿宁路1788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 | 杭州市拱墅区环城西路76号 |
| 邮政编码 | | 100007 | 310006 |
| 法定代表人 | | 刘强 | 陈海强（代为履行法定代表人职责） |

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05月27日- 2025年06月30日) |
|---------------|-----------------------------------|
| 本期已实现收益 | 5,996,190.89 |
| 本期利润 | 5,996,190.89 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0009 |
| 本期加权平均净值利润率 | 0.09% |
| 本期基金份额净值增长率 | 0.07% |
| 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 | 5,996,190.89 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0007 |
| 期末基金资产净值 | 8,005,964,139.03 |
| 期末基金份额净值 | 1.0007 |
| 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 | 10.78% |

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，由于本基金采用摊余成本法核算，所以，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等；

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；

4、本基金于2024年4月17日起暂停运作，2025年5月27日恢复运作。

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

| 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 率标准差 | ①-③ | ②-④ |
|----|--------------|--------------|--------------|----------------------|-----|-----|
|----|--------------|--------------|--------------|----------------------|-----|-----|

| | | 准差② | 率③ | ④ | | |
|------------|--------|-------|--------|-------|--------|--------|
| 过去一个月 | 0.07% | 0.00% | 0.36% | 0.01% | -0.29% | -0.01% |
| 过去三个月 | 0.07% | 0.00% | 0.41% | 0.01% | -0.34% | -0.01% |
| 过去六个月 | 0.07% | 0.00% | 0.41% | 0.01% | -0.34% | -0.01% |
| 过去一年 | 0.07% | 0.00% | 0.41% | 0.01% | -0.34% | -0.01% |
| 过去三年 | 5.59% | 0.01% | 8.38% | 0.01% | -2.79% | 0.00% |
| 自基金合同生效起至今 | 10.78% | 0.01% | 15.68% | 0.01% | -4.90% | 0.00% |

注：①本基金于2024年4月17日起暂停运作，2025年5月27日恢复运作。

②以上业绩指标按实际运作期计算，即：

过去一个月为：20250601-20250630；

过去三个月为：20250527-20250630；

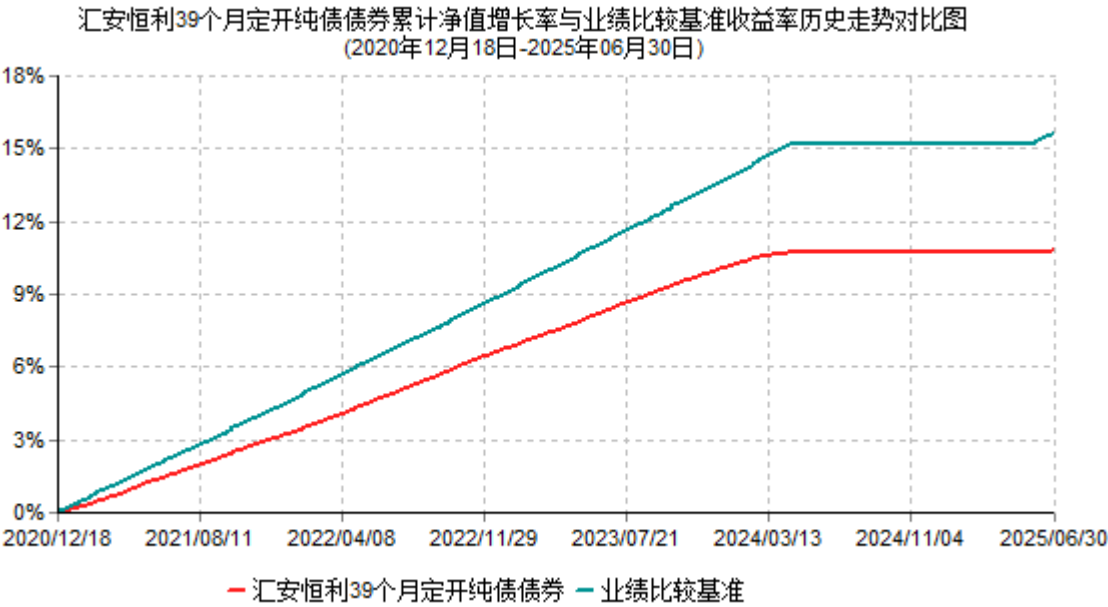
过去六个月为：20250527-20250630；

过去一年为：20250527-20250630；

过去三年为：20220701-20240416，20250527-20250630；

自基金合同生效起至今为20201218-20240416，20250527-20250630。

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本基金于2024年4月17日起暂停运作，2025年5月27日恢复运作。

§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 | | |
| 张昆 | 多策略组基金经理、本基金的基金经理 | 2020-12-23 | - | 8年 | 张昆先生，清华大学金融学硕士研究生，12年银行、基金行业从业经验。曾任中国邮政储蓄银行信评经理；雅利(上海)资产管理有限公司固定收益投资部投资经理；凯石基金管理有限公司投资四部总监。2020年2月加入汇安基金管理有限责任公司，担任多策略组混合资产投资总监、基金经理。2021年2月2日至2022年7月7日，任汇安嘉盈一年持有期债券型证券投资基金基金经理；2021年4月21日至2022年8月16日，任汇安稳裕债券型证券投资基金基金经理；2020年9月23日至2023年7月11日，任汇安恒鑫12个月定期开放纯债债券型发起式证券投资基金基金经理；2022年4月18日至202 |

| | | | | | |
|-----|---------------------|------------|---|----|---|
| | | | | | <p>3年8月18日，任汇安丰益灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2022年8月16日至2024年3月13日，任汇安裕和纯债债券型证券投资基金基金经理；2020年9月23日至2024年9月23日，任汇安裕鑫12个月定期开放纯债债券型发起式证券投资基金基金经理；2022年10月12日至2024年9月23日，任汇安裕盈纯债债券型证券投资基金基金经理；2021年10月12日至2024年12月2日，任汇安裕兴12个月定期开放纯债债券型发起式证券投资基金基金经理；2020年12月23日至今，任汇安恒利39个月定期开放纯债债券型证券投资基金基金经理；2021年1月12日至今，任汇安盛鑫三年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金基金经理；2022年6月22日至今，任汇安裕同纯债债券型证券投资基金基金经理；2024年3月26日至今，任汇安信泰稳健一年持有期混合型证券投资基金基金经理；2025年5月27日至今，任汇安聚利债券型证券投资基金基金经理。</p> |
| 金鸿峰 | 多策略组基金经理、本基金的基金经理助理 | 2025-05-07 | - | 9年 | <p>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</p> |

| | | | | |
|--|--|--|--|--|
| | | | | <p>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</p> |
|--|--|--|--|--|

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|--|
| | | | | | 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

报告期内，全球宏观经济受关税政策及其预期影响波动较大。国内经济处于有韧性的缓步回暖中，但受关税政策影响，出口及其相关产业链复苏相对疲软。消费出现积极变化，受补贴政策及消费信心回升的影响，社零增速渐次提高。投资方面，房地产投资相对较弱，但总体而言，经济最困难的阶段已经过去，未来处于稳中向好的局面。

报告期内，债券市场收益率中枢宽幅震荡，资金中枢先上后下。本基金适时把握收益率合理水平，积极建仓。严控信用风险，甄选具有一定性价比的信用资产进行配置。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末汇安恒利39个月定开纯债债券基金份额净值为1.0007元，本报告期内（2025年5月27日-2025年6月30日），基金份额净值增长率为0.07%，同期业绩比较基准收益率为0.41%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

后市来看，为了稳定经济增长、支持民营经济，维持低利率、降低社会融资成本以支持实体经济发展是长期的主要金融政策。狭义流动性仍将保持充裕。财政政策与货币政策有机配合，共同促进经济高质量发展。债券市场方面，受支持性货币政策立场和基本面影响，债市收益率或将保持宽幅震荡的格局。新质生产力行业以及内循环方面的行业将受政策支持，继续保持高质量发展。

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

本基金于2025年5月27日恢复运作。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，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，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基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本基金的管理人--汇安基金管理有限责任公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人依法对汇安基金管理有限责任公司编制和披露的汇安恒利39个月定期开放纯债债券型证券投资基金2025年中期报告中财务指标、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进行了复核，以上内容真实、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：汇安恒利39个月定期开放纯债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04月16日 |
|------|-----|--------------------|---------------------|
| 资 产： | | | |

| | | | |
|---------------|------------|----------------------------|-----------------------------|
| 货币资金 | 6.4.7.1 | 179,080,493.10 | 62,967,186.51 |
| 结算备付金 | | 183,212.39 | 40,671,592.64 |
| 存出保证金 | | - | - |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | - | - |
| 其中：股票投资 | | - | - |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | - | - |
| 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 | 415,045,479.46 | - |
| 债权投资 | 6.4.7.5 | 7,567,975,699.24 | - |
| 其中：债券投资 | | 7,567,975,699.24 | - |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 其他投资 | | - | - |
| 应收清算款 | | - | - |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | - | - |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 8,162,284,884.19 | 103,638,779.15 |
| 负债和净资产 | 附注号 | 本期末 2025年06月30日 | 上年度末 2024年04月16日 |
| 负 债： | | | |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | 6.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - | - |

| | | | |
|----------|---------|------------------|----------------|
| 应付清算款 | | 154,669,834.52 | - |
| 应付赎回款 | | - | - |
| 应付管理人报酬 | | 986,673.70 | 14,399.04 |
| 应付托管费 | | 328,891.22 | 4,799.68 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付投资顾问费 | | - | - |
| 应交税费 | | 187,210.14 | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.7 | 148,135.58 | 276,357.39 |
| 负债合计 | | 156,320,745.16 | 295,556.11 |
| 净资产： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.8 | 7,999,967,948.14 | 100,126,186.58 |
| 未分配利润 | 6.4.7.9 | 5,996,190.89 | 3,217,036.46 |
| 净资产合计 | | 8,005,964,139.03 | 103,343,223.04 |
| 负债和净资产总计 | | 8,162,284,884.19 | 103,638,779.15 |

注：报告截止日2025年6月30日，基金份额净值1.0007元，基金份额总额7,999,967,948.14份。

6.2 利润表

会计主体：汇安恒利39个月定期开放纯债债券型证券投资基金

本报告期：2025年05月27日至2025年06月30日

单位：人民币元

| 项 目 | 附注号 | 本期 2025年05月27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04月16日 |
|-----------|----------|-----------------------------------|--|
| 一、营业总收入 | | 10,661,270.17 | 28,174,892.83 |
| 1.利息收入 | | 10,661,270.17 | 28,174,892.08 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.10 | 1,068,625.11 | 229,330.65 |
| 债券利息收入 | | 5,713,089.52 | 21,027,423.74 |
| 资产支持证券利息 | | - | - |

| | | | |
|-----------------------|------------|--------------|--------------|
| 收入 | | | |
| 买入返售金融资产收入 | | 3,879,555.54 | 6,918,137.69 |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | - | - |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.11 | - | - |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.12 | - | - |
| 资产支持证券投资 | 6.4.7.13 | - | - |
| 收益 | | | |
| 贵金属投资收益 | 6.4.7.14 | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.15 | - | - |
| 股利收益 | 6.4.7.16 | - | - |
| 其他投资收益 | | - | - |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17 | - | - |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 6.4.7.18 | - | 0.75 |
| 减：二、营业总支出 | | 4,665,079.28 | 7,669,073.23 |
| 1.管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 1,052,427.32 | 3,022,187.80 |
| 2.托管费 | 6.4.10.2.2 | 350,809.10 | 1,007,395.94 |
| 3.销售服务费 | | - | - |
| 4.投资顾问费 | | - | - |
| 5.利息支出 | | - | 3,570,051.93 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | - | 3,570,051.93 |
| 6.信用减值损失 | 6.4.7.19 | 3,195,301.82 | - |
| 7.税金及附加 | | 20,058.23 | - |
| 8.其他费用 | 6.4.7.20 | 46,482.81 | 69,437.56 |

| | | | |
|---------------------|--|--------------|---------------|
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 5,996,190.89 | 20,505,819.60 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 5,996,190.89 | 20,505,819.60 |
| 五、其他综合收益的税后净额 | | - | - |
| 六、综合收益总额 | | 5,996,190.89 | 20,505,819.60 |

6.3 净资产变动表

会计主体：汇安恒利39个月定期开放纯债债券型证券投资基金

本报告期：2025年05月27日至2025年06月30日

单位：人民币元

| 项 目 | 本期 2025年05月27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 | 100,126,186.58 | 3,217,036.46 | 103,343,223.04 |
| 加：会计政策变更 | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - |
| 其他 | -100,126,186.58 | -3,217,036.46 | -103,343,223.04 |
| 二、本期期初净资产 | - | - | - |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | 7,999,967,948.14 | 5,996,190.89 | 8,005,964,139.03 |
| （一）、综合收益总额 | - | 5,996,190.89 | 5,996,190.89 |
| （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 | 7,999,967,948.14 | - | 7,999,967,948.14 |

| | | | |
|--|------------------------------------|-----------------|-------------------|
| 列) | | | |
| 其中：1.基金申购款 | 7,999,967,948.14 | - | 7,999,967,948.14 |
| 2.基金赎回款 | - | - | - |
| （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 | 7,999,967,948.14 | 5,996,190.89 | 8,005,964,139.03 |
| 项 目 | 上年度可比期间 2024年01月01日至2024年04月16日 | | |
| | 实收基金 | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净资产 | 4,200,127,001.35 | 405,310,663.08 | 4,605,437,664.43 |
| 二、本期期初净资产 | 4,200,127,001.35 | 405,310,663.08 | 4,605,437,664.43 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | -4,100,000,814.77 | -402,093,626.62 | -4,502,094,441.39 |
| （一）、综合收益总额 | - | 20,505,819.60 | 20,505,819.60 |
| （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） | -4,100,000,814.77 | -128,590,555.79 | -4,228,591,370.56 |
| 其中：1.基金申购款 | 57,590.87 | 1,818.15 | 59,409.02 |
| 2.基金赎回款 | -4,100,058,405.64 | -128,592,373.94 | -4,228,650,779.58 |
| （三）、本期向基金份额持有人分配 | - | -294,008,890.43 | -294,008,890.43 |

| | | | |
|--------------------------|----------------|--------------|----------------|
| 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 | 100,126,186.58 | 3,217,036.46 | 103,343,223.04 |

注：上期期末至本期期初间净资产(资产净值)列示的其他项调整为基金管理人于2024年4月16日(基金暂停运作的最后运作日)接受的投资人赎回申请以及于2024年4月17日对于开放期最后一日日终留存的基金份额全部自动赎回引起的净资产变动。

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

汇安恒利39个月定期开放纯债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[2020]460号《关于准予汇安恒利39个月定期开放纯债债券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《汇安恒利39个月定期开放纯债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、定期开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集4,200,126,938.40元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2020)第1052号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《汇安恒利39个月定期开放纯债债券型证券投资基金基金合同》于2020年12月18日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为4,200,126,953.49份基金份额，其中认购资金利息折合15.09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，基金托管人为浙商银行股份有限公司。

根据《汇安恒利39个月定期开放纯债债券型证券投资基金基金合同》和《汇安恒利39个月定期开放纯债债券型证券投资基金招募说明书》的相关规定，本基金以定期开放的方式运作，本基金以39个月为一个封闭期。本基金的第一个封闭期的起始之日为基金合同生效日，结束之日为基金合同生效日所对应的39个月后的月度对日(指日历月，如该日为非工作日或无对应日期，则顺延至下一工作日)的前一日。第二个封闭期的起始之日为第一个开放期结束之日次日，结束之日为第二个封闭期起始之日所对应的39个月后的月度对日(指日历月，如该日为非工作日或无对应日期，则顺延至下一工作日)的前一日，

依此类推。本基金在封闭期内不办理申购与赎回业务，也不上市交易。本基金自封闭期结束之日的下一个工作日起进入开放期，期间可以办理申购、赎回或其他业务。本基金每个开放期不少于5个工作日且最长不超过20个工作日，开放期的具体时间由基金管理人在上一个封闭期结束前公告说明。

根据基金管理人2024年4月17日公布的《汇安基金管理有限责任公司关于汇安恒利 39 个月定期开放纯债债券型证券投资基金第一个开放期到期后暂停运作、不进入下一封闭期的公告》和于2025年5月26日发布的《汇安基金管理有限责任公司关于汇安恒利 39 个月定期开放纯债债券型证券投资基金恢复运作并开放申购、赎回的公告》，本基金于第一个开放期到期后（即2024年4月17日）暂停运作，并于 2025 年 5 月 27 日起恢复本基金的运作并开放申购、赎回业务。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《汇安恒利39个月定期开放纯债债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括债券(国债、金融债、企业债、公司债(含非公开发行的公司债)、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、可分离交易可转债的纯债部分)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单等法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金不投资于股票等资产，也不投资于可转换债券(可分离交易可转债的纯债部分除外)、可交换债券。本基金的投资组合比例为：对债券的投资比例不低于基金资产的80%；但因开放期流动性需要，为保护基金份额持有人利益，每个开放期开始前三个月至开放期结束后三个月的期间内，基金投资不受上述比例限制。开放期内，每个交易日日终本基金持有现金或者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、应收申购款等；封闭期内，本基金不受上述5%的限制。在每个封闭期，本基金的业绩比较基准为：该封闭期起始日公布的三年期定期存款利率(税后)+1.5%。

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》、《汇安恒利39个月定期开放纯债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。

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5月27日（基金恢复运作日）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[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，包括买卖债券的差价收入，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。
- (4) 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 | 179,080,493.10 |
| 等于：本金 | 178,893,753.42 |
| 加：应计利息 | 186,739.68 |
| 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 | 179,080,493.10 |

6.4.7.2 交易性金融资产

无。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2025年06月30日 | |
|-------|--------------------|-----------|
| | 账面余额 | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | - | - |
| 银行间市场 | 415,045,479.46 | - |
| 合计 | 415,045,479.46 | - |

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 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

单位：人民币元

| 项目 | | 本期末 2025年06月30日 | | | | |
|--------|-------|--------------------|----------------|---------------|--------------|------------------|
| | | 初始成本 | 利息调整 | 应计利息 | 减：减值准备 | 账面价值 |
| 债券 | 交易所市场 | 1,165,000,000.00 | 26,550,736.55 | 16,018,047.16 | 542,472.67 | 1,207,026,311.04 |
| | 银行间市场 | 6,237,000,000.00 | 76,575,898.85 | 50,026,318.50 | 2,652,829.15 | 6,360,949,388.20 |
| | 小计 | 7,402,000,000.00 | 103,126,635.40 | 66,044,365.66 | 3,195,301.82 | 7,567,975,699.24 |
| 资产支持证券 | | - | - | - | - | - |
| 其他 | | - | - | - | - | - |
| 合计 | | 7,402,000,000.00 | 103,126,635.40 | 66,044,365.66 | 3,195,301.82 | 7,567,975,699.24 |

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

单位：人民币元

| 减值准备 | 第一阶段 | 第二阶段 | 第三阶段 | 合计 |
|-----------|--------------|----------------------|----------------------|--------------|
| | 未来12个月预期信用损失 | 整个存续期预期信用损失(未发生信用减值) | 整个存续期预期信用损失(已发生信用减值) | |
| 期初余额 | - | - | - | - |
| 本期从其他阶段转入 | - | - | - | - |
| 本期转出至其他阶段 | - | - | - | - |
| 本期新增 | 3,355,343.41 | - | - | 3,355,343.41 |
| 本期转回 | 160,041.59 | - | - | 160,041.59 |
| 其他变动 | - | - | - | - |
| 期末余额 | 3,195,301.82 | - | - | 3,195,301.82 |

6.4.7.6 其他资产

无。

6.4.7.7 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 | 101,652.77 |
| 其中：交易所市场 | - |
| 银行间市场 | 101,652.77 |
| 应付利息 | - |
| 预提费用-审计费 | 18,310.37 |
| 预提费用-信息披露费 | 21,972.44 |
| 预提费用-账户维护费 | 6,200.00 |

| | |
|----|------------|
| 合计 | 148,135.58 |
|----|------------|

6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2025年05月27日至2025年06月30日 | |
|---------------|-------------------------------|------------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 本期期初 | - | - |
| 本期申购 | 7,999,967,948.14 | 7,999,967,948.14 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | - | - |
| 本期末 | 7,999,967,948.14 | 7,999,967,948.14 |

注：1. 申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

2. 根据《汇安恒利39个月定期开放纯债债券型证券投资基金基金合同》及《汇安恒利39个月定期开放纯债债券型证券投资基金招募说明书》的相关规定，本基金于2025年5月29日(基金恢复运作日)至对应的39个月后的月度对日(指日历月，如该日为非工作日或无对应日期，则顺延至下一工作日)的前一日止期间暂不向投资人开放基金交易。

6.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|---------------|-------|---------------|
| 上年度末 | 3,217,036.46 | - | 3,217,036.46 |
| 加：会计政策变更 | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - |
| 其他 | -3,217,036.46 | - | -3,217,036.46 |
| 本期期初 | - | - | - |
| 本期利润 | 5,996,190.89 | - | 5,996,190.89 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | - | - | - |
| 其中：基金申购款 | - | - | - |
| 基金赎回款 | - | - | - |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 5,996,190.89 | - | 5,996,190.89 |

6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2025年05月27日至2025年06月30日 |
|-----------|-------------------------------|
| 活期存款利息收入 | 743,120.57 |
| 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 | 228,908.80 |
| 其他 | 96,595.74 |
| 合计 | 1,068,625.11 |

6.4.7.11 股票投资收益

6.4.7.11.1 股票投资收益——买卖股票差价收入
无。

6.4.7.11.2 股票投资收益——证券出借差价收入
无。

6.4.7.12 债券投资收益

6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成
无。

6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入
无。

6.4.7.12.3 债券投资收益——赎回差价收入
无。

6.4.7.12.4 债券投资收益——申购差价收入
无。

6.4.7.13 资产支持证券投资收益

6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.13.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.13.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.16 股利收益

无。

6.4.7.17 公允价值变动收益

无。

6.4.7.18 其他收入

无。

6.4.7.19 信用减值损失

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2025年05月27日至2025年06月30日 |
|----------|-------------------------------|
| 银行存款 | - |
| 买入返售金融资产 | - |
| 债权投资 | 3,195,301.82 |
| 其他债权投资 | - |
| 其他 | - |
| 合计 | 3,195,301.82 |

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2025年05月27日至2025年06月30日 |
|-----------|-------------------------------|
| 审计费用 | 18,310.37 |
| 信息披露费 | 21,972.44 |
| 证券出借违约金 | - |
| 账户维护费-中债登 | 3,000.00 |
| 其他 | 200.00 |
| 账户维护费-上清所 | 3,000.00 |
| 合计 | 46,482.81 |

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 |
| 浙商银行股份有限公司 | 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05月27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04月16日 |
|------------------|-----------------------------------|--|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 1,052,427.32 | 3,022,187.80 |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 144,250.82 | 107,504.55 |
| 应支付基金管理人的净管理费 | 908,176.50 | 2,914,683.25 |

注：于2025年5月27日前，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0.30%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×0.30%/当年天数。

根据《关于汇安恒利39个月定期开放纯债债券型证券投资基金降低管理费、托管费率并修改法律文件的公告》，自2025年5月27日起，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0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.15%/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05月27日至2025 年06月30日 | 上年度可比期间 2024年01月01日至2024 年04月16日 |
|----------------|-----------------------------------|--|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 350,809.10 | 1,007,395.94 |

注：于2024年5月16日前，支付基金托管人浙商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。

根据《关于汇安恒利39个月定期开放纯债债券型证券投资基金降低管理费、托管费率并修改法律文件的公告》，自2025年5月27日起，支付基金托管人浙商银行股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值0.05%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×0.05%/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

份额单位：份

| 关联方名称 | 本期末 2025年06月30日 | | 上年度末 2024年04月16日 | |
|------------|--------------------|------------------|---------------------|------------------|
| | 持有的基金份额 | 持有的基金份额占基金总份额的比例 | 持有的基金份额 | 持有的基金份额占基金总份额的比例 |
| 郭兆强 | 9.27 | 0.0000% | 99.98 | 0.0001% |
| 浙商银行股份有限公司 | 0.00 | 0.0000% | 99,999,917.00 | 99.87% |

注：

截至本报告期末，自然人股东郭兆强持有本基金份额占基金总份额的比例为0.0000001%，上表展示的比例为四舍五入后的结果。

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05月27日至2025年06月30日 | | 上年度可比期间 2024年01月01日至2024年04月16日 | |
|------------|-------------------------------|-----------|------------------------------------|------------|
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 浙商银行股份有限公司 | 178,928,444.97 | 83,642.92 | 62,967,186.51 | 104,988.63 |

注：本基金的银行存款由基金托管人浙商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

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浙商银行股份有限公司，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。

新金融工具准则将金融工具所处的信用风险状况划分为三个阶段。本基金对于债券减值阶段划分的依据是债券信用风险水平是否发生显著变化。根据债券市场历史违约情

况、境内外信用债市场等级划分和分布情况及债券市场定价信息，将减值阶段划分如下：在资产负债表日，若相关债券和资产支持证券投资的中证市场隐含评级不低于初始确认日的隐含评级或高于AA-等级，则处于第一阶段；若相关债券和资产支持证券投资的中证市场隐含评级低于初始确认日的隐含评级且不高于AA-等级，则处于第二阶段；若相关债券和资产支持证券投资的中证市场隐含评级处于C等级或发生违约，则处于第三阶段。

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04月16日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| AAA | 2,317,824,573.22 | - |
| AAA以下 | 85,671,966.40 | - |
| 未评级 | 5,164,479,159.62 | - |
| 合计 | 7,567,975,699.24 | - |

注：未评级债券为政策性金融债、中期票据。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的债券投资采用买入持有至到期策略，流动性风险主要来自于基金份额持有人于约定开放日要求赎回其持有的基金份额。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人于开放期内每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于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(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》且于基金开放期内按照《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%(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。

于开放期内，本基金的基金管理人每日对基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过7个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或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。

本基金对投资组合采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量，因此固定利率类金融工具的利率变动对本基金的基金资产净值无重大影响，浮动利率类金融工具使本基金面临现金流量利率风险。本基金的基金管理人主要通过合理配置债券组合的到期期限，管理利率波动带来的再投资风险。

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 | 179,080,493.10 | - | - | - | 179,080,493.10 |
| 结算备付金 | 183,212.39 | - | - | - | 183,212.39 |

| | | | | | |
|---------------------|----------------|------------------|------|-----------------|------------------|
| 买入返售金融资产 | 415,045,479.46 | - | - | - | 415,045,479.46 |
| 债权投资 | - | 7,567,975,699.24 | - | - | 7,567,975,699.24 |
| 资产总计 | 594,309,184.95 | 7,567,975,699.24 | - | - | 8,162,284,884.19 |
| 负债 | | | | | |
| 应付清算款 | - | - | - | 154,669,834.52 | 154,669,834.52 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 986,673.70 | 986,673.70 |
| 应付托管费 | - | - | - | 328,891.22 | 328,891.22 |
| 应交税费 | - | - | - | 187,210.14 | 187,210.14 |
| 其他负债 | - | - | - | 148,135.58 | 148,135.58 |
| 负债总计 | - | - | - | 156,320,745.16 | 156,320,745.16 |
| 利率敏感度缺口 | 594,309,184.95 | 7,567,975,699.24 | - | -156,320,745.16 | 8,005,964,139.03 |
| 上年度末 2024年04月16日 | 1年以内 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |
| 资产 | | | | | |
| 货币资金 | 62,967,186.51 | - | - | - | 62,967,186.51 |

| | | | | | |
|---------|----------------|---|---|-------------|----------------|
| 结算备付金 | 40,671,592.64 | - | - | - | 40,671,592.64 |
| 资产总计 | 103,638,779.15 | - | - | - | 103,638,779.15 |
| 负债 | | | | | |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 14,399.04 | 14,399.04 |
| 应付托管费 | - | - | - | 4,799.68 | 4,799.68 |
| 其他负债 | - | - | - | 276,357.39 | 276,357.39 |
| 负债总计 | - | - | - | 295,556.11 | 295,556.11 |
| 利率敏感度缺口 | 103,638,779.15 | - | - | -295,556.11 | 103,343,223.04 |

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

于2025年06月30日，本基金未持有浮动利率类的固定收益品种(2024年4月16日：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2024年4月16日：同)。

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固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

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

于本期末，本基金未持有持续的以公允价值计量的金融工具(2024年4月16日：同)。

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

无。

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4月16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、债权投资和其他金融负债等(2024年4月16日：同)。

除债权投资以外，其他不以公允价值计量的金融资产和金融负债的账面价值与公允价值差异很小。

于2025年6月30日，本基金持有的债权投资的账面价值为7,567,975,699.24元，公允价值为7,569,800,365.66元。于2024年4月16日(基金暂停运作前的最后运作日)，本基金未持有债权投资。债权投资按如下原则确定公允价值：(i) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。(ii) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。(iii) 如经济环

境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布<关于固定收益品种的估值处理标准>的通知之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值，本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和可交换债券除外)。按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值；本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。于2025年6月30日，本基金持有的上述投资的公允价值均属于第二层次(2024年4月16日：本基金未持有上述投资)。

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 | - | - |
| | 其中：股票 | - | - |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 7,567,975,699.24 | 92.72 |
| | 其中：债券 | 7,567,975,699.24 | 92.72 |
| | 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 | 415,045,479.46 | 5.08 |
| | 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 | 179,263,705.49 | 2.20 |
| 8 | 其他各项资产 | - | - |

| | | | |
|---|----|------------------|--------|
| 9 | 合计 | 8,162,284,884.19 | 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

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未买入股票。

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

本基金本报告期末未卖出股票。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期末未买入卖出股票。

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 | 223,446,787.02 | 2.79 |
| | 其中：政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | 1,336,557,227.08 | 16.69 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | 6,007,971,685.14 | 75.04 |
| 7 | 可转债(可交换债) | - | - |
| 8 | 同业存单 | - | - |

| | | | |
|----|----|------------------|-------|
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 7,567,975,699.24 | 94.53 |

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 | 102282521 | 22华润控股MTN004 | 3,000,000 | 310,211,473.46 | 3.87 |
| 2 | 102582294 | 25华润控股MTN003 A | 3,000,000 | 298,482,674.05 | 3.73 |
| 3 | 102582175 | 25保利发展MTN002 | 2,500,000 | 250,152,072.11 | 3.12 |
| 4 | 102282701 | 22中海企业MTN006 (绿色) | 2,000,000 | 205,596,077.99 | 2.57 |
| 5 | 102580954 | 25京城投MTN001 | 2,000,000 | 203,278,501.53 | 2.54 |

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 本基金本报告期末未投资股票，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

本基金本报告期末无其他资产。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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

| 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 |
| 276 | 28,985,391.12 | 7,999,961,828.60 | 100.00% | 6,119.54 | 0.00% |

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 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 | 4,022.64 | 0.0001% |

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 | 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 | 0~10 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 0 |

§9 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|----------------------------|------------------|
| 基金合同生效日(2020年12月18日)基金份额总额 | 4,200,126,953.49 |
| 本报告期期初基金份额总额 | - |
| 本报告期基金总申购份额 | 7,999,967,948.14 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | - |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 7,999,967,948.14 |

注：1. 申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

2. 根据《汇安恒利39个月定期开放纯债债券型证券投资基金基金合同》及《汇安恒利39个月定期开放纯债债券型证券投资基金招募说明书》的相关规定，本基金于2025年5月29日(基金恢复运作日)至对应的39个月后的月度对日(指日历月，如该日为非工作日或无对应日期，则顺延至下一工作日)的前一日止期间暂不向投资人开放基金交易。

§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，本基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|------|--------|------|--------------|-----------|------------|----|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 | |
| 东方证券 | 2 | - | - | - | - | - |

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 |
| 东方证券 | 1,187,686,810.00 | 100.00% | 4,900,000,000.00 | 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 | 汇安恒利39个月定期开放纯债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 |
| 3 | 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（2 | 规定报刊和/或公司网站 | 2025-03-31 |

| | | | |
|----|---|-------------|------------|
| | 024年度) | | |
| 4 | 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 |
| 5 | 汇安基金管理有限责任公司关于汇安恒利39个月定期开放纯债债券型证券投资基金恢复运作并开放申购、赎回的公告 | 规定报刊和/或公司网站 | 2025-05-26 |
| 6 | 关于汇安恒利39个月定期开放纯债债券型证券投资基金降低管理费、托管费率并修改法律文件的公告 | 规定报刊和/或公司网站 | 2025-05-26 |
| 7 | 汇安恒利39个月定期开放纯债债券型证券投资基金基金合同 | 规定报刊和/或公司网站 | 2025-05-26 |
| 8 | 汇安恒利39个月定期开放纯债债券型证券投资基金托管协议 | 规定报刊和/或公司网站 | 2025-05-26 |
| 9 | 汇安恒利39个月定期开放纯债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 | 2025-05-29 |
| 10 | 汇安恒利39个月定期开放纯债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 | 2025-05-29 |
| 11 | 汇安基金管理有限责任公司关于汇安恒利39个月定期开放纯债债券型证券投资基金提前结束开放期并进入下一封闭期的公告 | 规定报刊和/或公司网站 | 2025-05-29 |
| 12 | 关于汇安恒利39个月定期开放纯债债券型证券投资基金申购比例确认结果的公告 | 规定报刊和/或公司网站 | 2025-05-30 |

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 | | | | | 报告期末持有基金情况 | |
|--|----------------|------------------------|------|--------|------|------------|-------|
| | 序号 | 持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额 | 份额占比 |
| 个人 | 1 | 20250528-20250528 | - | 501.52 | - | 501.52 | 0.00% |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| 本基金本报告期内存在单一基金份额持有人持有基金份额比例超过20%的情况，投资人在投资本基金时，可能面临本基金因持有人集中度较高而产生的相应风险，具体包括：巨额赎回风险、流动性风险、基金资产净值持续低于5000万元的风险、基金份额净值大幅波动风险以及基金收益水平波动风险。本基金管理人将在基金运作中对以上风险进行严格的监控和管理，保护中小投资者利益。 | | | | | | | |

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

《汇安恒利39个月定期开放纯债债券型证券投资基金基金合同》自2020年12月28日生效，汇安恒利39个月定期开放纯债债券型证券投资基金已于2024年4月17日暂停运作。

根据2025年5月26日《汇安基金管理有限责任公司关于汇安恒利39个月定期开放纯债债券型证券投资基金恢复运作并开放申购、赎回的公告》以及基金合同等相关约定，基金管理人经与基金托管人浙商银行股份有限公司协商一致，并报中国证监会备案，决定自2025年5月27日起恢复本基金的运作并开放申购、赎回业务。

§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恒利39个月定期开放纯债债券型证券投资基金募集的文件
- (2) 《汇安恒利39个月定期开放纯债债券型证券投资基金基金合同》
- (3) 《汇安恒利39个月定期开放纯债债券型证券投资基金招募说明书》

- (4) 《汇安恒利39个月定期开放纯债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