

汇安沪深 300 指数增强型证券投资基金

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.....	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告.....	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	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.....	16
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	16
§5 托管人报告.....	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	16
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	17
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	17
6.1 资产负债表	17
6.2 利润表	19
6.3 净资产变动表	20
6.4 报表附注	22
§7 投资组合报告.....	50
7.1 期末基金资产组合情况	50
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	51
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.....	53
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	65
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	67
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.....	68
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	68
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	68
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.....	68
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	68
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	68
7.12 投资组合报告附注	68
§8 基金份额持有人信息.....	70

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	70
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	70
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.....	70
§9 开放式基金份额变动.....	71
§10 重大事件揭示	71
10.1 基金份额持有人大会决议	71
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.....	71
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	71
10.4 基金投资策略的改变	72
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	72
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况.....	72
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.....	72
10.8 其他重大事件	74
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	75
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	75
§12 备查文件目录	76
12.1 备查文件目录	76
12.2 存放地点	76
12.3 查阅方式	76

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	汇安沪深300指数增强型证券投资基金	
基金简称	汇安沪深300增强	
基金主代码	003884	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018年07月03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	136,074,198.80份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	汇安沪深300增强A	汇安沪深300增强C
下属分级基金的交易代码	003884	003885
报告期末下属分级基金的份额总额	57,611,199.09份	78,462,999.71份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为增强型股票指数基金，在严格控制对沪深300指数跟踪误差的基础上，通过量化投资方式进行积极的组合管理和风险控制，力求实现超越沪深300指数的投资收益和基金财产的长期增值。
投资策略	本基金为增强型股票指数基金，在目标指数成分股权重的基础上根据量化模型优化投资组合，力争在控制跟踪误差的基础上获取超越目标指数的投资收益。 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、中小企业私募债投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、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	沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。
风险收益特征	本基金为股票型基金，理论上其风险收益水平高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。本基金

	为指数型基金，具有与标的指数相似的风险收益特征。
--	--------------------------

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	中国证券报
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)	
	汇安沪深300增强A	汇安沪深300增强C
本期已实现收益	12,634,096.61	16,439,849.90
本期利润	11,396,648.43	13,562,982.39
加权平均基金份额本期利润	0.1896	0.1571
本期加权平均净值利润率	10.78%	9.88%
本期基金份额净值增长率	10.93%	10.72%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2026年06月30日)	
	汇安沪深300增强A	汇安沪深300增强C
期末可供分配利润	31,439,216.48	30,992,404.59
期末可供分配基金份额利润	0.5457	0.3950
期末基金资产净值	107,854,592.35	133,041,340.73
期末基金份额净值	1.8721	1.6956
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2026年06月30日)	
	汇安沪深300增强A	汇安沪深300增强C
基金份额累计净值增长率	81.95%	75.53%

- 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

汇安沪深300增强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	13.86%	1.25%	11.30%	1.19%	2.56%	0.06%
过去六个月	10.93%	1.12%	7.20%	1.07%	3.73%	0.05%
过去一年	34.72%	1.01%	25.13%	0.97%	9.59%	0.04%
过去三年	28.56%	1.08%	28.26%	1.06%	0.30%	0.02%
过去五年	-6.96%	1.13%	-4.03%	1.06%	-2.93%	0.07%
过去七年	67.84%	1.18%	29.32%	1.11%	38.52%	0.07%
自基金合同 生效起至今	81.95%	1.17%	44.55%	1.15%	37.40%	0.02%

汇安沪深300增强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	13.75%	1.25%	11.30%	1.19%	2.45%	0.06%
过去六个月	10.72%	1.12%	7.20%	1.07%	3.52%	0.05%
过去一年	34.19%	1.01%	25.13%	0.97%	9.06%	0.04%
过去三年	27.03%	1.08%	28.26%	1.06%	-1.23%	0.02%
过去五年	-8.80%	1.13%	-4.03%	1.06%	-4.77%	0.07%
过去七年	63.16%	1.18%	29.32%	1.11%	33.84%	0.07%
自基金合同 生效起至今	75.53%	1.17%	44.55%	1.15%	30.98%	0.02%

3.2.2 自基金转型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

汇安沪深300增强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
(2018年07月03日-2026年06月30日)



汇安沪深300增强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
(2018年07月03日-2026年06月30日)



注：本基金实施转型日为2018年7月3日，本报告期，本基金投资比例符合基金合同要求。

§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人，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		
柳预才	策略量化组基金经 理、本基金的基金经 理	2023- 09-27	-	13年	柳预才先生，上海财经大学数量金融学硕士研究生，13年证券、基金行业从业经验。曾任上海东方证券资产管理有限公司量化投资部研究助理、研究员；安信基金管理有限公司量化投资部研究员；农银汇理基金管理有限公司研究部研究员。2020年11月加入汇安基金管理有限公司，担任策略量化组基金经理。2021年9月3日至2023年6月19日，任汇安成长优选灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2023年9月27日至2024年12月23日，任汇安量化优选灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2024年7月19日至2026年3月3日，任汇安鑫泽稳健一年持

					有期混合型证券投资基金基金经理；2020年12月30日至今，任汇安宜创量化精选混合型证券投资基金基金经理；2022年12月23日至今，任汇安中证500指数增强型证券投资基金基金经理；2023年5月29日至今，任汇安多因子混合型证券投资基金基金经理；2023年6月6日至今，任汇安多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2023年9月27日至今，任汇安沪深300指数增强型证券投资基金基金经理；2025年5月27日至今，任汇安聚利债券型证券投资基金基金经理；2025年9月5日至今，任汇安中证红利低波动100指数型证券投资基金基金经理；2026年6月4日至今，任汇安嘉利混合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

回顾今年上半年，最显著的市场特征不是“普涨”而是“结构分化”。A股大部分宽基指数在报告期内收涨，但内部呈现出典型的K型分化：以AI算力、半导体、光模块为代表的“硬科技”链条走出独立牛市，带动科创50指数上半年上涨超过60%，创业板指上涨超过35%，同期沪深300指数仅上涨7.6%。而行业层面看分化更为巨大：申万电子、通信大幅上涨，而还有行业（如农林牧渔、美容护理）下跌超过20%。2025年延续至今的行情不是“总量牛市”，更多的是科技板块的牛市，其他大部分个股的涨幅并未跟上。报告期内，全市场仅约30%的个股上涨，本质上是产业发展趋势的高强度兑现，少数高景气赛道“虹吸”了其他大部分股票的流动性与估值弹性。

报告期内，两条线索交织驱动着全球宏观主线：全球的AI景气周期与中东地缘冲击。前者推动全球（尤其是中美两国）的科技成长股、尤其是半导体与硬科技资产领涨；后者通过霍尔木兹海峡对油价的冲击，改变通胀预期与全球货币政策，进而压制部分大类资产（如债券和黄金）、放大全球资产波动。从配置角度看，在这样的高波动环境下，

确定性的高景气板块，成为了资金追逐的主要方向，长久期债券与缺乏盈利支撑的传统板块承压。

在这样的市场背景下，本管理人一以贯之的量化投资策略在一定程度上处于逆风期（尤其是6月中下旬），这并非投资策略的失效，而是量化策略产生超额收益所需的“广谱分散、风格不极致”环境与当前市场并不适配。而在高景气主线中“行业集中+个股集中”的投资方式，更易在少数主线资产上获取高弹性收益。本管理人在此过程中，也在不断迭代量化投资框架，将行业景气度更多地纳入考量范围，努力在组合中更多地体现我国科技领域日新月异进步的时代特征。

复盘A股历轮波澜壮阔的大行情，虽然过程不尽相同，但都是从“这次不一样”的星辰大海，回归到“每次都一样”的脚踏实地。毋庸置疑，推动人类文明发展的科技进步是星辰大海，但是否也需要适度考虑为梦想充值的性价比？因此，在适度参与这轮行情的过程中，本管理人也保持着相对审慎的态度。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末汇安沪深300增强A基金份额净值为1.8721元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为10.93%，同期业绩比较基准收益率为7.20%；截至报告期末汇安沪深300增强C基金份额净值为1.6956元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为10.72%，同期业绩比较基准收益率为7.20%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从当前已披露的中报预告、产业发展趋势和宏观数据看，未来半年仍有不小的概率是结构性行情。科技板块大幅上涨后，市场状态或将从主线集中的“估值扩张”逐步转向板块扩散的“盈利兑现”，可适当关注如下一些景气程度高，盈利确定性较强的板块：

1) 国产存储产业链：兼具周期上行与国产替代双重核心优势，涵盖DRAM、NAND、特色存储、存储模组、企业级存储、半导体设备、配套半导体材料及先进封装、存储控制芯片等全环节。当前行业受益于全球存储价格回暖、AI硬件拉动高端存储需求、国内晶圆厂持续扩产，叠加国产设备材料验证落地提速，整体成长确定性强。重点关注拥有核心技术壁垒、通过头部客户验证、市场份额持续提升的优质标的。

2) 半导体设备、材料与先进封装：行业投资逻辑已实现了从技术突破转向规模化交付、生态搭建、商业化落地的迭代。相较于半导体设计企业，设备和材料企业客户粘性高、国产化提升空间充足，下游晶圆厂扩产带来稳定订单，业绩可跟踪性强，且受单一产品迭代风险影响较小。同时，先进封装深度受益于AI芯片、高带宽存储、Chiplet技术发展，是未来2-3年半导体行业明确的资本开支方向，具备稳定的成长属性。

3) 创新药：行业基本面持续边际改善，核心源于药企海外授权BD收入的增长、临床研发成果持续落地、国内医保支付环境优化。与此同时，国内医药研发的效率与成本

优势，逐渐获得全球市场认可。行业内部分化显著，需聚焦拥有真实临床价值、具备海外商业化能力、现金流充沛、管线布局清晰的优质标的。

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”）在对汇安沪深300指数增强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，对汇安沪深300指数增强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：汇安沪深300指数增强型证券投资基金

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	14,552,897.63	10,771,764.73
结算备付金		293,283.02	896,724.14
存出保证金		43,592.58	1,057,783.53
交易性金融资产	6.4.7.2	226,979,642.55	287,935,804.20
其中：股票投资		219,292,861.46	274,333,893.07
基金投资		-	-
债券投资		7,686,781.09	13,601,911.13
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		8,775.21	131,746.76

应收股利		-	-
应收申购款		144,905.83	28,539.43
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		242,023,096.82	300,822,362.79
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		4.10	260.28
应付赎回款		772,337.22	1,294,344.55
应付管理人报酬		187,372.03	252,445.28
应付托管费		18,737.19	25,244.55
应付销售服务费		39,620.30	59,992.59
应付投资顾问费		-	-
应交税费		159.10	24.15
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	108,933.80	180,116.46
负债合计		1,127,163.74	1,812,427.86
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	136,074,198.80	187,931,015.00
未分配利润	6.4.7.8	104,821,734.28	111,078,919.93
净资产合计		240,895,933.08	299,009,934.93
负债和净资产总计		242,023,096.82	300,822,362.79

注：报告截止日2026年6月30日，基金份额总额136,074,198.80份，其中汇安沪深300增强A基金份额净值1.8721元，份额总额57,611,199.09份；汇安沪深300增强C基金份额净值1.6956元，份额总额78,462,999.71份。

6.2 利润表

会计主体：汇安沪深300指数增强型证券投资基金

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		26,656,442.67	6,354,024.83
1.利息收入		13,034.12	112,459.55
其中：存款利息收入	6.4.7.9	13,034.12	29,705.90
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		-	82,753.65
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-” 填列）		30,726,404.12	6,858,126.63
其中：股票投资收益	6.4.7.10	28,113,428.44	3,679,981.92
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	67,585.11	4,259.66
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	279,323.98	546,362.39
股利收益	6.4.7.15	2,266,066.59	2,627,522.66
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	-4,114,315.69	-623,339.40
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	31,320.12	6,778.05
减：二、营业总支出		1,696,811.85	1,750,055.46
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	1,212,217.33	1,202,584.91
2.托管费	6.4.10.2.2	121,221.73	120,258.55
3.销售服务费	6.4.10.2.3	275,087.13	294,393.35
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.信用减值损失		-	-
7.税金及附加		1,157.49	2,816.39
8.其他费用	6.4.7.18	87,128.17	130,002.26
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		24,959,630.82	4,603,969.37
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		24,959,630.82	4,603,969.37
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		24,959,630.82	4,603,969.37

6.3 净资产变动表

会计主体：汇安沪深300指数增强型证券投资基金

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	187,931,015.00	111,078,919.93	299,009,934.93
二、本期期初净资	187,931,015.00	111,078,919.93	299,009,934.93

产			
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-51,856,816.20	-6,257,185.65	-58,114,001.85
（一）、综合收益总额	-	24,959,630.82	24,959,630.82
（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）	-51,856,816.20	-31,216,816.47	-83,073,632.67
其中：1.基金申购款	47,906,915.05	30,425,573.20	78,332,488.25
2.基金赎回款	-99,763,731.25	-61,642,389.67	-161,406,120.92
（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	136,074,198.80	104,821,734.28	240,895,933.08
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	198,976,351.45	56,422,458.79	255,398,810.24
二、本期期初净资产	198,976,351.45	56,422,458.79	255,398,810.24
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-26,695,407.39	-2,471,102.77	-29,166,510.16
（一）、综合收益总额	-	4,603,969.37	4,603,969.37

(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)	-26,695,407.39	-7,075,072.14	-33,770,479.53
其中: 1.基金申购款	12,321,980.07	2,986,440.60	15,308,420.67
2.基金赎回款	-39,017,387.46	-10,061,512.74	-49,078,900.20
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-
四、本期期末净资产	172,280,944.06	53,951,356.02	226,232,300.08

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

汇安沪深300指数增强型证券投资基金(以下简称“本基金”)是由汇安丰泰灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“汇安丰泰混合基金”)基金转型而来。根据本基金的基金管理人于2018年7月3日发布的《汇安基金管理有限责任公司关于汇安丰泰灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，基金份额持有人大会于2018年7月2日表决通过了《关于汇安丰泰灵活配置混合型证券投资基金转型的有关事项的议案》，同时根据《关于准予汇安丰泰灵活配置混合型证券投资基金变更注册的批复》(证监许可[2018]737号)准予注册的批复，汇安丰泰混合基金于2018年7月3日实施转型。同日起，《汇安沪深300指数增强型证券投资基金基金合同》生效，原《汇安丰泰灵活配置混合型证券投资基金基金合同》失效。原汇安丰泰混合基金A类基金份额转为本基金A类基金份额，原汇安丰泰混合基金C类基金份额转为本基金C类基金份额。

本基金为契约型开放式，存续期限不定。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《汇安沪深300指数增强型证券投资基金基金合同》和《汇安沪深300指数增强型证券投资基金招募说明书》，本基金根据申购费与销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者申购基金时收取申购费用，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；在投资人申购时不收取申购费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，并在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额的，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。投资人可自行选择申购的基金份额类别。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《汇安沪深300指数增强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(包括中小板、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、超短期融资券、可交换债券、可转换债券(含分离交易可转)、中小企业私募债等)、债券回购、同业存单、银行存款(包括协议存款、定期存款、通知存款及其他银行存款)、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：股票资产投资比例不低于基金资产的80%，其中投资于沪深300指数成分股及其备选成分股的比例不低于非现金基金资产的80%；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，本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；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。本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率 $\times 95\%$ + 银行活期存款利率(税后) $\times 5\%$ 。

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》、《汇安沪深300指数增强

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	14,552,897.63
等于：本金	14,552,062.20
加：应计利息	835.43
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-

减：坏账准备	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	14,552,897.63

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		178,899,422.27	-	219,292,861.46	40,393,439.19
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	7,607,259.52	83,111.09	7,686,781.09	-3,589.52
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	7,607,259.52	83,111.09	7,686,781.09	-3,589.52
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		186,506,681.79	83,111.09	226,979,642.55	40,389,849.67

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	242.54
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	24,388.70
其中：交易所市场	24,388.70
银行间市场	-
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
合计	108,933.80

6.4.7.7 实收基金

6.4.7.7.1 汇安沪深300增强A

金额单位：人民币元

项目 (汇安沪深300增强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	71,770,787.07	71,770,787.07
本期申购	8,021,530.50	8,021,530.50
本期赎回（以“-”号填列）	-22,181,118.48	-22,181,118.48
本期末	57,611,199.09	57,611,199.09

6.4.7.7.2 汇安沪深300增强C

金额单位：人民币元

项目 (汇安沪深300增强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	116,160,227.93	116,160,227.93
本期申购	39,885,384.55	39,885,384.55
本期赎回（以“-”号填列）	-77,582,612.77	-77,582,612.77
本期末	78,462,999.71	78,462,999.71

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 汇安沪深300增强A

单位：人民币元

项目 (汇安沪深300增强A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	24,051,857.03	25,294,287.45	49,346,144.48
本期期初	24,051,857.03	25,294,287.45	49,346,144.48
本期利润	12,634,096.61	-1,237,448.18	11,396,648.43
本期基金份额交易产生的变动数	-5,246,737.16	-5,252,662.49	-10,499,399.65
其中：基金申购款	3,606,596.98	2,597,103.44	6,203,700.42
基金赎回款	-8,853,334.14	-7,849,765.93	-16,703,100.07
本期已分配利润	-	-	-
本期末	31,439,216.48	18,804,176.78	50,243,393.26

6.4.7.8.2 汇安沪深300增强C

单位：人民币元

项目 (汇安沪深300增强C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	24,069,924.60	37,662,850.85	61,732,775.45
本期期初	24,069,924.60	37,662,850.85	61,732,775.45

本期利润	16,439,849.90	-2,876,867.51	13,562,982.39
本期基金份额交易产生的变动数	-9,517,369.91	-11,200,046.91	-20,717,416.82
其中：基金申购款	12,370,320.70	11,851,552.08	24,221,872.78
基金赎回款	-21,887,690.61	-23,051,598.99	-44,939,289.60
本期已分配利润	-	-	-
本期末	30,992,404.59	23,585,936.43	54,578,341.02

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	12,491.32
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	222.23
其他	320.57
合计	13,034.12

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	186,254,763.96
减：卖出股票成本总额	157,975,126.39
减：交易费用	166,209.13
买卖股票差价收入	28,113,428.44

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	67,400.59
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	184.52
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	67,585.11

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	10,315,458.76
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	10,202,124.48
减：应计利息总额	113,149.76
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	184.52

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

单位：人民币元

项目	本期
	2026年01月01日至2026年06月30日
期货投资	279,323.98

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	2,266,066.59
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	2,266,066.59

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	-3,980,365.69
——股票投资	-3,977,302.17
——债券投资	-3,063.52
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-133,950.00
——权证投资	-
——期货投资	-133,950.00
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	-4,114,315.69

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	29,664.14
转换费收入	1,655.98
合计	31,320.12

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	2,825.61
合计	87,128.17

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、基金销售机构
何斌	基金管理人的股东
秦军	基金管理人的股东
郭小峰	基金管理人的股东

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

无。

6.4.10.1.4 债券回购交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至20 26年06月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至20 25年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,212,217.33	1,202,584.91
其中：应支付销售机构的客户维护费	346,877.01	359,105.93
应支付基金管理人的净管理费	865,340.32	843,478.98

注：支付基金管理人汇安基金管理有限责任公司的管理人报酬按前一日基金资产净值1.00%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬＝前一日基金资产净值 × 1.00% / 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	121,221.73	120,258.55

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

日托管费＝前一日基金资产净值 × 0.10% / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售 服务费的 各关联方 名称	本期 2026年01月01日至2026年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	汇安沪深300增强A	汇安沪深300增强C	合计
上海浦东 发展银行 股份有限 公司	0.00	21,910.56	21,910.56
汇安基金 管理有限 责任公司	0.00	106,314.30	106,314.30
合计	-	128,224.86	128,224.86
获得销售 服务费的 各关联方 名称	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销售服务费		
	汇安沪深300增强A	汇安沪深300增强C	合计
汇安基金	0.00	109,853.56	109,853.56

管理有限 责任公司			
上海浦东 发展银行 股份有限 公司	0.00	7,137.02	7,137.02
合计	-	116,990.58	116,990.58

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0.40%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×0.40%/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

汇安沪深300增强C

份额单位：份

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
报告期初持有的基金份额	698,644.64	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-

报告期末持有的基金份额	698,644.64	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.89%	-

注：

1.基金管理人汇安基金管理有限责任公司投资本基金适用的认（申）购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行。

2.报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例，比例的分母分别采用各自类别的份额总额计算。

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 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	
	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	14,552,897.63	12,491.32	14,222,005.39	28,115.37

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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
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：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688795	摩尔线程	2025-11-26	6个月以上	科创板打新限售	114.28	676.94	1,034	118,165.52	699,955.96	-
301308	江波龙	2026-01-26	1-6个月（含）	询价转让限售	212.09	675.52	1,000	212,090.00	675,520.00	-
688082	盛美上海	2026-02-09	1-6个月（含）	询价转让限售	160.00	399.91	1,000	160,000.00	399,910.00	-
688099	晶晨股份	2026-01-28	1-6个月（含）	询价转让限售	82.85	99.72	2,000	165,700.00	199,440.00	-
688808	联讯仪器	2026-04-16	1-6个月（含）	科创板打新限售	81.88	1,584.33	54	4,421.52	85,553.82	-
688797	臻宝科技	2026-06-16	1-6个月（含）	科创板打新限售	44.56	468.67	91	4,054.96	42,648.97	-
688712	北芯生命	2026-01-28	1-6个月（含）	科创板打新限售	17.52	35.92	1,183	20,726.16	42,493.36	-
301682	宏明电子	2026-03-18	1-6个月（含）	创业板打	69.66	160.06	219	15,255.54	35,053.14	-

				新限售						
001399	惠科股份	2026-06-16	1-6个月(含)	新股锁定	10.12	27.73	1,194	12,083.28	33,109.62	-
688813	泰金新能	2026-03-24	1-6个月(含)	科创板打新限售	26.28	172.09	177	4,651.56	30,459.93	-
688635	长进光子	2026-05-20	1-6个月(含)	科创板打新限售	40.98	308.19	98	4,016.04	30,202.62	-
001257	盛龙股份	2026-03-24	1-6个月(含)	新股锁定	7.82	20.74	979	7,655.78	20,304.46	-
688811	有研复材	2026-04-01	1-6个月(含)	科创板打新限售	6.41	24.13	692	4,435.72	16,697.96	-
301687	新广益	2025-12-24	1-6个月(含)	创业板打新限售	21.93	77.78	195	4,276.35	15,167.10	-
301669	高特电子	2026-06-02	1-6个月(含)	创业板打新限售	7.08	28.40	478	3,384.24	13,575.20	-
301531	春光集团	2026-04-28	1-6个月(含)	创业板打新限售	13.30	51.56	258	3,431.40	13,302.48	-
301680	固德电材	2026-02-27	1-6个月(含)	创业板打	58.00	112.16	93	5,394.00	10,430.88	-

				新限售						
301599	理奇智能	2026-04-22	1-6个月(含)	创业板打新限售	13.91	32.47	276	3,839.16	8,961.72	-
001365	天海电子	2026-05-11	1-6个月(含)	新股锁定	27.19	31.31	232	6,308.08	7,263.92	-
301513	尚水智能	2026-04-10	1-6个月(含)	创业板打新限售	26.66	50.96	138	3,679.08	7,032.48	-
001393	维通利	2026-05-08	1-6个月(含)	新股锁定	30.38	38.99	162	4,921.56	6,316.38	-
001237	惠康科技	2026-05-15	1-6个月(含)	新股锁定	53.26	58.74	93	4,953.18	5,462.82	-
603435	嘉德利	2026-05-15	1-6个月(含)	新股锁定	15.76	46.71	103	1,623.28	4,811.13	-
601112	振石股份	2026-01-21	1-6个月(含)	新股锁定	11.18	17.59	265	2,962.70	4,661.35	-
603352	至信股份	2026-01-08	1-6个月(含)	新股锁定	21.88	25.52	101	2,209.88	2,577.52	-
603284	林平发展	2026-02-03	1-6个月(含)	新股锁定	37.88	34.87	46	1,742.48	1,604.02	-
001220	世盟股份	2026-01-27	1-6个月(含)	新股锁定	28.00	27.78	57	1,596.00	1,583.46	-
001312	福恩股份	2026-04-1	1-6个月(含)	新股锁定	18.38	16.78	81	1,488.78	1,359.18	-

		4								
603293	埃泰克	2026-04-09	1-6个月（含）	新股锁定	33.49	33.93	40	1,339.60	1,357.20	-

注：1、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股中需要限售的部分或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

2、基金参与上市公司向特定对象发行股票所获得的股票，自发行结束之日起6个月内不得转让。

3、基金作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起12个月内不得转让。

4、基金通过询价转让受让的科创板股份，在受让后6个月内不得转让。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688072	拓荆科技	2026-06-29	拟筹划重大资产重组	879.53	2026-07-13	890.99	900	508,275.18	791,577.00	-

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

本基金为股票型基金，其风险收益水平高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。本基金为指数型基金，具有与标的指数相似的风险收益特征。

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，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。

于2026年6月30日，本基金持有的债券和资产支持证券占基金资产净值的比例为3.19%(2025年12月31日：4.55%)。

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	7,686,781.09	-
合计	7,686,781.09	-

注：未评级部分为国债。

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同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》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。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。

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	14,552,897.63	-	-	-	14,552,897.63
结算备付金	293,283.02	-	-	-	293,283.02
存出保证金	43,592.58	-	-	-	43,592.58
交易性金融资产	7,686,781.09	-	-	219,292,861.46	226,979,642.55
应收清算款	-	-	-	8,775.21	8,775.21
应收申购款	-	-	-	144,905.83	144,905.83
资产总	22,576,554.32	-	-	219,446,542.50	242,023,096.82

计					
负债					
应付清算款	-	-	-	4.10	4.10
应付赎回款	-	-	-	772,337.22	772,337.22
应付管理人报酬	-	-	-	187,372.03	187,372.03
应付托管费	-	-	-	18,737.19	18,737.19
应付销售服务费	-	-	-	39,620.30	39,620.30
应交税费	-	-	-	159.10	159.10
其他负债	-	-	-	108,933.80	108,933.80
负债总计	-	-	-	1,127,163.74	1,127,163.74
利率敏感度缺口	22,576,554.32	-	-	218,319,378.76	240,895,933.08
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	10,771,764.73	-	-	-	10,771,764.73
结算备	896,724.14	-	-	-	896,724.14

付金					
存出保证金	1,057,783.53	-	-	-	1,057,783.53
交易性金融资产	13,601,911.13	-	-	274,333,893.07	287,935,804.20
应收清算款	-	-	-	131,746.76	131,746.76
应收申购款	-	-	-	28,539.43	28,539.43
资产总计	26,328,183.53	-	-	274,494,179.26	300,822,362.79
负债					
应付清算款	-	-	-	260.28	260.28
应付赎回款	-	-	-	1,294,344.55	1,294,344.55
应付管理人报酬	-	-	-	252,445.28	252,445.28
应付托管费	-	-	-	25,244.55	25,244.55
应付销售服务费	-	-	-	59,992.59	59,992.59
应交税费	-	-	-	24.15	24.15
其他负债	-	-	-	180,116.46	180,116.46
负债总计	-	-	-	1,812,427.86	1,812,427.86
利率敏感度缺	26,328,183.53	-	-	272,681,751.40	299,009,934.93

□					
---	--	--	--	--	--

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2026年6月30日，本基金持有的交易性债券投资和资产支持证券投资公允价值占基金资产净值的比例为3.19%(2025年12月31日：4.55%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2025年12月31日：同)。

6.4.13.4.2 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。

本基金为增强型股票指数基金，在严格控制对沪深300指数跟踪误差的基础上，通过量化投资方式进行积极的组合管理和风险控制。

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不低于基金资产的80%，其中投资于沪深300指数成分股及其备选成分股的比例不低于非现金基金资产的80%；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，本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；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	公允价值	占基金 资产净

		值比例 (%)		值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	219,292,861.46	91.03	274,333,893.07	91.75
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	219,292,861.46	91.03	274,333,893.07	91.75

注：其他包含在期货交易所交易的期货投资（附注6.4.7.3）。在当日无负债结算制度下，期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为0。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深300指数以外的其他变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币元)	
		本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
	沪深300指数上升5%	13,158,196.19	15,582,478.56
	沪深300指数下降5%	-13,158,196.19	-15,582,478.56

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	216,084,467.78	261,218,885.07
第二层次	8,478,358.09	15,990,118.13
第三层次	2,416,816.68	10,726,801.00
合计	226,979,642.55	287,935,804.20

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	219,292,861.46	90.61
	其中：股票	219,292,861.46	90.61
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	7,686,781.09	3.18
	其中：债券	7,686,781.09	3.18
	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	14,846,180.65	6.13
8	其他各项资产	197,273.62	0.08
9	合计	242,023,096.82	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（指数投资）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	1,105,225.00	0.46
B	采矿业	12,306,254.00	5.11
C	制造业	132,875,889.25	55.16
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,671,579.00	1.94
E	建筑业	2,123,330.56	0.88
F	批发和零售业	277,724.00	0.12
G	交通运输、仓储和邮政业	4,552,690.86	1.89
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术	8,457,870.05	3.51

	术服务业		
J	金融业	38,807,975.00	16.11
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	256,520.00	0.11
M	科学研究和技术服务业	3,959,418.00	1.64
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	273,406.00	0.11
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	209,667,881.72	87.04

7.2.2 报告期末（积极投资）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	-	-
B	采矿业	264,610.46	0.11
C	制造业	7,376,820.32	3.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	351,178.00	0.15
E	建筑业	276,100.30	0.11
F	批发和零售业	71,626.00	0.03
G	交通运输、仓储和邮政业	513,571.46	0.21
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	342,808.00	0.14
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	48,492.00	0.02

M	科学研究和技术服务业	305,738.00	0.13
N	水利、环境和公共设施管理业	74,035.20	0.03
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	9,624,979.74	4.00

7.2.3 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

7.3.1 期末指数投资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	300308	中际旭创	10,100	12,827,000.00	5.32
2	300750	宁德时代	27,300	10,729,173.00	4.45
3	600519	贵州茅台	5,800	6,875,842.00	2.85
4	300502	新易盛	10,660	6,470,620.00	2.69
5	601899	紫金矿业	213,900	5,377,446.00	2.23
6	601318	中国平安	95,600	4,563,944.00	1.89
7	603259	药明康德	31,800	3,959,418.00	1.64
8	603986	兆易创新	4,700	3,830,500.00	1.59
9	600036	招商银行	99,100	3,518,050.00	1.46
10	601138	工业富联	43,600	3,145,740.00	1.31
11	688256	寒武纪	1,686	2,690,097.30	1.12
12	600183	生益科技	15,439	2,677,122.60	1.11

13	002371	北方华创	2,970	2,627,143.20	1.09
14	000333	美的集团	32,400	2,447,172.00	1.02
15	601166	兴业银行	145,300	2,406,168.00	1.00
16	600030	中信证券	80,300	2,307,019.00	0.96
17	600900	长江电力	86,200	2,281,714.00	0.95
18	688041	海光信息	5,420	2,007,026.00	0.83
19	688008	澜起科技	6,348	1,967,245.20	0.82
20	002475	立讯精密	27,700	1,950,080.00	0.81
21	688012	中微公司	4,127	1,933,499.50	0.80
22	002463	沪电股份	12,600	1,925,280.00	0.80
23	688981	中芯国际	11,624	1,846,123.68	0.77
24	600150	中国船舶	53,595	1,810,975.05	0.75
25	300394	天孚通信	5,940	1,797,919.20	0.75
26	300274	阳光电源	11,101	1,765,281.02	0.73
27	000725	京东方 A	201,000	1,744,680.00	0.72
28	002384	东山精密	6,600	1,731,510.00	0.72
29	300059	东方财富	79,200	1,614,096.00	0.67
30	601211	国泰海通	87,600	1,594,320.00	0.66
31	300476	胜宏科技	4,600	1,593,578.00	0.66
32	601288	农业银行	253,100	1,536,317.00	0.64
33	601398	工商银行	215,200	1,521,464.00	0.63
34	603993	洛阳钼业	86,300	1,514,565.00	0.63
35	002415	海康威视	43,900	1,501,380.00	0.62
36	605117	德业股份	13,672	1,451,692.96	0.60
37	002594	比亚迪	18,000	1,434,600.00	0.60
38	601601	中国太保	50,200	1,431,704.00	0.59
39	600276	恒瑞医药	26,910	1,400,396.40	0.58
40	600089	特变电工	62,000	1,395,000.00	0.58
41	000776	广发证券	57,100	1,336,140.00	0.55
42	002028	思源电气	7,600	1,314,800.00	0.55
43	000338	潍柴动力	47,700	1,299,825.00	0.54

44	300408	三环集团	7,700	1,285,130.00	0.53
45	601088	中国神华	32,300	1,260,992.00	0.52
46	600887	伊利股份	51,400	1,231,544.00	0.51
47	002709	天赐材料	23,500	1,208,605.00	0.50
48	000651	格力电器	32,000	1,200,000.00	0.50
49	000100	TCL科技	206,000	1,198,920.00	0.50
50	000408	藏格矿业	17,200	1,192,304.00	0.49
51	300033	同花顺	4,860	1,171,260.00	0.49
52	601328	交通银行	172,000	1,105,960.00	0.46
53	600522	中天科技	17,800	1,080,104.00	0.45
54	603799	华友钴业	22,200	1,071,372.00	0.44
55	002049	紫光国微	12,000	1,065,000.00	0.44
56	301308	江波龙	1,500	1,027,420.00	0.43
57	600919	江苏银行	94,100	1,014,398.00	0.42
58	002142	宁波银行	33,300	988,677.00	0.41
59	002460	赣锋锂业	15,000	981,000.00	0.41
60	000001	平安银行	95,400	958,770.00	0.40
61	601336	新华保险	15,700	936,662.00	0.39
62	601939	建设银行	95,500	919,665.00	0.38
63	601872	招商轮船	52,000	913,640.00	0.38
64	600309	万华化学	13,100	896,171.00	0.37
65	000988	华工科技	4,600	849,206.00	0.35
66	601857	中国石油	96,400	836,752.00	0.35
67	300124	汇川技术	12,500	829,125.00	0.34
68	603019	中科曙光	7,700	825,671.00	0.34
69	601066	中信建投	28,400	825,588.00	0.34
70	002916	深南电路	1,740	796,746.00	0.33
71	688072	拓荆科技	900	791,577.00	0.33
72	600584	长电科技	7,200	745,560.00	0.31
73	600111	北方稀土	15,300	735,165.00	0.31
74	601816	京沪高铁	162,100	734,313.00	0.30

75	603288	海天味业	22,120	733,499.20	0.30
76	601600	中国铝业	89,200	733,224.00	0.30
77	000858	五 粮 液	9,900	732,600.00	0.30
78	601688	华泰证券	34,400	709,328.00	0.29
79	600031	三一重工	40,900	706,752.00	0.29
80	600346	恒力石化	39,100	692,461.00	0.29
81	601668	中国建筑	154,701	671,402.34	0.28
82	000063	中兴通讯	18,500	669,515.00	0.28
83	688111	金山办公	3,115	663,650.75	0.28
84	002714	牧原股份	18,700	654,313.00	0.27
85	002466	天齐锂业	10,400	637,728.00	0.26
86	600188	兖矿能源	34,100	605,957.00	0.25
87	688521	芯原股份	1,600	593,824.00	0.25
88	601995	中金公司	16,100	582,015.00	0.24
89	002050	三花智控	13,200	578,556.00	0.24
90	300628	亿联网络	16,680	564,117.60	0.23
91	600406	国电南瑞	24,600	562,110.00	0.23
92	601225	陕西煤业	27,500	559,625.00	0.23
93	601998	中信银行	79,900	553,707.00	0.23
94	300014	亿纬锂能	8,500	552,755.00	0.23
95	601229	上海银行	63,200	548,576.00	0.23
96	600660	福耀玻璃	10,800	544,752.00	0.23
97	300760	迈瑞医疗	4,000	543,320.00	0.23
98	000708	中信特钢	42,900	541,398.00	0.22
99	300433	蓝思科技	9,900	531,234.00	0.22
100	601988	中国银行	92,400	528,528.00	0.22
101	600938	中国海油	19,400	526,710.00	0.22
102	601728	中国电信	99,900	518,481.00	0.22
103	002352	顺丰控股	16,100	503,286.00	0.21
104	601628	中国人寿	14,100	498,435.00	0.21
105	601985	中国核电	54,800	494,844.00	0.21

106	600941	中国移动	5,700	490,941.00	0.20
107	688082	盛美上海	1,200	486,310.00	0.20
108	601658	邮储银行	97,100	478,703.00	0.20
109	000425	徐工机械	58,900	476,501.00	0.20
110	600926	杭州银行	32,800	473,960.00	0.20
111	601169	北京银行	94,100	461,090.00	0.19
112	002602	世纪华通	32,600	459,660.00	0.19
113	002736	国信证券	46,000	459,540.00	0.19
114	300498	温氏股份	36,600	450,912.00	0.19
115	601919	中远海控	34,000	450,840.00	0.19
116	688126	沪硅产业	11,062	441,263.18	0.18
117	300442	润泽科技	5,300	440,271.00	0.18
118	603501	豪威集团	4,600	436,310.00	0.18
119	002625	光启技术	14,200	430,544.00	0.18
120	002353	杰瑞股份	2,800	427,000.00	0.18
121	600999	招商证券	20,000	422,000.00	0.18
122	000938	紫光股份	14,500	418,470.00	0.17
123	600690	海尔智家	20,500	418,405.00	0.17
124	002230	科大讯飞	10,100	412,484.00	0.17
125	601766	中国中车	78,200	406,640.00	0.17
126	601009	南京银行	40,500	400,545.00	0.17
127	002938	鹏鼎控股	3,800	400,444.00	0.17
128	600028	中国石化	89,300	398,278.00	0.17
129	600886	国投电力	29,300	389,983.00	0.16
130	600019	宝钢股份	70,200	381,186.00	0.16
131	002179	中航光电	8,200	378,840.00	0.16
132	600050	中国联通	93,700	374,800.00	0.16
133	600893	航发动力	9,700	371,898.00	0.15
134	601012	隆基绿能	28,300	371,296.00	0.15
135	600160	巨化股份	7,000	371,070.00	0.15
136	600010	包钢股份	164,400	366,612.00	0.15

137	300661	圣邦股份	2,550	365,874.00	0.15
138	601100	恒立液压	3,400	365,704.00	0.15
139	601898	中煤能源	29,700	361,746.00	0.15
140	600760	中航沈飞	8,800	361,680.00	0.15
141	000977	浪潮信息	5,100	357,000.00	0.15
142	600026	中远海能	19,100	342,654.00	0.14
143	002600	领益智造	19,500	338,130.00	0.14
144	688271	联影医疗	3,309	334,970.07	0.14
145	601818	光大银行	115,800	334,662.00	0.14
146	000568	泸州老窖	4,300	333,336.00	0.14
147	002241	歌尔股份	14,300	322,179.00	0.13
148	601127	赛力斯	5,100	312,375.00	0.13
149	601390	中国中铁	74,700	311,499.00	0.13
150	601689	拓普集团	5,500	310,310.00	0.13
151	600809	山西汾酒	2,800	306,236.00	0.13
152	600489	中金黄金	16,900	305,045.00	0.13
153	600547	山东黄金	13,200	304,788.00	0.13
154	601006	大秦铁路	65,000	299,650.00	0.12
155	601838	成都银行	16,800	297,360.00	0.12
156	600104	上汽集团	30,300	295,728.00	0.12
157	600958	东方证券	30,700	289,808.00	0.12
158	600989	宝丰能源	14,000	284,620.00	0.12
159	601825	沪农商行	37,800	283,122.00	0.12
160	601669	中国电建	60,000	282,000.00	0.12
161	000630	铜陵有色	44,200	281,112.00	0.12
162	002202	金风科技	11,700	279,630.00	0.12
163	600905	三峡能源	74,900	277,879.00	0.12
164	000807	云铝股份	12,500	276,750.00	0.11
165	300015	爱尔眼科	33,100	273,406.00	0.11
166	600549	厦门钨业	3,200	272,640.00	0.11
167	300418	昆仑万维	6,700	270,412.00	0.11

168	600795	国电电力	57,700	269,459.00	0.11
169	601868	中国能建	100,500	268,335.00	0.11
170	002311	海大集团	6,000	267,660.00	0.11
171	002001	新 和 成	9,400	267,148.00	0.11
172	002422	科伦药业	6,900	265,788.00	0.11
173	600875	东方电气	9,100	261,807.00	0.11
174	000657	中钨高新	2,700	258,444.00	0.11
175	600460	士兰微	4,700	256,902.00	0.11
176	002027	分众传媒	53,000	256,520.00	0.11
177	601377	兴业证券	42,000	253,680.00	0.11
178	605499	东鹏饮料	2,050	253,031.50	0.11
179	601698	中国卫通	8,300	251,075.00	0.10
180	003816	中国广核	63,100	246,721.00	0.10
181	000166	申万宏源	55,100	242,440.00	0.10
182	600426	华鲁恒升	9,900	236,808.00	0.10
183	603296	华勤技术	3,180	236,178.60	0.10
184	000538	云南白药	4,900	232,113.00	0.10
185	688396	华润微	2,366	230,803.30	0.10
186	002648	卫星化学	9,800	230,202.00	0.10
187	600118	中国卫星	2,800	229,740.00	0.10
188	600482	中国动力	7,000	229,600.00	0.10
189	000975	山金国际	13,000	221,000.00	0.09
190	600362	江西铜业	5,100	220,830.00	0.09
191	601077	渝农商行	36,100	220,571.00	0.09
192	688036	传音控股	3,736	220,237.20	0.09
193	000625	长安汽车	30,700	220,119.00	0.09
194	600570	恒生电子	10,300	218,257.00	0.09
195	688183	生益电子	1,600	211,840.00	0.09
196	600196	复星医药	9,400	211,218.00	0.09
197	600115	中国东航	54,900	209,169.00	0.09
198	600029	南方航空	40,200	208,236.00	0.09

199	600436	片仔癀	1,900	207,632.00	0.09
200	603893	瑞芯微	1,100	207,196.00	0.09
201	600011	华能国际	27,200	206,448.00	0.09
202	600438	通威股份	16,800	203,448.00	0.08
203	600233	圆通速递	12,900	203,175.00	0.08
204	300316	晶盛机电	3,300	199,320.00	0.08
205	002837	英维克	2,500	198,900.00	0.08
206	600066	宇通客车	7,300	195,713.00	0.08
207	601058	赛轮轮胎	16,800	193,704.00	0.08
208	601111	中国国航	31,600	191,180.00	0.08
209	000963	华东医药	6,700	188,404.00	0.08
210	688047	龙芯中科	1,200	185,604.00	0.08
211	601877	正泰电器	7,400	185,518.00	0.08
212	601117	中国化学	25,100	184,485.00	0.08
213	000157	中联重科	26,300	183,311.00	0.08
214	002236	大华股份	11,000	181,390.00	0.08
215	688506	百利天恒	599	176,123.97	0.07
216	000301	东方盛虹	15,300	175,185.00	0.07
217	300803	指南针	1,900	174,173.00	0.07
218	002493	荣盛石化	16,100	173,075.00	0.07
219	600372	中航机载	15,800	171,430.00	0.07
220	601788	光大证券	11,800	170,274.00	0.07
221	300450	先导智能	4,100	166,952.00	0.07
222	301236	软通动力	3,900	165,555.00	0.07
223	601021	春秋航空	3,617	164,862.86	0.07
224	002304	洋河股份	4,300	164,045.00	0.07
225	601881	中国银河	13,000	163,410.00	0.07
226	002074	国轩高科	5,800	159,558.00	0.07
227	600219	南山铝业	39,800	158,802.00	0.07
228	600674	川投能源	11,100	157,287.00	0.07
229	300866	安克创新	1,500	156,750.00	0.07

230	601800	中国交建	27,082	154,638.22	0.06
231	601878	浙商证券	16,100	152,950.00	0.06
232	002532	天山铝业	13,700	147,001.00	0.06
233	601186	中国铁建	24,700	146,965.00	0.06
234	002920	德赛西威	1,800	146,700.00	0.06
235	301269	华大九天	1,200	143,304.00	0.06
236	600027	华电国际	31,200	138,840.00	0.06
237	001965	招商公路	14,700	134,652.00	0.06
238	601319	中国人保	19,400	131,144.00	0.05
239	600741	华域汽车	8,300	128,816.00	0.05
240	600085	同仁堂	5,500	127,105.00	0.05
241	000792	盐湖股份	4,200	126,798.00	0.05
242	601901	方正证券	17,100	123,120.00	0.05
243	600023	浙能电力	23,400	123,084.00	0.05
244	300832	新产业	2,900	121,800.00	0.05
245	688223	晶科能源	25,169	119,552.75	0.05
246	600600	青岛啤酒	2,100	109,683.00	0.05
247	600588	用友网络	11,600	106,488.00	0.04
248	600039	四川路桥	13,300	104,006.00	0.04
249	000895	双汇发展	4,600	103,040.00	0.04
250	002558	巨人网络	3,500	96,460.00	0.04
251	600018	上港集团	20,400	96,288.00	0.04
252	601633	长城汽车	6,200	93,558.00	0.04
253	601607	上海医药	5,800	89,320.00	0.04
254	600803	新奥股份	5,400	85,320.00	0.04
255	688303	大全能源	4,549	79,289.07	0.03
256	300999	金龙鱼	3,000	69,780.00	0.03
257	601018	宁波港	21,000	66,150.00	0.03
258	000596	古井贡酒	800	63,840.00	0.03
259	601456	国联民生	6,600	58,344.00	0.02
260	601916	浙商银行	17,600	46,288.00	0.02

261	001391	国货航	8,500	34,595.00	0.01
262	001280	中国铀业	500	33,350.00	0.01

7.3.2 期末积极投资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	688409	富创精密	3,000	918,750.00	0.38
2	688795	摩尔线程	1,034	699,955.96	0.29
3	603195	公牛集团	13,200	516,780.00	0.21
4	688797	臻宝科技	707	467,756.73	0.19
5	603929	亚翔集成	1,015	276,100.30	0.11
6	600801	华新建材	13,100	204,360.00	0.08
7	688099	晶晨股份	2,000	199,440.00	0.08
8	688120	华海清科	560	180,420.80	0.07
9	601107	四川成渝	36,800	179,584.00	0.07
10	600988	赤峰黄金	6,500	171,080.00	0.07
11	000550	江铃汽车	10,500	170,310.00	0.07
12	300037	新宙邦	1,800	167,130.00	0.07
13	002653	海思科	2,400	159,216.00	0.07
14	603444	吉比特	400	143,368.00	0.06
15	300782	卓胜微	1,300	142,454.00	0.06
16	002468	申通快递	8,900	129,584.00	0.05
17	000958	电投产融	22,100	124,644.00	0.05
18	301358	湖南裕能	1,600	121,392.00	0.05
19	603038	华立股份	5,700	88,920.00	0.04
20	301223	中荣股份	5,400	87,048.00	0.04
21	688808	联讯仪器	54	85,553.82	0.04
22	001202	炬申股份	6,200	84,010.00	0.03
23	301215	中汽股份	16,100	83,559.00	0.03

24	603209	兴通股份	6,600	82,698.00	0.03
25	603059	倍加洁	3,400	82,450.00	0.03
26	000421	南京公用	16,500	81,840.00	0.03
27	301665	泰禾股份	3,900	81,744.00	0.03
28	002942	新农股份	5,700	81,681.00	0.03
29	603238	诺邦股份	7,400	81,400.00	0.03
30	002722	物产金轮	6,900	81,351.00	0.03
31	300445	康斯特	3,900	81,198.00	0.03
32	603276	恒兴新材	5,300	81,143.00	0.03
33	002863	今飞凯达	19,100	80,984.00	0.03
34	300610	晨化股份	8,300	80,925.00	0.03
35	002688	金河生物	17,500	80,850.00	0.03
36	002811	郑中设计	7,200	80,568.00	0.03
37	603207	小方制药	3,600	80,496.00	0.03
38	300971	博亚精工	4,300	80,238.00	0.03
39	301613	新铝时代	2,200	80,146.00	0.03
40	300515	三德科技	6,100	79,605.00	0.03
41	300871	回盛生物	3,600	79,416.00	0.03
42	301575	艾芬达	2,960	79,357.60	0.03
43	301266	宇邦新材	3,470	79,254.80	0.03
44	688293	奥浦迈	1,900	79,211.00	0.03
45	301662	宏工科技	780	79,029.60	0.03
46	301507	民生健康	6,500	78,195.00	0.03
47	301108	洁雅股份	3,300	77,847.00	0.03
48	002953	日丰股份	8,900	77,608.00	0.03
49	603697	有友食品	8,000	76,720.00	0.03
50	002479	富春环保	18,200	76,622.00	0.03
51	002996	顺博合金	12,800	75,520.00	0.03
52	002054	德美化工	11,300	75,145.00	0.03
53	002991	甘源食品	1,900	75,069.00	0.03
54	001218	丽臣实业	3,400	75,004.00	0.03

55	600768	宁波富邦	5,000	74,900.00	0.03
56	300930	屹通新材	2,600	74,100.00	0.03
57	001230	劲旅环境	4,820	74,035.20	0.03
58	603132	金徽股份	4,700	73,226.00	0.03
59	301048	金鹰重工	8,500	73,185.00	0.03
60	601968	宝钢包装	18,300	71,736.00	0.03
61	002780	三夫户外	5,900	71,626.00	0.03
62	300743	天地数码	4,900	71,491.00	0.03
63	301156	美农生物	6,500	70,655.00	0.03
64	002702	海欣食品	15,800	70,310.00	0.03
65	603210	泰鸿万立	5,200	69,836.00	0.03
66	001277	速达股份	2,500	68,975.00	0.03
67	301026	浩通科技	3,400	68,748.00	0.03
68	300697	电工合金	4,500	68,175.00	0.03
69	600874	创业环保	12,700	68,072.00	0.03
70	301329	信音电子	2,700	65,583.00	0.03
71	301439	泓淋电力	4,000	62,880.00	0.03
72	300347	泰格医药	1,300	62,400.00	0.03
73	688809	强一股份	89	55,447.00	0.02
74	603329	上海雅仕	5,400	48,492.00	0.02
75	002582	好想你	5,500	46,475.00	0.02
76	688712	北芯生命	1,183	42,493.36	0.02
77	603066	音飞储存	3,700	36,112.00	0.01
78	301682	宏明电子	219	35,053.14	0.01
79	001399	惠科股份	1,194	33,109.62	0.01
80	688813	泰金新能	177	30,459.93	0.01
81	688635	长进光子	98	30,202.62	0.01
82	001257	盛龙股份	979	20,304.46	0.01
83	688811	有研复材	692	16,697.96	0.01
84	301687	新广益	195	15,167.10	0.01
85	301669	高特电子	478	13,575.20	0.01

86	301531	春光集团	258	13,302.48	0.01
87	301680	固德电材	93	10,430.88	0.00
88	301599	理奇智能	276	8,961.72	0.00
89	001365	天海电子	232	7,263.92	0.00
90	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
91	001393	维通利	162	6,316.38	0.00
92	001237	惠康科技	93	5,462.82	0.00
93	603435	嘉德利	103	4,811.13	0.00
94	601112	振石股份	265	4,661.35	0.00
95	603352	至信股份	101	2,577.52	0.00
96	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00
97	001220	世盟股份	57	1,583.46	0.00
98	001312	福恩股份	81	1,359.18	0.00
99	603293	埃泰克	40	1,357.20	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	300750	宁德时代	2,849,591.00	0.95
2	300308	中际旭创	2,395,306.00	0.80
3	300476	胜宏科技	1,942,589.00	0.65
4	000792	盐湖股份	1,577,324.00	0.53
5	603259	药明康德	1,554,446.00	0.52
6	601318	中国平安	1,380,128.00	0.46
7	601899	紫金矿业	1,340,381.00	0.45
8	601336	新华保险	1,307,329.00	0.44
9	002709	天赐材料	1,300,751.00	0.44
10	600519	贵州茅台	1,263,543.00	0.42

11	605117	德业股份	1,176,465.00	0.39
12	000776	广发证券	1,044,914.00	0.35
13	601088	中国神华	1,020,481.00	0.34
14	000408	藏格矿业	1,016,684.00	0.34
15	000100	TCL科技	1,002,248.00	0.34
16	600030	中信证券	941,045.00	0.31
17	601898	中煤能源	909,113.00	0.30
18	002384	东山精密	907,333.00	0.30
19	600089	特变电工	903,892.00	0.30
20	002415	海康威视	902,271.00	0.30

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	300308	中际旭创	4,415,661.00	1.48
2	300502	新易盛	3,897,685.00	1.30
3	300750	宁德时代	3,468,611.00	1.16
4	000792	盐湖股份	2,615,749.00	0.87
5	000333	美的集团	2,577,449.00	0.86
6	002475	立讯精密	2,300,358.00	0.77
7	601318	中国平安	2,272,630.00	0.76
8	002371	北方华创	2,156,988.00	0.72
9	688256	寒武纪	2,022,895.05	0.68
10	600036	招商银行	1,847,109.00	0.62
11	300274	阳光电源	1,794,377.96	0.60
12	002916	深南电路	1,706,934.00	0.57
13	600519	贵州茅台	1,706,065.00	0.57

14	600030	中信证券	1,607,013.00	0.54
15	601138	工业富联	1,569,880.00	0.53
16	688041	海光信息	1,540,886.67	0.52
17	002709	天赐材料	1,491,074.00	0.50
18	600900	长江电力	1,445,970.00	0.48
19	600309	万华化学	1,417,798.00	0.47
20	688981	中芯国际	1,396,789.73	0.47

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	106,911,396.95
卖出股票收入（成交）总额	186,254,763.96

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	7,686,781.09	3.19
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	7,686,781.09	3.19

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	019792	25国债19	43,000	4,345,117.01	1.80
2	019785	25国债13	33,000	3,341,664.08	1.39

注：本基金本报告期末仅持有上述2只债券。

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

本基金投资于股指期货仅为占比较低的辅助投资手段，并严格遵循基金合同和套保要求。投资股指期货时以套期保值为目的，在投资组合管理中谨慎持有少量流动性好、交易活跃的股指期货合约，以提升组合的投资效率和流动性，降低股票仓位频繁调整带来的交易成本。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

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中，招商银行在报告编制日前一年内曾受到立案调查或公开处罚。

基于对上述主体发行的相关证券的投资决策流程均符合相关法律法规及基金合同的要求。除上述主体外，本基金投资的其他前十名证券的发行主体本报告期内没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 基金投资的前十名股票没有超出基金合同约定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	43,592.58
2	应收清算款	8,775.21
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	144,905.83
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	197,273.62

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

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中未存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	688795	摩尔线程	699,955.96	0.29	科创板打新限售
2	688797	臻宝科技	42,648.97	0.02	科创板打新限售

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 沪深3 00增 强A	5,8 60	9,831.26	27,705,714.38	48.0 9%	29,905,484.71	51.91%
汇安 沪深3 00增 强C	9,6 86	8,100.66	33,131,113.87	42.2 3%	45,331,885.84	57.77%
合计	15, 360	8,859.00	60,836,828.25	44.7 1%	75,237,370.55	55.29%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比 例
基金管理人所有从业人员持有本基金	汇安沪深300增 强A	12,374.75	0.0215%
	汇安沪深300增 强C	689.73	0.0009%
	合计	13,064.48	0.0096%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	汇安沪深300增强A	0~10
	汇安沪深300增强C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	汇安沪深300增强A	0~10
	汇安沪深300增强C	0
	合计	0~10

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	汇安沪深300增强A	汇安沪深300增强C
基金合同生效日(2018年07月03日)基金份额总额	453,804.07	2,522,567.55
本报告期期初基金份额总额	71,770,787.07	116,160,227.93
本报告期基金总申购份额	8,021,530.50	39,885,384.55
减：本报告期基金总赎回份额	22,181,118.48	77,582,612.77
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	57,611,199.09	78,462,999.71

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	
长江证券	1	-	-	-	-	-
东方财富证券	1	-	-	-	-	-

华源 证券	1	144,111,741.52	49.38%	26,790.90	49.38%	-
东方 证券	2	-	-	-	-	-
东兴 证券	2	-	-	-	-	-
万联 证券	2	-	-	-	-	-
湘财 证券	2	-	-	-	-	-
中信 建投 证券	2	147,746,738.46	50.62%	27,467.44	50.62%	-
中信 证券	2	-	-	-	-	-

注：选择专用席位的标准和程序：

（1）选择标准

- 1、综合实力较强、市场信誉良好；
- 2、财务状况良好，经营状况稳健；
- 3、经营行为规范，具备健全的内部控制制度；
- 4、研究实力较强，并能够第一时间提供丰富的高质量研究咨询报告，并能根据特定要求提供定制研究报告；能够积极进行业务交流，定期进行观点交流和路演；能够提供实地调研等多种类型的研究服务；
- 5、具有佣金费率优势，具备支持交易的安全、稳定、便捷、高效的通讯条件和交易环境，能提供全面的交易信息服务；
- 6、从制度上和技术上保证管理人租用交易单元的交易信息严格保密。

（2）选择程序

- 1、本基金管理人根据上述标准进行评估并确定选用的券商。
- 2、本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议。

（3）交易单元变更情况

本基金本报告期内无交易单元变更。

10.7.2 基金租用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
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方财富 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华源证券	9,807,727.00	100.00%	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-

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	汇安沪深300指数增强型证 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（2 025年度）	规定报刊和/或公司网站	2026-03-31
3	汇安沪深300指数增强型证 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	汇安沪深300指数增强型证券投资基金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
7	汇安基金管理有限责任公司关于汇安沪深300指数增强型证券投资基金重大关联交易事项的公告	规定报刊和/或公司网站	2026-04-29
8	汇安基金管理有限责任公司关于旗下基金关联交易事项的公告	规定报刊和/或公司网站	2026-05-21
9	汇安基金管理有限责任公司关于旗下部分基金在直销渠道开展费率优惠活动的公告	规定报刊和/或公司网站	2026-06-30

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20260106-20260511	36,865,731.77	-	12,500,000.00	24,365,731.77	17.91%
产品特有风险							
本基金本报告期内存在单一基金份额持有人持有基金份额比例超过20%的情况，投资人在投资本基金时，可能面临本基金因持有人集中度较高而产生的相应风险，具							

体包括：巨额赎回风险、流动性风险、基金资产净值持续低于5000万元的风险、基金份额净值大幅波动风险以及基金收益水平波动风险。本基金管理人将在基金运作中对以上风险进行严格的监控和管理，保护中小投资者利益。

§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泰灵活配置混合型证券投资基金募集的文件
- (2) 关于准予汇安丰泰灵活配置混合型证券投资基金变更注册的批复
- (3) 汇安沪深300指数增强型证券投资基金基金合同
- (4) 汇安沪深300指数增强型证券投资基金托管协议
- (5) 汇安沪深300指数增强型证券投资基金招募说明书
- (6) 基金管理人业务资格批件、营业执照
- (7) 在规定报刊及规定网站上披露的各项公告
- (8) 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