

安联睿利 6 个月持有期混合型
证券投资基金
2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：安联基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2026 年 08 月 28 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 8 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 1 月 1 日起至 2026 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	12
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	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	16
§ 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	43
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	45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	46
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	46
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	47
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	47

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	47
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	47
7.12 本报告期投资基金情况	47
7.13 投资组合报告附注	49
§ 8 基金份额持有人信息	50
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	50
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	51
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	51
§ 9 开放式基金份额变动	51
§ 10 重大事件揭示	52
10.1 基金份额持有人大会决议	52
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	52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	52
10.4 基金投资策略的改变	52
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件	52
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况	52
10.7 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	52
10.8 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	53
10.9 其他重大事件	53
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	54
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	54
§ 12 备查文件目录	54
12.1 备查文件目录	54
12.2 存放地点	55
12.3 查阅方式	55

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	安联睿利 6 个月持有期混合型证券投资基金	
基金简称	安联睿利 6 个月持有混合	
基金主代码	025715	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025 年 12 月 23 日	
基金管理人	安联基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	235,655,961.48 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	安联睿利 6 个月持有混合 A	安联睿利 6 个月持有混合 C
下属分级基金的交易代码	025715	025716
报告期末下属分级基金的份额总额	138,924,580.84 份	96,731,380.64 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制组合风险和保持资产适度流动性的基础上，通过积极主动的投资管理，追求风险调整后的长期回报，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	（一）大类资产配置策略 本基金充分考虑客户收益性、风险性和流动性需求的，通过综合分析全球宏观经济形势、国家政策、供求关系、市场流动性和估值水平等环节，关注股票、债券市场的运行状况与风险收益特征，通过自上而下和自下而上的定性及定量分析，判断金融市场运行趋势和不同资产类别在经济周期的不同阶段的相对投资价值，对各大类资产的风险收益特征进行评估，从而确定固定收益类资产和权益类资产的配置比例，并在兼顾收益率和风险的基础上进行动态及时调整。 （二）债券投资策略 本基金通过综合分析国内外宏观经济态势、利率走势、收益率曲线变化趋势和信用风险变化等因素，并结合各种固定收益类资产在特定经济形势下的估值水平、预期收益和预期风险特征，在符合本基金相关投资比例规定的前提下，决定组合的久期水平、期限结构和类属配置，并在此基础之上实施积极的债券投资组合管理，以获取较高的投资收益。 （三）股票投资策略 在严格控制组合风险、保持资产流动性的前提下，本基金将根据股债收益风险比较决定是否参与权益类资产的投资以及参与的比重。 （四）基金投资策略 本基金采用定量分析和定性分析相结合的方式，一方面通过严格的量化规则筛选有潜在投资价值的标的纳入研究范围，另一方面

	结合所选基金的基金管理人的基本情况、投研体系、投研文化等定性因素进行二次研判，双重维度力求筛选出中长期业绩稳定的优秀基金。 (五) 资产支持证券投资策略 (六) 股指期货投资策略 (七) 国债期货投资策略
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×15%+中债新综合全价（总值）指数收益率×80%+同期银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为混合型基金，理论上其预期风险与预期收益低于股票型基金、高于债券型基金和货币市场基金。 本基金投资港股通标的股票的，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，还需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

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		安联基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	管江	许俊
	联系电话	021-38917777	010-66596688
	电子邮箱	customerservice@allianzgi.com.cn	fxjd_hq@bank-of-china.com
客户服务电话		021-38917777	95566
传真		021-58598281	010-66594942
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区临港新片区环湖西二路 888 号 B 楼 1108 室	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址		上海市浦东新区陆家嘴环路 479 号上海中心大厦 33 层 3301-3304 室	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码		200120	100818
法定代表人		郑宇尘	葛海蛟

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
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.allianzgi.com.cn
基金中期报告置备地点	基金管理人及基金托管人办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	安联基金管理有限公司	上海市浦东新区陆家嘴环路 479 号上海中心大厦 33 层 3301-3304 室

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日)	
	安联睿利 6 个月持有混合 A	安联睿利 6 个月持有混合 C
本期已实现收益	4,653,427.65	2,877,555.69
本期利润	7,658,089.72	4,985,218.64
加权平均基金份额本期利润	0.0278	0.0259
本期加权平均净值利润率	2.76%	2.58%
本期基金份额净值增长率	3.27%	3.05%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	2,470,982.00	1,513,314.44
期末可供分配基金份额利润	0.0178	0.0156
期末基金资产净值	143,465,001.34	99,683,338.13
期末基金份额净值	1.0327	1.0305
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	3.27%	3.05%

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3、期末可供分配利润，为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。表中的“期末”指报告期最后一日，即 2026 年 06 月 30 日。

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

安联睿利 6 个月持有混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	5.26%	0.38%	2.27%	0.20%	2.99%	0.18%
过去六个月	3.27%	0.38%	1.94%	0.17%	1.33%	0.21%
自基金合同生效起至今	3.27%	0.37%	1.98%	0.17%	1.29%	0.20%

安联睿利 6 个月持有混合 C

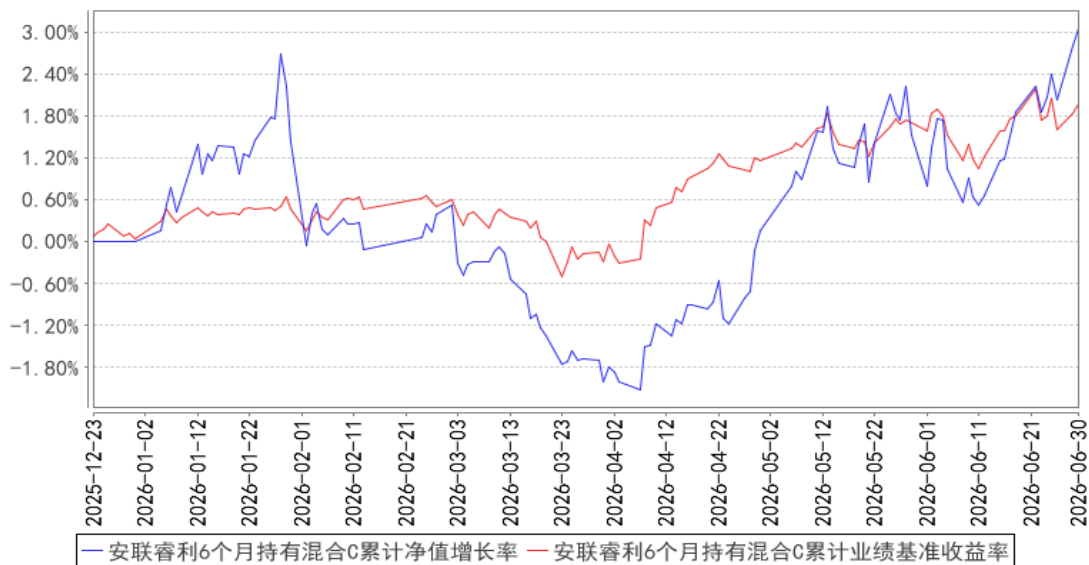
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	5.15%	0.38%	2.27%	0.20%	2.88%	0.18%
过去六个月	3.05%	0.38%	1.94%	0.17%	1.11%	0.21%
自基金合同生效起至今	3.05%	0.37%	1.98%	0.17%	1.07%	0.20%

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

安联睿利6个月持有混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



安联睿利6个月持有混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金合同于 2025 年 12 月 23 日生效，截至本报告期末基金成立未满一年；按照基金合同规

定，本基金自基金合同生效日起 6 个月内为建仓期，建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合基金合同相关约定。

§ 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

安联基金管理有限公司于 2023 年 8 月 23 日经中国证券监督管理委员会《关于核准设立安联基金管理有限公司的批复》（证监许可【2023】1888 号）批准设立，由安联投资有限公司（Allianz Global Investors GmbH）全资持有。截至报告期末，公司共管理 4 只公开募集证券投资基金：安联中国精选混合型证券投资基金、安联安裕债券型证券投资基金、安联睿利 6 个月持有期混合型证券投资基金和安联中国港股通精选混合型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
苏玉平	本基金的基金经理、固收投资部总经理	2025 年 12 月 23 日	-	29 年	苏玉平女士，固收投资部总经理、基金经理，特许金融分析师（CFA），上海财经大学保险学专业学士，上海财经大学货币银行学专业硕士。于 2023 年 1 月加入安联投资，2025 年 3 月起担任安联安裕债券型证券投资基金基金经理，2025 年 12 月起担任安联睿利 6 个月持有期混合型证券投资基金基金经理。曾任海通证券有限责任公司投资银行部项目经理，交通银行托管部内控监察和市场拓展部经理，中德安联保险有限公司投资部部门经理，国联安基金管理有限公司基金经理，华安基金管理有限公司固定收益部基金经理、专户业务总部副总监、养老金业务部副总监，安联寰通海外投资基金管理（上海）有限公司固收投资部总经理。

注：1、基金经理的任职日期及离任日期指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。首任基金经理任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作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投资基金法》等有关法律法规的

规定和基金合同、招募说明书等有关法律文件的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不存在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

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《安联基金管理有限公司公平交易制度》。公司通过科学、制衡的投资决策体系，加强交易执行环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，通过事后检查、事后分析和信息披露来保证公平交易过程和结果的监督。

本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司内部相关制度等规定，从研究分析、投资决策、交易执行、事后监控等环节严格把关，通过系统和人工等方式在各个环节严格控制公平交易执行。本报告期内，本基金管理人公平交易制度和控制要求总体执行情况良好，所管理投资组合不存在非公平交易或利益输送的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本管理人管理的所有投资组合不存在参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况，未发现可能导致不公平交易和利益输送的异常交易情况。

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

2026 年上半年，全球风偏维持高位，海外地缘冲突加剧。

海外方面，上半年地缘政治显著加剧，美国先“闪击”委内瑞拉，后与以色列联合对伊朗发动袭击，伊朗随之封锁霍尔木兹海峡，引发全球能源危机。美国通胀水平随之飙升，沃什上任后的首次 FOMC 会议维持利率不变，但点阵图大幅转鹰，市场利率预期随之大幅修正，开始积极计价加息预期。大类资产中，美元指数在上半年震荡走强，一度逼近 102，30Y 美债利率最高接近 5.2%。美股虽受到地缘冲突冲击影响，但在 AI 投资热潮下表现依然强劲。

国内方面，受政策节奏影响，上半年经济总量整体呈现前高后低，名义增长大幅改善，结构“外强内弱”，以 AI 链为代表的新型产业表现亮眼。上半年在海外 AI 基建带动下，出口表现亮眼，整体保持双位数增长。内需方面表现平平，社零增速逐月走低，5 月社零增速降至 -0.6%，经济 K 型分化加剧。通胀持续回暖，5 月 CPI 同比 1.2%，PPI 同比 3.9%，显示名义增长持续改善。

国内政策方面，两会延续“稳中求进、以进促稳”的总基调，设置更务实的增长区间目标，稳增长力度不弱但避免强刺激，更注重结构优化和风险防控。货币政策延续“适度宽松”的基调，

政策节奏更强调精准与相机抉择。财政政策延续 4.0% 的赤字率，拟发行 1.3 万亿元超长期特别国债，4.4 万亿元地方政府专项债，整体保持了必要的财政力度。但二季度财政实际落地偏缓，上半年专项债与超长期国债落地慢于上年。支出结构上，民生与科技等保持正增，其余多项偏弱，其中多项与基建相关科目仍在收缩。

在多方面因素综合影响下，大类资产上半年整体呈现股债双牛的市场结构。债券市场在流动性宽松背景下小幅走强，中债新综合全价指数一季度上涨 0.92%，中债信用债指数上涨 0.81%，中债金融债指数上涨 0.41%，中债国债指数上涨 0.78%；权益市场整体偏强，上半年沪深 300 指数上涨 7.55%，上证 50 指数下跌 1.38%，创业板指数上涨 35.58%。

基金操作层面，债券端，本基金年初以票息策略为主，但基于内部研究框架阶段性进行了长端利率债交易，在临近半年末时本基金将信用及利率券种结构向基准回归；权益端，本基金年初时看好春季行情并适度超配权益仓位，后续随着国内监管环境变化及外部不确定性因素增多，市场波动显著加大，本基金逐步将仓位回归至业绩基准附近，并以控制组合波动为主要目标。二季度随着中东局势缓和、市场风偏重新回升，本基金主要围绕科技相关板块采取超配策略。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金 A 类份额净值 1.0327 元，本报告期内净值增长率 3.27%，同期业绩比较基准收益率 1.94%；截至本报告期末，本基金 C 类份额净值 1.0305 元，本报告期内净值增长率 3.05%，同期业绩比较基准收益率 1.94%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，全球地缘冲突局势虽阶段性缓和，但不确定性犹存，美联储在新任联储主席的领导下其货币政策节奏仍需进一步观察，海外地缘、流动性等因素或将持续扰动市场风险偏好。同时，国内经济虽在出口支撑下表现出韧性，但内需仍有待提升。下半年预计财政政策及货币政策有望增强协同，以支撑经济平稳增长，随着四季度政策效果落地，经济节奏有望先抑后扬。在此背景下，债券市场或受到供给端压力及通胀的制约，但整体仍将受益于流动性环境平稳和避险需求支撑，预计以震荡为主。权益市场方面，国内经济的平稳运行与政策环境的稳定性，仍为权益资产提供了坚实的中长期支撑，但随着科技股情绪高涨，其估值或受业绩节奏制约，市场波动易加大、风格或将面临再平衡。我们仍将重点关注三大方向：高景气度的科技成长主线；具备国际竞争优势、受益于全球制造业修复的高端制造方向；受益于国内经济平稳及价格回升的顺周期领域。我们将继续在规则化的主动管理框架下动态优化大类资产仓位及结构，力争以长期较小的跟踪误差战胜业绩比较基准。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，本基金管理人严格按照《企业会计准则》、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，委托基金服务机构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。基金管理人及委托的基金服务机构严格执行基金估值控制流程，定期评估估值技术的合理性，基金份额净值经基金托管人复核无误后由基金管理人对外披露。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规、本基金基金合同的约定以及基金的实际运作情况，本报告期内本基金未进行收益分配。本基金将严格按照法律法规及基金合同约定进行收益分配。

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

报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在安联睿利 6 个月持有期混合型证券投资基金（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，完全尽职尽责的履行了应尽的义务。

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的复核，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。

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

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（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等财务数据真实、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：安联睿利 6 个月持有期混合型证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	20,888,430.72	70,588,980.08
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	230,884,437.14	219,146,668.02
其中：股票投资		29,470,537.43	3,243,015.65
基金投资		22,239,636.90	458,173.80
债券投资		179,174,262.81	215,445,478.57
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	1,400,001.40	183,629,408.25
应收清算款		736,901.51	-
应收股利		-	-
应收申购款		10.00	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	32,664.04
资产总计		253,909,780.77	473,397,720.39
负 债 和 净 资 产			
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		-	-
应付赎回款		10,285,121.41	-
应付管理人报酬		253,883.96	72,616.89
应付托管费		53,388.26	15,560.77
应付销售服务费		59,713.71	17,027.80
应付投资顾问费		-	-
应交税费		39,107.72	2,036.89
应付利润		-	-

递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	70,226.24	1,804.77
负债合计		10,761,441.30	109,047.12
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	235,655,961.48	473,285,106.77
未分配利润	6.4.7.8	7,492,377.99	3,566.50
净资产合计		243,148,339.47	473,288,673.27
负债和净资产总计		253,909,780.77	473,397,720.39

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额总额 235,655,961.48 份，其中 A 类基金份额净值 1.0327 元，基金份额 138,924,580.84 份；C 类基金份额净值 1.0305 元，基金份额 96,731,380.64 份。

6.2 利润表

会计主体：安联睿利 6 个月持有期混合型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
一、营业总收入		15,089,006.34
1. 利息收入		354,417.72
其中：存款利息收入	6.4.7.9	24,616.36
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		329,801.36
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		9,622,263.60
其中：股票投资收益	6.4.7.10	614,888.61
基金投资收益	6.4.7.11	2,892,124.57
债券投资收益	6.4.7.12	5,722,556.52
资产支持证券投资收益	6.4.7.13	-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.14	-
股利收益	6.4.7.15	392,693.90
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	5,112,325.02
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	-
减：二、营业总支出		2,445,697.98

1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	1, 630, 441. 24
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	344, 672. 50
3. 销售服务费	6. 4. 10. 2. 3	382, 471. 58
4. 投资顾问费		—
5. 利息支出		663. 95
其中：卖出回购金融资产支出		663. 95
6. 信用减值损失	6. 4. 7. 19	—
7. 税金及附加		22, 494. 35
8. 其他费用	6. 4. 7. 20	64, 954. 36
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		12, 643, 308. 36
减：所得税费用		—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		12, 643, 308. 36
五、其他综合收益的税后净额		—
六、综合收益总额		12, 643, 308. 36

注：本基金基金合同于 2025 年 12 月 23 日生效，无上年度可比期间数据。

6.3 净资产变动表

会计主体：安联睿利 6 个月持有期混合型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 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	473, 285, 106. 77	3, 566. 50	473, 288, 673. 27
二、本期期初净资产	473, 285, 106. 77	3, 566. 50	473, 288, 673. 27
三、本期增减变动额 （减少以“-”号填列）	-237, 629, 145. 29	7, 488, 811. 49	-230, 140, 333. 80
（一）、综合收益总额	—	12, 643, 308. 36	12, 643, 308. 36
（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）	-237, 629, 145. 29	-5, 154, 496. 87	-242, 783, 642. 16
其中：1. 基金申购款	2, 433, 744. 07	40, 407. 00	2, 474, 151. 07
2. 基金赎回款	-240, 062, 889. 36	-5, 194, 903. 87	-245, 257, 793. 23
（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	235,655,961.48	7,492,377.99	243,148,339.47

注：本基金基金合同于 2025 年 12 月 23 日生效，无上年度可比期间数据。

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：

<u>郑宇尘</u>	<u>卢蓉</u>	<u>龚伟婷</u>
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

安联睿利 6 个月持有期混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可【2025】2074 号《关于准予安联睿利 6 个月持有期混合型证券投资基金注册的批复》注册，由安联基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《安联睿利 6 个月持有期混合型证券投资基金基金合同》公开募集。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 473,061,366.83 元。经向中国证监会备案，《安联睿利 6 个月持有期混合型证券投资基金基金合同》于 2025 年 12 月 23 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 473,285,106.77 份基金份额，其中认购资金利息折合 223,739.94 份基金份额。本基金的基金管理人为安联基金管理有限公司（以下简称“安联基金”），基金托管人为中国银行股份有限公司（以下简称“中国银行”）。

根据《安联睿利 6 个月持有期混合型证券投资基金基金合同》和《安联睿利 6 个月持有期混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金根据认购/申购费用、销售服务费、赎回费用收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购或申购时收取认购费或申购费，在投资者赎回时根据持有期限收取赎回费，并不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；在投资者认购或申购时不收取认购费或申购费，在投资者赎回时根据持有期限收取赎回费，且从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 C 类基金份额。A 类基金份额、C 类基金份额分别设置代码，分别计算和公告其基金份额净值和其基金份额累计净值。基金份额净值计算公式为计算日该类别基金资产净值除以计算日该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《安联睿利 6 个月持有期混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具, 包括国

内依法发行或上市的股票（包括主板、创业板和其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、港股通标的股票，债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券（含可分离交易可转债）、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券），衍生品（包括股指期货、国债期货），资产支持证券，货币市场工具，同业存单，债券回购，银行存款（包括协议存款、定期存款、通知存款和其他银行存款），经中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金（仅包括全市场的境内股票型 ETF，不包括 QDII 基金、香港互认基金、基金中基金、其他可投资公募基金的非基金中基金、货币市场基金）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。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率 $\times$ 15%+中债新综合全价（总值）指数收益率 $\times$ 80%+同期银行活期存款利率（税后） $\times$ 5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础编制财务报表。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》（以下合称“企业会计准则”）的要求，同时亦按照中国证券投资基金业协会（以下简称“基金业协会”）颁布的《公开募集证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号——年度报告和中期报告》、《证券投资基金会计核算业务指引》及财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、基金业协会发布的其他有关基金行业实务操作的规定编制财务报表。

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财政部颁布的企业会计准则及附注 6.4.2 中所列示的中国证监会和基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2026 年 6 月 30 日的财务状况、自 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为自 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币，编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(a) 金融资产的分类

本基金的金融工具包括股票投资、债券投资、基金投资和买入返售金融资产等。

本基金通常根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征，在初始确认时将金融资产分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以摊余成本计量的金融资产。

除非本基金改变管理金融资产的业务模式，在此情形下，所有受影响的相关金融资产在业务模式发生变更后的首个报告期间的第一天进行重分类，否则金融资产在初始确认后不得进行重分类。

本基金将同时符合下列条件且未被指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，分类为以摊余成本计量的金融资产：

- 本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标；
- 该金融资产的合同条款规定，在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。

除上述以摊余成本计量的金融资产外，本基金将其余所有的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。本基金现无分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

管理金融资产的业务模式，是指本基金如何管理金融资产以产生现金流量。业务模式决定本基金所管理金融资产现金流量的来源是收取合同现金流量、出售金融资产还是两者兼有。本基金以客观事实为依据、以关键管理人员决定的对金融资产进行管理的特定业务目标为基础，确定管理金融资产的业务模式。

本基金对金融资产的合同现金流量特征进行评估，以确定相关金融资产在特定日期产生的合同现金流量是否仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。其中，本金是指金融资产在初始确认时的公允价值；利息包括对货币时间价值、与特定期未偿付本金金额相关的信用风险、以及其他基本借贷风险、成本和利润的对价。此外，本基金对可能导致金融资产合同现金流量的时间分布或金额发生变更的合同条款进行评估，以确定其是否满足上述合同现金流量特征的要求。

(b) 金融负债的分类

本基金将金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及以摊余成本计量的金融负债。

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

该类金融负债包括交易性金融负债（含属于金融负债的衍生工具）和指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

- 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

本基金现无分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

(a) 金融工具的初始确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

(b) 后续计量

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产以公允价值进行后续计量，产生的利得或损失（包括利息和股利收入）计入当期损益，除非该金融资产属于套期关系的一部分。

- 以摊余成本计量的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产采用实际利率法以摊余成本计量。以摊余成本计量且不属于任何套期关系的一部分的金融资产所产生的利得或损失，在终止确认、重分类、按照实际利率法摊销或确认减值时，计入当期损益。

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债以公允价值进行后续计量，除与套期会计有关外，产生的利得或损失（包括利息费用）计入当期损益。

- 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

(c) 金融工具的终止确认

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；
- 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；
- 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险

和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

- 所转移金融资产在终止确认日的账面价值；
- 因转移金融资产而收到的对价。

金融负债（或其一部分）的现时义务已经解除的，本基金终止确认该金融负债（或该部分金融负债）。

（d）金融工具的减值

本基金以预期信用损失为基础，对下列项目进行减值会计处理并确认损失准备：

- 以摊余成本计量的金融资产

本基金持有的其他以公允价值计量的金融资产不适用预期信用损失模型。

预期信用损失的计量

预期信用损失，是指以发生违约的风险为权重的金融工具信用损失的加权平均值。信用损失，是指本基金按照原实际利率折现的、根据合同应收的所有合同现金流量与预期收取的所有现金流量之间的差额，即全部现金短缺的现值。

在计量预期信用损失时，本基金需考虑的最长期限为面临信用风险的最长合同期限（包括考虑续约选择权）。

整个存续期预期信用损失，是指因金融工具整个预计存续期内所有可能发生的违约事件而导致的预期信用损失。

未来 12 个月内预期信用损失，是指因资产负债表日后 12 个月内（若金融工具的预计存续期少于 12 个月，则为预计存续期）可能发生的金融工具违约事件而导致的预期信用损失，是整个存续期预期信用损失的一部分。

本基金对满足下列情形的金融工具按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备，对其他金融工具按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备：

- 该金融工具在资产负债表日只具有较低的信用风险；或
- 该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加。

预期信用损失准备的列报

为反映金融工具的信用风险自初始确认后的变化，本基金在每个资产负债表日重新计量预期信用损失，由此形成的损失准备的增加或转回金额，应当作为减值损失或利得计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融资产，损失准备抵减该金融资产在资产负债表中列示的账面价值。

核销

如果本基金不再合理预期金融资产合同现金流量能够全部或部分收回，则直接减记该金融资产的账面余额。这种减记构成相关金融资产的终止确认。这种情况通常发生在本基金确定债务人没有资产或收入来源可产生足够的现金流量以偿还将被减记的金额。但是，被减记的金融资产仍可能受到本基金催收到期款项相关执行活动的影响。

已减记的金融资产以后又收回的，作为减值损失的转回计入收回当期的损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，根据企业会计准则的规定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。

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，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。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

对不存在活跃市场的金融工具，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。采用估值技术确定公允价值时，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。

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整并确定公允价值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；
- 本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购、赎回和分红再投资引起的实收基金份额变动分别于上述各交易确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量，并于会计期末全额转入未分配利润。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

利息收入

存款利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认为利息收入。

投资收益

股票投资收益、债券投资收益、基金投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其初始计量金额的差额确认，处置时产生的交易费用计入投资收益。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资，在其持有期间，按票面金额和票面利率计算的利息计入投资收益。

基金投资在持有期间应取得的红利于除息日确认为投资收益。

公允价值变动收益

公允价值变动收益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、衍生金融工具、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。不包括本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资在持有期间按票面利率计算的利息。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

根据《安联睿利 6 个月持有期混合型证券投资基金基金合同》的规定，在符合有关基金分红条件的前提下，基金管理人可对本基金进行基金分红；若基金合同生效不满 3 个月，本基金可不进行收益分配。本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可对各类基金份额分别选择不同的分红方式，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；通过红利再投资所得基金份额的最短持有期起始日与该认/申购份额最短持有期起始日相同。基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值。同一类别每一基金份额享有同等分配权；由于本基金各类基金份额在费用收取上不同，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同。法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在遵守法律法规和监管部门的规定，且对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人在与基金托管人协商一致并按照监管部门要求履行适当程序后可对基金收益分配原则和支付方式进行调整，但应于变更实施日前在规定媒介公告。

6.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

6.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

编制财务报表时，本基金需要运用估计和假设，这些估计和假设会对会计政策的应用及资产、负债、收入和支出的金额产生影响。实际情况可能与这些估计不同。本基金对估计涉及的关键假设和不确定因素的判断进行持续评估，会计估计变更的影响在变更当期和未来期间予以确认。

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证券监督管理委员会关于证券投资基

金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

对于在发行时明确一定期限限售期的股票，根据中基协发[2017]6 号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》，在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值日流通受限股票的价值。

根据《关于固定收益品种的估值处理标准》在银行间债券市场、上海证券交易所、深圳证券交易所、北京证券交易所及中国证券监督管理委员会认可的其他交易场所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值基准服务机构提供的价格数据进行估值。

对于基金投资，根据中基协发[2017]3 号《关于发布〈基金中基金估值业务指引（试行）〉的通知》之附件《基金中基金估值业务指引（试行）》，按如下方法估值：

(a) 对于交易型开放式指数基金、境内上市定期开放式基金及封闭式基金，按所投资基金估值日的收盘价估值；

(b) 对于境内上市开放式基金（LOF）及其他境内非货币市场基金，按所投资基金估值日的份额净值估值；

(c) 对于境内上市交易型货币市场基金，如所投资基金披露份额净值，则按所投资基金估值日的份额净值估值；如所投资基金披露万份（百份）收益，则按所投资基金前一估值日后至估值日期间（含节假日）的万份（百份）收益计提估值日基金收益；

(d) 对于境内非上市货币市场基金按所投资基金前一估值日后至估值日期间（含节假日）的万份收益计提估值日基金收益。

如遇所投资基金不公布基金份额净值、进行折算或拆分、估值日无交易等特殊情况，本基金根据以下原则进行估值：

(1) 以所投资基金的基金份额净值估值的，若所投资基金与基金中基金估值频率一致但未公布估值日基金份额净值，按其最近公布的基金份额净值为基础估值。

(2) 以所投资基金的收盘价估值的，若估值日无交易，且最近交易日后市场环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后市场环境发生了重大变化的，可使用最新的基金份额净值为基础或参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素调整最近交易市价，确定公允价值。

(3) 如果所投资基金前一估值日至估值日期间发生分红除权、折算或拆分，基金管理人应根据基金份额净值或收盘价、单位基金份额分红金额、折算拆分比例、持仓份额等因素合理确定公允

价值。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[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[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85 号文《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[2014]81 号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127 号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号文《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 号文《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 号文《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》、中投信〔2021〕20 号《关于香港联合交易所有限公司上调股票交易印花税率有关提示的通知》、财政部税务总局公告 2023 年第 2 号《关于延续实施有关个人所得税优惠政策的公告》、财政部税务总局中国证监会公告 2023 年第 23 号《关于延续实施沪港、深港股票市场交易互联互通机制和内地与香港基金互认有关个人所得税政策的公告》、财税[2023]39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部税务总局公告 2024 年第 8 号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2025]4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、《中华人民共和国增值税法实施条例》、财税[2026]10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

a) 本基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的规定征收率计算缴纳增值税。

本基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入，自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，免征增值税；对金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税，对该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。本基金管理人运营本基金提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

b) 对投资者从本基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

对本基金从中国内地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。

c) 对本基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）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。对本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。

对本基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向本基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。

对内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称中国结算）提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。对本基金通过沪港通、深港通投资香港联交所上市股票取得的股息红利所得，按照上述规定计征个人所得税。

对内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市股票取得的转让差价所得和通过基金互认买卖香港基金份额取得的转让差价所得，继续暂免征收个人所得税，执行至 2027 年 12 月 31 日。

d) 本基金卖出股票按 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。自

2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。对于本基金通过沪港通、深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

e) 对本基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照本基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	20,600,573.06
等于：本金	20,598,576.90
加：应计利息	1,996.16
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	287,857.66
等于：本金	287,293.61
加：应计利息	564.05
减：坏账准备	-
合计	20,888,430.72

注：其他存款本期末余额为存放在证券经纪商的证券交易结算资金。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		25,201,768.38	-	29,470,537.43	4,268,769.05
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	14,337,147.03	154,810.73	14,424,601.65	-67,356.11
	银行间市场	163,347,791.79	1,368,661.16	164,749,661.16	33,208.21
	合计	177,684,938.82	1,523,471.89	179,174,262.81	-34,147.90
资产支持证券		-	-	-	-

基金	21,355,148.88	-	22,239,636.90	884,488.02
其他	-	-	-	-
合计	224,241,856.08	1,523,471.89	230,884,437.14	5,119,109.17

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	1,400,001.40	-
银行间市场	-	-
合计	1,400,001.40	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 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	9,810.05
其中：交易所市场	-
银行间市场	9,810.05
应付利息	-
预提费用-审计费	22,315.49
预提费用-信息披露费	38,100.70
合计	70,226.24

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

安联睿利 6 个月持有混合 A

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额

上年度末	279,066,214.79	279,066,214.79
本期申购	1,110,717.43	1,110,717.43
本期赎回(以“-”号填列)	-141,252,351.38	-141,252,351.38
本期末	138,924,580.84	138,924,580.84

安联睿利 6 个月持有混合 C

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	194,218,891.98	194,218,891.98
本期申购	1,323,026.64	1,323,026.64
本期赎回(以“-”号填列)	-98,810,537.98	-98,810,537.98
本期末	96,731,380.64	96,731,380.64

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额（如适用）。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

安联睿利 6 个月持有混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	18,812.79	-6,669.84	12,142.95
本期期初	18,812.79	-6,669.84	12,142.95
本期利润	4,653,427.65	3,004,662.07	7,658,089.72
本期基金份额交易产生的变动数	-2,201,258.44	-928,553.73	-3,129,812.17
其中：基金申购款	4,776.98	14,817.92	19,594.90
基金赎回款	-2,206,035.42	-943,371.65	-3,149,407.07
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,470,982.00	2,069,438.50	4,540,420.50

安联睿利 6 个月持有混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-3,935.54	-4,640.91	-8,576.45
本期期初	-3,935.54	-4,640.91	-8,576.45
本期利润	2,877,555.69	2,107,662.95	4,985,218.64
本期基金份额交易产生的变动数	-1,360,305.71	-664,378.99	-2,024,684.70
其中：基金申购款	6,328.02	14,484.08	20,812.10
基金赎回款	-1,366,633.73	-678,863.07	-2,045,496.80
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,513,314.44	1,438,643.05	2,951,957.49

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	5,740.92

定期存款利息收入	16,916.67
其他存款利息收入	1,958.77
结算备付金利息收入	—
其他	—
合计	24,616.36

注：其他存款利息收入为存放在证券经纪商的证券交易结算资金产生的利息收入。

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	563,809,574.89
减：卖出股票成本总额	562,264,946.63
减：交易费用	929,739.65
买卖股票差价收入	614,888.61

6.4.7.11 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出/赎回基金成交总额	432,032,800.52
减：卖出/赎回基金成本总额	428,998,903.59
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	97,677.82
减：交易费用	44,094.54
基金投资收益	2,892,124.57

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

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	4,179,605.60
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	1,542,950.92
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	5,722,556.52

6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	810,390,138.62
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	799,222,677.51
减：应计利息总额	9,602,495.87
减：交易费用	22,014.32
买卖债券差价收入	1,542,950.92

6.4.7.12.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无债券投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.12.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无债券投资收益——申购差价收入。

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

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

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

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资产生的股利收益	297,872.90
其中：证券出借权益补偿收入	—
基金投资产生的股利收益	94,821.00
合计	392,693.90

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
1. 交易性金融资产	5,130,419.92
股票投资	4,297,038.40
债券投资	-57,439.83
资产支持证券投资	—
基金投资	890,821.35
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	18,094.90
合计	5,112,325.02

6.4.7.17 其他收入

本基金本报告期内无其他收入。

6.4.7.18 持有基金产生的费用

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	-
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	58,991.94
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	12,977.42

注：当期持有基金产生的应支付销售服务费、应支付管理费、应支付托管费按照被投资基金基金合同约定已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，上表列示金额为按照本基金对被投资基金的实际持仓情况根据被投资基金基金合同约定的相应费率计算得出。

6.4.7.19 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	22,315.49
信息披露费	36,295.93
证券出借违约金	-
账户维护费_中债登	3,000.00
账户维护费_上清所	3,200.00
证券组合费	142.94
合计	64,954.36

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
安联基金	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国银行	基金托管人、基金销售机构
安联投资有限公司	基金管理人的股东
安联环球投资亚太有限公司（以下简称“安联环球投资亚太”）	与基金管理人存在其他重大利害关系的关联方

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 基金交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行基金交易。

6.4.10.1.5 权证交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,630,441.24
其中：应支付销售机构的客户维护费	796,921.78
应支付基金管理人的净管理费	833,519.46

注：本基金对基金财产中持有的本基金管理人自身管理的基金部分不收取管理费。本基金的管理费按前一日基金资产净值扣除基金资产中本基金管理人管理的其他基金份额所对应资产净值后剩余部分（若为负数，则 E 取 0）的 0.70% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E\times 0.70\%\div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值扣除基金资产中本基金管理人管理的其他基金份额所对应资产净值后剩余部分（若为负数，则取 0）

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	344,672.50

注：本基金投资于本基金托管人所托管的基金的部分不收取托管费。本基金的托管费按前一日基金资产净值扣除基金资产中本基金托管人托管的其他基金份额所对应资产净值后剩余部分（若为负数，则 E 取 0）的 0.15% 年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E\times 0.15\%\div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值扣除基金资产中本基金托管人托管的其他基金份额所对应资产净值后剩余部分（若为负数，则取 0）

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	安联睿利 6 个月持有混合 A	安联睿利 6 个月持有混合 C	合计
中国银行	-	319,579.24	319,579.24
合计	-	319,579.24	319,579.24

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.40%。
本基金 C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.40% 年费率计提。计算方法如下：

$$H=E\times 0.40\%\div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

C 类基金份额的销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金在本报告期末与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金在本报告期末与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。本基金合同生效日为 2025 年 12 月 23 日，无上年度同期对比数据。

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

安联睿利 6 个月持有混合 A

关联方名称	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 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 (%)
安联环球 投资亚太	10,001,318.33	7.20	10,001,318.33	3.58

注：本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资安联睿利 6 个月持有混合 C。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
中国银行	20,600,573.06	5,740.92

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，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

本基金本报告期内无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

6.4.10.8.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用

本基金本报告期内无当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2026 年 6 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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
118071	华峰转债	2026 年 06 月 24 日	1 个月内（含）	新债未上市	100.00	100.00	450	45,000.00	45,000.79	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人制定了政策和程序来识别、分析和管理基金在日常经营活动中涉及的各类风险，并设定适当的风险限额和内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控各类风险。本基金管理人建立了由董事会及其下设的风险控制委员会、监事会、管理层、风险管理委员会、督察长、法务部、合规部、风险管理部以及各业务部门共同组成的全面风险管理架构体系，各部门和人员

根据公司制度规定履行各自的风险管理职责，形成合作、制衡的风险管理机制。

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同责任，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于信用良好的银行，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，违约风险可能性很小；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。

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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
A-1	—	—
A-1 以下	—	—
未评级	13,652,952.14	214,971,567.56
合计	13,652,952.14	214,971,567.56

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为国债、政策性金融债等无信用评级的债券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金于本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
AAA	10,902,921.60	473,911.01
AAA 以下	45,000.79	—
未评级	154,573,388.28	—
合计	165,521,310.67	473,911.01

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为国债、政策性金融债等无信用评级的债券

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金于本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《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，建立健全公开募集证券投资基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金进行持续的流动性风险管理。

基金管理人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。基金管理人在本基金合同中设计了巨额赎回条款，约定对巨额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。

报告期内，本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，所持有的大部分投资品种均可在证券交易所或银行间同业市场进行交易，资产变现能力较强。此外，基金管理人通过对本基金的流动性指标进行持续的监测和分析，并建立流动性风险内部管控流程，确保本基金保持较好的流动性。

本基金本报告期末无重大流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	20,888,430.72	-	-	-	20,888,430.72
交易性金融资产	65,371,170.41	71,937,506.85	41,865,585.55	51,710,174.33	230,884,437.14
买入返售金融资产	1,400,001.40	-	-	-	1,400,001.40
应收证券清算款	-	-	-	736,901.51	736,901.51
应收申购款	-	-	-	10.00	10.00
资产总计	87,659,602.53	71,937,506.85	41,865,585.55	52,447,085.84	253,909,780.77
负债					
应付赎回款	-	-	-	10,285,121.41	10,285,121.41
应付管理人报酬	-	-	-	253,883.96	253,883.96
应付托管费	-	-	-	53,388.26	53,388.26
应付销售服务费	-	-	-	59,713.71	59,713.71
应交税费	-	-	-	39,107.72	39,107.72
其他负债	-	-	-	70,226.24	70,226.24
负债总计	-	-	-	10,761,441.30	10,761,441.30
利率敏感度缺口	87,659,602.53	71,937,506.85	41,865,585.55	41,685,644.54	243,148,339.47
上年度末 2025 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	70,588,980.08	-	-	-	70,588,980.08
交易性金融资产	215,445,478.57	-	-	3,701,189.45	219,146,668.02
买入返售金融资产	183,629,408.25	-	-	-	183,629,408.25
其他资产	-	-	-	32,664.04	32,664.04
资产总计	469,663,866.90	-	-	3,733,853.49	473,397,720.39
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	72,616.89	72,616.89
应付托管费	-	-	-	15,560.77	15,560.77
应付销售服务费	-	-	-	17,027.80	17,027.80
应交税费	-	-	-	2,036.89	2,036.89
其他负债	-	-	-	1,804.77	1,804.77
负债总计	-	-	-	109,047.12	109,047.12
利率敏感度缺口	469,663,866.90	-	-	3,624,806.37	473,288,673.27

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（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	市场利率上升 25 个基点	-1,739,776.78	-23,046.34
	市场利率下降 25 个基点	1,794,835.58	23,058.35

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。本基金持有非记账本位币人民币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	2,251,802.73	-	2,251,802.73
资产合计	-	2,251,802.73	-	2,251,802.73
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	2,251,802.73	-	2,251,802.73
项目	上年度末 2025 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
资产合计	-	-	-	-
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	-	-	-

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

于本报告期末，本基金持有的外币资产占基金资产净值的比例为 0.93%，因此外币汇率的变化对于本基金资产净值无重大影响。

于上年度末，本基金未持有外币资产，因此外币汇率的变化对于本基金资产净值无重大影响。

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。本基金主要投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金份额、证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券，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。

本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。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，同时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 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例（%）	公允价值	占基金资产净值 比例（%）
交易性金融资产—股票投资	29,470,537.43	12.12	3,243,015.65	0.69
交易性金融资产—基金投资	22,239,636.90	9.15	458,173.80	0.10
交易性金融资产—债券投资	179,174,262.81	73.69	215,445,478.57	45.52
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	230,884,437.14	94.96	219,146,668.02	46.30

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1. 基金的市场价格风险决定于基金相对沪深 300 的贝塔系数，以及沪深 300 指数的变动	
	2. 除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）

	本期末（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
沪深 300 指数上升 5%	3,529,342.61	—
沪深 300 指数下降 5%	-3,529,342.61	—

注：于上年度末，本基金持有的交易性权益类证券与公募基金公允价值占基金净资产的比例为 0.79%，因此其他价格风险对于本基金净资产无重大影响。

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层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下： 第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价； 第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值； 第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	52,436,823.05	4,175,100.46
第二层次	178,447,614.09	214,971,567.56
第三层次	—	—
合计	230,884,437.14	219,146,668.02

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。 对于证券交易所上市的股票和可转换债券等，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，本基金分别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不会将相关股票和可转换债券等的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。

于本报告期间，本基金无公允价值所属层次间的重大变动。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2026 年 6 月 30 日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融工具主要包括以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

于 2026 年 6 月 30 日，本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

§ 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	29,470,537.43	11.61
	其中：股票	29,470,537.43	11.61
2	基金投资	22,239,636.90	8.76
3	固定收益投资	179,174,262.81	70.57
	其中：债券	179,174,262.81	70.57
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	1,400,001.40	0.55
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	20,888,430.72	8.23
8	其他各项资产	736,911.51	0.29
9	合计	253,909,780.77	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 2,251,802.73 元，占期末基金资产净值比例为 0.93%。

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

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-

B	采矿业	-	-
C	制造业	19,213,082.70	7.90
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,384,162.00	0.98
J	金融业	5,621,490.00	2.31
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	27,218,734.70	11.19

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
信息技术	2,251,802.73	0.93
合计	2,251,802.73	0.93

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

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	688200	华峰测控	8,423	4,422,917.30	1.82
2	688012	中微公司	7,968	3,733,008.00	1.54
3	688141	杰华特	15,532	2,384,162.00	0.98
4	603986	兆易创新	2,900	2,363,500.00	0.97
5	00981	中芯国际	29,000	2,251,802.73	0.93
6	601211	国泰海通	101,500	1,847,300.00	0.76
7	600036	招商银行	50,100	1,778,550.00	0.73
8	002371	北方华创	1,900	1,680,664.00	0.69
9	300750	宁德时代	4,100	1,611,341.00	0.66
10	688041	海光信息	4,258	1,576,737.40	0.65
11	000338	潍柴动力	57,400	1,564,150.00	0.64

12	601628	中国人寿	39,700	1,403,395.00	0.58
13	300308	中际旭创	600	762,000.00	0.31
14	300661	圣邦股份	5,100	731,748.00	0.30
15	601939	建设银行	61,500	592,245.00	0.24
16	301360	荣旗科技	7,300	499,977.00	0.21
17	300408	三环集团	1,600	267,040.00	0.11

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	688012	中微公司	32,461,591.75	6.86
2	300308	中际旭创	21,436,437.00	4.53
3	688256	寒武纪	18,150,125.43	3.83
4	300750	宁德时代	16,989,188.00	3.59
5	603986	兆易创新	14,240,977.44	3.01
6	603993	洛阳钼业	14,209,687.00	3.00
7	06869	长飞光纤光缆	12,988,214.40	2.74
8	002353	杰瑞股份	12,953,790.00	2.74
9	002371	北方华创	12,866,782.00	2.72
10	688072	拓荆科技	9,995,813.95	2.11
11	000811	冰轮环境	9,930,381.60	2.10
12	600346	恒力石化	9,836,179.58	2.08
13	002517	恺英网络	9,791,848.00	2.07
14	688630	芯碁微装	9,710,732.92	2.05
15	300765	石药创新	9,443,844.24	2.00
16	301217	铜冠铜箔	9,426,421.44	1.99
17	688200	华峰测控	9,405,447.01	1.99
18	603619	中曼石油	9,265,876.00	1.96
19	601211	国泰海通	9,241,037.00	1.95
20	603225	新凤鸣	9,006,377.00	1.90

注：“买入金额”按买入成交金额（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	688012	中微公司	30,908,001.63	6.53
2	300308	中际旭创	22,968,160.00	4.85
3	688256	寒武纪	21,284,883.14	4.50
4	300750	宁德时代	14,844,117.00	3.14
5	002353	杰瑞股份	14,497,319.00	3.06
6	06869	长飞光纤光缆	14,463,546.81	3.06

7	603993	洛阳钼业	13,662,301.60	2.89
8	603986	兆易创新	13,339,435.00	2.82
9	002371	北方华创	12,832,888.00	2.71
10	000811	冰轮环境	11,762,285.00	2.49
11	301217	铜冠铜箔	11,150,222.00	2.36
12	688072	拓荆科技	9,742,410.77	2.06
13	300408	三环集团	9,475,580.00	2.00
14	600346	恒力石化	9,169,928.00	1.94
15	688630	芯碁微装	9,030,089.86	1.91
16	002517	恺英网络	8,987,338.00	1.90
17	603225	新凤鸣	8,803,768.46	1.86
18	603619	中曼石油	8,647,389.00	1.83
19	300765	石药创新	8,392,097.00	1.77
20	688200	华峰测控	7,867,232.07	1.66

注：“卖出金额”按卖出成交金额（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	584,195,430.01
卖出股票收入（成交）总额	563,809,574.89

注：“买入股票成本（成交）总额”和“卖出股票收入（成交）总额”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	23,642,225.36	9.72
2	央行票据	-	-
3	金融债券	83,436,076.72	34.31
	其中：政策性金融债	83,436,076.72	34.31
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	71,324,311.22	29.33
7	可转债（可交换债）	771,649.51	0.32
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	179,174,262.81	73.69

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	260203	26 国开 03	400,000	40,491,430.14	16.65

2	210205	21 国开 05	100,000	11,068,334.25	4.55
3	220205	22 国开 05	100,000	10,878,616.44	4.47
4	220210	22 国开 10	100,000	10,812,150.68	4.45
5	102101302	21 亦庄控股 MTN002	100,000	10,354,953.42	4.26

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

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在控制风险的前提下，谨慎适度参与股指期货的投资。本基金在进行股指期货投资中，将有选择地投资于流动性好、交易活跃的股指期货合约，以对冲投资组合的风险、有效管理现金流量或降低建仓或调仓过程中的冲击成本等。

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

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在控制风险的前提下，谨慎适度参与国债期货的投资。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未发生国债期货投资。

7.12 本报告期投资基金情况

7.12.1 投资政策及风险说明

1. 投资政策

本基金可投资于全市场的境内股票型 ETF。

针对此类基金，本基金管理人从标的指数表现、跟踪误差、超额收益、规模变化等多角度进行分析，选取出表现稳定，符合未来市场发展方向的基金。同时，本基金管理人还将通过分析标的基金基金管理人的资产管理规模、投研文化、投资团队稳定性、风险控制能力等因素，对标的基金的业绩稳定性、风险控制能力等方面进行筛选。

本基金还将定期对投资组合进行回顾和动态调整，剔除不再符合筛选标准的标的基金，增加符合筛选标准的基金，以实现基金投资组合的优化。

2. 风险说明

本基金可投资经中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金，可能带来以下风险：

（1）本基金可以投资于其他公开募集的基金，因此本基金所持有的基金的业绩表现、持有基金的基金管理人水平等因素将影响到本基金的基金业绩表现。公开募集的基金不同于银行储蓄和债券等能够提供固定收益预期的金融工具，投资于公开募集的基金既可能分享基金投资所产生的收益，也可能承担基金投资所带来的损失。投资不同类型的基金将获得不同的收益预期，也将承担不同程度的风险。

（2）所投资或持有的基金份额暂停上市或二级市场交易停牌等情况下，本基金存在无法变现持有的基金份额而造成流动性风险的可能性。

（3）除了持有的本基金管理人管理的其他基金部分不收取管理费，持有本基金托管人托管的其他基金部分不收取托管费，申购本基金管理人管理的其他基金不收取申购费、赎回费（不包括按照基金合同应归入基金资产的部分）、销售服务费等，本基金承担的相关基金费用可能比普通的开放式基金高。

（4）本基金投资流通受限基金时，对于封闭式基金而言，当要卖出基金的时候，可能会面临在一定的价格下无法卖出而要降价卖出的风险；对于流通受限基金而言，由于流通受限基金的非流通特性，在本基金参与投资后将在一定的期限内无法流通，在面临基金大规模赎回的情况下有可能因为无法变现造成流动性风险。

7.12.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有基金投资明细

序号	基金代码	基金名称	运作方式	持有份额（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	是否属于基金管理人及管理人关联方所管理的基金
1	159919	嘉实沪深300ETF	交易型开放式	1,915,300.00	10,022,764.90	4.12	否
2	159783	华夏中证科创创业50ETF	交易型开放式	1,902,100.00	2,818,912.20	1.16	否
3	510300	华泰柏瑞沪深300ETF	交易型开放式	512,700.00	2,573,241.30	1.06	否

4	512890	华泰柏瑞中证红利低波动 ETF	交易型开放式	2,399,500.00	2,560,266.50	1.05	否
5	159516	国泰中证半导体材料设备主题 ETF	交易型开放式	1,258,400.00	2,485,340.00	1.02	否
6	588200	嘉实上证科创板芯片 ETF	交易型开放式	151,300.00	746,816.80	0.31	否
7	515880	国泰中证全指通信设备 ETF	交易型开放式	407,000.00	730,972.00	0.30	否
8	159566	易方达国证新能源车电池 ETF	交易型开放式	132,800.00	301,323.20	0.12	否

注：本基金的投资范围包括经中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金，本基金管理人根据基金合同约定并参照《证券投资基金信息披露 XBRL 模板》中“基金中基金”的要求披露本报告期本基金投资基金的情况。

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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

本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有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。

7.13.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同约定的备选股票库。

7.13.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
----	----	----

1	存出保证金	-
2	应收清算款	736,901.51
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	10.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	736,911.51

7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113042	上银转债	726,648.72	0.30

7.13.5 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不存在流通受限情况。

7.13.6 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，投资组合报告中市值占净值比例的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（%）
安联睿利 6 个月持有混合 A	465	298,762.54	10,060,853.81	7.24	128,863,727.03	92.76
安联睿利 6 个月持有混合 C	546	177,163.70	200,031.11	0.21	96,531,349.53	99.79
合计	988	238,518.18	10,260,884.92	4.35	225,395,076.56	95.65

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

额)。

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	安联睿利 6 个月持有混合 A	940,908.55	0.6773
	安联睿利 6 个月持有混合 C	468,272.75	0.4841
	合计	1,409,181.30	0.5980

注：从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.3 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	安联睿利 6 个月持有混合 A	50~100
	安联睿利 6 个月持有混合 C	0~10
	合计	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	安联睿利 6 个月持有混合 A	50~100
	安联睿利 6 个月持有混合 C	0
	合计	50~100

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	安联睿利 6 个月持有混合 A	安联睿利 6 个月持有混合 C
基金合同生效日（2025 年 12 月 23 日）基金份额总额	279,066,214.79	194,218,891.98
本报告期期初基金份额总额	279,066,214.79	194,218,891.98
本报告期基金总申购份额	1,110,717.43	1,323,026.64
减：本报告期基金总赎回份额	141,252,351.38	98,810,537.98
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	138,924,580.84	96,731,380.64

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额（如适用）。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人主要发生如下变更：

2026 年 1 月 23 日起，沈良先生离任总经理，新任董事长职务；郑宇尘先生离任副总经理，新任总经理职务。

2026 年 2 月 13 日起，罗瑞宏先生离任首席信息官。

2026 年 2 月 26 日起，卢蓉女士新任首席信息官。

本报告期内，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

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内无基金投资策略的改变。

10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

报告期内，本基金所投资的基金未发生包括转换运作方式、与其他基金合并、终止基金合同、召开基金份额持有人大会及大会表决意见等重大影响事件。

10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效以来聘请毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）提供审计服务，本报告期内，为本基金进行审计的机构未发生变化。

10.7 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.7.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人无受调查或处罚等情况。

10.7.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.7.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的基金托管业务履职不涉及受调查或处罚等情况。

10.7.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人相关从业人员的基金托管业务履职不涉及受调查或处罚等情况。

10.8 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.8.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
广发证券	3	1,148,005,004.90	100.00	515,995.29	100.00	-

10.8.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例 (%)
广发证券	376,564,602.18	100.00	4,918,428,000.00	100.00	-	-	881,922,345.86	100.00

10.9 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	安联睿利 6 个月持有期混合型证券投资基金（安联睿利 6 个月持有混合 A）基金产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2026 年 1 月 21 日
2	安联睿利 6 个月持有期混合型证券投资基金（安联睿利 6 个月持有混合 C）基金产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2026 年 1 月 21 日
3	安联睿利 6 个月持有期混合型证券投资基金开放日常申购、转换转入、定期定额投资业务公告	中国证监会规定媒介	2026 年 1 月 21 日

4	安联基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会规定媒介	2026 年 1 月 23 日
5	安联基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会规定媒介	2026 年 2 月 14 日
6	安联基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会规定媒介	2026 年 2 月 28 日
7	关于调整旗下部分公募基金风险等级的公告	中国证监会规定媒介	2026 年 3 月 16 日
8	安联基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025 年度）	中国证监会规定媒介	2026 年 3 月 30 日
9	安联基金管理有限公司旗下基金 2026 年第一季度报告提示性公告	中国证监会规定媒介	2026 年 4 月 21 日
10	安联睿利 6 个月持有期混合型证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	中国证监会规定媒介	2026 年 4 月 21 日
11	安联基金管理有限公司对外行使表决权（2025 年度）情况信息披露	中国证监会规定媒介	2026 年 4 月 30 日
12	安联睿利 6 个月持有期混合型证券投资基金开放日常赎回、转换转出业务公告	中国证监会规定媒介	2026 年 6 月 18 日
13	安联睿利 6 个月持有期混合型证券投资基金（安联睿利 6 个月持有混合 A）基金产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2026 年 6 月 18 日
14	安联睿利 6 个月持有期混合型证券投资基金（安联睿利 6 个月持有混合 C）基金产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2026 年 6 月 18 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期内未发生单一投资者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、中国证监会批准募集本基金的文件
- 2、本基金的基金合同
- 3、本基金的托管协议
- 4、本基金的招募说明书
- 5、本基金的各项公告
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照

7、法律法规及中国证监会规定的其他文件

12.2 存放地点

基金管理人的办公场所：上海市浦东新区陆家嘴环路 479 号上海中心大厦 33 层 3301-3304 室。

12.3 查阅方式

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人安联基金管理有限公司。

咨询电话：021-38917777。

公司网址：www.allianzgi.com.cn。

公司办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 479 号上海中心大厦 33 层 3301-3304 室。

安联基金管理有限公司

2026 年 8 月 28 日