

汇安鼎利纯债债券型证券投资基金

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:中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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	7
2.5 其他相关资料	7
§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	8
§4 管理人报告.....	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	14
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	16
§5 托管人报告.....	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	16
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	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.....	46
7.1 期末基金资产组合情况	46
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	47
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.....	47
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	47
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.....	48
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	48
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	49
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.....	49
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	49
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	49
7.12 投资组合报告附注	49
§8 基金份额持有人信息.....	50

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	50
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	51
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	51
§9 开放式基金份额变动.....	51
§10 重大事件揭示	51
10.1 基金份额持有人大会决议	52
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	52
10.4 基金投资策略的改变	52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	52
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况.....	52
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.....	52
10.8 其他重大事件	54
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	54
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	54
§12 备查文件目录	55
12.1 备查文件目录	55
12.2 存放地点	55
12.3 查阅方式	55

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	汇安鼎利纯债债券型证券投资基金	
基金简称	汇安鼎利纯债	
基金主代码	006431	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019年03月20日	
基金管理人	汇安基金管理有限责任公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	641,344,755.43份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	汇安鼎利纯债A	汇安鼎利纯债C
下属分级基金的交易代码	006431	006432
报告期末下属分级基金的份额总额	627,952,621.66份	13,392,133.77份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制投资组合风险的前提下，力争长期内实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	1、债券投资策略 在进行债券投资时，本基金将会考量利率预期策略、信用债券投资策略、套利交易策略和可转换债券投资策略，选择合适时机投资于低估的债券品种，通过积极主动管理，获得超额收益。 2、资产支持证券投资策略 本基金将分析资产支持证券的资产特征，估计违约率和提前偿付比率，并利用收益率曲线和期权定价模型，对资产支持证券进行估值。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资，以降低流动性风险。 3、中小企业私募债投资策略 本基金将在严格控制信用风险的基础上，通过严密的投资决策流程、投资授权审批机制、集中交易制

	度等保障审慎投资于中小企业私募债券，并通过组合管理、分散化投资、合理谨慎地评估、预测和控制相关风险，实现投资收益的最大化。本基金依靠内部信用评级系统持续跟踪研究发债主体的经营状况、财务指标等情况，对其信用风险进行评估并作出及时反应。内部信用评级以深入的企业基本面分析为基础，结合定性和定量方法，注重对企业未来偿债能力的分析评估对中小企业私募债券进行分类，以便准确地评估中小企业私募债券的信用风险程度，并及时跟踪其信用风险的变化。 4、国债期货投资策略 本基金在进行国债期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对债券交易市场和期货市场运行趋势的研究，结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险性特征，运用国债期货对冲系统风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。
业绩比较基准	中债综合指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金，理论上其长期平均预期风险和预期收益率低于股票型基金和混合型基金，高于货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		汇安基金管理有限责任公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	郭冬青	郭明
	联系电话	010-56711600	(010) 66105799
	电子邮箱	guodq@huianfund.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		010-56711690	95588
传真		010-56711640	(010) 66105798

注册地址	上海市虹口区欧阳路218弄1号2楼215室	北京市西城区复兴门内大街5号
办公地址	北京市东城区东直门南大街5号中青旅大厦13层；上海市虹口区东大名路501号白玉兰大厦36层	北京市西城区复兴门内大街5号
邮政编码	100007	100140
法定代表人	刘强	廖林

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)	
	汇安鼎利纯债A	汇安鼎利纯债C
本期已实现收益	14,716,942.55	321,461.07
本期利润	21,514,504.24	473,905.54
加权平均基金份额本期利润	0.0343	0.0341
本期加权平均净值利润率	3.10%	3.09%

本期基金份额净值增长率	3.14%	3.15%
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	50,664,136.23	1,053,719.05
期末可供分配基金份额利润	0.0807	0.0787
期末基金资产净值	690,064,586.81	14,689,527.73
期末基金份额净值	1.0989	1.0969
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	21.70%	20.75%

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

汇安鼎利纯债A

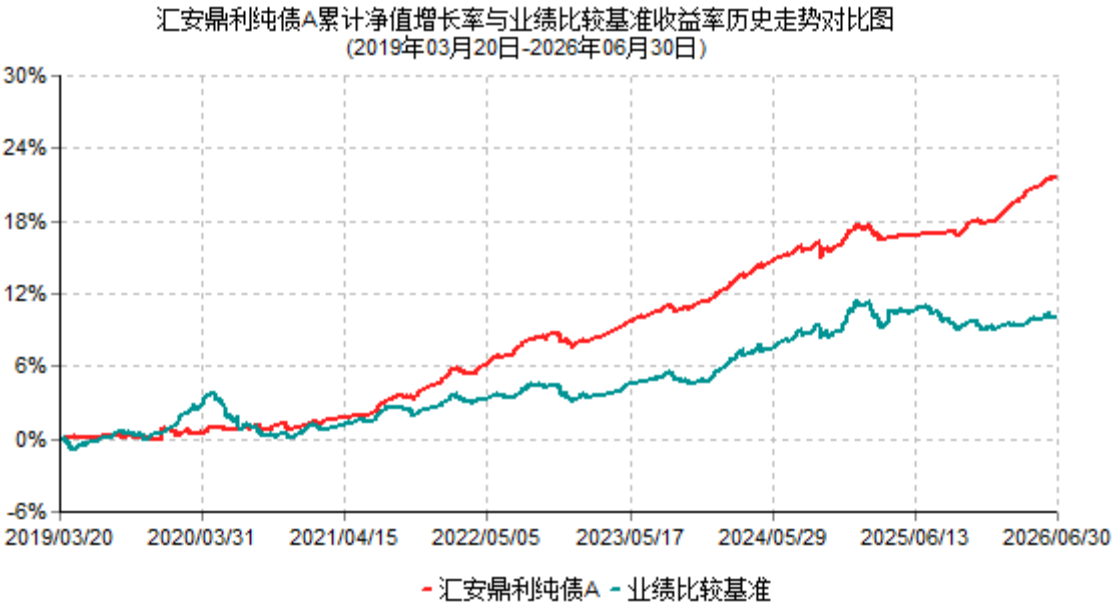
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	1.31%	0.02%	0.62%	0.04%	0.69%	-0.02%
过去六个月	3.14%	0.02%	0.91%	0.04%	2.23%	-0.02%
过去一年	4.10%	0.03%	-0.56%	0.06%	4.66%	-0.03%
过去三年	10.38%	0.05%	5.12%	0.08%	5.26%	-0.03%
过去五年	19.05%	0.05%	8.48%	0.07%	10.57%	-0.02%
过去七年	21.48%	0.05%	10.29%	0.07%	11.19%	-0.02%
自基金合同	21.70%	0.05%	10.17%	0.07%	11.53%	-0.02%

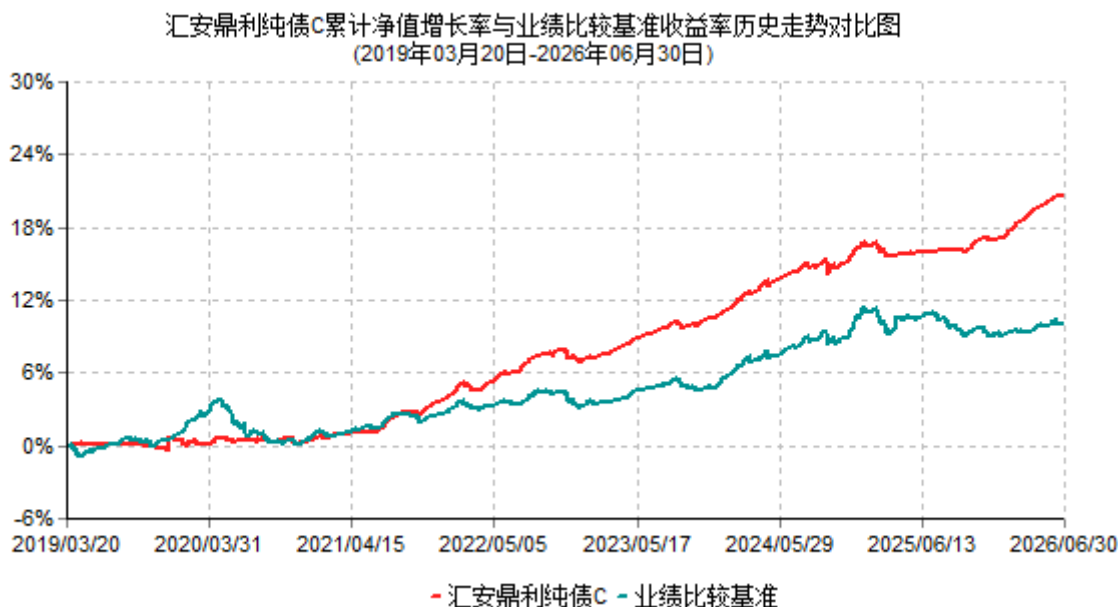
生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

汇安鼎利纯债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	1.31%	0.02%	0.62%	0.04%	0.69%	-0.02%
过去六个月	3.15%	0.02%	0.91%	0.04%	2.24%	-0.02%
过去一年	4.10%	0.03%	-0.56%	0.06%	4.66%	-0.03%
过去三年	10.36%	0.05%	5.12%	0.08%	5.24%	-0.03%
过去五年	19.00%	0.05%	8.48%	0.07%	10.52%	-0.02%
过去七年	20.63%	0.05%	10.29%	0.07%	10.34%	-0.02%
自基金合同 生效起至今	20.75%	0.05%	10.17%	0.07%	10.58%	-0.02%

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





注：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- 07-28	-	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

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%已下。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。本产品在上半年以信用债配置策略为主，持仓主体较为分散，杠杆水平维持在1.15左右。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末汇安鼎利纯债A基金份额净值为1.0989元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为3.14%，同期业绩比较基准收益率为0.91%；截至报告期末汇安鼎利纯债C基金份额净值为1.0969元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为3.15%，同期业绩比较基准收益率为0.91%。

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

本报告期内收益分配情况如下：

本基金A类份额以截至2026年5月19日基金可分配收益62,765,381.72元为基准，以2026年5月25日为权益登记日、除息日，于2026年5月26日向本基金的基金持有人派发2026年度第一次分红，每10份基金份额派发红利0.275元。

本基金C类份额以截至2026年5月19日基金可分配收益1,316,236.09元为基准，以2026年5月25日为权益登记日、除息日，于2026年5月26日向本基金的基金持有人派发2026年度第一次分红，每10份基金份额派发红利0.267元。

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，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本基金的管理人——汇安基金管理有限责任公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现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

本托管人依法对汇安基金管理有限责任公司编制和披露的本基金2026年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：汇安鼎利纯债债券型证券投资基金

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	10,671,264.72	5,955,396.66
结算备付金		-	-
存出保证金		66.84	4,367.73
交易性金融资产	6.4.7.2	779,525,309.80	794,149,997.59
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		757,453,271.21	777,726,227.66
资产支持证券投资		22,072,038.59	16,423,769.93
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		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		790,196,641.36	800,109,761.98
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		85,023,589.47	95,024,865.60
应付清算款		-	-
应付赎回款		9,863.04	46,036.57
应付管理人报酬		173,587.64	188,763.20
应付托管费		57,862.53	62,921.07
应付销售服务费		120.77	322.65
应付投资顾问费		-	-
应交税费		70,765.32	58,430.70
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	106,738.05	121,242.14
负债合计		85,442,526.82	95,502,581.93
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	641,344,755.43	645,197,834.09
未分配利润	6.4.7.8	63,409,359.11	59,409,345.96
净资产合计		704,754,114.54	704,607,180.05
负债和净资产总计		790,196,641.36	800,109,761.98

注：报告截止日2026年6月30日，基金份额总额641,344,755.43份，其中汇安鼎利纯债A基金份额净值1.0989元，份额总额627,952,621.66份；汇安鼎利纯债C基金份额净值1.0969元，份额总额13,392,133.77份。

6.2 利润表

会计主体：汇安鼎利纯债债券型证券投资基金

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		24,219,838.58	-5,436,356.97
1.利息收入		17,946.40	100,034.17
其中：存款利息收入	6.4.7.9	12,081.40	54,894.89
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		5,865.00	45,139.28
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-” 填列）		17,251,788.80	14,517,039.48
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	17,027,203.97	14,517,039.48
资产支持证券投资 收益	6.4.7.12	224,584.83	-
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	-	-
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	6,950,006.16	-20,053,464.30
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	97.22	33.68
减：二、营业总支出		2,231,428.80	2,299,184.81
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	1,055,639.09	908,557.58
2.托管费	6.4.10.2.2	351,879.73	302,852.56
3.销售服务费	6.4.10.2.3	762.50	40.58
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		662,852.46	966,105.55
其中：卖出回购金融资产支出		662,852.46	966,105.55
6.信用减值损失		-	-
7.税金及附加		42,270.90	15,728.09
8.其他费用	6.4.7.18	118,024.12	105,900.45
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		21,988,409.78	-7,735,541.78
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		21,988,409.78	-7,735,541.78
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		21,988,409.78	-7,735,541.78

6.3 净资产变动表

会计主体：汇安鼎利纯债债券型证券投资基金

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	645,197,834.09	59,409,345.96	704,607,180.05
二、本期期初净资产	645,197,834.09	59,409,345.96	704,607,180.05

产			
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-3,853,078.66	4,000,013.15	146,934.49
（一）、综合收益总额	-	21,988,409.78	21,988,409.78
（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）	-3,853,078.66	-359,988.95	-4,213,067.61
其中：1.基金申购款	46,183.24	4,277.64	50,460.88
2.基金赎回款	-3,899,261.90	-364,266.59	-4,263,528.49
（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）	-	-17,628,407.68	-17,628,407.68
四、本期期末净资产	641,344,755.43	63,409,359.11	704,754,114.54
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	981,644,028.21	117,923,911.49	1,099,567,939.70
二、本期期初净资产	981,644,028.21	117,923,911.49	1,099,567,939.70
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-980,151,853.82	-117,756,747.53	-1,097,908,601.35
（一）、综合收益总额	-	-7,735,541.78	-7,735,541.78

（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）	-980,151,853.82	-110,021,205.75	-1,090,173,059.57
其中：1.基金申购款	1,371,214.03	153,265.98	1,524,480.01
2.基金赎回款	-981,523,067.85	-110,174,471.73	-1,091,697,539.58
（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	1,492,174.39	167,163.96	1,659,338.35

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

汇安鼎利纯债债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2018]1423号《关于准予汇安鼎利纯债债券型证券投资基金注册的批复》注册，由汇安基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《汇安鼎利纯债债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集250,334,888.32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(2019)第0183号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《汇安鼎利纯债债券型证券投资基金基金合同》于2019年3月20日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为250,388,687.11份基金份额，其中认购资金利息折合53,798.79份基金份额。本基金的基金管理人为汇安基金管理有限责任公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《汇安鼎利纯债债券型证券投资基金基金合同》和《汇安鼎利纯债债券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《汇安鼎利纯债债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市交易的债券(国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府机构债券、地方政府债券、中小企业私募债、可分离交易可转债中的纯债部分)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、货币市场工具、国债期货以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金不投资于股票、权证等资产，也不投资于可转换债券(可分离交易可转债的纯债部分除外)、可交换债券。本基金对债券的投资比例不低于基金资产的80%；每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：中债综合指数收益率。

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》、《汇安鼎利纯债债券型证券投资基金基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金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[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，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。
- (3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。
- (4) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30日
活期存款	10,671,264.72
等于：本金	10,669,658.48
加：应计利息	1,606.24
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	10,671,264.72

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		-	-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	92,253,564.80	3,283,392.87	95,272,792.87	-264,164.80
	银行间市场	649,461,827.91	4,708,278.34	662,180,478.34	8,010,372.09
	合计	741,715,392.71	7,991,671.21	757,453,271.21	7,746,207.29
资产支持证券		21,830,150.68	187,038.59	22,072,038.59	54,849.32
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		763,545,543.39	8,178,709.80	779,525,309.80	7,801,056.61

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	12,518.50
其中：交易所市场	-
银行间市场	12,518.50
应付利息	-
预提费用-审计费	34,712.18
预提费用-信息披露费	59,507.37
合计	106,738.05

6.4.7.7 实收基金

6.4.7.7.1 汇安鼎利纯债A

金额单位：人民币元

项目 (汇安鼎利纯债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	628,005,909.69	628,005,909.69
本期申购	541.92	541.92
本期赎回（以“-”号填列）	-53,829.95	-53,829.95
本期末	627,952,621.66	627,952,621.66

6.4.7.7.2 汇安鼎利纯债C

金额单位：人民币元

项目 (汇安鼎利纯债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	17,191,924.40	17,191,924.40
本期申购	45,641.32	45,641.32
本期赎回（以“-”号填列）	-3,845,431.95	-3,845,431.95
本期末	13,392,133.77	13,392,133.77

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 汇安鼎利纯债A

单位：人民币元

项目 (汇安鼎利纯债A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	53,220,666.17	4,651,050.34	57,871,716.51
本期期初	53,220,666.17	4,651,050.34	57,871,716.51
本期利润	14,716,942.55	6,797,561.69	21,514,504.24
本期基金份额交易产生的变动数	-4,784.60	-783.11	-5,567.71
其中：基金申购款	39.44	11.79	51.23
基金赎回款	-4,824.04	-794.90	-5,618.94
本期已分配利润	-17,268,687.89	-	-17,268,687.89
本期末	50,664,136.23	11,447,828.92	62,111,965.15

6.4.7.8.2 汇安鼎利纯债C

单位：人民币元

项目 (汇安鼎利纯债C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,410,470.56	127,158.89	1,537,629.45
本期期初	1,410,470.56	127,158.89	1,537,629.45
本期利润	321,461.07	152,444.47	473,905.54
本期基金份额交易产生的变动数	-318,492.79	-35,928.45	-354,421.24
其中：基金申购款	3,235.04	991.37	4,226.41
基金赎回款	-321,727.83	-36,919.82	-358,647.65
本期已分配利润	-359,719.79	-	-359,719.79
本期末	1,053,719.05	243,674.91	1,297,393.96

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	12,055.54

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	21.52
其他	4.34
合计	12,081.40

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

无。

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	11,773,417.18
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	5,253,786.79
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	17,027,203.97

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	349,801,955.39

减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	339,456,507.58
减：应计利息总额	5,084,686.02
减：交易费用	6,975.00
买卖债券差价收入	5,253,786.79

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

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
资产支持证券投资收益——利息收入	227,058.56
资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入	-2,473.73
资产支持证券投资收益——赎回差价收入	-
资产支持证券投资收益——申购差价收入	-
合计	224,584.83

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

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
卖出资产支持证券成交总额	14,674,891.91

减：卖出资产支持证券成本总额	14,555,160.77
减：应计利息总额	122,204.87
减：交易费用	-
资产支持证券投资收益	-2,473.73

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

无。

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	6,950,006.16
——股票投资	-
——债券投资	6,893,996.07
——资产支持证券投资	56,010.09
——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	6,950,006.16

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	-
其他	97.22
合计	97.22

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	34,712.18

信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
汇划手续费	5,204.57
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	118,024.12

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
中国工商银行股份有限公司	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	1,055,639.09	908,557.58
其中：应支付销售机构的客户维护费	9,205.76	835.38
应支付基金管理人的净管理费	1,046,433.33	907,722.20

注：支付基金管理人汇安基金管理有限责任公司的管理人报酬按前一日基金资产净值0.30%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬＝前一日基金资产净值×0.30%/当年天数。

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	上年度可比期间 2025年01月01日至2025
----	------------------------	-----------------------------

	年06月30日	年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	351,879.73	302,852.56

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

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.10\% / \text{当年天数}。$$

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		
	汇安鼎利纯债A	汇安鼎利纯债C	合计
中国工商 银行股份 有限公司	0.00	20.47	20.47
合计	-	20.47	20.47
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		
	汇安鼎利纯债A	汇安鼎利纯债C	合计
中国工商 银行股份 有限公司	0.00	16.37	16.37
合计	-	16.37	16.37

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0.01%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：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日C类基金份额的基金资产净值} \times 0.01\% / \text{当年天数}。$$

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

汇安鼎利纯债A

份额单位：份

关联方名称	本期末 2026年06月30日		上年度末 2025年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
任建辉	0.00	0.0000%	9.54	0.0000%

汇安鼎利纯债C

份额单位：份

关联方名称	本期末 2026年06月30日		上年度末 2025年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
何斌	98.60	0.0000%	98.60	0.0000%

注：
1.截止本报告期末，自然人股东何斌持有本基金C类份额占基金总份额的比例为0.00002%，上表展示的比例为四舍五入后的结果。
2.截止上年度末，自然人股东何斌持有本基金C类份额占基金总份额的比例为0.00002%，自然人股东任建辉持有本基金A类份额占基金总份额的比例为0.000001%，上表展示的比例为四舍五入后的结果。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		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
中国工商银行股份有限公司	10,671,264.72	12,055.54	314,199.57	54,882.71

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。(上年度对比期间：基金管理人自主承担本基金部分信息披露费、审计费和银行间账户维护费等固定费用。)

6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

汇安鼎利纯债A

单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日	每10份基金 份额分红数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润 分配合计	备注
1	2026-05-25	2026-05-25	0.2750	17,268,094.74	593.15	17,268,687.89	-
合计			0.2750	17,268,094.74	593.15	17,268,687.89	-

汇安鼎利纯债C

单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日	每10份基金 份额分红数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润 分配合计	备注
1	2026-05-25	2026-05-25	0.2670	309,852.06	49,867.73	359,719.79	-

合计			0.2670	309,852.06	49,867.73	359,719.79	-
----	--	--	--------	------------	-----------	------------	---

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

截至本报告期末2026年06月30日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额85,023,589.47元，是以如下债券作为抵押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
102580220	25青岛上合MTN001	2026-07-02	100.83	100,000	10,083,058.63
102581883	25青岛经开MTN001B	2026-07-02	104.00	200,000	20,799,522.19
102582674	25青岛上合MTN002	2026-07-02	99.34	262,000	26,028,320.37
102682073	26青岛地铁MTN003A	2026-07-01	100.20	369,000	36,974,883.75
合计				931,000	93,885,784.94

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购
无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券
无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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

公司致力于实行全面、系统的风险管理，通过制定系统化的风险管理程序，对风险管理的整个流程进行评估和改进。公司奉行分工明确、相互协作、彼此牵制的风险管理组织结构，构建由四大防线共同筑成的风险管理体系：第一道防线由各个业务部门构成，各业务部门总监作为风险责任人；第二道监控防线由合规风控部构成，对公司运营过程中产生的或潜在的各项风险进行有效管理，并就内部控制及风险管理制度的执行情况独立地履行检查、评价、报告、建议职能；第三道防线是由总经理及其下设的风险管理委员会构成，总经理负责公司日常经营管理中的风险管理工作。总经理下设风险管理委员会，负责对公司经营及基金运作中的风险进行研究、评估和防控；第四道监控防线由董事会及其下设公司风险控制委员会构成。董事会负责公司整体风险的预防和控制，审核、监督公司风险管理制度的有效执行。董事会下设公司风险控制委员会，协助董事会确立公司风险取向，风险总量、风险限额，制定和调整公司风险管理战略、原则、政策和指导方针，并确保其得到有效执行。

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

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

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资
无。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资
无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资
无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
AAA	71,860,955.07	101,512,512.88
AAA以下	74,042,294.24	73,512,539.18
未评级	611,550,021.90	602,701,175.60
合计	757,453,271.21	777,726,227.66

注：未评级部分为政策性金融债、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

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	1,832,531.74	16,423,769.93
AAA以下	20,239,506.85	-
未评级	-	-
合计	22,072,038.59	16,423,769.93

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，除卖出回购金融资产款余额中有85,023,589.47元将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他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，因此账面余额约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发行的证券不得超过该证券的10%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。

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。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	10,671,264.72	-	-	-	10,671,264.72
存出保证金	66.84	-	-	-	66.84

交易性金融资产	42,251,008.45	705,357,912.31	31,916,389.04	-	779,525,309.80
资产总计	52,922,340.01	705,357,912.31	31,916,389.04	-	790,196,641.36
负债					
卖出回购金融资产款	85,023,589.47	-	-	-	85,023,589.47
应付赎回款	-	-	-	9,863.04	9,863.04
应付管理人报酬	-	-	-	173,587.64	173,587.64
应付托管费	-	-	-	57,862.53	57,862.53
应付销售服务费	-	-	-	120.77	120.77
应交税费	-	-	-	70,765.32	70,765.32
其他负债	-	-	-	106,738.05	106,738.05
负债总计	85,023,589.47	-	-	418,937.35	85,442,526.82
利率敏感度缺口	-32,101,249.46	705,357,912.31	31,916,389.04	-418,937.35	704,754,114.54
上年度末 2025年 12月31	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计

日					
资产					
货币资金	5,955,396.66	-	-	-	5,955,396.66
存出保证金	4,367.73	-	-	-	4,367.73
交易性金融资产	56,679,139.79	686,965,073.14	50,505,784.66	-	794,149,997.59
资产总计	62,638,904.18	686,965,073.14	50,505,784.66	-	800,109,761.98
负债					
卖出回购金融资产款	95,024,865.60	-	-	-	95,024,865.60
应付赎回款	-	-	-	46,036.57	46,036.57
应付管理人报酬	-	-	-	188,763.20	188,763.20
应付托管费	-	-	-	62,921.07	62,921.07
应付销售服务费	-	-	-	322.65	322.65
应交税费	-	-	-	58,430.70	58,430.70
其他负债	-	-	-	121,242.14	121,242.14
负债总计	95,024,865.60	-	-	477,716.33	95,502,581.93
利率敏	-32,385,961.42	686,965,073.14	50,505,784.66	-477,716.33	704,607,180.05

敏感度缺口					
-------	--	--	--	--	--

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	5,325,591.64	6,106,984.15
	市场利率上升25个基点	-5,268,492.99	-6,035,941.06

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

- 第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。
- 第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。
- 第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

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	-	-
第二层次	779,525,309.80	794,149,997.59
第三层次	-	-
合计	779,525,309.80	794,149,997.59

6.4.14.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。
本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2026年6月30日，本基金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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	779,525,309.80	98.65

	其中：债券	757,453,271.21	95.86
	资产支持证券	22,072,038.59	2.79
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	10,671,264.72	1.35
8	其他各项资产	66.84	0.00
9	合计	790,196,641.36	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金本报告期末未买入股票。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金本报告期末未卖出股票。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期末未买入卖出股票。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
----	------	------	--------------

1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	40,418,476.71	5.74
	其中：政策性金融债	40,418,476.71	5.74
4	企业债券	95,272,792.87	13.52
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	621,762,001.63	88.22
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	757,453,271.21	107.48

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	102581551	25即墨旅投MTN001	500,000	51,910,739.73	7.37
2	102601985	26海化集团MTN001	500,000	50,383,657.53	7.15
3	102682073	26青岛地铁MTN003A	500,000	50,101,468.49	7.11
4	102580255	25澳柯玛集MTN001	400,000	41,150,237.81	5.84
5	184471	22远景01	400,000	35,916,361.64	5.10

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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	267630	潍信1优	200,000	20,239,506.85	2.87
2	146938	诚远2A1	100,000	1,832,531.74	0.26

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中，潍坊水务、水发集团在过去一年受到立案调查或过公开处罚，本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

本基金投资的其余前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 本基金本报告期末未投资股票，不存在投资的前十名股票超出基金合同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	66.84
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-

5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	66.84

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 鼎利 纯债A	147	4,271,786.54	627,684,258.43	99.9 6%	268,363.23	0.04%
汇安 鼎利 纯债C	368	36,391.67	7,517,577.84	56.1 3%	5,874,555.93	43.87%
合计	510	1,257,538.74	635,201,836.27	99.0 4%	6,142,919.16	0.96%

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	汇安鼎利纯债A	5,490.52	0.0009%
	汇安鼎利纯债C	314.55	0.0023%
	合计	5,805.07	0.0009%

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	汇安鼎利纯债A	0~10
	汇安鼎利纯债C	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	汇安鼎利纯债A	0
	汇安鼎利纯债C	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	汇安鼎利纯债A	汇安鼎利纯债C
基金合同生效日(2019年03月20日)基金份额总额	37,469,980.23	212,918,706.88
本报告期期初基金份额总额	628,005,909.69	17,191,924.40
本报告期基金总申购份额	541.92	45,641.32
减：本报告期基金总赎回份额	53,829.95	3,845,431.95
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	627,952,621.66	13,392,133.77

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

本报告期内托管人无重大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

本报告期内托管人相关从业人员无重大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	交	股票交易	应支付该券商的佣金	备
----	---	------	-----------	---

名称	易单元数量	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	注
东北证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	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

						比例		比例
东北证 券	26,372,00 0.00	100.0 0%	10,000,00 0.00	100.0 0%	-	-	-	-
国金证 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	汇安鼎利纯债债券型证券投资基金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	汇安鼎利纯债债券型证券投资基金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关于提请投资者及时更新已过期身份证件及其他身份基本信息的公告	规定报刊和/或公司网站	2026-04-03
5	汇安鼎利纯债债券型证券投资基金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	汇安鼎利纯债债券型证券投资基金分红公告	规定报刊和/或公司网站	2026-05-22

§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

投资者	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	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比

类别		达到或者超过20%的时间区间					
机构	1	20260101-20260630	627,684,248.23	-	-	627,684,248.23	97.87%
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鼎利纯债债券型证券投资基金募集的文件
- (2) 《汇安鼎利纯债债券型证券投资基金基金合同》
- (3) 《汇安鼎利纯债债券型证券投资基金招募说明书》
- (4) 《汇安鼎利纯债债券型证券投资基金托管协议》
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照
- (6) 在规定报刊及规定网站上披露的各项公告
- (7) 中国证监会规定的其他文件

12.2 存放地点

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

12.3 查阅方式

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

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

公司网站：<http://www.huianfund.cn>

汇安基金管理有限责任公司
二〇二六年八月三十一日