

汇安丰恒灵活配置混合型证券投资基金

2026 年中期报告

2026 年 06 月 30 日

基金管理人:汇安基金管理有限责任公司

基金托管人:上海浦东发展银行股份有限公司

送出日期:2026 年 08 月 31 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2026年8月28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	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作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	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	15
§5 托管人报告	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内容的真实、准确和完整发表意见	16
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	18
6.3 净资产变动表	20
6.4 报表附注	22
§7 投资组合报告	45
7.1 期末基金资产组合情况	45
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	46
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	72
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	74
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	75
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	75
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	75
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	75
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	75
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	75
7.12 投资组合报告附注	76
§8 基金份额持有人信息	76

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	76
8.2 盈利投资者数量占比	77
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	77
8.4 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.....	77
§9 开放式基金份额变动.....	78
§10 重大事件揭示	78
10.1 基金份额持有人大会决议	78
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	78
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	78
10.4 基金投资策略的改变	78
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	79
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况.....	79
10.7 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.....	79
10.8 其他重大事件	80
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	81
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	81
§12 备查文件目录	81
12.1 备查文件目录	81
12.2 存放地点	81
12.3 查阅方式	81

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	汇安丰恒灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	汇安丰恒混合	
基金主代码	003845	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017年03月13日	
基金管理人	汇安基金管理有限责任公司	
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	131,503,701.13份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	汇安丰恒混合A	汇安丰恒混合C
下属分级基金的交易代码	003845	003846
报告期末下属分级基金的份额总额	3,039,218.26份	128,464,482.87份

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		汇安基金管理有限责任公司	上海浦东发展银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	郭冬青	汪小敏
	联系电话	010-56711600	021-31888888
	电子邮箱	guodq@huianfund.cn	wangxm8@spdb.com.cn
客户服务电话		010-56711690	95528
传真		010-56711640	021-63602540
注册地址		上海市虹口区欧阳路218弄1号2楼215室	上海市中山东一路12号
办公地址		北京市东城区东直门南大街5号中青旅大厦13层；上海市虹口区东大名路501号白玉兰大厦36层	上海市博成路1388号浦银中心A栋
邮政编码		100007	200126
法定代表人		刘强	张为忠

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.huianfund.cn
基金中期报告置备地点	基金管理人及基金托管人办公地点

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 (2026年01月01日-2026年06月30日)	
	汇安丰恒混合A	汇安丰恒混合C
本期已实现收益	72,785.38	4,373,841.20
本期利润	39,316.24	3,137,334.38
加权平均基金份额本期利润	0.0136	0.0174
本期加权平均净值利润率	1.39%	1.64%
本期基金份额净值增长率	1.47%	1.42%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2026年06月30日)	
期末可供分配利润	-1,143,829.01	-38,835,613.98
期末可供分配基金份额利润	-0.3764	-0.3023
期末基金资产净值	2,977,156.16	136,361,876.00
期末基金份额净值	0.9796	1.0615
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2026年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	-2.04%	6.15%

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、对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分余额的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

汇安丰恒混合A

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

				④		
过去三个月	1.04%	0.16%	2.25%	0.19%	-1.21%	-0.03%
过去六个月	1.47%	0.15%	2.41%	0.17%	-0.94%	-0.02%
过去一年	3.17%	0.12%	5.26%	0.14%	-2.09%	-0.02%
过去三年	4.32%	0.29%	8.44%	0.26%	-4.12%	0.03%
过去五年	1.59%	0.44%	-2.37%	0.41%	3.96%	0.03%
过去七年	11.28%	0.37%	19.67%	0.48%	-8.39%	-0.11%
自基金合同生效起至今	-2.04%	0.57%	32.94%	0.52%	-34.98%	0.05%

汇安丰恒混合C

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	1.02%	0.16%	2.25%	0.19%	-1.23%	-0.03%
过去六个月	1.42%	0.15%	2.41%	0.17%	-0.99%	-0.02%
过去一年	3.08%	0.12%	5.26%	0.14%	-2.18%	-0.02%
过去三年	4.08%	0.29%	8.44%	0.26%	-4.36%	0.03%
过去五年	1.23%	0.44%	-2.37%	0.41%	3.60%	0.03%
过去七年	10.83%	0.37%	19.67%	0.48%	-8.84%	-0.11%
自基金合同生效起至今	6.15%	0.59%	32.94%	0.52%	-26.79%	0.07%

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

汇安丰恒混合A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2017年03月13日-2026年06月30日)



汇安丰恒混合C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2017年03月13日-2026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自2024年3月15日，本基金业绩比较基准由“上证国债指数收益率*50.00%+沪深300指数收益率*50.00%”变更为“中证中信证券量化债股优选稳健策略指数收益率*95.00%+银行活期存款利率(税后)*5.00%”。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为汇安基金管理有限责任公司，于2016年4月19日获中国证监会批复，2016年4月25日正式成立，是业内首家全自然人、由内部核心专业人士控股的公募基金管理公司，注册资本1亿元人民币，注册地为上海市，设北京、上海双总部。公司目前具有公开募集证券投资基金管理、基金销售、特定客户资产管理的资格。

截至2026年6月30日，公司旗下管理71只公募基金：

汇安丰融灵活配置混合型证券投资基金

汇安嘉汇纯债债券型证券投资基金

汇安丰恒灵活配置混合型证券投资基金

汇安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
汇安质选增利债券型证券投资基金
汇安中证红利低波动100指数型证券投资基金
汇安成长领航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		
金鸿峰	多策略组基金经理、 本基金的基金经理	2021- 07-13	-	10年	金鸿峰女士，中央财经大学国防经济学硕士研究生，10年证券、基金行业从业经验。曾任北京市农产品电子商务公司市场部经理，2016年5月加入汇安基金管理有限责任公司，现任多策略组基金经理。2021年7月23日至2022年7月28日，任汇安嘉裕纯债债券型证券投资基金基金经理；2021年8月4日至2022年8月16日，任汇安裕和纯债债券型证券投资基金基金经理；2021年7月13日至2025年3月4日，任汇安中债-广西壮族自治区公司信用类债券指数证券投资基金基金经理；2024年9月25日至2025年12月1日，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；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；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；2025年12月1日至今，任汇安质选增利债券型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	--

- 1、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。
- 2、本基金无基金经理助理。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期末本基金的基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规的规定及基金合同、招募说明书等有关基金法律文件的约定，依照诚实信用、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最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，完善相应制度及流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行，确保公平交易原则的实现。基金管理人公平对待旗下管理的所有投资组合，报告期内公平交易制度得到良好的贯彻执行，未发现存在违反公平交易原则的情况。

报告期内，公司对连续四个季度期间内、不同时间窗口下（如：1日内、3日内、5日内）公司管理的不同投资组合同向交易开展交易价差分析。分析结果表明，本报告期内公司对各投资组合公平对待，不存在利益输送的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

基金管理人严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。本报告期内，本基金未发现可能的异常交易情况，不存在所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边成交量超过该证券当日成交量的5%的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2026年一季度，债市呈短强长震、曲线陡峭化，10年国债在1.78%-1.90%之间震荡，1年期下行至1.3%以下。信用债收益率普降、利差普遍收窄。债市行情受股债跷跷板、流动性充裕、地缘冲突、通胀预期等交织驱动；叠加银行配置加力、供给阶段性扰动，整体呈现出上有顶下有底的震荡行情。二季度债市整体偏强运行，4月资金整体偏松，利率中枢下移，杠杆套息策略有效，5月经济数据呈现出需求端边际走弱的态势，叠加资金价格持续低位，市场交易由短及长，长端收益率进一步下探，6月随着政府债发行缴款以及资金面中枢抬升，债市由此前的趋势性行情转为窄幅震荡。信用债方面，二永债在5月相对强势，特别是4-5年的二永债表现较好，主因是普信债票息较低，利差持续压缩难度较大，机构在低利率环境下需要兼顾票息和流动性的资产，因此二永债的需求较高，但随着6月利率债进入震荡期，二永也随之调整。本产品报告期内权益部分的仓

位在20%以下。债券部分的久期在3左右，信用债配置为主，结构偏向哑铃形态。同时保有一定仓位参与长端和超长端利率债的交易。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末汇安丰恒混合A基金份额净值为0.9796元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为1.47%，同期业绩比较基准收益率为2.41%；截至报告期末汇安丰恒混合C基金份额净值为1.0615元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为1.42%，同期业绩比较基准收益率为2.41%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

往后看，经济弱修复格局依然对债市有支撑，生产端和出口相对有韧性，但内需偏弱压低了名义增长以及融资需求，同时也制约了上游价格向终端产品价格传导，通胀数据更多是结构性的，而非总需求推动的全面抬升。政策不支持大幅度收紧，特别是货币政策方面，央行或更倾向于对流动性的维稳，避免资金大幅度波动。另外需要关注三季度的供给高峰期，央行的对冲工具，以及配置盘的承接能力。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照《企业会计准则》、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，公司运营总监担任估值委员会主席，投资部门、合规风控部和运营部指定人员担任委员。估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备行业研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供银行间同业市场及交易所交易的债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未发生利润分配情况。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

本报告期内，本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对汇安丰恒灵活配置混合型证券投资基金的投资运作进行了监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支以及利润分配等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：汇安丰恒灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2026年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	2,125,070.06	7,484,323.37
结算备付金		-	-

存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	140,373,652.53	278,735,534.99
其中：股票投资		23,748,114.33	24,567,615.38
基金投资		-	-
债券投资		116,625,538.20	254,167,919.61
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		22,381.00	1,237,179.38
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		142,521,103.59	287,457,037.74
负债和净资产	附注号	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		2,997,810.08	13,036,150.06
应付管理人报酬		70,600.97	155,797.55
应付托管费		11,766.84	25,966.25
应付销售服务费		11,513.23	25,810.92
应付投资顾问费		-	-
应交税费		4,285.25	15,471.71

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	86,095.06	172,958.07
负债合计		3,182,071.43	13,432,154.56
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	131,503,701.13	262,011,732.78
未分配利润	6.4.7.8	7,835,331.03	12,013,150.40
净资产合计		139,339,032.16	274,024,883.18
负债和净资产总计		142,521,103.59	287,457,037.74

注：报告截止日2026年6月30日，基金份额总额131,503,701.13份，其中汇安丰恒混合A基金份额净值0.9796元，份额总额3,039,218.26份；汇安丰恒混合C基金份额净值1.0615元，份额总额128,464,482.87份。

6.2 利润表

会计主体：汇安丰恒灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2026年01月01日至2026年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026年01月01日至 2026年06月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至202 5年06月30日
一、营业总收入		4,100,655.89	7,838,138.93
1.利息收入		6,934.29	35,262.38
其中：存款利息收入	6.4.7.9	6,934.29	35,262.38
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		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-” 填列）		5,271,985.85	8,832,026.26
其中：股票投资收益	6.4.7.10	1,994,668.48	1,903,859.98

基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	3,053,759.22	6,011,086.13
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	223,558.15	917,080.15
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失 以“-”号填列）	6.4.7.16	-1,269,975.96	-1,270,439.79
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	91,711.71	241,290.08
减：二、营业总支出		924,005.27	2,617,756.39
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	581,053.90	1,445,918.11
2.托管费	6.4.10.2.2	96,842.32	240,986.27
3.销售服务费	6.4.10.2.3	95,446.43	237,774.66
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		37,271.12	557,896.98
其中：卖出回购金融资产 支出		37,271.12	557,896.98
6.信用减值损失		-	-
7.税金及附加		6,313.61	24,745.29
8.其他费用	6.4.7.18	107,077.89	110,435.08
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		3,176,650.62	5,220,382.54
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		3,176,650.62	5,220,382.54
五、其他综合收益的税后 净额		-	-

六、综合收益总额		3,176,650.62	5,220,382.54
----------	--	--------------	--------------

6.3 净资产变动表

会计主体：汇安丰恒灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2026年01月01日至2026年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2026年01月01日至2026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	262,011,732.78	12,013,150.40	274,024,883.18
二、本期期初净资产	262,011,732.78	12,013,150.40	274,024,883.18
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-130,508,031.65	-4,177,819.37	-134,685,851.02
（一）、综合收益总额	-	3,176,650.62	3,176,650.62
（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）	-130,508,031.65	-7,354,469.99	-137,862,501.64
其中：1.基金申购款	133,469,820.15	7,263,183.65	140,733,003.80
2.基金赎回款	-263,977,851.80	-14,617,653.64	-278,595,505.44
（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	131,503,701.13	7,835,331.03	139,339,032.16

项 目	上年度可比期间		
	2025年01月01日至2025年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	533,816,892.76	6,757,534.39	540,574,427.15
二、本期期初净资产	533,816,892.76	6,757,534.39	540,574,427.15
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-175,436,716.42	3,384,875.20	-172,051,841.22
（一）、综合收益总额	-	5,220,382.54	5,220,382.54
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-175,436,716.42	-1,835,507.34	-177,272,223.76
其中：1.基金申购款	565,123,883.13	9,258,627.71	574,382,510.84
2.基金赎回款	-740,560,599.55	-11,094,135.05	-751,654,734.60
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	358,380,176.34	10,142,409.59	368,522,585.93

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署:

刘强

王嘉浩

江士

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

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

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

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

公司关于汇安丰恒灵活配置混合型证券投资基金变更业绩比较基准并修改基金合同的公告》，本基金的业绩比较基准自2024年3月15日变更为：中证中信证券量化债股优选稳健策略指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5%。

本财务报表由本基金的基金管理人汇安基金管理有限责任公司于2026年8月27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”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的中国证监会颁布的《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》、《汇安丰恒灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2026年6月30日的财务状况以及2026年1月1日至2026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[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》、财政部、国家税务总局公告2025年第4号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、国务院令第826号《中华人民共和国增值税法实施条例》、财政部、税务总局公告2026年第10号《财政部 税务总局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。2027年12月31日前，资管产品管理人运营契约制资管产品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%的征收率缴纳增值税。

2027年12月31日前，对证券投资基金管理人运用基金资产买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对除持有金融债券外的金融同业往来利息收入亦免征增值税。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。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(包含在2025年8月8日之后续发行的部分)的利息收入，免征增值税直至债券到期。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 2026年06月30日
活期存款	1,947,610.01
等于：本金	1,947,413.99
加：应计利息	196.02
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	177,460.05
等于：本金	177,450.08
加：应计利息	9.97
减：坏账准备	-
合计	2,125,070.06

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

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026年06月30日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		21,285,590.01	-	23,748,114.33	2,462,524.32
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	65,003,502.38	529,427.12	64,941,477.12	-591,452.38
	银行间市场	50,948,242.19	296,061.08	51,684,061.08	439,757.81

	合计	115,951,744.57	825,488.20	116,625,538.20	-151,694.57
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		137,237,334.58	825,488.20	140,373,652.53	2,310,829.75

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 2026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	900.00
其中：交易所市场	-
银行间市场	900.00
应付利息	-
预提费用-审计费	24,795.19
预提费用-信息披露费	59,507.37
其他应付	892.50

合计	86,095.06
----	-----------

6.4.7.7 实收基金

6.4.7.7.1 汇安丰恒混合A

金额单位：人民币元

项目 (汇安丰恒混合A)	本期 2026年01月01日至2026年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,547,952.66	2,547,952.66
本期申购	1,629,983.68	1,629,983.68
本期赎回（以“-”号填列）	-1,138,718.08	-1,138,718.08
本期末	3,039,218.26	3,039,218.26

6.4.7.7.2 汇安丰恒混合C

金额单位：人民币元

项目 (汇安丰恒混合C)	本期 2026年01月01日至2026年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	259,463,780.12	259,463,780.12
本期申购	131,839,836.47	131,839,836.47
本期赎回（以“-”号填列）	-262,839,133.72	-262,839,133.72
本期末	128,464,482.87	128,464,482.87

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

6.4.7.8.1 汇安丰恒混合A

单位：人民币元

项目 (汇安丰恒混合A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-1,020,921.85	932,777.02	-88,144.83
本期期初	-1,020,921.85	932,777.02	-88,144.83
本期利润	72,785.38	-33,469.14	39,316.24

本期基金份额交易产生的变动数	-195,692.54	182,459.03	-13,233.51
其中：基金申购款	-641,799.49	598,735.02	-43,064.47
基金赎回款	446,106.95	-416,275.99	29,830.96
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,143,829.01	1,081,766.91	-62,062.10

6.4.7.8.2 汇安丰恒混合C

单位：人民币元

项目 (汇安丰恒混合C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-85,143,639.57	97,244,934.80	12,101,295.23
本期期初	-85,143,639.57	97,244,934.80	12,101,295.23
本期利润	4,373,841.20	-1,236,506.82	3,137,334.38
本期基金份额交易产生的变动数	41,934,184.39	-49,275,420.87	-7,341,236.48
其中：基金申购款	-42,283,704.09	49,589,952.21	7,306,248.12
基金赎回款	84,217,888.48	-98,865,373.08	-14,647,484.60
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-38,835,613.98	46,733,007.11	7,897,393.13

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
活期存款利息收入	6,376.09
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	558.20
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	6,934.29

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01月01日至2026年06月30日
卖出股票成交总额	20,121,711.69
减：卖出股票成本总额	18,097,474.54
减：交易费用	29,568.67
买卖股票差价收入	1,994,668.48

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 2026年01月01日至2026年06月30日
债券投资收益——利息收入	2,167,287.66
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	886,471.56
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	3,053,759.22

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 2026年01月01日至2026年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	195,089,008.65

减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	191,485,545.39
减：应计利息总额	2,696,782.02
减：交易费用	20,209.68
买卖债券差价收入	886,471.56

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 2026年01月01日至2026年06月30日
股票投资产生的股利收益	223,558.15
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	223,558.15

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
1.交易性金融资产	-1,269,975.96
——股票投资	-1,877,471.08
——债券投资	607,495.12
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-

3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-1,269,975.96

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
基金赎回费收入	50,640.46
转换费收入	41,071.25
合计	91,711.71

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
审计费用	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
汇划手续费	4,175.33
账户维护费-中债登	9,000.00
其他	600.00
账户维护费-上清所	9,000.00
合计	107,077.89

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
无。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
汇安基金管理有限责任公司	基金管理人、基金登记机构、基金销售机构
上海浦东发展银行股份有限公司	基金托管人
何斌	基金管理人的股东
秦军	基金管理人的股东
郭小峰	基金管理人的股东
任建辉	基金管理人的股东
刘强	基金管理人的股东
郭兆强	基金管理人的股东
尹喜杰	基金管理人的股东
王福德	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

无。

6.4.10.1.4 债券回购交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	581,053.90	1,445,918.11
其中：应支付销售机构的客户维护费	285,606.15	642,805.30
应支付基金管理人的净管理费	295,447.75	803,112.81

注：支付基金管理人汇安基金管理有限责任公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值0.60%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日基金管理人报酬＝前一日基金资产净值 × 0.60% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	96,842.32	240,986.27

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

日托管费＝前一日基金资产净值 X 0.10% / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

无。

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

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况
无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2026年01月01日至2026年06月30日		2025年01月01日至2025年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
上海浦东发展银行股份有限公司	1,947,610.01	6,376.09	768,902.32	28,248.78

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

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况
无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明
无。

6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

无。

6.4.12 期末（2026年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金，属于证券投资基金中预期风险与预期收益中等的投资品种，其风险收益水平高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过管理及信息系统持续监控上述各类风险。

公司建立董事会领导下的风险管理体系，包括董事会的下设的风险控制委员会、总经理下设的风险管理委员会、督察长、合规风控部以及各个业务部门组成。

公司致力于实行全面、系统的风险管理，通过制定系统化的风险管理程序，对风险管理的整个流程进行评估和改进。公司奉行分工明确、相互协作、彼此牵制的风险管理组织结构，构建由四大防线共同筑成的风险管理体系：第一道防线由各个业务部门构成，各业务部门总监作为风险责任人；第二道监控防线由合规风控部构成，对公司运营过程中产生的或潜在的各项风险进行有效管理，并就内部控制及风险管理制度的执行情况独立地履行检查、评价、报告、建议职能；第三道防线是由总经理及其下设的风险管理委员会构成，总经理负责公司日常经营管理中的风险管理工作。总经理下设风险管理委员

会，负责对公司经营及基金运作中的风险进行研究、评估和防控；第四道监控防线由董事会及其下设公司风险控制委员会构成。董事会负责公司整体风险的预防和控制，审核、监督公司风险管理制度的有效执行。董事会下设公司风险控制委员会，协助董事会确立公司风险取向，风险总量、风险限额，制定和调整公司风险管理战略、原则、政策和指导方针，并确保其得到有效执行。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

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

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

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	21,694,499.04	50,884,583.01
合计	21,694,499.04	50,884,583.01

注：未评级部分为国债、短期融资券。

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 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
AAA	21,703,833.69	92,930,801.81
AAA以下	-	18,551,356.16
未评级	73,227,205.47	91,801,178.63
合计	94,931,039.16	203,283,336.60

注：未评级部分为国债、政策性金融债、地方债、公司债、中期票据。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

于2026年6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。

6.4.13.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司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%。

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2026年06月30日，本基金组合资产中7个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

本基金投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种比重较大，此外还持有银行存及银行存款等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026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	2,125,070.06	-	-	-	2,125,070.06
交易性 金融资产	42,032,716.02	42,982,869.04	31,609,953.14	23,748,114.33	140,373,652.53
应收申 购款	-	-	-	22,381.00	22,381.00
资产总 计	44,157,786.08	42,982,869.04	31,609,953.14	23,770,495.33	142,521,103.59
负债					
应付赎 回款	-	-	-	2,997,810.08	2,997,810.08
应付管 理人报 酬	-	-	-	70,600.97	70,600.97

应付托管费	-	-	-	11,766.84	11,766.84
应付销售服务费	-	-	-	11,513.23	11,513.23
应交税费	-	-	-	4,285.25	4,285.25
其他负债	-	-	-	86,095.06	86,095.06
负债总计	-	-	-	3,182,071.43	3,182,071.43
利率敏感度缺口	44,157,786.08	42,982,869.04	31,609,953.14	20,588,423.90	139,339,032.16
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	7,484,323.37	-	-	-	7,484,323.37
交易性金融资产	88,594,768.21	90,500,197.26	75,072,954.14	24,567,615.38	278,735,534.99
应收申购款	-	-	-	1,237,179.38	1,237,179.38
资产总计	96,079,091.58	90,500,197.26	75,072,954.14	25,804,794.76	287,457,037.74
负债					
应付赎回款	-	-	-	13,036,150.06	13,036,150.06

应付管理人报酬	-	-	-	155,797.55	155,797.55
应付托管费	-	-	-	25,966.25	25,966.25
应付销售服务费	-	-	-	25,810.92	25,810.92
应交税费	-	-	-	15,471.71	15,471.71
其他负债	-	-	-	172,958.07	172,958.07
负债总计	-	-	-	13,432,154.56	13,432,154.56
利率敏感度缺口	96,079,091.58	90,500,197.26	75,072,954.14	12,372,640.20	274,024,883.18

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 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
	市场利率下降25个基点	1,055,038.42	2,138,865.36
	市场利率上升25个基点	-1,027,532.76	-2,084,922.49

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026年06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	23,748,114.33	17.04	24,567,615.38	8.97
交易性金融资 产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资 产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资 产—贵金属投	-	-	-	-

资				
衍生金融资产	-	-	-	-
—权证投资				
其他	-	-	-	-
合计	23,748,114.33	17.04	24,567,615.38	8.97

6.4.13.4.2 其他价格风险的敏感性分析

注：于2026年6月30日，本基金持有的交易性权益类投资公允价值占基金资产净值的比例为17.04%(2025年12月31日：8.97%)，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响(2025年12月31日：同)。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
第一层次	23,748,114.33	24,567,615.38
第二层次	116,625,538.20	254,167,919.61
第三层次	-	-
合计	140,373,652.53	278,735,534.99

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估

值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2026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(2025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	23,748,114.33	16.66
	其中：股票	23,748,114.33	16.66
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	116,625,538.20	81.83
	其中：债券	116,625,538.20	81.83
	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	2,125,070.06	1.49
8	其他各项资产	22,381.00	0.02

9	合计	142,521,103.59	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	80,388.00	0.06
B	采矿业	1,735,292.90	1.25
C	制造业	13,741,961.41	9.86
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	490,628.00	0.35
E	建筑业	256,335.00	0.18
F	批发和零售业	330,955.00	0.24
G	交通运输、仓储和邮政业	495,385.00	0.36
H	住宿和餐饮业	35,847.00	0.03
I	信息传输、软件和信息技术服务业	991,698.00	0.71
J	金融业	4,893,942.22	3.51
K	房地产业	191,882.00	0.14
L	租赁和商务服务业	144,179.00	0.10
M	科学研究和技术服务业	88,860.00	0.06
N	水利、环境和公共设施管理业	21,592.60	0.02
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	3,420.00	0.00
Q	卫生和社会工作	86,690.20	0.06
R	文化、体育和娱乐业	71,750.00	0.05
S	综合	87,308.00	0.06
	合计	23,748,114.33	17.04

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	002384	东山精密	5,200	1,364,220.00	0.98
2	601288	农业银行	202,000	1,226,140.00	0.88
3	601398	工商银行	88,100	622,867.00	0.45
4	601857	中国石油	58,400	506,912.00	0.36
5	601138	工业富联	5,500	396,825.00	0.28
6	601658	邮储银行	67,700	333,761.00	0.24
7	601211	国泰海通	16,962	308,708.40	0.22
8	002371	北方华创	340	300,750.40	0.22
9	601988	中国银行	48,900	279,708.00	0.20
10	601628	中国人寿	7,600	268,660.00	0.19
11	000988	华工科技	1,400	258,454.00	0.19
12	600418	江淮汽车	9,900	255,717.00	0.18
13	603986	兆易创新	300	244,500.00	0.18
14	002407	多氟多	4,800	241,104.00	0.17
15	600519	贵州茅台	200	237,098.00	0.17
16	601728	中国电信	38,400	199,296.00	0.14
17	002625	光启技术	6,300	191,016.00	0.14
18	601088	中国神华	4,800	187,392.00	0.13
19	600497	驰宏锌锗	13,700	165,907.00	0.12
20	002028	思源电气	900	155,700.00	0.11
21	600549	厦门钨业	1,800	153,360.00	0.11
22	600028	中国石化	31,300	139,598.00	0.10
23	601998	中信银行	19,200	133,056.00	0.10
24	002240	盛新锂能	2,900	130,007.00	0.09
25	300308	中际旭创	100	127,000.00	0.09
26	600350	山东高速	11,300	125,769.00	0.09
27	688008	澜起科技	399	123,650.10	0.09
28	600118	中国卫星	1,500	123,075.00	0.09

29	600885	宏发股份	3,460	119,335.40	0.09
30	002128	电投能源	5,000	115,600.00	0.08
31	002436	兴森科技	2,200	112,090.00	0.08
32	601168	西部矿业	4,100	111,274.00	0.08
33	600988	赤峰黄金	4,200	110,544.00	0.08
34	600066	宇通客车	3,800	101,878.00	0.07
35	600500	中化国际	13,000	101,790.00	0.07
36	605358	立昂微	1,300	100,880.00	0.07
37	600392	盛和资源	3,200	95,264.00	0.07
38	603893	瑞芯微	500	94,180.00	0.07
39	688041	海光信息	249	92,204.70	0.07
40	600096	云天化	3,000	91,200.00	0.07
41	603979	金诚信	1,500	88,545.00	0.06
42	600498	烽火通信	1,200	88,320.00	0.06
43	603993	洛阳钼业	5,000	87,750.00	0.06
44	600673	东阳光	2,600	87,308.00	0.06
45	603228	景旺电子	1,200	86,892.00	0.06
46	601233	桐昆股份	4,000	86,600.00	0.06
47	300502	新易盛	140	84,980.00	0.06
48	601319	中国人保	12,500	84,500.00	0.06
49	600580	卧龙电驱	2,460	81,426.00	0.06
50	002487	大金重工	1,400	81,158.00	0.06
51	600879	航天电子	3,800	80,902.00	0.06
52	600141	兴发集团	1,700	79,849.00	0.06
53	300750	宁德时代	200	78,602.00	0.06
54	600760	中航沈飞	1,900	78,090.00	0.06
55	002273	水晶光电	2,200	78,056.00	0.06
56	600352	浙江龙盛	6,400	77,504.00	0.06
57	605499	东鹏饮料	607	74,922.01	0.05
58	600895	张江高科	2,000	74,500.00	0.05
59	601555	东吴证券	9,400	74,448.00	0.05

60	688536	思瑞浦	200	72,818.00	0.05
61	600839	四川长虹	10,300	71,894.00	0.05
62	600887	伊利股份	3,000	71,880.00	0.05
63	603444	吉比特	200	71,684.00	0.05
64	301308	江波龙	100	70,380.00	0.05
65	601077	渝农商行	11,500	70,265.00	0.05
66	601567	三星电气	4,600	68,724.00	0.05
67	600398	海澜之家	13,100	68,513.00	0.05
68	603160	汇顶科技	1,100	67,881.00	0.05
69	000657	中钨高新	700	67,004.00	0.05
70	600909	华安证券	6,000	66,660.00	0.05
71	600143	金发科技	4,300	66,435.00	0.05
72	600436	片仔癀	600	65,568.00	0.05
73	000636	风华高科	900	65,016.00	0.05
74	601108	财通证券	7,500	64,875.00	0.05
75	601066	中信建投	2,200	63,954.00	0.05
76	300866	安克创新	600	62,700.00	0.04
77	601611	中国核建	5,500	61,325.00	0.04
78	002138	顺络电子	800	58,480.00	0.04
79	601128	常熟银行	9,801	57,041.82	0.04
80	002497	雅化集团	2,800	57,036.00	0.04
81	600036	招商银行	1,600	56,800.00	0.04
82	601615	明阳智能	4,900	56,693.00	0.04
83	600809	山西汾酒	500	54,685.00	0.04
84	600025	华能水电	6,100	54,229.00	0.04
85	601995	中金公司	1,500	54,225.00	0.04
86	600416	湘电股份	5,500	53,900.00	0.04
87	600060	海信视像	1,900	52,953.00	0.04
88	000630	铜陵有色	8,300	52,788.00	0.04
89	600109	国金证券	6,000	52,680.00	0.04
90	600208	衢州发展	18,500	52,355.00	0.04

91	600900	长江电力	1,900	50,293.00	0.04
92	688005	容百科技	1,633	49,969.80	0.04
93	601933	永辉超市	17,400	49,416.00	0.04
94	002185	华天科技	2,200	49,082.00	0.04
95	603606	东方电缆	1,180	48,981.80	0.04
96	688047	龙芯中科	313	48,411.71	0.03
97	603345	安井食品	600	48,114.00	0.03
98	601696	中银证券	3,800	48,070.00	0.03
99	603456	九洲药业	3,500	47,810.00	0.03
100	601336	新华保险	800	47,728.00	0.03
101	603298	杭叉集团	2,000	47,720.00	0.03
102	601058	赛轮轮胎	4,100	47,273.00	0.03
103	600298	安琪酵母	1,300	47,060.00	0.03
104	600499	科达制造	3,400	46,920.00	0.03
105	002812	恩捷股份	700	46,837.00	0.03
106	600755	厦门国贸	8,600	46,612.00	0.03
107	601577	长沙银行	5,300	46,163.00	0.03
108	002916	深南电路	100	45,790.00	0.03
109	601162	天风证券	13,500	45,495.00	0.03
110	600699	均胜电子	2,100	45,381.00	0.03
111	000333	美的集团	600	45,318.00	0.03
112	600050	中国联通	11,300	45,200.00	0.03
113	002080	中材科技	500	45,000.00	0.03
114	300568	星源材质	2,400	44,928.00	0.03
115	600177	雅戈尔	5,900	44,427.00	0.03
116	600867	通化东宝	5,500	44,220.00	0.03
117	601636	旗滨集团	4,300	43,989.00	0.03
118	600707	彩虹股份	2,600	43,914.00	0.03
119	605117	德业股份	408	43,321.44	0.03
120	603288	海天味业	1,300	43,108.00	0.03
121	601318	中国平安	900	42,966.00	0.03

122	603019	中科曙光	400	42,892.00	0.03
123	603882	金域医学	1,900	42,712.00	0.03
124	300394	天孚通信	140	42,375.20	0.03
125	002475	立讯精密	600	42,240.00	0.03
126	600021	上海电力	2,800	42,196.00	0.03
127	601992	金隅集团	30,500	41,480.00	0.03
128	002738	中矿资源	700	41,293.00	0.03
129	688331	荣昌生物	317	41,292.42	0.03
130	601225	陕西煤业	2,000	40,700.00	0.03
131	600989	宝丰能源	2,000	40,660.00	0.03
132	300088	长信科技	3,500	40,600.00	0.03
133	000778	新兴铸管	10,900	40,439.00	0.03
134	601899	紫金矿业	1,600	40,224.00	0.03
135	603712	七一二	3,100	39,959.00	0.03
136	603179	新泉股份	800	39,720.00	0.03
137	002340	格林美	6,000	39,660.00	0.03
138	600516	方大炭素	6,400	39,488.00	0.03
139	603156	养元饮品	800	39,256.00	0.03
140	601231	环旭电子	1,200	38,880.00	0.03
141	002202	金风科技	1,600	38,240.00	0.03
142	002531	天顺风能	4,500	37,935.00	0.03
142	002156	通富微电	500	37,935.00	0.03
143	600155	华创云信	6,800	37,536.00	0.03
144	002517	恺英网络	2,300	37,375.00	0.03
145	600529	山东药玻	2,000	36,900.00	0.03
146	601958	金钼股份	1,300	36,543.00	0.03
147	600872	中炬高新	2,100	36,456.00	0.03
148	601997	贵阳银行	7,100	36,423.00	0.03
149	000998	隆平高科	4,800	36,192.00	0.03
150	601717	中创智领	2,600	36,166.00	0.03
151	301200	大族数控	100	36,065.00	0.03

152	600018	上港集团	7,500	35,400.00	0.03
153	601198	东兴证券	2,600	35,334.00	0.03
154	600660	福耀玻璃	700	35,308.00	0.03
155	601872	招商轮船	2,000	35,140.00	0.03
156	600183	生益科技	200	34,680.00	0.02
157	300476	胜宏科技	100	34,643.00	0.02
158	600369	西南证券	8,600	34,572.00	0.02
159	688981	中芯国际	215	34,146.30	0.02
160	603077	和邦生物	14,700	34,104.00	0.02
161	300857	协创数据	100	33,990.00	0.02
162	601816	京沪高铁	7,500	33,975.00	0.02
163	002408	齐翔腾达	7,200	33,768.00	0.02
164	600536	中国软件	1,200	33,744.00	0.02
165	002506	协鑫集成	10,600	33,708.00	0.02
166	601600	中国铝业	4,100	33,702.00	0.02
167	002019	亿帆医药	3,600	33,660.00	0.02
168	601689	拓普集团	595	33,569.90	0.02
169	603185	弘元绿能	2,000	33,380.00	0.02
170	300438	鹏辉能源	400	33,140.00	0.02
171	600873	梅花生物	4,500	33,075.00	0.02
172	603688	石英股份	400	33,044.00	0.02
173	600884	杉杉股份	2,400	32,520.00	0.02
174	600637	东方明珠	3,900	32,409.00	0.02
175	002373	千方科技	4,500	32,310.00	0.02
176	002837	英维克	400	31,824.00	0.02
177	601016	节能风电	8,200	31,816.00	0.02
178	300567	精测电子	100	31,760.00	0.02
179	600704	物产中大	6,700	31,624.00	0.02
180	002690	美亚光电	2,200	31,526.00	0.02
181	601601	中国太保	1,100	31,372.00	0.02
182	600600	青岛啤酒	600	31,338.00	0.02

183	601668	中国建筑	7,200	31,248.00	0.02
184	002268	电科网安	2,400	30,960.00	0.02
185	603883	老百姓	2,800	30,688.00	0.02
186	600489	中金黄金	1,700	30,685.00	0.02
187	002463	沪电股份	200	30,560.00	0.02
188	002353	杰瑞股份	200	30,500.00	0.02
189	000958	电投产融	5,400	30,456.00	0.02
190	600486	扬农化工	600	30,420.00	0.02
191	600362	江西铜业	700	30,310.00	0.02
192	600166	福田汽车	10,400	30,264.00	0.02
193	002555	三七互娱	1,600	30,192.00	0.02
194	002008	大族激光	200	30,022.00	0.02
195	600129	太极集团	2,200	29,854.00	0.02
196	600765	中航重机	2,300	29,716.00	0.02
197	600406	国电南瑞	1,300	29,705.00	0.02
198	600795	国电电力	6,300	29,421.00	0.02
199	600535	天士力	2,200	29,106.00	0.02
200	601990	南京证券	4,400	28,908.00	0.02
201	600862	中航高科	1,600	28,848.00	0.02
202	600030	中信证券	1,000	28,730.00	0.02
203	601818	光大银行	9,900	28,611.00	0.02
204	600763	通策医疗	840	28,459.20	0.02
205	600859	王府井	3,100	28,458.00	0.02
206	601179	中国西电	1,900	28,348.00	0.02
207	601166	兴业银行	1,700	28,152.00	0.02
208	600348	华阳股份	3,600	27,540.00	0.02
209	300118	东方日升	2,200	27,390.00	0.02
210	600521	华海药业	1,900	27,360.00	0.02
211	601633	长城汽车	1,800	27,162.00	0.02
212	601328	交通银行	4,200	27,006.00	0.02
213	002155	湖南黄金	1,130	26,973.10	0.02

214	601888	中国中免	500	26,855.00	0.02
215	000887	中鼎股份	1,500	26,835.00	0.02
216	603127	昭衍新药	700	26,754.00	0.02
217	600820	隧道股份	5,100	26,571.00	0.02
218	688183	生益电子	200	26,480.00	0.02
219	600739	辽宁成大	2,600	26,286.00	0.02
220	000818	航锦科技	1,800	26,136.00	0.02
221	600170	上海建工	11,700	25,974.00	0.02
222	600008	首创环保	9,500	25,840.00	0.02
223	600941	中国移动	300	25,839.00	0.02
224	002281	光迅科技	100	25,694.00	0.02
225	600019	宝钢股份	4,700	25,521.00	0.02
226	603529	爱玛科技	1,300	25,363.00	0.02
227	600999	招商证券	1,200	25,320.00	0.02
228	601666	平煤股份	3,500	25,025.00	0.02
229	603259	药明康德	200	24,902.00	0.02
230	601000	唐山港	6,000	24,900.00	0.02
231	300223	君正股份	100	24,890.00	0.02
232	600435	北方导航	2,200	24,640.00	0.02
233	600390	五矿资本	5,400	24,624.00	0.02
234	603596	伯特利	988	24,541.92	0.02
235	601216	君正集团	5,500	24,530.00	0.02
236	600380	健康元	2,600	24,492.00	0.02
237	002594	比亚迪	300	23,910.00	0.02
238	601212	白银有色	4,700	23,876.00	0.02
239	002865	钧达股份	400	23,872.00	0.02
240	600153	建发股份	3,000	23,790.00	0.02
241	001389	广合科技	100	23,725.00	0.02
242	688390	固德威	217	23,546.67	0.02
243	688777	中控技术	200	23,500.00	0.02
244	600737	中粮糖业	1,900	23,427.00	0.02

245	002867	周大生	2,100	23,415.00	0.02
246	603939	益丰药房	1,300	23,374.00	0.02
247	002557	洽洽食品	1,300	23,348.00	0.02
248	600188	兖矿能源	1,300	23,101.00	0.02
249	600346	恒力石化	1,300	23,023.00	0.02
250	600546	山煤国际	2,100	22,953.00	0.02
251	002195	岩山科技	3,500	22,890.00	0.02
252	600967	内蒙一机	2,100	22,785.00	0.02
253	600378	昊华科技	300	22,614.00	0.02
254	002409	雅克科技	100	22,450.00	0.02
255	002368	太极股份	1,600	22,384.00	0.02
256	601012	隆基绿能	1,700	22,304.00	0.02
257	002558	巨人网络	800	22,048.00	0.02
258	600998	九州通	4,700	22,043.00	0.02
259	600977	中国电影	1,700	21,964.00	0.02
260	600487	亨通光电	200	21,868.00	0.02
261	000725	京东方 A	2,500	21,700.00	0.02
262	600583	海油工程	4,300	21,629.00	0.02
263	603737	三棵树	892	21,497.20	0.02
264	300776	帝尔激光	100	21,496.00	0.02
265	002432	九安医疗	300	21,204.00	0.02
266	300009	安科生物	2,700	21,195.00	0.02
267	002938	鹏鼎控股	200	21,076.00	0.02
268	688375	国博电子	200	20,860.00	0.01
269	600276	恒瑞医药	400	20,816.00	0.01
270	600863	华能蒙电	4,400	20,680.00	0.01
271	002415	海康威视	600	20,520.00	0.01
272	600022	山东钢铁	16,400	20,336.00	0.01
273	600150	中国船舶	600	20,274.00	0.01
274	600399	抚顺特钢	4,900	20,139.00	0.01
275	601298	青岛港	2,500	20,125.00	0.01

276	000401	金隅冀东	6,000	20,040.00	0.01
277	600674	川投能源	1,400	19,838.00	0.01
278	601766	中国中车	3,800	19,760.00	0.01
279	600258	首旅酒店	1,800	19,656.00	0.01
280	603225	新凤鸣	1,000	19,650.00	0.01
281	603650	彤程新材	200	19,596.00	0.01
282	688396	华润微	200	19,510.00	0.01
283	603260	合盛硅业	400	19,304.00	0.01
284	000021	深科技	300	19,281.00	0.01
285	600015	华夏银行	3,000	19,170.00	0.01
286	002936	郑州银行	11,600	19,140.00	0.01
287	600271	航天信息	2,900	19,082.00	0.01
288	600563	法拉电子	100	19,080.00	0.01
289	600959	江苏有线	6,600	19,074.00	0.01
290	002850	科达利	100	18,930.00	0.01
291	688036	传音控股	314	18,510.30	0.01
292	600056	中国医药	2,100	18,375.00	0.01
293	300059	东方财富	900	18,342.00	0.01
294	003031	中瓷电子	100	18,030.00	0.01
295	301611	珂玛科技	100	18,007.00	0.01
296	600039	四川路桥	2,300	17,986.00	0.01
297	600282	南钢股份	3,900	17,901.00	0.01
298	601868	中国能建	6,700	17,889.00	0.01
299	603816	顾家家居	800	17,888.00	0.01
300	600131	国网信通	1,200	17,520.00	0.01
301	601061	中信金属	1,600	17,232.00	0.01
302	600315	上海家化	1,000	16,820.00	0.01
303	300408	三环集团	100	16,690.00	0.01
304	600104	上汽集团	1,700	16,592.00	0.01
305	000426	兴业银锡	500	16,480.00	0.01
306	600460	士兰微	300	16,398.00	0.01

307	601939	建设银行	1,700	16,371.00	0.01
308	601881	中国银河	1,300	16,341.00	0.01
309	600023	浙能电力	3,100	16,306.00	0.01
310	601966	玲珑轮胎	1,600	16,304.00	0.01
311	002920	德赛西威	200	16,300.00	0.01
312	300450	先导智能	400	16,288.00	0.01
313	600010	包钢股份	7,300	16,279.00	0.01
314	002821	凯莱英	100	16,200.00	0.01
315	600754	锦江酒店	900	16,191.00	0.01
316	688516	奥特维	282	16,183.98	0.01
317	300253	卫宁健康	2,400	16,152.00	0.01
318	300433	蓝思科技	300	16,098.00	0.01
319	002518	科士达	300	16,077.00	0.01
320	600655	豫园股份	3,900	16,029.00	0.01
321	600886	国投电力	1,200	15,972.00	0.01
322	600481	双良节能	3,200	15,968.00	0.01
323	600905	三峡能源	4,300	15,953.00	0.01
324	600011	华能国际	2,100	15,939.00	0.01
325	300274	阳光电源	100	15,902.00	0.01
326	601880	辽港股份	11,500	15,870.00	0.01
327	600196	复星医药	700	15,729.00	0.01
328	600511	国药股份	600	15,624.00	0.01
329	688469	芯联集成	1,462	15,511.82	0.01
330	688336	三生国健	290	15,399.00	0.01
331	603218	日月股份	1,500	15,330.00	0.01
332	603290	斯达半导	100	15,294.00	0.01
333	603927	中科软	1,200	15,252.00	0.01
334	600004	白云机场	2,100	15,246.00	0.01
335	600601	方正科技	1,100	15,224.00	0.01
336	603379	三美股份	200	15,178.00	0.01
337	600528	中铁工业	2,300	15,157.00	0.01

338	600919	江苏银行	1,400	15,092.00	0.01
339	002532	天山铝业	1,400	15,022.00	0.01
340	600329	达仁堂	400	14,888.00	0.01
341	000933	神火股份	700	14,840.00	0.01
342	000858	五 粮 液	200	14,800.00	0.01
343	601118	海南橡胶	3,000	14,760.00	0.01
344	603858	步长制药	1,000	14,600.00	0.01
345	600176	中国巨石	200	14,576.00	0.01
346	603659	璞泰来	500	14,465.00	0.01
347	002797	第一创业	2,200	14,454.00	0.01
348	601985	中国核电	1,600	14,448.00	0.01
349	600875	东方电气	500	14,385.00	0.01
350	601155	新城控股	1,400	14,364.00	0.01
351	300661	圣邦股份	100	14,348.00	0.01
352	601186	中国铁建	2,400	14,280.00	0.01
353	002064	华峰化学	1,500	14,235.00	0.01
354	600126	杭钢股份	2,300	14,099.00	0.01
355	600801	华新建材	900	14,040.00	0.01
356	300296	利亚德	2,500	14,000.00	0.01
357	002595	豪迈科技	300	13,980.00	0.01
358	600732	爱旭股份	1,000	13,850.00	0.01
359	688248	南网科技	200	13,836.00	0.01
360	601866	中远海发	6,200	13,702.00	0.01
361	600309	万华化学	200	13,682.00	0.01
362	601021	春秋航空	300	13,674.00	0.01
363	300760	迈瑞医疗	100	13,583.00	0.01
364	600095	湘财股份	1,800	13,554.00	0.01
365	600995	南网储能	1,100	13,530.00	0.01
366	300395	菲利华	100	13,373.00	0.01
367	600566	济川药业	600	13,314.00	0.01
368	601919	中远海控	1,000	13,260.00	0.01

369	600016	民生银行	4,100	13,202.00	0.01
370	000001	平安银行	1,300	13,065.00	0.01
371	603317	天味食品	1,000	13,010.00	0.01
372	601390	中国中铁	3,100	12,927.00	0.01
373	301536	星宸科技	100	12,871.00	0.01
374	600901	江苏金租	2,200	12,650.00	0.01
375	000156	华数传媒	2,000	12,620.00	0.01
376	601568	北元化工	3,700	12,580.00	0.01
377	688122	西部超导	200	12,562.00	0.01
378	601877	正泰电器	500	12,535.00	0.01
379	002352	顺丰控股	400	12,504.00	0.01
380	002472	双环传动	300	12,453.00	0.01
381	600029	南方航空	2,400	12,432.00	0.01
382	000623	吉林敖东	700	12,411.00	0.01
383	601608	中信重工	2,600	12,402.00	0.01
384	601688	华泰证券	600	12,372.00	0.01
385	600690	海尔智家	600	12,246.00	0.01
386	600522	中天科技	200	12,136.00	0.01
387	688295	中复神鹰	200	12,108.00	0.01
388	600031	三一重工	700	12,096.00	0.01
389	603233	大参林	800	12,024.00	0.01
390	600426	华鲁恒升	500	11,960.00	0.01
391	301269	华大九天	100	11,942.00	0.01
392	002414	高德红外	900	11,934.00	0.01
393	300136	信维通信	100	11,925.00	0.01
394	688387	信科移动	600	11,904.00	0.01
395	002142	宁波银行	400	11,876.00	0.01
396	601828	美凯龙	5,800	11,832.00	0.01
397	000783	长江证券	1,200	11,700.00	0.01
398	688567	孚能科技	1,096	11,508.00	0.01
399	601111	中国国航	1,900	11,495.00	0.01

400	600970	中材国际	1,600	11,408.00	0.01
401	603087	甘李药业	200	11,352.00	0.01
402	000651	格力电器	300	11,250.00	0.01
403	600848	上海临港	1,500	11,235.00	0.01
404	000563	陕国投 A	4,000	11,040.00	0.01
405	600233	圆通速递	700	11,025.00	0.01
406	300782	卓胜微	100	10,958.00	0.01
407	003816	中国广核	2,800	10,948.00	0.01
408	000338	潍柴动力	400	10,900.00	0.01
409	601106	中国一重	3,300	10,890.00	0.01
410	000063	中兴通讯	300	10,857.00	0.01
411	000703	恒逸石化	800	10,856.00	0.01
412	600372	中航机载	1,000	10,850.00	0.01
413	600361	创新新材	3,000	10,800.00	0.01
414	601607	上海医药	700	10,780.00	0.01
415	600026	中远海能	600	10,764.00	0.01
416	601100	恒立液压	100	10,756.00	0.01
417	600582	天地科技	2,400	10,680.00	0.01
418	600115	中国东航	2,800	10,668.00	0.01
419	600325	华发股份	4,600	10,626.00	0.01
420	300054	鼎龙股份	100	10,597.00	0.01
421	002044	美年健康	2,100	10,563.00	0.01
422	002714	牧原股份	300	10,497.00	0.01
423	002600	领益智造	600	10,404.00	0.01
424	603296	华勤技术	140	10,397.80	0.01
425	002429	兆驰股份	1,000	10,390.00	0.01
426	600584	长电科技	100	10,355.00	0.01
427	000559	万向钱潮	800	10,344.00	0.01
428	300285	国瓷材料	100	10,318.00	0.01
429	002709	天赐材料	200	10,286.00	0.01
430	601788	光大证券	700	10,101.00	0.01

431	603806	福斯特	600	10,074.00	0.01
432	600845	宝信软件	600	9,978.00	0.01
433	002831	裕同科技	280	9,956.80	0.01
434	600373	中文传媒	1,500	9,945.00	0.01
435	601009	南京银行	1,000	9,890.00	0.01
436	603799	华友钴业	200	9,652.00	0.01
436	601238	广汽集团	1,900	9,652.00	0.01
437	600612	老凤祥	300	9,645.00	0.01
438	300454	深信服	100	9,620.00	0.01
439	600111	北方稀土	200	9,610.00	0.01
440	600642	申能股份	1,100	9,603.00	0.01
441	688065	凯赛生物	200	9,570.00	0.01
442	002294	信立泰	300	9,567.00	0.01
443	601360	三六零	1,100	9,559.00	0.01
444	603568	伟明环保	620	9,535.60	0.01
445	601618	中国中冶	3,900	9,516.00	0.01
446	600808	马钢股份	3,800	9,500.00	0.01
447	603501	豪威集团	100	9,485.00	0.01
448	601598	中国外运	1,900	9,424.00	0.01
449	000776	广发证券	400	9,360.00	0.01
450	300390	天华新能	100	9,351.00	0.01
451	300037	新宙邦	100	9,285.00	0.01
452	603885	吉祥航空	900	9,261.00	0.01
453	600009	上海机场	400	9,240.00	0.01
453	002179	中航光电	200	9,240.00	0.01
454	600483	福能股份	900	9,171.00	0.01
455	300803	指南针	100	9,167.00	0.01
456	002056	横店东磁	300	9,144.00	0.01
457	002203	海亮股份	400	9,140.00	0.01
458	601698	中国卫通	300	9,075.00	0.01
459	601799	星宇股份	100	9,062.00	0.01

460	000792	盐湖股份	300	9,057.00	0.01
461	688126	沪硅产业	227	9,055.03	0.01
462	002958	青农商行	3,300	9,042.00	0.01
463	300763	锦浪科技	100	9,035.00	0.01
464	600089	特变电工	400	9,000.00	0.01
465	002049	紫光国微	100	8,875.00	0.01
466	601236	红塔证券	1,300	8,866.00	0.01
467	002050	三花智控	200	8,766.00	0.01
468	000100	TCL科技	1,500	8,730.00	0.01
469	603658	安图生物	300	8,706.00	0.01
470	600598	北大荒	800	8,672.00	0.01
471	600926	杭州银行	600	8,670.00	0.01
472	601901	方正证券	1,200	8,640.00	0.01
473	000987	越秀资本	1,100	8,602.00	0.01
474	601699	潞安环能	600	8,568.00	0.01
475	601898	中煤能源	700	8,526.00	0.01
476	600928	西安银行	2,600	8,502.00	0.01
477	600985	淮北矿业	600	8,430.00	0.01
478	600517	国网英大	1,800	8,424.00	0.01
479	601169	北京银行	1,700	8,330.00	0.01
480	300442	润泽科技	100	8,307.00	0.01
481	688568	中科星图	200	8,294.00	0.01
482	300058	蓝色光标	600	8,256.00	0.01
483	600415	小商品城	800	8,128.00	0.01
484	601665	齐鲁银行	1,400	8,078.00	0.01
485	600062	华润双鹤	500	8,020.00	0.01
486	600968	海油发展	2,400	7,992.00	0.01
487	000878	云南铜业	500	7,940.00	0.01
488	600803	新奥股份	500	7,900.00	0.01
489	600061	国投资本	1,200	7,860.00	0.01
489	002791	坚朗五金	600	7,860.00	0.01

490	601006	大秦铁路	1,700	7,837.00	0.01
491	603195	公牛集团	200	7,830.00	0.01
492	003022	联泓新科	300	7,770.00	0.01
493	000568	泸州老窖	100	7,752.00	0.01
494	603826	坤彩科技	300	7,668.00	0.01
495	002465	海格通信	600	7,662.00	0.01
496	002025	航天电器	100	7,622.00	0.01
497	000066	中国长城	400	7,620.00	0.01
498	688709	成都华微	200	7,618.00	0.01
499	600038	中直股份	300	7,587.00	0.01
499	301358	湖南裕能	100	7,587.00	0.01
500	000060	中金岭南	1,000	7,570.00	0.01
501	002493	荣盛石化	700	7,525.00	0.01
502	603589	口子窖	400	7,472.00	0.01
503	002624	完美世界	600	7,452.00	0.01
504	000967	盈峰环境	700	7,371.00	0.01
505	000425	徐工机械	900	7,281.00	0.01
506	600438	通威股份	600	7,266.00	0.01
507	002271	东方雨虹	600	7,122.00	0.01
508	001286	陕西能源	700	7,098.00	0.01
509	601838	成都银行	400	7,080.00	0.01
510	300724	捷佳伟创	100	7,060.00	0.01
511	000166	申万宏源	1,600	7,040.00	0.01
512	000977	浪潮信息	100	7,000.00	0.01
513	300357	我武生物	300	6,996.00	0.01
514	002736	国信证券	700	6,993.00	0.01
515	300999	金龙鱼	300	6,978.00	0.01
516	002966	苏州银行	1,000	6,960.00	0.00
517	601229	上海银行	800	6,944.00	0.00
518	000408	藏格矿业	100	6,932.00	0.00
519	601098	中南传媒	700	6,888.00	0.00

520	601918	新集能源	800	6,872.00	0.00
521	601800	中国交建	1,200	6,852.00	0.00
522	688180	君实生物	200	6,764.00	0.00
523	000728	国元证券	900	6,741.00	0.00
524	002739	儒意电影	700	6,720.00	0.00
525	002945	华林证券	500	6,715.00	0.00
526	002939	长城证券	800	6,672.00	0.00
527	300124	汇川技术	100	6,633.00	0.00
528	600482	中国动力	200	6,560.00	0.00
529	002460	赣锋锂业	100	6,540.00	0.00
530	000997	新大陆	400	6,520.00	0.00
531	300558	贝达药业	100	6,507.00	0.00
532	300014	亿纬锂能	100	6,503.00	0.00
533	002673	西部证券	1,000	6,490.00	0.00
534	601808	中海油服	600	6,486.00	0.00
535	002507	涪陵榨菜	600	6,480.00	0.00
535	000883	湖北能源	1,500	6,480.00	0.00
536	000582	北部湾港	600	6,438.00	0.00
537	601019	山东出版	1,000	6,400.00	0.00
538	688538	和辉光电	2,461	6,398.60	0.00
539	600918	中泰证券	1,200	6,384.00	0.00
540	600562	国睿科技	300	6,366.00	0.00
541	000629	钒钛股份	1,900	6,346.00	0.00
542	000683	博源化工	1,100	6,336.00	0.00
543	000519	中兵红箭	300	6,321.00	0.00
544	600299	安迪苏	800	6,280.00	0.00
545	002078	太阳纸业	500	6,245.00	0.00
546	002444	巨星科技	200	6,220.00	0.00
547	600741	华域汽车	400	6,208.00	0.00
548	000027	深圳能源	1,000	6,200.00	0.00
549	300496	中科创达	100	6,179.00	0.00

550	002131	利欧股份	1,300	6,175.00	0.00
551	002466	天齐锂业	100	6,132.00	0.00
552	000539	粤电力 A	900	6,129.00	0.00
553	601127	赛力斯	100	6,125.00	0.00
554	601669	中国电建	1,300	6,110.00	0.00
555	300718	长盛轴承	100	6,097.00	0.00
556	603728	鸣志电器	100	6,092.00	0.00
557	002385	大北农	2,200	6,072.00	0.00
558	300474	景嘉微	100	6,048.00	0.00
559	300316	晶盛机电	100	6,040.00	0.00
560	300432	富临精工	300	6,027.00	0.00
561	603833	欧派家居	200	6,022.00	0.00
562	600332	白云山	300	6,012.00	0.00
563	300679	电连技术	100	5,999.00	0.00
564	603605	珀莱雅	100	5,992.00	0.00
565	603766	隆鑫通用	500	5,965.00	0.00
566	000050	深天马 A	600	5,946.00	0.00
567	000617	中油资本	900	5,931.00	0.00
568	300487	蓝晓科技	100	5,885.00	0.00
569	600339	中油工程	1,900	5,833.00	0.00
570	302132	中航成飞	100	5,832.00	0.00
571	601099	太平洋	1,700	5,729.00	0.00
572	300207	欣旺达	300	5,697.00	0.00
573	600958	东方证券	600	5,664.00	0.00
573	002756	永兴材料	100	5,664.00	0.00
573	000733	振华科技	100	5,664.00	0.00
574	600663	陆家嘴	900	5,652.00	0.00
575	002152	广电运通	600	5,628.00	0.00
576	000959	首钢股份	1,600	5,616.00	0.00
577	002261	拓维信息	200	5,602.00	0.00
578	002266	浙富控股	1,100	5,566.00	0.00

579	600048	保利发展	1,200	5,556.00	0.00
580	000831	中国稀土	100	5,549.00	0.00
581	002085	万丰奥威	500	5,545.00	0.00
582	000738	航发控制	300	5,487.00	0.00
583	688728	格科微	260	5,470.40	0.00
584	688475	萤石网络	200	5,470.00	0.00
585	600938	中国海油	200	5,430.00	0.00
586	600295	鄂尔多斯	500	5,360.00	0.00
587	601921	浙版传媒	800	5,352.00	0.00
588	002157	正邦科技	1,900	5,339.00	0.00
589	600098	广州发展	900	5,319.00	0.00
590	600160	巨化股份	100	5,301.00	0.00
591	600312	平高电气	300	5,298.00	0.00
592	000415	渤海租赁	1,300	5,291.00	0.00
593	601928	凤凰传媒	600	5,274.00	0.00
594	601865	福莱特	500	5,255.00	0.00
595	601825	沪农商行	700	5,243.00	0.00
596	601333	广深铁路	1,900	5,225.00	0.00
597	601001	晋控煤业	300	5,217.00	0.00
598	300017	网宿科技	400	5,204.00	0.00
599	601858	中国科传	300	5,193.00	0.00
600	600219	南山铝业	1,300	5,187.00	0.00
601	688276	百克生物	371	5,171.74	0.00
602	000750	国海证券	1,400	5,152.00	0.00
603	601117	中国化学	700	5,145.00	0.00
604	600585	海螺水泥	300	5,085.00	0.00
605	601228	广州港	1,800	5,076.00	0.00
606	603486	科沃斯	100	5,075.00	0.00
607	000729	燕京啤酒	500	5,065.00	0.00
608	000708	中信特钢	400	5,048.00	0.00
609	601018	宁波港	1,600	5,040.00	0.00

610	603699	纽威股份	100	5,030.00	0.00
611	000625	长安汽车	700	5,019.00	0.00
612	002065	东华软件	700	4,998.00	0.00
613	000032	深桑达 A	200	4,990.00	0.00
614	000009	中国宝安	800	4,984.00	0.00
615	600688	上海石化	1,700	4,981.00	0.00
616	600927	永安期货	400	4,980.00	0.00
616	002126	银轮股份	100	4,980.00	0.00
617	300015	爱尔眼科	600	4,956.00	0.00
618	300682	朗新科技	500	4,950.00	0.00
619	603707	健友股份	700	4,949.00	0.00
620	300498	温氏股份	400	4,928.00	0.00
621	603565	中谷物流	500	4,905.00	0.00
622	000932	华菱钢铁	1,400	4,858.00	0.00
623	002027	分众传媒	1,000	4,840.00	0.00
624	603920	世运电路	100	4,804.00	0.00
624	300073	当升科技	100	4,804.00	0.00
625	300347	泰格医药	100	4,800.00	0.00
626	688561	奇安信	200	4,796.00	0.00
627	601878	浙商证券	500	4,750.00	0.00
628	000538	云南白药	100	4,737.00	0.00
629	688779	五矿新能	581	4,711.91	0.00
630	002648	卫星化学	200	4,698.00	0.00
631	003035	南网能源	800	4,656.00	0.00
632	600547	山东黄金	200	4,618.00	0.00
633	688819	天能股份	207	4,595.40	0.00
634	600588	用友网络	500	4,590.00	0.00
635	001965	招商公路	500	4,580.00	0.00
635	000301	东方盛虹	400	4,580.00	0.00
636	002244	滨江集团	600	4,560.00	0.00
637	000423	东阿阿胶	100	4,536.00	0.00

638	002241	歌尔股份	200	4,506.00	0.00
639	002603	以岭药业	300	4,500.00	0.00
640	300623	捷捷微电	100	4,499.00	0.00
640	000088	盐田港	1,100	4,499.00	0.00
641	000895	双汇发展	200	4,480.00	0.00
642	601916	浙商银行	1,700	4,471.00	0.00
643	002311	海大集团	100	4,461.00	0.00
644	000807	云铝股份	200	4,428.00	0.00
645	002670	国盛证券	400	4,400.00	0.00
646	300919	中伟新材	100	4,375.00	0.00
647	000709	河钢股份	2,200	4,268.00	0.00
648	603338	浙江鼎力	100	4,250.00	0.00
649	603341	龙旗科技	100	4,249.00	0.00
650	301236	软通动力	100	4,245.00	0.00
650	002335	科华数据	100	4,245.00	0.00
651	600570	恒生电子	200	4,238.00	0.00
652	601377	兴业证券	700	4,228.00	0.00
653	300832	新产业	100	4,200.00	0.00
654	001696	宗申动力	200	4,162.00	0.00
655	300012	华测检测	300	4,158.00	0.00
656	600132	重庆啤酒	100	4,130.00	0.00
657	002423	中粮资本	500	4,115.00	0.00
658	600606	绿地控股	3,400	4,114.00	0.00
659	002372	伟星新材	500	4,095.00	0.00
659	000429	粤高速 A	300	4,095.00	0.00
660	603786	科博达	100	4,091.00	0.00
661	000893	亚钾国际	100	4,089.00	0.00
662	002926	华西证券	500	4,085.00	0.00
663	002230	科大讯飞	100	4,084.00	0.00
664	301498	乖宝宠物	100	4,059.00	0.00
665	000039	中集集团	500	4,055.00	0.00

666	300418	昆仑万维	100	4,036.00	0.00
667	688303	大全能源	230	4,008.90	0.00
668	002032	苏泊尔	100	3,960.00	0.00
669	300458	全志科技	100	3,946.00	0.00
670	000951	中国重汽	200	3,902.00	0.00
671	300024	机器人	200	3,866.00	0.00
672	001979	招商蛇口	600	3,858.00	0.00
673	600720	中交设计	800	3,856.00	0.00
674	002422	科伦药业	100	3,852.00	0.00
674	000598	兴蓉环境	600	3,852.00	0.00
675	300339	润和软件	100	3,851.00	0.00
676	600893	航发动力	100	3,834.00	0.00
677	002120	韵达股份	600	3,816.00	0.00
678	002304	洋河股份	100	3,815.00	0.00
679	600007	中国国贸	200	3,796.00	0.00
680	002439	启明星辰	300	3,795.00	0.00
681	002130	沃尔核材	200	3,792.00	0.00
682	002461	珠江啤酒	500	3,785.00	0.00
683	300001	特锐德	100	3,783.00	0.00
684	000528	柳工	500	3,775.00	0.00
685	000825	太钢不锈	1,100	3,751.00	0.00
686	002262	恩华药业	200	3,750.00	0.00
687	300383	光环新网	300	3,732.00	0.00
688	688425	铁建重工	923	3,710.46	0.00
689	000591	太阳能	800	3,680.00	0.00
690	002007	华兰生物	300	3,657.00	0.00
691	000537	绿发电力	500	3,655.00	0.00
692	000031	大悦城	1,700	3,604.00	0.00
693	000830	鲁西化工	300	3,600.00	0.00
694	000155	川能动力	300	3,594.00	0.00
695	600363	联创光电	100	3,578.00	0.00

696	600027	华电国际	800	3,560.00	0.00
697	300003	乐普医疗	300	3,555.00	0.00
698	601456	国联民生	400	3,536.00	0.00
699	300861	美畅股份	140	3,526.60	0.00
700	300070	碧水源	1,100	3,509.00	0.00
701	300676	华大基因	100	3,506.00	0.00
702	000157	中联重科	500	3,485.00	0.00
703	002841	视源股份	100	3,453.00	0.00
704	002607	中公教育	1,900	3,420.00	0.00
705	601139	深圳燃气	600	3,396.00	0.00
706	002568	百润股份	200	3,384.00	0.00
707	300628	亿联网络	100	3,382.00	0.00
708	000739	普洛药业	200	3,332.00	0.00
709	002236	大华股份	200	3,298.00	0.00
710	688599	天合光能	231	3,261.72	0.00
711	000937	冀中能源	810	3,223.80	0.00
712	600602	云赛智联	200	3,216.00	0.00
713	600171	上海贝岭	100	3,194.00	0.00
714	300957	贝泰妮	100	3,151.00	0.00
715	001289	龙源电力	200	3,126.00	0.00
716	002430	杭氧股份	100	3,096.00	0.00
717	300748	金力永磁	100	3,085.00	0.00
718	300529	健帆生物	200	3,080.00	0.00
719	002299	圣农发展	200	3,032.00	0.00
720	000723	美锦能源	900	3,015.00	0.00
721	000898	鞍钢股份	1,600	2,992.00	0.00
722	300140	节能环保	600	2,982.00	0.00
723	300979	华利集团	100	2,975.00	0.00
724	603000	人民网	200	2,958.00	0.00
725	002683	广东宏大	100	2,929.00	0.00
726	300144	宋城演艺	500	2,905.00	0.00

727	000513	丽珠集团	100	2,889.00	0.00
728	000938	紫光股份	100	2,886.00	0.00
729	300699	光威复材	100	2,865.00	0.00
730	688472	阿特斯	263	2,845.66	0.00
731	002001	新 和 成	100	2,842.00	0.00
732	300627	华测导航	100	2,840.00	0.00
733	000963	华东医药	100	2,812.00	0.00
734	600316	洪都航空	100	2,794.00	0.00
734	300115	长盈精密	100	2,794.00	0.00
735	000034	神州数码	100	2,775.00	0.00
736	002312	川发龙鳞	300	2,751.00	0.00
736	002074	国轩高科	100	2,751.00	0.00
737	688223	晶科能源	576	2,736.00	0.00
738	000921	海信家电	100	2,732.00	0.00
739	300146	汤臣倍健	300	2,712.00	0.00
740	603392	万泰生物	100	2,697.00	0.00
741	300142	沃森生物	200	2,598.00	0.00
742	002402	和而泰	100	2,583.00	0.00
743	002223	鱼跃医疗	100	2,566.00	0.00
744	600685	中船防务	100	2,544.00	0.00
745	000876	新 希 望	400	2,508.00	0.00
746	002410	广联达	300	2,448.00	0.00
747	603305	旭升集团	200	2,424.00	0.00
748	000785	居然智家	1,200	2,400.00	0.00
749	601965	中国汽研	200	2,392.00	0.00
750	002318	久立特材	100	2,390.00	0.00
751	603369	今世缘	100	2,371.00	0.00
752	300002	神州泰岳	300	2,343.00	0.00
753	600085	同仁堂	100	2,311.00	0.00
754	300735	光弘科技	100	2,274.00	0.00
755	300601	康泰生物	200	2,268.00	0.00

756	000999	华润三九	100	2,249.00	0.00
757	000400	许继电气	100	2,170.00	0.00
758	002153	石基信息	300	2,169.00	0.00
759	603899	晨光股份	100	2,063.00	0.00
760	688009	中国通号	432	2,056.32	0.00
761	000768	中航西飞	100	2,048.00	0.00
762	002773	康弘药业	100	2,045.00	0.00
763	000002	万 科 A	600	1,776.00	0.00
764	600764	中国海防	100	1,743.00	0.00
765	000975	山金国际	100	1,700.00	0.00
766	002459	晶澳科技	200	1,620.00	0.00
767	002583	海能达	200	1,538.00	0.00
768	300413	芒果超媒	100	1,463.00	0.00
769	002508	老板电器	100	1,462.00	0.00
770	601136	首创证券	100	1,395.00	0.00
771	002984	森麒麟	100	1,307.00	0.00
772	300122	智飞生物	100	1,169.00	0.00
773	600161	天坛生物	100	1,158.00	0.00
774	300251	光线传媒	100	1,109.00	0.00
775	002572	索菲亚	100	730.00	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	601398	工商银行	474,234.00	0.17
2	600519	贵州茅台	415,109.00	0.15
3	601857	中国石油	382,552.00	0.14
4	601138	工业富联	328,128.00	0.12

5	601988	中国银行	318,322.00	0.12
6	300750	宁德时代	314,069.00	0.11
7	601288	农业银行	299,600.00	0.11
8	601628	中国人寿	202,950.00	0.07
9	600036	招商银行	194,613.00	0.07
10	300308	中际旭创	181,363.00	0.07
11	601088	中国神华	178,143.00	0.07
12	601899	紫金矿业	161,914.00	0.06
13	601318	中国平安	160,378.00	0.06
14	600900	长江电力	156,594.00	0.06
15	000333	美的集团	129,393.00	0.05
16	600028	中国石化	124,019.00	0.05
17	601658	邮储银行	121,500.00	0.04
18	300502	新易盛	116,121.00	0.04
19	002371	北方华创	112,888.00	0.04
20	688041	海光信息	111,774.66	0.04

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	601288	农业银行	604,629.00	0.22
2	600519	贵州茅台	561,909.00	0.21
3	601398	工商银行	551,995.00	0.20
4	601857	中国石油	487,402.00	0.18
5	601988	中国银行	372,364.00	0.14
6	002384	东山精密	367,948.00	0.13
7	601138	工业富联	335,725.00	0.12

8	300502	新易盛	235,722.20	0.09
9	601628	中国人寿	225,626.00	0.08
10	300750	宁德时代	220,325.00	0.08
11	601088	中国神华	213,582.00	0.08
12	600028	中国石化	149,135.00	0.05
13	601899	紫金矿业	143,611.00	0.05
14	601658	邮储银行	140,744.00	0.05
15	601728	中国电信	124,368.00	0.05
16	600036	招商银行	124,100.00	0.05
17	603993	洛阳钼业	101,148.00	0.04
18	600900	长江电力	101,091.00	0.04
19	601166	兴业银行	96,929.00	0.04
20	601318	中国平安	96,529.00	0.04

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	19,155,444.57
卖出股票收入（成交）总额	20,121,711.69

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	23,659,238.22	16.98
2	央行票据	-	-
3	金融债券	9,904,876.71	7.11
	其中：政策性金融债	9,904,876.71	7.11
4	企业债券	31,024,863.56	22.27
5	企业短期融资券	10,113,941.37	7.26

6	中期票据	20,217,541.91	14.51
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	21,705,076.43	15.58
10	合计	116,625,538.20	83.70

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	019830	26国债04	120,000	12,078,680.55	8.67
2	2105765	21吉林债33	100,000	11,447,701.09	8.22
3	115174	23山能02	100,000	10,388,485.48	7.46
4	138989	23广越02	100,000	10,380,245.48	7.45
5	233473	24浙江66	100,000	10,257,375.34	7.36

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

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	22,381.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	22,381.00

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额 级别	持 有 人 户 数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总 份额 比例	持有份额	占总份 额比例
汇安 丰恒 混合A	270	11,256.36	426,357.77	14.03%	2,612,860.49	85.97%
汇安 丰恒 混合C	3,073	41,804.26	1,343,144.33	1.05%	127,121,338.54	98.95%
合计	3,325	39,549.99	1,769,502.10	1.35%	129,734,199.03	98.65%

8.2 盈利投资者数量占比

项目	过去一年（2025年07月01日-2026年06月30日）
盈利投资者数量占比	93.12%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 （份）	占基金总份额比 例
基金管理人所有从业人员持有本基金	汇安丰恒混 合A	13.86	0.0005%
	汇安丰恒混 合C	92,267.92	0.0718%
	合计	92,281.78	0.0702%

8.4 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	汇安丰恒混合A	0~10

和研究部门负责人持有本开放式基金	汇安丰恒混合C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	汇安丰恒混合A	0
	汇安丰恒混合C	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	汇安丰恒混合A	汇安丰恒混合C
基金合同生效日(2017年03月13日)基金份额总额	195,086,316.11	5,000,000.00
本报告期期初基金份额总额	2,547,952.66	259,463,780.12
本报告期基金总申购份额	1,629,983.68	131,839,836.47
减：本报告期基金总赎回份额	1,138,718.08	262,839,133.72
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	3,039,218.26	128,464,482.87

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

本基金自2024年9月14日至本报告期末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、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人未受到调查或处罚。

10.6.2 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未受到调查或处罚。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

报告期内，托管人无受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

报告期内，托管人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.7 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

10.7.1 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	
中信证券	2	39,277,156.26	100.00%	40,101.30	100.00%	-

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

基金证券经纪商选择标准如下：

- 1）经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- 2）具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施稳定、响应支持及时、能满足公募基金采用券商交易模式进行证券交易和结算的需要；

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

(2) 基金交易单元的选择程序如下：

- 1) 本基金管理人根据上述标准测试并考察后确定选用交易单元的证券经营机构；
- 2) 本基金管理人和被选中的证券经营机构签订证券经纪服务协议。

(3) 交易单元变更情况

本基金本报告期内无交易单元变更。

10.7.2 基金租用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
中信证券	91,737,935.00	100.00%	452,700,000.00	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	汇安丰恒灵活配置混合型证券投资基金2025年第4季度报告	规定报刊和/或公司网站	2026-01-22
2	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（2025年度）	规定报刊和/或公司网站	2026-03-31
3	汇安丰恒灵活配置混合型证券投资基金2025年年度报告	规定报刊和/或公司网站	2026-03-31
4	汇安基金管理有限责任公司	规定报刊和/或公司网站	2026-04-03

	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		
5	汇安丰恒灵活配置混合型证券投资基金2026年第1季度报告	规定报刊和/或公司网站	2026-04-22
6	汇安基金管理有限责任公司关于浙江分公司成立的公告	规定报刊和/或公司网站	2026-04-22

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本基金本报告期内未存在单一基金份额持有人持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

12.2 存放地点

北京市东城区东直门南大街5号中青旅大厦13层
上海市虹口区东大名路501白玉兰大厦36层

12.3 查阅方式

投资者可到基金管理人的办公场所及网站免费查阅备查文件，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

投资者对本报告如有疑问，可咨询本基金管理人汇安基金管理有限责任公司，客户服务中心电话010-56711690。

公司网站: <http://www.huianfund.cn>

汇安基金管理有限责任公司

二〇二六年八月三十一日