

汇安多因子混合型证券投资基金

2026 年中期报告

2026 年 06 月 30 日

基金管理人:汇安基金管理有限责任公司

基金托管人:中国光大银行股份有限公司

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。

基金托管人中国光大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遵规守信情况的说明.....	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.....	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遵规守信情况声明.....	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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.....	53
7.1 期末基金资产组合情况	53
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	54
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.....	55
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	68
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	71
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.....	71
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.....	72
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.....	72
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.....	72
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	72
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	72
7.12 投资组合报告附注	72
§8 基金份额持有人信息.....	73

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	73
8.2 盈利投资者数量占比	74
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	74
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	74
§9 开放式基金份额变动.....	74
§10 重大事件揭示	75
10.1 基金份额持有人大会决议	75
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.....	75
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	75
10.4 基金投资策略的改变	75
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	75
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况.....	75
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.....	76
10.8 其他重大事件	78
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	79
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	79
§12 备查文件目录	79
12.1 备查文件目录	79
12.2 存放地点	79
12.3 查阅方式.....	79

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	汇安多因子混合型证券投资基金	
基金简称	汇安多因子混合	
基金主代码	006648	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019年04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	中国光大银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,204,138,843.24份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	汇安多因子混合A	汇安多因子混合C
下属分级基金的交易代码	006648	006649
报告期末下属分级基金的份额总额	205,717,353.89份	998,421,489.35份

2.2 基金产品说明

投资目标	在有效控制风险的基础上，采用多因子投资策略，综合多方面指标，通过灵活的资产配置、策略配置与严谨的风险管理，优化调整投资组合，力争获取稳定、持续超越业绩比较基准的投资回报，实现基金资产的长期增值。
投资策略	本基金通过合理稳健的资产配置策略，将基金资产在权益类资产和债券类资产之间灵活配置，同时采取多因子股票投资策略和积极主动的债券投资策略，紧跟当下国民经济发展过程中各行业的成长机会和资本市场发展机遇，严格控制下行风险，力争实现基金份额净值的长期平稳增长。 本基金投资策略主要包括资产配置策略、股票投资策略、债券投资组合策略、流通受限证券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、权证投资策略、存托凭证投资策略等。
业绩比较基准	中证500指数收益率×60%+中证综合债券指数收

	益率×40%
风险收益特征	本基金为混合型基金，理论上其风险收益水平高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		汇安基金管理有限责任公司	中国光大银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	郭冬青	王茵
	联系电话	010-56711600	010-63639180
	电子邮箱	guodq@huianfund.cn	wangyin@cebbank.com
客户服务电话		010-56711690	95595
传真		010-56711640	010-63639132
注册地址		上海市虹口区欧阳路218弄1号2楼215室	北京市西城区太平桥大街25号、甲25号中国光大中心
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	北京市西城区太平桥大街25号中国光大中心
邮政编码		100007	100033
法定代表人		刘强	吴利军

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	汇安基金管理有限责任公司	上海市虹口区东大名路501号上海白玉兰广场36层02单元

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2026年01月01日-2026年06月30日)	
	汇安多因子混合A	汇安多因子混合C
本期已实现收益	24,532,094.99	86,525,530.91
本期利润	80,122,480.99	272,072,474.39
加权平均基金份额本期利润	0.4680	0.4170
本期加权平均净值利润率	19.92%	18.24%
本期基金份额净值增长率	22.08%	21.79%
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	179,389,131.03	796,100,015.74
期末可供分配基金份额利润	0.8720	0.7974
期末基金资产净值	528,027,396.43	2,467,981,832.33
期末基金份额净值	2.5668	2.4719
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	164.35%	154.59%

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

汇安多因子混合A

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	17.71%	1.28%	11.50%	0.99%	6.21%	0.29%
过去六个月	22.08%	1.25%	13.44%	1.00%	8.64%	0.25%
过去一年	55.65%	1.11%	30.52%	0.85%	25.13%	0.26%
过去三年	73.86%	1.27%	36.96%	0.88%	36.90%	0.39%
过去五年	30.45%	1.28%	32.58%	0.81%	-2.13%	0.47%
过去七年	152.22%	1.27%	67.38%	0.81%	84.84%	0.46%
自基金合同 生效起至今	164.35%	1.26%	62.43%	0.82%	101.92%	0.44%

汇安多因子混合C

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	17.56%	1.28%	11.50%	0.99%	6.06%	0.29%
过去六个月	21.79%	1.25%	13.44%	1.00%	8.35%	0.25%
过去一年	54.88%	1.11%	30.52%	0.85%	24.36%	0.26%
过去三年	71.28%	1.27%	36.96%	0.88%	34.32%	0.39%
过去五年	27.24%	1.28%	32.58%	0.81%	-5.34%	0.47%
过去七年	143.09%	1.27%	67.38%	0.81%	75.71%	0.46%
自基金合同 生效起至今	154.59%	1.26%	62.43%	0.82%	92.16%	0.44%

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

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		
柳预才	策略量化组基金经 理、本基金的基金经 理	2023- 05-29	-	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；安信基金管理有限责任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责任公司，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

截至报告期末汇安多因子混合A基金份额净值为2.5668元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为22.08%，同期业绩比较基准收益率为13.44%；截至报告期末汇安多因子混合C基金份额净值为2.4719元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为21.79%，同期业绩比较基准收益率为13.44%。

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，中国光大银行股份有限公司在汇安多因子混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）托管过程中，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，依法安全保管了基金的全部资产，对本基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督，对发现的问题及时提出了意见和建议。同时，按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告，没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为，诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

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，中国光大银行股份有限公司依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》

及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，对基金管理人的投资运作等行为进行了复核、监督，未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金在运作中遵守了有关法律法规的要求，各重要方面的运作严格依据基金合同的约定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

中国光大银行股份有限公司以自身能够获取的数据和信息为限，根据法律法规规定、基金合同和托管协议约定对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进行了复核，认为以上内容真实、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：汇安多因子混合型证券投资基金

报告截止日：2026年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	523,978,297.97	75,450,673.34
结算备付金		26,787,248.26	10,832,779.58
存出保证金		18,506,426.60	3,552,427.58
交易性金融资产	6.4.7.2	2,458,282,049.76	746,763,253.90
其中：股票投资		2,332,398,191.20	705,137,351.63
基金投资		-	-
债券投资		125,883,858.56	41,625,902.27
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	260,000,000.00	-

应收清算款		-	14,308,548.31
应收股利		-	-
应收申购款		27,778,895.27	5,807,773.51
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		3,315,332,917.86	856,715,456.22
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		294,226,503.54	18,849,817.53
应付赎回款		18,988,918.79	8,645,668.42
应付管理人报酬		2,871,016.40	883,123.05
应付托管费		478,502.72	147,187.18
应付销售服务费		991,033.45	239,392.19
应付投资顾问费		-	-
应交税费		154,056.06	4,467.37
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	1,613,658.14	769,118.69
负债合计		319,323,689.10	29,538,774.43
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	1,204,138,843.24	402,189,342.00
未分配利润	6.4.7.8	1,791,870,385.52	424,987,339.79
净资产合计		2,996,009,228.76	827,176,681.79
负债和净资产总计		3,315,332,917.86	856,715,456.22

注：报告截止日2026年6月30日，基金份额总额1,204,138,843.24份，其中汇安多因子混合A基金份额净值2.5668元，份额总额205,717,353.89份；汇安多因子混合C基金份额净值2.4719元，份额总额998,421,489.35份。

6.2 利润表

会计主体：汇安多因子混合型证券投资基金

本报告期：2026年01月01日至2026年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026年01月01日至 2026年06月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至202 5年06月30日
一、营业总收入		368,951,284.36	55,894,228.15
1.利息收入		782,099.53	298,987.55
其中：存款利息收入	6.4.7.9	628,721.20	58,306.36
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息 收入		-	-
买入返售金融资产 收入		153,378.33	240,681.19
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-” 填列）		124,796,915.18	46,225,934.48
其中：股票投资收益	6.4.7.10	102,603,932.25	38,884,033.73
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	533,894.83	220,319.37
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	6,049,769.73	1,375,881.57
股利收益	6.4.7.15	15,609,318.37	5,745,699.81
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失	6.4.7.16	241,137,329.48	9,359,533.01

以“-”号填列)			
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	2,234,940.17	9,773.11
减：二、营业总支出		16,756,328.98	4,052,865.91
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	11,135,367.65	2,991,857.60
2.托管费	6.4.10.2.2	1,855,894.52	498,642.91
3.销售服务费	6.4.10.2.3	3,648,459.04	463,938.08
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		22,388.22	5,124.76
8.其他费用	6.4.7.18	94,219.55	93,302.56
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列)		352,194,955.38	51,841,362.24
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列)		352,194,955.38	51,841,362.24
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		352,194,955.38	51,841,362.24

6.3 净资产变动表

会计主体：汇安多因子混合型证券投资基金

本报告期：2026年01月01日至2026年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期		
	2026年01月01日至2026年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计

一、上期期末净资产	402,189,342.00	424,987,339.79	827,176,681.79
二、本期期初净资产	402,189,342.00	424,987,339.79	827,176,681.79
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	801,949,501.24	1,366,883,045.73	2,168,832,546.97
（一）、综合收益总额	-	352,194,955.38	352,194,955.38
（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）	801,949,501.24	1,014,688,090.35	1,816,637,591.59
其中：1.基金申购款	1,568,957,159.74	2,027,084,106.49	3,596,041,266.23
2.基金赎回款	-767,007,658.50	-1,012,396,016.14	-1,779,403,674.64
（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	1,204,138,843.24	1,791,870,385.52	2,996,009,228.76
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	327,685,763.21	155,362,512.60	483,048,275.81
二、本期期初净资产	327,685,763.21	155,362,512.60	483,048,275.81
三、本期增减变动额（减少以“-”号	-8,196,948.05	45,537,961.82	37,341,013.77

填列)			
(一)、综合收益总额	-	51,841,362.24	51,841,362.24
(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)	-8,196,948.05	-6,303,400.42	-14,500,348.47
其中: 1.基金申购款	33,013,793.86	16,439,223.15	49,453,017.01
2.基金赎回款	-41,210,741.91	-22,742,623.57	-63,953,365.48
(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	319,488,815.16	200,900,474.42	520,389,289.58

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

汇安多因子混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2018]1820号《关于准予汇安多因子混合型证券投资基金注册的批复》注册,由汇安基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《汇安多因子混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集498,086,043.79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0277号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《汇安多因子混合型证券投资基金基金合同》于2019年4月30日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为498,310,794.83份基金份额,

其中认购资金利息折合224,751.04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，基金托管人为中国光大银行股份有限公司。

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《汇安多因子混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包含中小板、创业板和其他经中国证监会核准上市的股票)、存托凭证、债券(包括国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、可转换债券、中小企业私募债等)、债券回购、同业存单、银行存款(包括协议存款、定期存款等)、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指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：股票资产的比例为基金资产的50%-95%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：中证500指数收益率 $\times$ 60%+中证综合债券指数收益率 $\times$ 40%。

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》、《汇安多因子混合型证券投资基金基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2026年6月30日的财务状况以及2026年1月1日至2026年6月30日的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财政部、国家税务总局公告2025年第4号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、国务院令第826号《中华人民共和国增值税法实施条例》、财政部、税务总局公告2026年第10号《财政部 税务总局关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。2027年12月31日前，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

2027年12月31日前，对证券投资基金管理人运用基金资产买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对除持有金融债券外的金融同业往来利息收入亦免征增值税。自2025年8月8日起，对在该日期之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(包含在

2025年8月8日之后续发行的部分)的利息收入，免征增值税直至债券到期。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告2023年第39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30日
活期存款	523,978,297.97
等于：本金	523,931,874.73
加：应计利息	46,423.24
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	523,978,297.97

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		2,034,903,208.80	-	2,332,398,191.20	297,494,982.40
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	124,716,945.28	1,214,088.56	125,883,858.56	-47,175.28
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	124,716,945.28	1,214,088.56	125,883,858.56	-47,175.28
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		2,159,620,154.08	1,214,088.56	2,458,282,049.76	297,447,807.12

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-

货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	113,585,316.19	-	-	-
--股指期货	113,585,316.19	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	113,585,316.19	-	-	-

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IM2612	IM2612	21.00	34,522,320.00	1,236,440.00
IM2609	IM2609	19.00	32,243,000.00	1,762,403.81
IF2609	IF2609	10.00	14,549,400.00	901,260.00
IC2609	IC2609	14.00	24,531,920.00	2,208,920.00
IF2612	IF2612	3.00	4,285,260.00	26,160.00
IC2612	IC2612	6.00	10,250,880.00	662,280.00
合计				6,797,463.81
减：可抵销 期货暂收款				6,797,463.81
净额				0.00

注：衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指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。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	260,000,000.00	-
银行间市场	-	-

合计	260,000,000.00	-
----	----------------	---

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	2,209.93
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	1,517,228.66
其中：交易所市场	1,517,228.66
银行间市场	-
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	1,613,658.14

6.4.7.7 实收基金

6.4.7.7.1 汇安多因子混合A

金额单位：人民币元

项目 (汇安多因子混合A)	本期 2026年01月01日至2026年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	148,958,492.66	148,958,492.66
本期申购	130,034,114.24	130,034,114.24
本期赎回（以“-”号填列）	-73,275,253.01	-73,275,253.01

本期末	205,717,353.89	205,717,353.89
-----	----------------	----------------

6.4.7.7.2 汇安多因子混合C

金额单位：人民币元

项目 (汇安多因子混合C)	本期 2026年01月01日至2026年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	253,230,849.34	253,230,849.34
本期申购	1,438,923,045.50	1,438,923,045.50
本期赎回（以“-”号填列）	-693,732,405.49	-693,732,405.49
本期末	998,421,489.35	998,421,489.35

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 汇安多因子混合A

单位：人民币元

项目 (汇安多因子混合A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	108,323,101.33	55,903,917.59	164,227,018.92
本期期初	108,323,101.33	55,903,917.59	164,227,018.92
本期利润	24,532,094.99	55,590,386.00	80,122,480.99
本期基金份额交易产生的变动数	46,533,934.71	31,426,607.92	77,960,542.63
其中：基金申购款	106,008,628.57	73,497,589.84	179,506,218.41
基金赎回款	-59,474,693.86	-42,070,981.92	-101,545,675.78
本期已分配利润	-	-	-
本期末	179,389,131.03	142,920,911.51	322,310,042.54

6.4.7.8.2 汇安多因子混合C

单位：人民币元

项目 (汇安多因子混合C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
------------------	-------	-------	---------

上年度末	167,946,683.38	92,813,637.49	260,760,320.87
本期期初	167,946,683.38	92,813,637.49	260,760,320.87
本期利润	86,525,530.91	185,546,943.48	272,072,474.39
本期基金份额交易产生的变动数	541,627,801.45	395,099,746.27	936,727,547.72
其中：基金申购款	1,061,109,983.68	786,467,904.40	1,847,577,888.08
基金赎回款	-519,482,182.23	-391,368,158.13	-910,850,340.36
本期已分配利润	-	-	-
本期末	796,100,015.74	673,460,327.24	1,469,560,342.98

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	600,920.86
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	7,662.43
其他	20,137.91
合计	628,721.20

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	2,033,106,002.83
减：卖出股票成本总额	1,926,819,621.24
减：交易费用	3,682,449.34
买卖股票差价收入	102,603,932.25

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	532,304.83
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	1,590.00
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	533,894.83

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	6,585,900.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	6,498,410.00
减：应计利息总额	85,900.00
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	1,590.00

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	6,049,769.73
------	--------------

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	15,609,318.37
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	15,609,318.37

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	235,514,985.67
——股票投资	235,497,598.67
——债券投资	17,387.00
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	5,622,343.81
——权证投资	-
——期货投资	5,622,343.81
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	241,137,329.48

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	2,229,282.73
转换费收入	5,657.44
合计	2,234,940.17

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	-
合计	94,219.55

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
中国光大银行股份有限公司	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	11,135,367.65	2,991,857.60
其中：应支付销售机构的客户维护费	4,060,684.56	1,141,388.67
应支付基金管理人的净管理费	7,074,683.09	1,850,468.93

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1.20%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 × 1.20% / 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	1,855,894.52	498,642.91

注：支付基金托管人中国光大银行股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费＝前一日基金资产净值 X 0.20% / 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		
	汇安多因子混合A	汇安多因子混合C	合计
汇安基金 管理有限 责任公司	0.00	883,738.30	883,738.30
中国光大 银行股份 有限公司	0.00	655,358.63	655,358.63
合计	-	1,539,096.93	1,539,096.93
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		
	汇安多因子混合A	汇安多因子混合C	合计
中国光大 银行股份	0.00	332,798.44	332,798.44

有限公司			
汇安基金 管理有限 责任公司	0.00	72,686.87	72,686.87
合计	-	405,485.31	405,485.31

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0.50%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×0.50%/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

汇安多因子混合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	529,616.89	-
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	529,616.89	-

报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.05%	-
---------------------	-------	---

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
中国光大银行股份有限公司	523,978,297.97	600,920.86	15,498,390.04	48,964.19

注：本基金的银行存款由基金托管人中国光大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
301308	江波龙	2026-01-26	1-6个月（含）	询价转让限售	212.09	675.52	9,000	1,908,810.00	6,079,680.00	-
688147	微导纳米	2026-04-07	1-6个月（含）	询价转让限售	57.10	147.02	32,000	1,827,200.00	4,704,640.00	-
688082	盛美上海	2026-02-09	1-6个月（含）	询价转让限售	160.00	399.91	11,000	1,760,000.00	4,399,010.00	-
688200	华峰测控	2026-06-02	1-6个月（含）	询价转让限售	262.82	469.54	8,880	2,333,880.00	4,169,515.20	-
688308	欧科亿	2026-06-02	1-6个月（含）	询价转让限售	96.45	155.08	25,000	2,411,250.00	3,877,000.00	-
688521	芯原股份	2026-03-04	1-6个月（含）	大宗交易流通受限	199.23	338.50	11,000	2,191,530.00	3,723,500.00	-
688268	华特气体	2026-05-25	1-6个月（含）	大宗交易流通受限	138.00	224.64	14,500	2,001,000.00	3,257,280.00	-
688182	灿勤科技	2026-05-29	1-6个月（含）	询价转让限售	32.66	38.82	80,000	2,612,800.00	3,105,600.00	-
600601	方正科技	2026-06-02	1-6个月（含）	大宗交易流通	11.19	12.64	179,000	2,003,010.00	2,262,560.00	-

				受限						
688521	芯原股份	2026-06-25	1-6个月 (含)	大宗交易 流通受限	297.48	321.98	7,000	2,082,360.00	2,253,860.00	-
688045	必易微	2026-06-05	1-6个月 (含)	询价转让 限售	56.56	73.89	30,000	1,696,800.00	2,216,700.00	-
688795	摩尔线程	2025-11-26	6个月以上	科创板打 新限售	114.28	676.94	3,248	371,181.44	2,198,701.12	-
603260	合盛硅业	2026-02-24	1-6个月 (含)	大宗交易 流通受限	44.14	45.62	46,000	2,030,440.00	2,098,520.00	-
688409	富创精密	2026-06-24	1-6个月 (含)	大宗交易 流通受限	184.48	267.38	11,000	2,029,280.00	2,941,180.00	-
688698	伟创电气	2026-05-29	1-6个月 (含)	询价转让 限售	74.17	48.38	30,000	2,225,100.00	1,451,400.00	-
300855	图南股份	2026-05-18	1-6个月 (含)	询价转让 限售	37.17	29.02	50,000	1,858,500.00	1,451,000.00	-
300900	广联航空	2026-03-04	1-6个月 (含)	询价转让 限售	27.16	36.06	36,000	977,760.00	1,298,160.00	-
688099	晶晨股份	2026-01-28	1-6个月 (含)	询价转让 限售	82.85	99.72	11,000	911,350.00	1,096,920.00	-
688808	联讯	2026-04-1	1-6个月	科创	81.88	1,584.33	163	13,346.44	258,245.79	-

	仪器	6	(含)	板打 新限售						
0013 99	惠科 股份	2026 -06-1 6	1-6个月 (含)	新股 锁定	10.12	27.73	6,488	65,65 8.56	179,9 12.24	-
3016 82	宏明 电子	2026 -03-1 8	1-6个月 (含)	创业 板打 新限售	69.66	160.0 6	714	49,73 7.24	114,2 82.84	-
6887 97	臻宝 科技	2026 -06-1 6	1-6个月 (含)	科创 板打 新限售	44.56	468.6 7	207	9,22 3.92	97,01 4.69	-
6887 81	视涯 科技	2026 -03-1 8	1-6个月 (含)	科创 板打 新限售	22.68	47.61	1,300	29,48 4.00	61,89 3.00	-
6887 12	北芯 生命	2026 -01-2 8	1-6个月 (含)	科创 板打 新限售	17.52	35.92	1,500	26,28 0.00	53,88 0.00	-
6888 13	泰金 新能	2026 -03-2 4	1-6个月 (含)	科创 板打 新限售	26.28	172.0 9	234	6,14 9.52	40,26 9.06	-
6886 35	长进 光子	2026 -05-2 0	1-6个月 (含)	科创 板打 新限售	40.98	308.1 9	128	5,24 5.44	39,44 8.32	-
0012 57	盛龙 股份	2026 -03-2 4	1-6个月 (含)	新股 锁定	7.82	20.74	1,743	13,63 0.26	36,14 9.82	-
0013	天海	2026	1-6个月	新股	27.19	31.31	719	19,54	22,51	-

65	电子	-05-1 1	(含)	锁定				9.61	1.89	
6888 11	有研 复材	2026 -04-0 1	1-6个月 (含)	科创 板打 新限售	6.41	24.13	834	5,34 5.94	20,12 4.42	-
3016 96	三瑞 智能	2026 -03-3 1	1-6个月 (含)	创业 板打 新限售	24.68	86.80	216	5,33 0.88	18,74 8.80	-
0012 37	惠康 科技	2026 -05-1 5	1-6个月 (含)	新股 锁定	53.26	58.74	285	15,17 9.10	16,74 0.90	-
3016 69	高特 电子	2026 -06-0 2	1-6个月 (含)	创业 板打 新限售	7.08	28.40	546	3,86 5.68	15,50 6.40	-
3016 87	新广 益	2025 -12-2 4	1-6个月 (含)	创业 板打 新限售	21.93	77.78	195	4,27 6.35	15,16 7.10	-
0013 93	维通 利	2026 -05-0 8	1-6个月 (含)	新股 锁定	30.38	38.99	387	11,75 7.06	15,08 9.13	-
3015 31	春光 集团	2026 -04-2 8	1-6个月 (含)	创业 板打 新限售	13.30	51.56	290	3,85 7.00	14,95 2.40	-
3015 99	理奇 智能	2026 -04-2 2	1-6个月 (含)	创业 板打 新限售	13.91	32.47	433	6,02 3.03	14,05 9.51	-
6011 12	振石 股份	2026 -01-2 1	1-6个月 (含)	新股 锁定	11.18	17.59	775	8,66 4.50	13,63 2.25	-

301680	固德电材	2026-02-27	1-6个月 (含)	创业板打 新限售	58.00	112.16	117	6,786.00	13,122.72	-
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	-
603435	嘉德利	2026-05-15	1-6个月 (含)	新股 锁定	15.76	46.71	104	1,639.04	4,857.84	-
603352	至信股份	2026-01-08	1-6个月 (含)	新股 锁定	21.88	25.52	112	2,450.56	2,858.24	-
603293	埃泰克	2026-04-09	1-6个月 (含)	新股 锁定	33.49	33.93	72	2,411.28	2,442.96	-
001312	福恩股份	2026-04-14	1-6个月 (含)	新股 锁定	18.38	16.78	134	2,462.92	2,248.52	-
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	-

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	13,200	2,704,535.25	11,609,796.00	-

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

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

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

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

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国光大银行股份有限公司，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4.20%(2025年12月31日：5.03%)。

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	124,174,486.94	-
合计	124,174,486.94	-

注：未评级部分为国债。

6.4.13.2.2 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	-	-
AAA以下	-	-
未评级	1,709,371.62	-
合计	1,709,371.62	-

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

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》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、买入返售金融资产及债券投资等。

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	523,978,297.97	-	-	-	523,978,297.97
结算备付金	26,787,248.26	-	-	-	26,787,248.26
存出保证金	18,506,426.60	-	-	-	18,506,426.60
交易性金融资产	124,174,486.94	-	1,709,371.62	2,332,398,191.20	2,458,282,049.76
买入返售金融资产	260,000,000.00	-	-	-	260,000,000.00
应收申购款	-	-	-	27,778,895.27	27,778,895.27
资产总计	953,446,459.77	-	1,709,371.62	2,360,177,086.47	3,315,332,917.86
负债					
应付清	-	-	-	294,226,503.54	294,226,503.54

算款					
应付赎回款	-	-	-	18,988,918.79	18,988,918.79
应付管理人报酬	-	-	-	2,871,016.40	2,871,016.40
应付托管费	-	-	-	478,502.72	478,502.72
应付销售服务费	-	-	-	991,033.45	991,033.45
应交税费	-	-	-	154,056.06	154,056.06
其他负债	-	-	-	1,613,658.14	1,613,658.14
负债总计	-	-	-	319,323,689.10	319,323,689.10
利率敏感度缺口	953,446,459.77	-	1,709,371.62	2,040,853,397.37	2,996,009,228.76
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	75,450,673.34	-	-	-	75,450,673.34
结算备付金	10,832,779.58	-	-	-	10,832,779.58
存出保证金	3,552,427.58	-	-	-	3,552,427.58

交易性金融资产	39,950,450.65	-	1,675,451.62	705,137,351.63	746,763,253.90
应收清算款	-	-	-	14,308,548.31	14,308,548.31
应收申购款	-	-	-	5,807,773.51	5,807,773.51
资产总计	129,786,331.15	-	1,675,451.62	725,253,673.45	856,715,456.22
负债					
应付清算款	-	-	-	18,849,817.53	18,849,817.53
应付赎回款	-	-	-	8,645,668.42	8,645,668.42
应付管理人报酬	-	-	-	883,123.05	883,123.05
应付托管费	-	-	-	147,187.18	147,187.18
应付销售服务费	-	-	-	239,392.19	239,392.19
应交税费	-	-	-	4,467.37	4,467.37
其他负债	-	-	-	769,118.69	769,118.69
负债总计	-	-	-	29,538,774.43	29,538,774.43
利率敏感度缺口	129,786,331.15	-	1,675,451.62	695,714,899.02	827,176,681.79

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4.20%(2025年12月31日：5.03%)，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。

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票资产投资比例为基金资产的50%-95%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值的5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30日		上年度末 2025年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)

交易性金融资产—股票投资	2,332,398,191.20	77.85	705,137,351.63	85.25
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	2,332,398,191.20	77.85	705,137,351.63	85.25

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%	163,507,036.75	44,892,656.52
	沪深300指数下降5%	-163,507,036.75	-44,892,656.52

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	2,267,119,790.08	685,445,580.80
第二层次	137,493,654.56	42,687,912.31
第三层次	53,668,605.12	18,629,760.79
合计	2,458,282,049.76	746,763,253.90

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	2,332,398,191.20	70.35
	其中：股票	2,332,398,191.20	70.35
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	125,883,858.56	3.80
	其中：债券	125,883,858.56	3.80
	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	260,000,000.00	7.84
	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	550,765,546.23	16.61
8	其他各项资产	46,285,321.87	1.40
9	合计	3,315,332,917.86	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	6,436,388.00	0.21
B	采矿业	94,874,962.72	3.17
C	制造业	1,812,577,406.17	60.50
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	29,447,377.06	0.98
E	建筑业	18,015,467.00	0.60
F	批发和零售业	117,519,974.00	3.92
G	交通运输、仓储和邮政业	35,308,672.46	1.18
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	72,303,785.59	2.41
J	金融业	39,656,217.00	1.32
K	房地产业	-	-

L	租赁和商务服务业	15,716,357.80	0.52
M	科学研究和技术服务业	32,557,496.00	1.09
N	水利、环境和公共设施管理业	35,236,422.04	1.18
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	5,575,644.00	0.19
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	11,256,129.36	0.38
S	综合	5,915,892.00	0.20
	合计	2,332,398,191.20	77.85

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300308	中际旭创	48,100	61,087,000.00	2.04
2	688002	睿创微纳	341,154	52,773,112.26	1.76
3	300502	新易盛	81,868	49,693,876.00	1.66
4	300037	新宙邦	462,700	42,961,695.00	1.43
5	300475	香农芯创	136,400	40,920,000.00	1.37
6	601138	工业富联	551,000	39,754,650.00	1.33
7	301031	中熔电气	322,551	38,528,716.95	1.29
8	300972	万辰集团	215,200	37,317,832.00	1.25
9	301358	湖南裕能	490,600	37,221,822.00	1.24
10	002850	科达利	196,200	37,140,660.00	1.24
11	000408	藏格矿业	529,300	36,691,076.00	1.22
12	605117	德业股份	309,960	32,911,552.80	1.10
13	605016	百龙创园	1,184,100	30,608,985.00	1.02
14	688475	萤石网络	1,059,501	28,977,352.35	0.97

15	000933	神火股份	1,342,200	28,454,640.00	0.95
16	600801	华新建材	1,505,600	23,487,360.00	0.78
17	688059	华锐精密	105,223	21,014,085.33	0.70
18	301536	星宸科技	161,900	20,838,149.00	0.70
19	002653	海思科	304,900	20,227,066.00	0.68
20	002281	光迅科技	70,000	17,985,800.00	0.60
21	002979	雷赛智能	317,000	17,682,260.00	0.59
22	600183	生益科技	101,800	17,652,120.00	0.59
23	603928	兴业股份	1,168,620	17,295,576.00	0.58
24	002557	洽洽食品	956,400	17,176,944.00	0.57
25	601069	西部黄金	778,900	17,135,800.00	0.57
26	603929	亚翔集成	62,300	16,946,846.00	0.57
27	300223	君正股份	66,000	16,427,400.00	0.55
28	301500	飞南资源	609,100	15,867,055.00	0.53
29	301219	腾远钴业	289,310	15,854,188.00	0.53
30	601899	紫金矿业	604,300	15,192,102.00	0.51
31	000810	创维数字	1,132,900	15,010,925.00	0.50
32	603986	兆易创新	17,900	14,588,500.00	0.49
33	600487	亨通光电	132,900	14,531,286.00	0.49
34	688183	生益电子	108,661	14,386,716.40	0.48
35	300184	力源信息	768,400	13,485,420.00	0.45
36	301200	大族数控	37,200	13,416,180.00	0.45
37	300428	立中集团	721,700	13,120,506.00	0.44
38	300861	美畅股份	516,700	13,015,673.00	0.43
39	002440	闰土股份	1,269,600	13,013,400.00	0.43
40	300548	长芯博创	45,000	12,510,000.00	0.42
41	603259	药明康德	100,100	12,463,451.00	0.42
42	002555	三七互娱	622,800	11,752,236.00	0.39
43	600596	新安股份	735,900	11,744,964.00	0.39
44	688072	拓荆科技	13,200	11,609,796.00	0.39
45	688012	中微公司	24,485	11,471,222.50	0.38

46	300953	震裕科技	85,320	11,407,284.00	0.38
47	601900	南方传媒	1,036,476	11,256,129.36	0.38
48	300681	英搏尔	392,900	11,244,798.00	0.38
49	603638	艾迪精密	459,000	10,763,550.00	0.36
50	002709	天赐材料	202,400	10,409,432.00	0.35
51	301377	鼎泰高科	18,600	10,246,740.00	0.34
52	600292	电投水电	846,001	10,185,852.04	0.34
53	688200	华峰测控	20,300	10,166,157.20	0.34
54	603026	石大胜华	111,100	9,929,007.00	0.33
55	000426	兴业银锡	300,900	9,917,664.00	0.33
56	301297	富乐德	161,300	9,878,012.00	0.33
57	000973	佛塑科技	684,500	9,822,575.00	0.33
58	300390	天华新能	103,300	9,659,583.00	0.32
59	301246	宏源药业	358,200	9,635,580.00	0.32
60	002466	天齐锂业	156,200	9,578,184.00	0.32
61	688120	华海清科	29,680	9,562,302.40	0.32
62	300604	长川科技	27,800	9,491,476.00	0.32
63	688503	聚和材料	71,466	9,483,538.20	0.32
64	601088	中国神华	236,610	9,237,254.40	0.31
65	300373	扬杰科技	58,400	9,182,232.00	0.31
66	688409	富创精密	31,200	9,127,430.00	0.30
67	688525	佰维存储	18,200	9,004,086.00	0.30
68	300073	当升科技	186,240	8,946,969.60	0.30
69	601677	明泰铝业	533,400	8,854,440.00	0.30
70	300864	南大环境	447,000	8,573,460.00	0.29
71	600489	中金黄金	474,500	8,564,725.00	0.29
72	688048	长光华芯	17,000	8,534,000.00	0.28
73	603186	华正新材	37,804	8,517,241.20	0.28
74	001309	德明利	9,000	8,486,100.00	0.28
75	002270	华明装备	447,700	8,439,145.00	0.28
76	601107	四川成渝	1,715,600	8,372,128.00	0.28

77	688498	源杰科技	4,350	8,204,100.00	0.27
78	300394	天孚通信	27,048	8,186,888.64	0.27
79	000612	焦作万方	772,300	8,178,657.00	0.27
80	603198	迎驾贡酒	269,700	7,983,120.00	0.27
81	000550	江铃汽车	489,900	7,946,178.00	0.27
82	600150	中国船舶	232,900	7,869,691.00	0.26
83	688519	南亚新材	20,529	7,801,841.16	0.26
84	000988	华工科技	41,500	7,661,315.00	0.26
85	688155	先惠技术	94,177	7,617,977.53	0.25
86	300976	达瑞电子	95,180	7,581,087.00	0.25
87	002558	巨人网络	274,600	7,567,976.00	0.25
88	300628	亿联网络	221,900	7,504,658.00	0.25
89	603066	音飞储存	766,100	7,477,136.00	0.25
90	605599	菜百股份	529,900	7,259,630.00	0.24
91	688309	恒誉科技	118,640	7,222,803.20	0.24
92	601872	招商轮船	407,800	7,165,046.00	0.24
93	603706	东方环宇	410,100	7,090,629.00	0.24
94	601233	桐昆股份	323,800	7,010,270.00	0.23
95	300823	建科智能	478,800	6,980,904.00	0.23
96	002414	高德红外	524,400	6,953,544.00	0.23
97	002266	浙富控股	1,365,800	6,910,948.00	0.23
98	600546	山煤国际	630,300	6,889,179.00	0.23
99	688127	蓝特光学	70,491	6,879,921.60	0.23
100	688213	思特威	63,949	6,847,019.43	0.23
101	688380	中微半导	102,977	6,787,214.07	0.23
102	301308	江波龙	10,000	6,783,480.00	0.23
103	002636	金安国纪	56,400	6,766,308.00	0.23
104	601898	中煤能源	544,500	6,632,010.00	0.22
105	600601	方正科技	492,500	6,601,400.00	0.22
106	688615	合合信息	58,100	6,571,110.00	0.22
107	688521	芯原股份	19,500	6,534,070.00	0.22

108	001215	千味央厨	176,900	6,527,610.00	0.22
109	300970	华绿生物	352,100	6,436,388.00	0.21
110	300458	全志科技	162,800	6,424,088.00	0.21
111	001314	亿道信息	103,900	6,421,020.00	0.21
112	301238	瑞泰新材	261,700	6,385,480.00	0.21
113	002054	德美化工	954,800	6,349,420.00	0.21
114	002468	申通快递	430,000	6,260,800.00	0.21
115	600927	永安期货	501,400	6,242,430.00	0.21
116	300750	宁德时代	15,700	6,170,257.00	0.21
117	601061	中信金属	567,100	6,107,667.00	0.20
118	002049	紫光国微	68,500	6,079,375.00	0.20
119	600522	中天科技	100,000	6,068,000.00	0.20
120	301026	浩通科技	299,984	6,065,676.48	0.20
121	300442	润泽科技	73,000	6,064,110.00	0.20
122	600863	华能蒙电	1,264,800	5,944,560.00	0.20
123	002768	国恩股份	114,008	5,935,256.48	0.20
124	688230	芯导科技	75,267	5,931,792.27	0.20
125	002371	北方华创	6,700	5,926,552.00	0.20
126	000833	粤桂股份	252,600	5,915,892.00	0.20
127	300438	鹏辉能源	69,500	5,758,075.00	0.19
128	301371	敷尔佳	218,900	5,691,400.00	0.19
129	601600	中国铝业	687,320	5,649,770.40	0.19
130	600455	博通股份	253,900	5,575,644.00	0.19
131	688633	星球石墨	186,905	5,556,685.65	0.19
132	603507	振江股份	168,800	5,551,832.00	0.19
133	301613	新铝时代	151,300	5,511,859.00	0.18
134	603889	新澳股份	1,076,000	5,498,360.00	0.18
135	688045	必易微	69,433	5,402,097.74	0.18
136	300590	移为通信	373,600	5,361,160.00	0.18
137	301048	金鹰重工	618,700	5,327,007.00	0.18
138	603489	八方股份	189,800	5,306,808.00	0.18

139	300857	协创数据	15,600	5,302,440.00	0.18
140	002925	盈趣科技	213,760	5,271,321.60	0.18
141	600685	中船防务	199,000	5,062,560.00	0.17
142	000421	南京公用	1,013,200	5,025,472.00	0.17
143	000807	云铝股份	222,100	4,917,294.00	0.16
144	002842	翔鹭钨业	100,800	4,858,560.00	0.16
145	601002	晋亿实业	1,107,200	4,783,104.00	0.16
146	688147	微导纳米	32,000	4,704,640.00	0.16
147	002192	融捷股份	52,100	4,657,740.00	0.16
148	001218	丽臣实业	209,900	4,630,394.00	0.15
149	002916	深南电路	10,100	4,624,790.00	0.15
150	301099	雅创电子	48,000	4,584,000.00	0.15
151	301275	汉朔科技	101,700	4,566,330.00	0.15
152	688049	炬芯科技	96,645	4,533,616.95	0.15
153	603390	通达电气	434,200	4,533,048.00	0.15
154	301607	富特科技	86,400	4,514,400.00	0.15
155	688182	灿勤科技	112,151	4,490,343.57	0.15
156	688082	盛美上海	11,151	4,464,242.00	0.15
157	688396	华润微	45,398	4,428,574.90	0.15
158	001298	好上好	213,200	4,423,900.00	0.15
159	301662	宏工科技	43,155	4,372,464.60	0.15
160	301216	万凯新材	189,600	4,358,904.00	0.15
161	300697	电工合金	284,200	4,305,630.00	0.14
162	000708	中信特钢	338,500	4,271,870.00	0.14
163	688378	奥来德	68,224	4,229,888.00	0.14
164	002033	丽江股份	511,500	4,224,990.00	0.14
165	000885	城发环境	351,200	4,224,936.00	0.14
166	688281	华秦科技	82,331	4,135,486.13	0.14
167	301608	博实结	81,955	4,119,058.30	0.14
168	603329	上海雅仕	455,500	4,090,390.00	0.14
169	001266	宏英智能	82,900	4,070,390.00	0.14

170	300127	银河磁体	145,000	4,052,750.00	0.14
171	603296	华勤技术	54,180	4,023,948.60	0.13
172	002811	郑中设计	358,100	4,007,139.00	0.13
173	002961	瑞达期货	202,900	3,972,782.00	0.13
174	002953	日丰股份	452,200	3,943,184.00	0.13
175	300570	太辰光	15,800	3,898,018.00	0.13
176	688221	前沿生物	173,644	3,889,625.60	0.13
177	688308	欧科亿	25,000	3,877,000.00	0.13
178	688416	恒烁股份	27,690	3,876,600.00	0.13
179	688256	寒武纪	2,418	3,858,039.90	0.13
180	688629	华丰科技	20,406	3,826,329.06	0.13
181	300476	胜宏科技	11,000	3,810,730.00	0.13
182	688001	华兴源创	43,962	3,767,543.40	0.13
183	600760	中航沈飞	89,700	3,686,670.00	0.12
184	688677	海泰新光	36,240	3,664,951.20	0.12
185	688275	万润新能	28,600	3,647,930.00	0.12
186	000880	潍柴重机	156,400	3,598,764.00	0.12
187	300855	图南股份	118,600	3,595,436.00	0.12
188	688349	三一重能	236,191	3,585,379.38	0.12
189	301510	固高科技	112,200	3,582,546.00	0.12
190	301190	善水科技	223,200	3,577,896.00	0.12
191	002028	思源电气	20,600	3,563,800.00	0.12
192	001286	陕西能源	348,300	3,531,762.00	0.12
193	002185	华天科技	156,100	3,482,591.00	0.12
194	000657	中钨高新	36,300	3,474,636.00	0.12
195	688108	赛诺医疗	181,272	3,358,970.16	0.11
196	601336	新华保险	55,700	3,323,062.00	0.11
197	688268	华特气体	14,500	3,257,280.00	0.11
198	002838	道恩股份	106,100	3,248,782.00	0.11
199	603210	泰鸿万立	237,700	3,192,311.00	0.11
200	688779	五矿新能	390,038	3,163,208.18	0.11

201	300226	上海钢联	199,380	3,052,507.80	0.10
202	000703	恒逸石化	224,600	3,047,822.00	0.10
203	300388	节能国祯	491,300	3,031,321.00	0.10
204	603061	金海通	5,960	2,993,231.20	0.10
205	600575	淮河能源	937,700	2,991,263.00	0.10
206	603588	高能环境	152,500	2,928,000.00	0.10
207	002378	章源钨业	87,300	2,922,804.00	0.10
208	301345	涛涛车业	12,600	2,910,600.00	0.10
209	601108	财通证券	335,100	2,898,615.00	0.10
210	301631	壹连科技	40,228	2,890,784.08	0.10
211	002479	富春环保	681,200	2,867,852.00	0.10
212	300434	金石亚药	253,400	2,845,682.00	0.09
213	002396	星网锐捷	147,040	2,818,756.80	0.09
214	301507	民生健康	234,000	2,815,020.00	0.09
215	688110	东芯股份	13,815	2,814,115.50	0.09
216	688577	浙海德曼	60,000	2,749,800.00	0.09
217	688266	泽璟制药	23,467	2,737,660.22	0.09
218	300033	同花顺	11,320	2,728,120.00	0.09
219	688313	仕佳光子	14,510	2,679,271.50	0.09
220	301396	宏景科技	8,000	2,652,800.00	0.09
221	601398	工商银行	375,000	2,651,250.00	0.09
222	000301	东方盛虹	230,800	2,642,660.00	0.09
223	600176	中国巨石	36,200	2,638,256.00	0.09
224	300900	广联航空	70,000	2,609,540.00	0.09
225	688372	伟测科技	14,000	2,604,000.00	0.09
226	601319	中国人保	384,400	2,598,544.00	0.09
227	002993	奥海科技	35,800	2,563,638.00	0.09
228	002475	立讯精密	36,100	2,541,440.00	0.08
229	300975	商络电子	47,700	2,468,475.00	0.08
230	601225	陕西煤业	121,000	2,462,350.00	0.08
231	688630	芯碁微装	4,475	2,458,520.25	0.08

232	605305	中际联合	57,200	2,397,824.00	0.08
233	601628	中国人寿	66,600	2,354,310.00	0.08
234	300789	唐源电气	131,800	2,342,086.00	0.08
235	002518	科士达	43,600	2,336,524.00	0.08
236	003010	若羽臣	95,400	2,318,220.00	0.08
237	688279	峰昭科技	10,300	2,311,732.00	0.08
238	603025	大豪科技	168,800	2,302,432.00	0.08
239	300181	佐力药业	161,900	2,282,790.00	0.08
240	300515	三德科技	174,300	2,274,615.00	0.08
241	688717	艾罗能源	27,400	2,262,418.00	0.08
242	600028	中国石化	500,100	2,230,446.00	0.07
243	600346	恒力石化	125,700	2,226,147.00	0.07
244	600155	华创云信	403,100	2,225,112.00	0.07
245	300407	凯发电气	205,800	2,222,640.00	0.07
246	301087	可孚医疗	46,600	2,220,490.00	0.07
247	002897	意华股份	25,100	2,208,298.00	0.07
248	688101	三达膜	133,100	2,200,143.00	0.07
249	688795	摩尔线程	3,248	2,198,701.12	0.07
250	300409	道氏技术	110,100	2,194,293.00	0.07
251	300298	三诺生物	157,000	2,190,150.00	0.07
252	300008	天海防务	361,000	2,187,660.00	0.07
253	603993	洛阳钼业	124,500	2,184,975.00	0.07
254	601033	永兴股份	162,500	2,177,500.00	0.07
255	000733	振华科技	38,300	2,169,312.00	0.07
256	300827	上能电气	69,800	2,149,142.00	0.07
257	300693	盛弘股份	44,000	2,145,000.00	0.07
258	688269	凯立新材	66,952	2,123,047.92	0.07
259	688522	纳睿雷达	105,500	2,112,110.00	0.07
260	603260	合盛硅业	46,000	2,098,520.00	0.07
261	001332	锡装股份	53,400	2,097,018.00	0.07
262	002215	诺普信	253,600	2,087,128.00	0.07

263	601318	中国平安	43,600	2,081,464.00	0.07
264	603991	领先股份	14,700	2,074,905.00	0.07
265	600987	航民股份	340,480	2,059,904.00	0.07
266	002493	荣盛石化	191,200	2,055,400.00	0.07
267	688336	三生国健	38,116	2,023,959.60	0.07
268	002837	英维克	25,400	2,020,824.00	0.07
269	002736	国信证券	201,800	2,015,982.00	0.07
270	600115	中国东航	523,600	1,994,916.00	0.07
271	300206	理邦仪器	162,400	1,986,152.00	0.07
272	601601	中国太保	69,600	1,984,992.00	0.07
273	600316	洪都航空	71,000	1,983,740.00	0.07
274	000629	钒钛股份	591,800	1,976,612.00	0.07
275	688697	纽威数控	144,713	1,966,649.67	0.07
276	688301	奕瑞科技	15,736	1,951,264.00	0.07
277	688551	科威尔	27,606	1,939,873.62	0.06
278	600519	贵州茅台	1,600	1,896,784.00	0.06
279	603276	恒兴新材	123,700	1,893,847.00	0.06
280	300890	翔丰华	56,600	1,877,422.00	0.06
281	300395	菲利华	14,000	1,872,220.00	0.06
282	601857	中国石油	214,545	1,862,250.60	0.06
283	300404	博济医药	211,600	1,853,616.00	0.06
284	002588	史丹利	232,600	1,837,540.00	0.06
285	600988	赤峰黄金	69,700	1,834,504.00	0.06
286	301665	泰禾股份	86,400	1,810,944.00	0.06
287	002805	丰元股份	62,700	1,792,593.00	0.06
288	300277	汽轮科技	118,700	1,785,248.00	0.06
289	002204	大连重工	338,000	1,784,640.00	0.06
290	603890	春秋电子	64,200	1,773,204.00	0.06
291	600776	东方通信	133,300	1,751,562.00	0.06
292	301058	中粮科工	225,100	1,751,278.00	0.06
293	300735	光弘科技	76,600	1,741,884.00	0.06

294	300490	华自科技	130,900	1,731,807.00	0.06
295	300801	泰和科技	53,600	1,731,280.00	0.06
296	300339	润和软件	44,700	1,721,397.00	0.06
297	601288	农业银行	277,400	1,683,818.00	0.06
298	000899	赣能股份	173,000	1,671,180.00	0.06
299	300652	雷迪克	49,700	1,665,447.00	0.06
300	300620	光库科技	4,400	1,664,080.00	0.06
301	301266	宇邦新材	72,600	1,658,184.00	0.06
302	603045	福达合金	23,100	1,649,109.00	0.06
303	301439	泓淋电力	104,200	1,638,024.00	0.05
304	000100	TCL科技	280,000	1,629,600.00	0.05
305	301261	恒工精密	20,800	1,624,480.00	0.05
306	300445	康斯特	77,100	1,605,222.00	0.05
307	688609	九联科技	143,300	1,577,733.00	0.05
308	301210	金杨精密	52,500	1,575,000.00	0.05
309	300658	延江股份	137,600	1,572,768.00	0.05
310	688356	键凯科技	20,400	1,572,432.00	0.05
311	301469	恒达新材	56,800	1,566,544.00	0.05
312	300187	永清环保	307,500	1,552,875.00	0.05
313	000519	中兵红箭	73,600	1,550,752.00	0.05
314	688729	屹唐股份	36,000	1,548,000.00	0.05
315	002155	湖南黄金	63,070	1,505,480.90	0.05
316	002056	横店东磁	48,600	1,481,328.00	0.05
317	300139	晓程科技	40,500	1,480,275.00	0.05
318	600498	烽火通信	20,000	1,472,000.00	0.05
319	688698	伟创电气	30,000	1,451,400.00	0.05
320	002702	海欣食品	323,900	1,441,355.00	0.05
321	300618	寒锐钴业	39,800	1,420,860.00	0.05
322	601869	长飞光纤	2,600	1,419,340.00	0.05
323	301156	美农生物	128,200	1,393,534.00	0.05
324	688362	甬矽电子	14,400	1,388,160.00	0.05

325	600236	桂冠电力	157,660	1,384,254.80	0.05
326	002923	润都股份	140,400	1,328,184.00	0.04
327	688258	卓易信息	11,100	1,315,794.00	0.04
328	688808	联讯仪器	600	1,273,104.00	0.04
329	300775	三角防务	55,200	1,216,608.00	0.04
330	603267	鸿远电子	15,600	1,208,688.00	0.04
331	600547	山东黄金	50,700	1,170,663.00	0.04
332	688809	强一股份	1,859	1,158,157.00	0.04
333	600549	厦门钨业	13,500	1,150,200.00	0.04
334	688636	智明达	31,564	1,143,563.72	0.04
335	605060	联德股份	20,100	1,140,474.00	0.04
336	301189	奥尼电子	19,060	1,123,205.80	0.04
337	000975	山金国际	65,600	1,115,200.00	0.04
338	002463	沪电股份	7,200	1,100,160.00	0.04
339	688797	臻宝科技	1,656	1,096,984.08	0.04
340	688099	晶晨股份	11,000	1,096,920.00	0.04
341	301292	海科新源	13,700	1,092,301.00	0.04
342	601988	中国银行	190,900	1,091,948.00	0.04
343	601995	中金公司	30,200	1,091,730.00	0.04
344	603316	诚邦股份	51,900	1,068,621.00	0.04
345	688699	明微电子	13,000	1,065,350.00	0.04
346	603337	杰克科技	29,400	1,065,162.00	0.04
347	003043	华亚智能	10,700	1,063,473.00	0.04
348	600233	圆通速递	66,400	1,045,800.00	0.03
349	600497	驰宏锌锗	84,800	1,026,928.00	0.03
350	301479	弘景光电	16,720	1,006,544.00	0.03
351	002025	航天电器	13,100	998,482.00	0.03
352	300504	天邑股份	60,700	979,091.00	0.03
353	301329	信音电子	39,500	959,455.00	0.03
354	600397	江钨装备	35,000	953,050.00	0.03
355	688041	海光信息	2,300	851,690.00	0.03

356	688153	唯捷创芯	25,501	819,092.12	0.03
357	002484	江海股份	7,800	819,000.00	0.03
358	600595	中孚实业	143,100	804,222.00	0.03
359	001337	四川黄金	20,900	766,194.00	0.03
360	301360	荣旗科技	11,050	756,814.50	0.03
361	688122	西部超导	11,675	733,306.75	0.02
362	600110	诺德股份	48,300	728,847.00	0.02
363	600109	国金证券	81,100	712,058.00	0.02
364	688291	金橙子	12,059	705,210.32	0.02
365	688347	华虹宏力	2,080	699,504.00	0.02
366	301150	中一科技	10,920	689,161.20	0.02
367	688357	建龙微纳	22,000	648,340.00	0.02
368	003816	中国广核	164,900	644,759.00	0.02
369	000600	建投能源	73,500	643,125.00	0.02
370	601985	中国核电	71,100	642,033.00	0.02
371	688220	翱捷科技	4,720	586,790.40	0.02
372	002851	麦格米特	3,000	501,540.00	0.02
373	688031	星环科技	3,400	391,612.00	0.01
374	002625	光启技术	12,700	385,064.00	0.01
375	920284	灵鸽科技	18,000	371,160.00	0.01
376	920522	纳科诺尔	12,600	298,620.00	0.01
377	001399	惠科股份	6,488	179,912.24	0.01
378	301599	理奇智能	3,225	140,202.07	0.00
379	301682	宏明电子	714	114,282.84	0.00
380	688781	视涯科技	1,300	61,893.00	0.00
381	688712	北芯生命	1,500	53,880.00	0.00
382	688813	泰金新能	234	40,269.06	0.00
383	688635	长进光子	128	39,448.32	0.00
384	001257	盛龙股份	1,743	36,149.82	0.00
385	001365	天海电子	719	22,511.89	0.00
386	688811	有研复材	834	20,124.42	0.00

387	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.00
388	001237	惠康科技	285	16,740.90	0.00
389	301669	高特电子	546	15,506.40	0.00
390	301687	新广益	195	15,167.10	0.00
391	001393	维通利	387	15,089.13	0.00
392	301531	春光集团	290	14,952.40	0.00
393	300980	祥源新材	500	14,705.00	0.00
394	601112	振石股份	775	13,632.25	0.00
395	301680	固德电材	117	13,122.72	0.00
396	605389	长龄液压	90	8,640.00	0.00
397	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
398	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
399	603352	至信股份	112	2,858.24	0.00
400	301186	超达装备	60	2,460.00	0.00
401	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00
402	001312	福恩股份	134	2,248.52	0.00
403	301061	匠心家居	60	2,104.20	0.00
404	002039	黔源电力	93	1,750.26	0.00
405	301606	绿联科技	27	1,647.54	0.00
406	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00
407	001220	世盟股份	57	1,583.46	0.00
408	301283	聚胶股份	35	856.80	0.00
409	002722	物产金轮	72	848.88	0.00
410	301110	青木科技	20	757.20	0.00
411	600558	大西洋	20	98.80	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	301358	湖南裕能	43,785,165.16	5.29
2	300972	万辰集团	43,584,158.00	5.27
3	605016	百龙创园	42,068,659.00	5.09
4	000408	藏格矿业	39,964,150.00	4.83
5	000933	神火股份	39,620,082.00	4.79
6	688002	睿创微纳	36,967,876.78	4.47
7	002850	科达利	36,651,909.94	4.43
8	601138	工业富联	35,643,164.00	4.31
9	301031	中熔电气	34,107,207.04	4.12
10	605117	德业股份	34,077,956.00	4.12
11	300037	新宙邦	33,423,828.00	4.04
12	688475	萤石网络	31,565,506.85	3.82
13	301607	富特科技	27,178,806.00	3.29
14	600801	华新建材	26,954,883.00	3.26
15	002518	科士达	26,089,987.00	3.15
16	300475	香农芯创	25,257,669.12	3.05
17	002979	雷赛智能	24,770,459.00	2.99
18	002709	天赐材料	24,698,934.08	2.99
19	688183	生益电子	23,816,000.71	2.88
20	601069	西部黄金	23,408,026.20	2.83
21	603929	亚翔集成	21,572,784.00	2.61
22	002557	洽洽食品	21,368,653.00	2.58
23	300308	中际旭创	20,834,741.00	2.52
24	301297	富乐德	19,576,291.00	2.37
25	688208	道通科技	19,156,481.60	2.32
26	002440	闰土股份	18,876,034.68	2.28
27	301608	博实结	18,405,479.00	2.23
28	301219	腾远钴业	18,251,553.70	2.21
29	688059	华锐精密	18,217,503.13	2.20
30	300407	凯发电气	18,007,610.00	2.18

31	300428	立中集团	17,825,323.00	2.15
32	301200	大族数控	17,751,993.00	2.15
33	300502	新易盛	16,940,604.00	2.05

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	301200	大族数控	29,475,942.00	3.56
2	301607	富特科技	24,793,032.50	3.00
3	002518	科士达	21,140,864.80	2.56
4	603929	亚翔集成	20,367,455.00	2.46
5	002709	天赐材料	19,885,176.00	2.40
6	688208	道通科技	18,862,358.60	2.28
7	688183	生益电子	18,277,062.84	2.21
8	300407	凯发电气	17,877,661.00	2.16
9	600989	宝丰能源	17,777,067.26	2.15
10	301297	富乐德	16,556,334.12	2.00
11	688677	海泰新光	16,217,035.07	1.96
12	301608	博实结	15,909,377.69	1.92
13	605118	力鼎光电	13,953,934.64	1.69
14	002281	光迅科技	13,662,719.70	1.65
15	301377	鼎泰高科	12,864,437.95	1.56
16	688410	山外山	12,818,699.72	1.55
17	688519	南亚新材	12,795,543.16	1.55
18	600039	四川路桥	12,776,137.00	1.54
19	300442	润泽科技	12,497,877.09	1.51
20	600262	北方股份	12,325,810.00	1.49

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	3,318,582,862.14
卖出股票收入（成交）总额	2,033,106,002.83

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	125,883,858.56	4.20
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	125,883,858.56	4.20

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	019785	25国债13	550,000	55,694,401.37	1.86
2	019792	25国债19	349,000	35,266,182.28	1.18
3	019827	26国债01	330,000	33,213,903.29	1.11

4	019742	24特国01	16,000	1,709,371.62	0.06
---	--------	--------	--------	--------------	------

注：本基金本报告期末仅持有上述4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，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	18,506,426.60
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	27,778,895.27
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	46,285,321.87

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 多因 子混 合A	6,931	29,680.76	58,423,603.56	28.40%	147,293,750.33	71.60%

汇安多因子混合C	27,482	36,330.02	362,658,572.45	36.32%	635,762,916.90	63.68%
合计	33,969	35,448.17	421,082,176.01	34.97%	783,056,667.23	65.03%

8.2 盈利投资者数量占比

项目	过去一年（2025年07月01日-2026年06月30日）
盈利投资者数量占比	95.51%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	汇安多因子混合A	26,099.73	0.0127%
	汇安多因子混合C	9,067.70	0.0009%
	合计	35,167.43	0.0029%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	汇安多因子混合A	汇安多因子混合C
基金合同生效日(2019年04月30日)基金份额总额	280,347,760.24	217,963,034.59
本报告期期初基金份额总额	148,958,492.66	253,230,849.34
本报告期基金总申购份额	130,034,114.24	1,438,923,045.50
减：本报告期基金总赎回份额	73,275,253.01	693,732,405.49
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	205,717,353.89	998,421,489.35

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，本基金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

本报告期内，本基金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	
华创证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	330,677,667.76	6.20%	144,144.41	6.20%	-
中信建投证券	1	2,448,802.66	0.05%	893.80	0.04%	-
长江证券	2	2,436,815,252.97	45.72%	1,062,215.02	45.72%	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	563,952,041.40	10.58%	245,827.85	10.58%	-
华福证券	2	335,595,793.19	6.30%	146,288.89	6.30%	-
联储证券	2	-	-	-	-	-
中泰	2	374,605,295.38	7.03%	163,291.79	7.03%	-

证券						
中信 证券	2	190,332,198.39	3.57%	83,092.26	3.58%	-
天风 证券	3	1,095,151,261.08	20.55%	477,379.27	20.55%	-

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
华创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
浙商证券	8,807,56	9.81%	-	-	-	-	-	-

	8.00							
中信建投 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	53,542,59 4.00	59.6 4%	2,840,000,0 00.00	100.0 0%	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华福证券	19,911,71 1.00	22.1 8%	-	-	-	-	-	-
联储证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	7,509,45 0.00	8.37%	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-

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	汇安多因子混合型证券投资基金2025年第4季度报告	规定报刊和/或公司网站	2026-01-22
2	汇安基金管理有限责任公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025年度）	规定报刊和/或公司网站	2026-03-31
3	汇安多因子混合型证券投资基金2025年年度报告	规定报刊和/或公司网站	2026-03-31
4	汇安基金管理有限责任公司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	汇安多因子混合型证券投资基金2026年第1季度报告	规定报刊和/或公司网站	2026-04-22
6	汇安基金管理有限责任公司关于浙江分公司成立的公告	规定报刊和/或公司网站	2026-04-22

7	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

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

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

12.2 存放地点

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

12.3 查阅方式

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

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

公司网站：<http://www.huianfund.cn>

汇安基金管理有限责任公司
二〇二六年八月三十一日