汇安鑫利优选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:兴业银行股份有限公司

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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2026年8月28日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2026年1月1日起至2026年6月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录 2
1.1 重要提示 2
1.2 目录 3
§2 基金简介 5
2.1 基金基本情况 5
2.2 基金产品说明 5
2.3 基金管理人和基金托管人 5
2.4 信息披露方式 6
2.5 其他相关资料 6
§3 主要财务指标和基金净值表现 6
3.1 主要会计数据和财务指标 6
3.2 基金净值表现 7
§4 管理人报告 9
4.1 基金管理人及基金经理情况 9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 13
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 13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 15
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 15
§5 托管人报告 15
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 15
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 15
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 15
§6 半年度财务会计报告（未经审计） 15
6.1 资产负债表 15
6.2 利润表 17
6.3 净资产变动表 19
6.4 报表附注 21
§7 投资组合报告 45
7.1 期末基金资产组合情况 45
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 45
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 50
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 50
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 50
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 50
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 50
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 51
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 51
7.12 投资组合报告附注 51
§8 基金份额持有人信息 52

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....52
8.2 盈利投资者数量占比.....52
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....53
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.....53
§9 开放式基金份额变动.....53
§10 重大事件揭示.....54
10.1 基金份额持有人大会决议.....54
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.....54
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....54
10.4 基金投资策略的改变.....54
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....54
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况.....54
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.....55
10.8 其他重大事件.....56
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....57
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.....57
§12 备查文件目录.....57
12.1 备查文件目录.....57
12.2 存放地点.....58
12.3 查阅方式.....58

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	汇安鑫利优选混合型证券投资基金	
基金简称	汇安鑫利优选混合	
基金主代码	010558	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021年04月02日	
基金管理人	汇安基金管理有限责任公司	
基金托管人	兴业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	139,468,788.99份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	汇安鑫利优选混合A	汇安鑫利优选混合C
下属分级基金的交易代码	010558	010559
报告期末下属分级基金的份额总额	91,753,607.74份	47,715,181.25份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过精选具有核心竞争力的优质上市公司，合理配置资产权重，在充分控制投资风险的前提下，力求实现基金资产的长期、稳定增值。
投资策略	本基金投资策略主要包括资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略、融资业务投资策略、存托凭证投资策略等。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×80%+中证全债指数收益率×20%
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	兴业银行股份有限公司
信息披	姓名	郭冬青	冯萌

露负责人	联系电话	010-56711600	021-52629999-213310
	电子邮箱	guodq@huianfund.cn	fengmeng@cib.com.cn
客户服务电话		010-56711690	95561
传真		010-56711640	021-62159217
注册地址		上海市虹口区欧阳路218弄1号2楼215室	福建省福州市台江区江滨中大道398号兴业银行大厦
办公地址		北京市东城区东直门南大街5号中青旅大厦13层；上海市虹口区东大名路501号白玉兰大厦36层	上海市浦东新区银城路167号4楼
邮政编码		100007	200120
法定代表人		刘强	吕家进

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)	
	汇安鑫利优选混合	汇安鑫利优选混合

	A	C
本期已实现收益	7,622,573.00	3,740,224.44
本期利润	16,606,090.08	8,299,945.23
加权平均基金份额本期利润	0.1666	0.1620
本期加权平均净值利润率	19.34%	19.29%
本期基金份额净值增长率	20.88%	20.58%
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	-16,835,243.60	-9,724,270.61
期末可供分配基金份额利润	-0.1835	-0.2038
期末基金资产净值	90,771,416.74	45,982,725.14
期末基金份额净值	0.9893	0.9637
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	-1.07%	-3.63%

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

汇安鑫利优选混合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	24.74%	1.35%	9.78%	1.01%	14.96%	0.34%
过去六个月	20.88%	1.27%	6.58%	0.91%	14.30%	0.36%

过去一年	43.58%	1.06%	21.34%	0.81%	22.24%	0.25%
过去三年	29.80%	1.31%	27.34%	0.89%	2.46%	0.42%
过去五年	-0.57%	1.32%	2.03%	0.89%	-2.60%	0.43%
自基金合同生效起至今	-1.07%	1.29%	4.15%	0.89%	-5.22%	0.40%

汇安鑫利优选混合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	24.57%	1.35%	9.78%	1.01%	14.79%	0.34%
过去六个月	20.58%	1.27%	6.58%	0.91%	14.00%	0.36%
过去一年	42.86%	1.06%	21.34%	0.81%	21.52%	0.25%
过去三年	27.86%	1.31%	27.34%	0.89%	0.52%	0.42%
过去五年	-3.03%	1.32%	2.03%	0.89%	-5.06%	0.43%
自基金合同生效起至今	-3.63%	1.29%	4.15%	0.89%	-7.78%	0.40%

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		
刘田	景气成长组基金经理、本基金的基金经	2023-05-29	-	13年	刘田先生，中国人民大学政治经济学硕士研究生，13年

	理				证券、基金行业从业经验。曾任凯盛电子科技有限责任公司销售部销售工程师；中邮创业基金管理有限公司投资研究部研究员；中邮创业基金管理股份有限公司投资部基金经理。2020年4月加入汇安基金管理有限责任公司，担任景气成长组基金经理。2021年6月9日至2022年6月15日，任汇安丰融灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2022年5月19日至2023年5月29日，任汇安资产轮动灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2020年7月31日至2025年12月22日，任汇安核心成长混合型证券投资基金基金经理；2022年5月19日至今，任汇安行业龙头混合型证券投资基金基金经理；2023年5月29日至今，任汇安鑫利优选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

市场回顾：2026年上半年，A股市场宽幅震荡，截止上半年末，上证指数收4094.40，区间涨跌幅3.16%，深证收16205.56，区间涨跌幅19.82%，创业板收4342.71，区间涨跌幅 35.58%，全A收7148.70，区间涨跌幅11.52%。上半年，创业板指和深成指表现优于全A指数和上证指数。

行业层面：

前 5：电子 +86.29%，通信+73.59%，建筑材料+46.26%，机械设备+22.60%，基础化工+9.00%；

后 5：商贸零售-29.42%，农林牧渔-25.26%，美容护理-24.86%，食品饮料-19.52%，钢铁-19.01%。

操作回顾：

首先，报告期内，我们整体配置方向变化较小，比较多数量的重仓个股已经连续多个季度出现在我们的组合之中，我们依然希望通过长期投资的方式来分享公司业务成长带来的价值增长。

其次，上半年来看，国内宏观环境整体稳定，国内经济整体趋于平淡但是却不乏亮点，一方面，AI为代表的新质生产力、出口等方向依然保持较快增长；另一方面，传统经济虽然平淡，但是也极具韧性。上半年，市场的主要变数在海外的波动，中东局势紧张带来油价高涨、通涨反复、全球流动性预期趋紧，在海外高波动的影响下，国内市场的风险偏好、流动性也受到一定程度的负面影响。

组合层面，我们寻找到的结构性机会更多的出现在科技成长类行业，我们的配置结构变化不大；另一方面，考虑市场阶段性的风险偏好下降，为了应对可能出现的高波动，我们在二季度逐步降低了组合的整体仓位，希望能够阶段性降低组合的波动率。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末汇安鑫利优选混合A基金份额净值为0.9893元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为20.88%，同期业绩比较基准收益率为6.58%；截至报告期末汇安鑫利优选混合C基金份额净值为0.9637元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为20.58%，同期业绩比较基准收益率为6.58%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

市场展望：

展望下半年，我们认为，静态地看市场估值端已经收缩到中性偏低的位置；动态地看，业绩端的增长还在持续，因此当前位置看，市场整体风险可控。中长期看，中国优质企业在全球竞争力大概率还会持续提升，这会在未来的业绩端和估值端有所体现，我们对于这些优质公司持乐观的判断。下半年，我们会继续以细分行业龙头企业为牵引，兼顾中期维度的高景气，努力平衡好组合的波动和收益，不断迭代投资方法论，力求给持有人带来更好的持有体验。

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

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内，本托管人根据自身能够获取的数据和信息，依据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人根据自身能够获取的数据和信息，认真复核了本中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§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：汇安鑫利优选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	42,314,171.83	24,815,773.80
结算备付金		75,088.63	95,337.98
存出保证金		53,545.29	49,498.29
交易性金融资产	6.4.7.2	95,069,635.81	108,123,830.01
其中：股票投资		95,069,635.81	108,123,830.01
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		-	184,682.73
应收股利		-	-
应收申购款		21,831.28	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		137,534,272.84	133,269,122.81
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		61.00	34,832.23
应付赎回款		487,651.49	67,041.73

应付管理人报酬		124,184.52	132,790.91
应付托管费		20,697.41	22,131.85
应付销售服务费		17,249.70	18,975.20
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	130,286.84	213,041.96
负债合计		780,130.96	488,813.88
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	139,468,788.99	163,580,643.37
未分配利润	6.4.7.8	-2,714,647.11	-30,800,334.44
净资产合计		136,754,141.88	132,780,308.93
负债和净资产总计		137,534,272.84	133,269,122.81

注：报告截止日2026年6月30日，基金份额总额139,468,788.99份，其中汇安鑫利优选混合A基金份额净值0.9893元，份额总额91,753,607.74份；汇安鑫利优选混合C基金份额净值0.9637元，份额总额47,715,181.25份。

6.2 利润表

会计主体：汇安鑫利优选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2025年06月30日
一、营业总收入		25,984,733.65	11,335,136.44
1.利息收入		46,731.67	31,149.53
其中：存款利息收入	6.4.7.9	46,731.67	31,149.53
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-

买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		12,394,468.40	10,365,240.93
其中：股票投资收益	6.4.7.10	11,763,028.86	9,486,243.54
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	631,439.54	878,997.39
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	13,543,237.87	938,677.61
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	295.71	68.37
减：二、营业总支出		1,078,698.34	1,010,920.37
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	767,052.99	712,090.71
2.托管费	6.4.10.2.2	127,842.15	118,681.85
3.销售服务费	6.4.10.2.3	106,734.74	103,034.35
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.信用减值损失		-	-
7.税金及附加		-	-
8.其他费用	6.4.7.18	77,068.46	77,113.46

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		24,906,035.31	10,324,216.07
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		24,906,035.31	10,324,216.07
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		24,906,035.31	10,324,216.07

6.3 净资产变动表

会计主体：汇安鑫利优选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	163,580,643.37	-30,800,334.44	132,780,308.93
二、本期期初净资产	163,580,643.37	-30,800,334.44	132,780,308.93
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-24,111,854.38	28,085,687.33	3,973,832.95
（一）、综合收益总额	-	24,906,035.31	24,906,035.31
（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）	-24,111,854.38	3,179,652.02	-20,932,202.36
其中：1.基金申购款	701,387.64	-95,998.88	605,388.76
2.基金赎回款	-24,813,242.02	3,275,650.90	-21,537,591.12

（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	139,468,788.99	-2,714,647.11	136,754,141.88
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	188,298,380.12	-70,216,757.92	118,081,622.20
二、本期期初净资产	188,298,380.12	-70,216,757.92	118,081,622.20
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-10,200,069.54	13,914,771.69	3,714,702.15
（一）、综合收益总额	-	10,324,216.07	10,324,216.07
（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）	-10,200,069.54	3,590,555.62	-6,609,513.92
其中：1.基金申购款	2,396,627.19	-789,961.00	1,606,666.19
2.基金赎回款	-12,596,696.73	4,380,516.62	-8,216,180.11
（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	178,098,310.58	-56,301,986.23	121,796,324.35

产			

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

汇安鑫利优选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[2020]2727号《关于准予汇安鑫利优选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《汇安鑫利优选混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币423,404,683.23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(2021)第0351号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《汇安鑫利优选混合型证券投资基金基金合同》于2021年4月2日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额423,495,658.06份基金份额，其中认购资金利息折合90,974.83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，基金托管人为兴业银行股份有限公司。

根据《汇安鑫利优选混合型证券投资基金基金合同》和《汇安鑫利优选混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金根据认购费/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。在投资人认购/申购基金时收取认购/申购费用，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，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《汇安鑫利优选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(包含主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票)、存托凭证、债券(包括国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、可转换债券、可交换债券)、债券回购、同业存单、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、资产支持证券、股指期货、国债期货以及法

律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。在条件许可的情况下，基金管理人可在不改变本基金既有投资目标、策略和风险收益特征并在控制风险的前提下，根据相关法律法规，参与融资业务，不需要召开基金份额持有人大会。本基金的投资组合比例为：股票资产投资比例为基金资产的60%-95%；每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值的5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等；股指期货、国债期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率×80%+中证全债指数收益率×20%。

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》、《汇安鑫利优选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	42,314,171.83
等于：本金	42,310,189.75
加：应计利息	3,982.08
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	42,314,171.83

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	74,251,569.86	-	95,069,635.81	20,818,065.95
贵金属投资-金交	-	-	-	-

所黄金合约					
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		74,251,569.86	-	95,069,635.81	20,818,065.95

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	53,423.38
其中：交易所市场	53,423.38
银行间市场	-
应付利息	-

预提费用-审计费	17,356.09
预提费用-信息披露费	59,507.37
合计	130,286.84

6.4.7.7 实收基金

6.4.7.7.1 汇安鑫利优选混合A

金额单位：人民币元

项目 (汇安鑫利优选混合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	106,879,701.97	106,879,701.97
本期申购	255,023.51	255,023.51
本期赎回（以“-”号填列）	-15,381,117.74	-15,381,117.74
本期末	91,753,607.74	91,753,607.74

6.4.7.7.2 汇安鑫利优选混合C

金额单位：人民币元

项目 (汇安鑫利优选混合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	56,700,941.40	56,700,941.40
本期申购	446,364.13	446,364.13
本期赎回（以“-”号填列）	-9,432,124.28	-9,432,124.28
本期末	47,715,181.25	47,715,181.25

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 汇安鑫利优选混合A

单位：人民币元

项目 (汇安鑫利优选混合A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-27,788,441.68	8,375,556.02	-19,412,885.66

本期期初	-27,788,441.68	8,375,556.02	-19,412,885.66
本期利润	7,622,573.00	8,983,517.08	16,606,090.08
本期基金份额交易产生的变动数	3,330,625.08	-1,506,020.50	1,824,604.58
其中：基金申购款	-55,283.78	26,102.97	-29,180.81
基金赎回款	3,385,908.86	-1,532,123.47	1,853,785.39
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-16,835,243.60	15,853,052.60	-982,191.00

6.4.7.8.2 汇安鑫利优选混合C

单位：人民币元

项目 (汇安鑫利优选混合C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-15,669,323.60	4,281,874.82	-11,387,448.78
本期期初	-15,669,323.60	4,281,874.82	-11,387,448.78
本期利润	3,740,224.44	4,559,720.79	8,299,945.23
本期基金份额交易产生的变动数	2,204,828.55	-849,781.11	1,355,047.44
其中：基金申购款	-107,798.14	40,980.07	-66,818.07
基金赎回款	2,312,626.69	-890,761.18	1,421,865.51
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-9,724,270.61	7,991,814.50	-1,732,456.11

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	46,365.39
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	273.51
其他	92.77

合计	46,731.67

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	162,502,718.81
减：卖出股票成本总额	150,515,293.74
减：交易费用	224,396.21
买卖股票差价收入	11,763,028.86

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

无。

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

6.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.12.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.12.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.12.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.13 贵金属投资收益

6.4.7.13.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.13.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.13.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.13.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
股票投资产生的股利收益	631,439.54
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	631,439.54

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	13,543,237.87
——股票投资	13,543,237.87
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	13,543,237.87

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	295.71
合计	295.71

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
审计费用	17,356.09

信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
汇划手续费	205.00
合计	77,068.46

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
兴业银行股份有限公司	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2026年06月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	767,052.99	712,090.71
其中：应支付销售机构的客户维护费	380,029.74	355,479.40
应支付基金管理人的净管理费	387,023.25	356,611.31

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	127,842.15	118,681.85

注：支付基金托管人兴业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		
	汇安鑫利优选混合A	汇安鑫利优选混合C	合计
汇安基金管理有限责任公司	0.00	2,800.34	2,800.34
兴业银行股份有限公司	0.00	100,252.17	100,252.17
合计	-	103,052.51	103,052.51
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		
	汇安鑫利优选混合A	汇安鑫利优选混合C	合计
兴业银行股份有限公司	0.00	99,850.08	99,850.08
合计	-	99,850.08	99,850.08

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

汇安鑫利优选混合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	1,344,871.62	-
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	1,344,871.62	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	2.82%	-

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
兴业银行股份有限公司	42,314,171.83	46,365.39	17,316,605.16	30,747.28

注：本基金的银行存款由基金托管人兴业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
688797	臻宝科技	2026-06-16	1-6个月（含）	科创板打新限售	44.56	468.67	50	2,228.00	23,433.50	-
688712	北芯生命	2026-01-28	1-6个月（含）	科创板打新限售	17.52	35.92	575	10,074.00	20,654.00	-
688813	泰金新能	2026-03-24	1-6个月（含）	科创板打新限	26.28	172.09	96	2,522.88	16,520.64	-

				售						
688635	长进光子	2026-05-20	1-6个月（含）	科创板打新限售	40.98	308.19	53	2,171.94	16,334.07	-
601112	振石股份	2026-01-21	1-6个月（含）	新股锁定	11.18	17.59	129	1,442.22	2,269.11	-
603352	至信股份	2026-01-08	1-6个月（含）	新股锁定	21.88	25.52	45	984.60	1,148.40	-
603284	林平发展	2026-02-03	1-6个月（含）	新股锁定	37.88	34.87	28	1,060.64	976.36	-

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

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人兴业银行股份有限公司，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，本基金无债券投资或资产支持证券投资(2025年12月31日：同)。

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发行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、结算备付金及存出保证金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026年	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计

06月30日					
资产					
货币资金	42,314,171.83	-	-	-	42,314,171.83
结算备付金	75,088.63	-	-	-	75,088.63
存出保证金	53,545.29	-	-	-	53,545.29
交易性金融资产	-	-	-	95,069,635.81	95,069,635.81
应收申购款	-	-	-	21,831.28	21,831.28
资产总计	42,442,805.75	-	-	95,091,467.09	137,534,272.84
负债					
应付清算款	-	-	-	61.00	61.00
应付赎回款	-	-	-	487,651.49	487,651.49
应付管理人报酬	-	-	-	124,184.52	124,184.52
应付托管费	-	-	-	20,697.41	20,697.41
应付销售服务费	-	-	-	17,249.70	17,249.70
其他负债	-	-	-	130,286.84	130,286.84
负债总	-	-	-	780,130.96	780,130.96

计					
利率敏感度缺口	42,442,805.75	-	-	94,311,336.13	136,754,141.88
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	24,815,773.80	-	-	-	24,815,773.80
结算备付金	95,337.98	-	-	-	95,337.98
存出保证金	49,498.29	-	-	-	49,498.29
交易性金融资产	-	-	-	108,123,830.01	108,123,830.01
应收清算款	-	-	-	184,682.73	184,682.73
资产总计	24,960,610.07	-	-	108,308,512.74	133,269,122.81
负债					
应付清算款	-	-	-	34,832.23	34,832.23
应付赎回款	-	-	-	67,041.73	67,041.73
应付管理人报酬	-	-	-	132,790.91	132,790.91
应付托	-	-	-	22,131.85	22,131.85

管费					
应付销售服务费	-	-	-	18,975.20	18,975.20
其他负债	-	-	-	213,041.96	213,041.96
负债总计	-	-	-	488,813.88	488,813.88
利率敏感度缺口	24,960,610.07	-	-	107,819,698.86	132,780,308.93

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2026年6月30日，本基金未持有交易性债券投资和资产支持证券投资(2025年12月31日：同)，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60%-95%；每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值的5%的现金或者到期日在一年以内的政府

债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；股指期货、国债期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30日		上年度末 2025年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产－股票投资	95,069,635.81	69.52	108,123,830.01	81.43
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	95,069,635.81	69.52	108,123,830.01	81.43

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%	6,159,949.31	5,838,360.16
	沪深300指数下降5%	-6,159,949.31	-5,838,360.16

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	94,988,299.73	107,418,297.88
第二层次	-	646,242.00
第三层次	81,336.08	59,290.13
合计	95,069,635.81	108,123,830.01

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	95,069,635.81	69.12
	其中：股票	95,069,635.81	69.12
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	42,389,260.46	30.82
8	其他各项资产	75,376.57	0.05
9	合计	137,534,272.84	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	-	-
B	采矿业	3,425,800.00	2.51

C	制造业	72,893,321.81	53.30
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	3,879,360.00	2.84
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	13,252,524.00	9.69
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	1,618,630.00	1.18
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	95,069,635.81	69.52

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	688596	正帆科技	130,000	10,277,800.00	7.52
2	603986	兆易创新	10,600	8,639,000.00	6.32
3	688120	华海清科	25,000	8,054,500.00	5.89
4	688019	安集科技	20,000	6,789,200.00	4.96
5	002409	雅克科技	24,000	5,388,000.00	3.94

6	600418	江淮汽车	195,000	5,036,850.00	3.68
7	300750	宁德时代	11,000	4,323,110.00	3.16
8	300223	君正股份	10,000	2,489,000.00	1.82
9	600030	中信证券	80,000	2,298,400.00	1.68
10	601398	工商银行	300,000	2,121,000.00	1.55
11	002938	鹏鼎控股	18,000	1,896,840.00	1.39
12	601318	中国平安	38,000	1,814,120.00	1.33
13	601100	恒立液压	16,000	1,720,960.00	1.26
14	600999	招商证券	80,000	1,688,000.00	1.23
15	603259	药明康德	13,000	1,618,630.00	1.18
16	301031	中熔电气	13,320	1,591,074.00	1.16
17	600115	中国东航	400,000	1,524,000.00	1.11
18	600968	海油发展	430,000	1,431,900.00	1.05
19	601111	中国国航	235,200	1,422,960.00	1.04
20	000729	燕京啤酒	140,000	1,418,200.00	1.04
21	300415	伊之密	70,000	1,393,700.00	1.02
22	601901	方正证券	190,000	1,368,000.00	1.00
22	002415	海康威视	40,000	1,368,000.00	1.00
23	600132	重庆啤酒	33,000	1,362,900.00	1.00
24	601108	财通证券	156,400	1,352,860.00	0.99
25	301183	东田微	5,000	1,324,350.00	0.97
26	000166	申万宏源	300,000	1,320,000.00	0.97
27	000651	格力电器	35,000	1,312,500.00	0.96
28	601377	兴业证券	213,600	1,290,144.00	0.94
29	600519	贵州茅台	1,000	1,185,490.00	0.87
30	300124	汇川技术	17,000	1,127,610.00	0.82
31	001203	大中矿业	33,000	988,350.00	0.72
32	600029	南方航空	180,000	932,400.00	0.68
33	600989	宝丰能源	40,000	813,200.00	0.59
34	000807	云铝股份	35,000	774,900.00	0.57
35	300308	中际旭创	600	762,000.00	0.56

36	002532	天山铝业	70,000	751,100.00	0.55
37	600595	中孚实业	130,000	730,600.00	0.53
38	002812	恩捷股份	10,000	669,100.00	0.49
39	603308	应流股份	10,000	604,000.00	0.44
40	600988	赤峰黄金	15,000	394,800.00	0.29
41	002078	太阳纸业	30,000	374,700.00	0.27
42	000975	山金国际	20,000	340,000.00	0.25
43	688797	臻宝科技	493	329,152.23	0.24
44	600489	中金黄金	15,000	270,750.00	0.20
45	600312	平高电气	13,000	229,580.00	0.17
46	603337	杰克科技	2,000	72,460.00	0.05
47	688809	强一股份	41	25,543.00	0.02
48	688712	北芯生命	575	20,654.00	0.02
49	688813	泰金新能	96	16,520.64	0.01
50	688635	长进光子	53	16,334.07	0.01
51	601112	振石股份	129	2,269.11	0.00
52	603352	至信股份	45	1,148.40	0.00
53	603284	林平发展	28	976.36	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	300223	君正股份	4,816,693.00	3.63
2	300855	图南股份	3,887,680.00	2.93
3	688123	聚辰股份	3,775,461.09	2.84
4	600968	海油发展	2,687,300.00	2.02
5	000568	泸州老窖	2,609,212.00	1.97
6	301396	宏景科技	2,382,306.04	1.79

7	000960	锡业股份	2,361,028.00	1.78
8	600418	江淮汽车	2,198,976.65	1.66
9	601398	工商银行	2,136,000.00	1.61
10	688008	澜起科技	2,120,456.10	1.60
11	688041	海光信息	1,998,218.22	1.50
12	002938	鹏鼎控股	1,959,880.00	1.48
13	002078	太阳纸业	1,833,170.00	1.38
14	688500	慧辰股份	1,828,611.00	1.38
15	688019	安集科技	1,781,179.11	1.34
16	000338	潍柴动力	1,753,164.00	1.32
17	600999	招商证券	1,712,118.00	1.29
18	600132	重庆啤酒	1,710,577.00	1.29
19	301183	东田微	1,701,751.00	1.28
20	300666	江丰电子	1,694,886.00	1.28

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	688123	聚辰股份	5,015,331.28	3.78
2	300855	图南股份	4,615,112.00	3.48
3	300223	君正股份	4,170,701.00	3.14
4	000568	泸州老窖	4,002,647.40	3.01
5	301396	宏景科技	3,638,203.00	2.74
6	000338	潍柴动力	3,388,348.00	2.55
7	688008	澜起科技	3,342,348.07	2.52
8	000960	锡业股份	2,413,299.00	1.82
9	300666	江丰电子	2,369,974.00	1.78

10	002179	中航光电	2,320,260.00	1.75
11	688041	海光信息	2,220,089.74	1.67
12	600988	赤峰黄金	2,164,123.00	1.63
13	600941	中国移动	2,143,968.00	1.61
14	603171	税友股份	2,109,092.00	1.59
15	603337	杰克科技	2,099,066.00	1.58
16	002555	三七互娱	2,053,602.04	1.55
17	600741	华域汽车	2,008,960.00	1.51
18	688603	天承科技	1,973,776.07	1.49
19	002001	新 和 成	1,911,261.00	1.44
20	300926	博俊科技	1,907,741.00	1.44

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	123,917,861.67
卖出股票收入（成交）总额	162,502,718.81

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期未投资股指期货。

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发行主体中，正帆科技、中信证券、工商银行在报告编制日前一年内受到过公开处罚，本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策流程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主体本期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、处罚的情况。

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	53,545.29
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	21,831.28
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	75,376.57

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
汇安鑫利优选混合A	870	105,463.92	0.00	0.00%	91,753,607.74	100.00%
汇安鑫利优选混合C	998	47,810.80	1,344,871.62	2.82%	46,370,309.63	97.18%
合计	1,852	75,307.12	1,344,871.62	0.96%	138,123,917.37	99.04%

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	98.26%

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	汇安鑫利优选混合A	2,711,351.67	2.9550%
	汇安鑫利优选混合C	0.00	0.0000%
	合计	2,711,351.67	1.9441%

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	汇安鑫利优选混合A	0
	汇安鑫利优选混合C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	汇安鑫利优选混合A	>100
	汇安鑫利优选混合C	0
	合计	>100

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	汇安鑫利优选混合A	汇安鑫利优选混合C
基金合同生效日(2021年04月02日)基金份额总额	275,124,177.91	148,371,480.15
本报告期期初基金份额总额	106,879,701.97	56,700,941.40
本报告期基金总申购份额	255,023.51	446,364.13
减：本报告期基金总赎回份额	15,381,117.74	9,432,124.28
本报告期基金拆分变动份额	-	-

本报告期期末基金份额总额	91,753,607.74	47,715,181.25

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金在报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金在报告期内基金投资策略没有改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自2024年9月14日至本报告期末聘任容诚会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务，本报告期内未发生变动。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人未受到调查或处罚。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人相关从业人员未受到调查或处罚。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

报告期内，本基金托管人在开展基金托管业务过程中无受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

报告期内，本基金托管人相关从业人员在开展基金托管业务过程中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	
财通证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	2	81,096,689.92	28.33%	35,350.28	28.33%	-
广发证券	2	87,828,069.92	30.68%	38,283.22	30.68%	-
银河证券	2	117,358,980.76	40.99%	51,157.09	40.99%	-
中金公司	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

本基金本报告期内新增交易单元:方正证券1个、银河证券1个。

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
财通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-

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	汇安鑫利优选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	汇安鑫利优选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	汇安鑫利优选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	汇安鑫利优选混合型证券投资基金（2026年第1号）招募说明书（更新）	规定报刊和/或公司网站	2026-06-18
8	汇安鑫利优选混合型证券投资基金基金产品资料概要（更新）	规定报刊和/或公司网站	2026-06-18
9	汇安基金管理有限责任公司关于旗下部分基金在直销渠道开展费率优惠活动的公告	规定报刊和/或公司网站	2026-06-30

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

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鑫利优选混合型证券投资基金募集的文件

（2）《汇安鑫利优选混合型证券投资基金基金合同》

（3）《汇安鑫利优选混合型证券投资基金招募说明书》

（4）《汇安鑫利优选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