

汇安嘉盈一年持有期债券型证券投资基金

2026 年中期报告

2026 年 06 月 30 日

基金管理人:汇安基金管理有限责任公司

基金托管人:中国邮政储蓄银行股份有限公司

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。

基金托管人中国邮政储蓄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	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	16
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	17
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	48
7.1 期末基金资产组合情况	48
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	49
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	49
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	67
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	69
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	70
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	70
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	70
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	70
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	70
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	71
7.12 投资组合报告附注	71
§8 基金份额持有人信息	72

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	72
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	73
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	73
§9 开放式基金份额变动	73
§10 重大事件揭示	74
10.1 基金份额持有人大会决议	74
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	74
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	74
10.4 基金投资策略的改变	74
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	74
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	75
10.8 其他重大事件	76
§11 影响投资者决策的其他重要信息	77
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	77
§12 备查文件目录	77
12.1 备查文件目录	77
12.2 存放地点	77
12.3 查阅方式	77

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	汇安嘉盈一年持有期债券型证券投资基金		
基金简称	汇安嘉盈一年持有期债券		
基金主代码	007315		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2021年02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	中国邮政储蓄银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	12,155,742.82份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称	汇安嘉盈一年持有期债券A	汇安嘉盈一年持有期债券C	汇安嘉盈一年持有期债券E
下属分级基金的交易代码	007315	010270	023953
报告期末下属分级基金的份额总额	7,062,496.27份	4,941,895.60份	151,350.95份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险并保证充分流动性的前提下，通过积极主动的资产管理，力争为投资者提供稳健持续增长的投资收益。
投资策略	本基金的主要投资策略包括资产配置策略、固定收益类金融工具投资策略、资产支持证券投资策略、股票投资策略、国债期货投资策略。
业绩比较基准	中债综合指数收益率*90%+沪深300指数收益率*10%
风险收益特征	本基金为债券型基金，理论上其长期平均预期风险和预期收益率低于股票型基金和混合型基金，高于货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
----	-------	-------

名称	汇安基金管理有限责任公司		中国邮政储蓄银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	郭冬青	张立学
	联系电话	010-56711600	010-68858126
	电子邮箱	guodq@huianfund.cn	zhanglixue@psbcoa.com.cn
客户服务电话	010-56711690		95580
传真	010-56711640		010-86353609
注册地址	上海市虹口区欧阳路218弄1号2楼215室		北京市西城区金融大街3号
办公地址	北京市东城区东直门南大街5号中青旅大厦13层；上海市虹口区东大名路501号白玉兰大厦36层		北京市西城区金融大街3号A座
邮政编码	100007		100808
法定代表人	刘强		郑国雨

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
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住所

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)		
	汇安嘉盈一 年持有期债 券A	汇安嘉盈一 年持有期债 券C	汇安嘉盈一 年持有期债 券E
本期已实现收益	58,899.01	29,192.50	775.03
本期利润	52,694.69	27,229.98	-32.36
加权平均基金份额本期利润	0.0068	0.0053	-0.0004
本期加权平均净值利润率	0.72%	0.57%	-0.04%
本期基金份额净值增长率	0.71%	0.51%	0.67%
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	-631,738.65	-540,539.95	-13,699.73
期末可供分配基金份额利润	-0.0894	-0.1094	-0.0905
期末基金资产净值	6,702,141.70	4,589,061.14	143,472.34
期末基金份额净值	0.9490	0.9286	0.9479
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	-5.10%	-7.14%	4.50%

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

汇安嘉盈一年持有期债券A

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

		准差②	率③	率标准差④		
过去三个月	0.69%	0.15%	1.74%	0.14%	-1.05%	0.01%
过去六个月	0.71%	0.16%	1.62%	0.12%	-0.91%	0.04%
过去一年	3.65%	0.14%	1.98%	0.11%	1.67%	0.03%
过去三年	-4.08%	0.30%	7.80%	0.11%	-11.88%	0.19%
过去五年	-6.68%	0.31%	7.84%	0.11%	-14.52%	0.20%
自基金合同生效起至今	-5.10%	0.30%	8.11%	0.12%	-13.21%	0.18%

汇安嘉盈一年持有期债券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	0.58%	0.15%	1.74%	0.14%	-1.16%	0.01%
过去六个月	0.51%	0.16%	1.62%	0.12%	-1.11%	0.04%
过去一年	3.24%	0.14%	1.98%	0.11%	1.26%	0.03%
过去三年	-5.24%	0.30%	7.80%	0.11%	-13.04%	0.19%
过去五年	-8.54%	0.31%	7.84%	0.11%	-16.38%	0.20%
自基金合同生效起至今	-7.14%	0.30%	8.11%	0.12%	-15.25%	0.18%

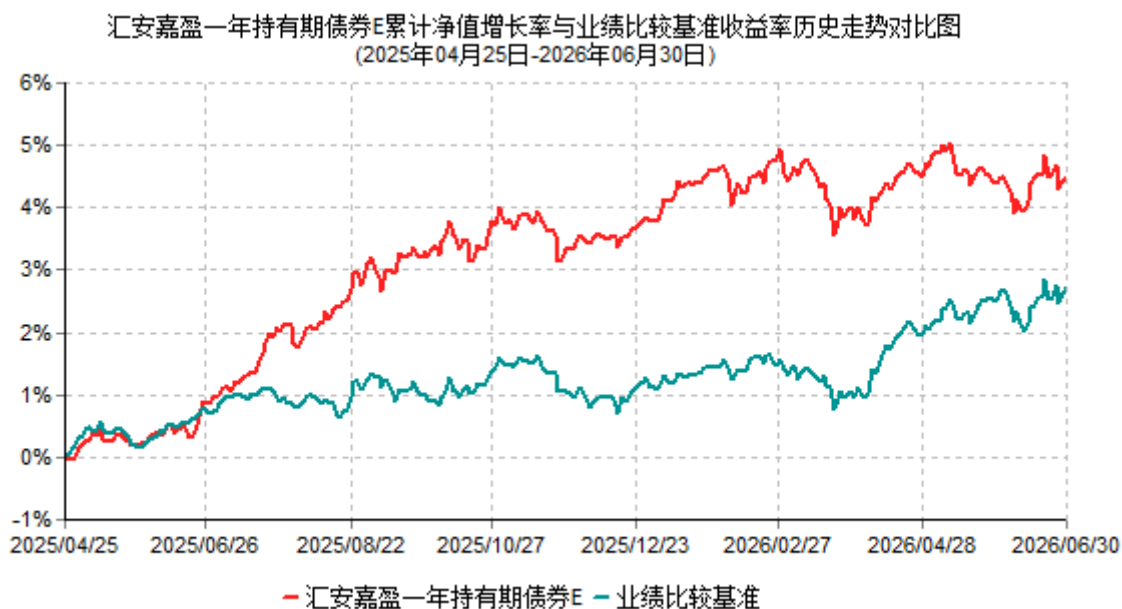
汇安嘉盈一年持有期债券E

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	0.66%	0.15%	1.74%	0.14%	-1.08%	0.01%
过去六个月	0.67%	0.16%	1.62%	0.12%	-0.95%	0.04%
过去一年	3.49%	0.14%	1.98%	0.11%	1.51%	0.03%
自基金合同生效起至今	4.50%	0.13%	2.72%	0.10%	1.78%	0.03%

注：本基金自2025年4月23日起增设E类份额。

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：①本报告期，本基金投资比例符合基金合同要求。

②本基金自2025年4月23日起增设E类份额。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截至2026年6月30日，公司旗下管理71只公募基金：

汇安丰融灵活配置混合型证券投资基金

汇安嘉汇纯债债券型证券投资基金

汇安丰恒灵活配置混合型证券投资基金

汇安嘉源纯债债券型证券投资基金

汇安丰利灵活配置混合型证券投资基金

汇安丰泽灵活配置混合型证券投资基金

汇安沪深300指数增强型证券投资基金

汇安嘉裕纯债债券型证券投资基金

汇安多策略灵活配置混合型证券投资基金

汇安资产轮动灵活配置混合型证券投资基金
汇安裕华纯债定期开放债券型发起式证券投资基金
汇安成长优选灵活配置混合型证券投资基金
汇安稳裕债券型证券投资基金
汇安趋势动力股票型证券投资基金
汇安量化优选灵活配置混合型证券投资基金
汇安裕阳三年持有期混合型证券投资基金
汇安短债债券型证券投资基金
汇安嘉鑫纯债债券型证券投资基金
富时中国A50交易型开放式指数证券投资基金
汇安核心成长混合型证券投资基金
汇安鼎利纯债债券型证券投资基金
汇安多因子混合型证券投资基金
汇安行业龙头混合型证券投资基金
汇安中短债债券型证券投资基金
汇安嘉诚债券型证券投资基金
汇安量化先锋混合型证券投资基金
汇安中债-广西壮族自治区公司信用类债券指数证券投资基金
汇安宜创量化精选混合型证券投资基金
汇安嘉盛纯债债券型证券投资基金
汇安信利债券型证券投资基金
汇安裕和纯债债券型证券投资基金
汇安上证证券交易型开放式指数证券投资基金
汇安嘉利混合型证券投资基金
汇安核心资产混合型证券投资基金
汇安裕鑫12个月定期开放纯债债券型发起式证券投资基金
汇安价值蓝筹混合型证券投资基金
汇安消费龙头混合型证券投资基金
汇安恒鑫12个月定期开放纯债债券型发起式证券投资基金
汇安中证500指数增强型证券投资基金
汇安泓阳三年持有期混合型证券投资基金
汇安恒利39个月定期开放纯债债券型证券投资基金
汇安盛鑫三年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金
汇安嘉盈一年持有期债券型证券投资基金
汇安均衡优选混合型证券投资基金

汇安核心价值混合型证券投资基金
汇安鑫利优选混合型证券投资基金
汇安泓利一年持有期混合型证券投资基金
汇安鑫泽稳健一年持有期混合型证券投资基金
汇安信泰稳健一年持有期混合型证券投资基金
汇安优势企业精选混合型证券投资基金
汇安永利30天持有期短债债券型证券投资基金
汇安润阳三年持有期混合型证券投资基金
汇安永福90天持有期中短债债券型证券投资基金
汇安裕同纯债债券型证券投资基金
汇安添利18个月持有期混合型证券投资基金
汇安远见成长混合型证券投资基金
汇安品质优选混合型证券投资基金
汇安价值先锋混合型证券投资基金
汇安裕盈纯债债券型证券投资基金
汇安裕泰纯债债券型证券投资基金
汇安中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金
汇安均衡成长混合型证券投资基金
汇安行业优选混合型证券投资基金
汇安中债0-3年政策性金融债指数证券投资基金
汇安景气成长混合型证券投资基金
汇安中证A500指数证券投资基金
汇安裕宏利率债债券型证券投资基金
汇安聚利债券型证券投资基金
汇安质选增利债券型证券投资基金
汇安中证红利低波动100指数型证券投资基金
汇安成长领航混合型证券投资基金

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金 经理（助理） 期限		证券 从业 年限	说明
		任职 日期	离任 日期		

金鸿峰	多策略组基金经理、 本基金的基金经理	2025- 03-04	-	10年	金鸿峰女士，中央财经大学国防经济学硕士研究生，10年证券、基金行业从业经验。曾任北京市农产品电子商务公司市场部经理，2016年5月加入汇安基金管理有限责任公司，现任多策略组基金经理。2021年7月23日至2022年7月28日，任汇安嘉裕纯债债券型证券投资基金基金经理；2021年8月4日至2022年8月16日，任汇安裕和纯债债券型证券投资基金基金经理；2021年7月13日至2025年3月4日，任汇安中债-广西壮族自治区公司信用类债券指数证券投资基金基金经理；2024年9月25日至2025年12月1日，任汇安中债0-3年政策性金融债指数证券投资基金基金经理；2021年7月13日至今，任汇安嘉汇纯债债券型证券投资基金基金经理；2021年7月13日至今，任汇安丰恒灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2021年7月23日至今，任汇安嘉源纯债债券型证券投资基金基金经理；2021年7月28日至今，任汇安嘉鑫纯债债券型证券投资基金基金经理；2021年7月28日至今，任汇安鼎利纯债债券型证券投资
-----	-----------------------	----------------	---	-----	---

					资基金基金经理；2021年8月4日至今，任汇安嘉盛纯债债券型证券投资基金基金经理；2022年8月16日至今，任汇安裕裕债券型证券投资基金基金经理；2022年11月8日至今，任汇安裕泰纯债债券型证券投资基金基金经理；2025年3月4日至今，任汇安嘉盈一年持有期债券型证券投资基金基金经理；2025年12月1日至今，任汇安质选增利债券型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	---

1、上述任职日期、离职日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

2、本基金无基金经理助理。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期末本基金的基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规的规定及基金合同、招募说明书等有关基金法律文件的约定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2026年一季度，债市呈短强长震、曲线陡峭化，10年国债在1.78%-1.90%之间震荡，1年期下行至1.3%以下。信用债收益率普降、利差普遍收窄。债市行情受股债跷跷板、流动性充裕、地缘冲突、通胀预期等交织驱动；叠加银行配置加力、供给阶段性扰动，整体呈现出上有顶下有底的震荡行情。二季度债市整体偏强运行，4月资金整体偏松，利率中枢下移，杠杆套息策略有效，5月经济数据呈现出需求端边际走弱的态势，叠加资金价格持续低位，市场交易由短及长，长端收益率进一步下探，6月随着政府债发行缴款以及资金面中枢抬升，债市由此前的趋势性行情转为窄幅震荡。信用债方面，二永债在5月相对强势，特别是4-5年的二永债表现较好，主因是普信债票息较低，利差持续压缩难度较大，机构在低利率环境下需要兼顾票息和流动性的资产，因此二永债的需求较高，但随着6月利率债进入震荡期，二永也随之调整。本产品权益仓位在20%以下，债券久期整体偏短，由于产品规模较小，债券以交易所活跃券为主。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末汇安嘉盈一年持有期债券A基金份额净值为0.9490元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.71%，同期业绩比较基准收益率为1.62%；截至报告期末汇安嘉盈一年持有期债券C基金份额净值为0.9286元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.51%，同期业绩比较基准收益率为1.62%；截至报告期末汇安嘉盈一年持有期债券E基金份额净值为0.9479元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.67%，同期业绩比较基准收益率为1.62%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

往后看，经济弱修复格局依然对债市有支撑，生产端和出口相对有韧性，但内需偏弱压低了名义增长以及融资需求，同时也制约了上游价格向终端产品价格传导，通胀数

据更多是结构性的，而非总需求推动的全面抬升。政策不支持大幅度收紧，特别是货币政策方面，央行或更倾向于对流动性的维稳，避免资金大幅度波动。另外需要关注三季度的供给高峰期，央行的对冲工具，以及配置盘的承接能力。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未发生利润分配情况。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

截至报告期末，本基金连续超过六十个工作日基金资产净值低于五千万元，本基金管理人已按法规要求向证监会报送解决方案。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的情形。为减轻基金固定费用支出给投资者造成的负担，切实保障基金份额持有人利益，2024年07月01日至本报告期末由基金管理人承担本基金相关固定费用（包括审计费、信息披露费等）。

§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，中国邮政储蓄银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在汇安嘉盈一年持有期债券型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《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有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《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，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内，本基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：汇安嘉盈一年持有期债券型证券投资基金

报告截止日：2026年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	522,769.42	479,751.61
结算备付金		18,378.58	-
存出保证金		1,446.74	999.96
交易性金融资产	6.4.7.2	10,865,807.10	11,678,781.86
其中：股票投资		1,420,473.26	1,122,105.80
基金投资		-	-
债券投资		9,445,333.84	10,556,676.06
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	-	700,038.36
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		50,098.00	238.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		11,458,499.84	12,859,809.79
负债和净资产	附注号	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		12,842.75	9,393.25
应付管理人报酬		7,570.65	8,795.46
应付托管费		1,514.16	1,759.10
应付销售服务费		1,512.58	1,759.06
应付投资顾问费		-	-
应交税费		274.54	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	109.98	245.21
负债合计		23,824.66	21,952.08
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	12,155,742.82	13,731,251.32
未分配利润	6.4.7.8	-721,067.64	-893,393.61
净资产合计		11,434,675.18	12,837,857.71
负债和净资产总计		11,458,499.84	12,859,809.79

注：报告截止日2026年6月30日，基金份额总额12,155,742.82份，其中汇安嘉盈一年持有期债券A基金份额净值0.9490元，份额总额7,062,496.27份；汇安嘉盈一年持有期债券C基金份额净值0.9286元，份额总额4,941,895.60份；汇安嘉盈一年持有期债券E基金份额净值0.9479元，份额总额151,350.95份。

6.2 利润表

会计主体：汇安嘉盈一年持有期债券型证券投资基金

本报告期：2026年01月01日至2026年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026年01月01日至 2026年06月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至202 5年06月30日
一、营业总收入		147,742.07	252,474.11
1.利息收入		1,698.64	1,803.16
其中：存款利息收入	6.4.7.9	1,506.86	1,160.18
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		191.78	642.98
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		154,183.66	308,652.83
其中：股票投资收益	6.4.7.10	7,513.43	137,174.51
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	133,124.68	147,772.51
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	13,545.55	23,705.81
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	-8,974.23	-57,981.88
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	834.00	-
减：二、营业总支出		67,849.76	86,493.38
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	48,533.02	56,341.05
2.托管费	6.4.10.2.2	9,706.62	11,268.24
3.销售服务费	6.4.10.2.3	9,560.60	12,082.01
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		-	6,781.89
其中：卖出回购金融资产支出		-	6,781.89
6.信用减值损失		-	-
7.税金及附加		49.52	20.19
8.其他费用	6.4.7.18	-	-
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		79,892.31	165,980.73
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		79,892.31	165,980.73
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		79,892.31	165,980.73

6.3 净资产变动表

会计主体：汇安嘉盈一年持有期债券型证券投资基金

本报告期：2026年01月01日至2026年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期
	2026年01月01日至2026年06月30日

	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	13,731,251.32	-893,393.61	12,837,857.71
二、本期期初净资产	13,731,251.32	-893,393.61	12,837,857.71
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-1,575,508.50	172,325.97	-1,403,182.53
（一）、综合收益总额	-	79,892.31	79,892.31
（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）	-1,575,508.50	92,433.66	-1,483,074.84
其中：1.基金申购款	490,949.55	-31,675.61	459,273.94
2.基金赎回款	-2,066,458.05	124,109.27	-1,942,348.78
（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	12,155,742.82	-721,067.64	11,434,675.18
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	16,378,456.41	-1,673,104.47	14,705,351.94
二、本期期初净资产	16,378,456.41	-1,673,104.47	14,705,351.94

三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-1,226,020.12	289,671.34	-936,348.78
（一）、综合收益总额	-	165,980.73	165,980.73
（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）	-1,226,020.12	123,690.61	-1,102,329.51
其中：1.基金申购款	161,904.18	-16,260.49	145,643.69
2.基金赎回款	-1,387,924.30	139,951.10	-1,247,973.20
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	15,152,436.29	-1,383,433.13	13,769,003.16

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

汇安嘉盈一年持有期债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2019]666号《关于准予汇安鼎信三个月定期开放纯债债券型证券投资基金注册的批复》和[2020]2156号《关于准予汇安鼎信三个月定期开放纯债券投资基金变更注册的批复》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《汇安嘉盈一年持有期债券型证券投资基金基金

合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集256,503,399.67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0155号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《汇安嘉盈一年持有期债券型证券投资基金基金合同》于2021年2月2日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为256,597,544.94份基金份额，其中认购资金利息折合94,145.27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，基金托管人为中国邮政储蓄银行股份有限公司。

根据《关于汇安嘉盈一年持有期债券型证券投资基金增设E类基金份额并修改基金合同及托管协议等事项的公告》、《汇安嘉盈一年持有期债券型证券投资基金基金合同》和《汇安嘉盈一年持有期债券型证券投资基金招募说明书》的规定，本基金自2025年4月23日起增设E类基金份额，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，且从本类别基金资产净值中不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，且从本类别基金资产净值中计提销售服务费的基金份额，称为C类基金份额、E类基金份额；C类基金份额和E类基金份额收取不同的销售服务费。本基金A类基金份额、C类基金份额和E类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金A类基金份额、C类基金份额和E类基金份额将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。

本基金每份基金份额设置1年锁定持有期。锁定持有期到期后进入开放持有期，每份基金份额自开放持有期首日起才能办理赎回及转换转出业务。锁定持有期指基金合同生效日(对认购份额而言，下同)、基金份额申购确认日(对申购份额而言，下同)或基金份额转换转入确认日(对转换转入份额而言，下同)起(即锁定持有期起始日)，至基金合同生效日、基金份额申购确认日或基金份额转换转入确认日次1年的年度对日的前一日(含当日，即锁定持有期到期日)之间的区间，若该年度对日为非工作日或不存在对应日期的，则顺延至下一个工作日。基金份额在锁定持有期内不办理赎回及转换转出业务。每份基金份额的锁定持有期结束后即进入开放持有期，开放持有期首日为锁定持有期到期日下一个工作日，即基金合同生效日、基金份额申购确认日或基金份额转换转入确认日次1年的年度对日。每份基金份额在开放持有期期间的开放日可以办理赎回及转换转出业务。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《汇安嘉盈一年持有期债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票)、债券(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、地方政府债、政府机构债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、可转换债券(含可分离交易可转债)、

可交换债券)、债券回购、资产支持证券、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、国债期货,以及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金仅投资于债项评级为AA(含)以上的信用债券,如无债项评级则主体评级在AA(含)以上。本基金的投资组合比例为:本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%;每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后,现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金的业绩比较基准为:中债综合指数收益率 $\times 90\%$ +沪深300指数收益率 $\times 10\%$ 。

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》、《汇安嘉盈一年持有期债券型证券投资基金基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定,开放式基金在基金合同生效后,连续60个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5,000万元情形的,基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案,如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等,并召开基金份额持有人大会进行表决。于2026年6月30日,本基金出现连续60个工作日基金资产净值低于5,000万元的情形,本基金的基金管理人已向中国证监会报告并在评估后续处理方案,故本财务报表仍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	522,769.42
等于：本金	522,665.58
加：应计利息	103.84
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	522,769.42

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		1,196,961.68	-	1,420,473.26	223,511.58
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	9,403,702.61	37,343.84	9,445,333.84	4,287.39
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	9,403,702.61	37,343.84	9,445,333.84	4,287.39
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		10,600,664.29	37,343.84	10,865,807.10	227,798.97

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	109.98
其中：交易所市场	109.98
银行间市场	-
应付利息	-
合计	109.98

6.4.7.7 实收基金

6.4.7.7.1 汇安嘉盈一年持有期债券A

金额单位：人民币元

项目 (汇安嘉盈一年持有期债券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	8,205,044.95	8,205,044.95
本期申购	47,388.65	47,388.65
本期赎回（以“-”号填列）	-1,189,937.33	-1,189,937.33
本期末	7,062,496.27	7,062,496.27

6.4.7.7.2 汇安嘉盈一年持有期债券C

金额单位：人民币元

项目 (汇安嘉盈一年持有期债券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	5,525,882.77	5,525,882.77
本期申购	292,533.55	292,533.55
本期赎回（以“-”号填列）	-876,520.72	-876,520.72
本期末	4,941,895.60	4,941,895.60

6.4.7.7.3 汇安嘉盈一年持有期债券E

金额单位：人民币元

项目	本期
----	----

(汇安嘉盈一年持有期债券E)	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	323.60	323.60
本期申购	151,027.35	151,027.35
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	151,350.95	151,350.95

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 汇安嘉盈一年持有期债券A

单位：人民币元

项目 (汇安嘉盈一年持有期 债券A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-796,935.04	323,833.50	-473,101.54
本期期初	-796,935.04	323,833.50	-473,101.54
本期利润	58,899.01	-6,204.32	52,694.69
本期基金份额交易产 生的变动数	106,297.38	-46,245.10	60,052.28
其中：基金申购款	-4,444.29	2,041.05	-2,403.24
基金赎回款	110,741.67	-48,286.15	62,455.52
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-631,738.65	271,384.08	-360,354.57

6.4.7.8.2 汇安嘉盈一年持有期债券C

单位：人民币元

项目 (汇安嘉盈一年持有期 债券C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-635,769.07	215,495.90	-420,273.17
本期期初	-635,769.07	215,495.90	-420,273.17
本期利润	29,192.50	-1,962.52	27,229.98

本期基金份额交易产生的变动数	66,036.62	-25,827.89	40,208.73
其中：基金申购款	-33,015.58	11,570.56	-21,445.02
基金赎回款	99,052.20	-37,398.45	61,653.75
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-540,539.95	187,705.49	-352,834.46

6.4.7.8.3 汇安嘉盈一年持有期债券E

单位：人民币元

项目 (汇安嘉盈一年持有期 债券E)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-31.68	12.78	-18.90
本期期初	-31.68	12.78	-18.90
本期利润	775.03	-807.39	-32.36
本期基金份额交易产生的变动数	-14,443.08	6,615.73	-7,827.35
其中：基金申购款	-14,443.08	6,615.73	-7,827.35
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-13,699.73	5,821.12	-7,878.61

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	1,491.88
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	13.35
其他	1.63
合计	1,506.86

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	276,072.00
减：卖出股票成本总额	268,020.55
减：交易费用	538.02
买卖股票差价收入	7,513.43

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	79,667.44
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	53,457.24
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	133,124.68

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）	14,241,932.67

成交总额	
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	14,087,726.76
减：应计利息总额	100,748.67
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	53,457.24

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	13,545.55
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	13,545.55

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	-8,974.23
——股票投资	42,393.01
——债券投资	-51,367.24
——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	-8,974.23

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
基金赎回费收入	-
其他	834.00
合计	834.00

6.4.7.18 其他费用

无。

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

中国邮政储蓄银行股份有限公司	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	上年度可比期间 2025年01月01日至20
----	----------------------	---------------------------

	26年06月30日	25年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	48,533.02	56,341.05
其中：应支付销售机构的客户维护费	24,254.75	28,157.52
应支付基金管理人的净管理费	24,278.27	28,183.53

注：支付基金管理人汇安基金管理有限责任公司的管理人报酬按前一日基金资产净值0.80%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值 × 0.80% / 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	9,706.62	11,268.24

注：支付基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值0.16%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值 × 0.16% / 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			
	汇安嘉盈一年持有 期债券A	汇安嘉盈一年持有 期债券C	汇安嘉盈一年持有 期债券E	合计
汇安基金 管理有限 责任公司	0.00	0.08	0.00	0.08
中国邮政 储蓄银行 股份有限 公司	0.00	1,616.97	0.00	1,616. 97
合计	-	1,617.05	-	1,617.

				05
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			
	汇安嘉盈一年持有 期债券A	汇安嘉盈一年持有 期债券C	汇安嘉盈一年持有 期债券E	合计
汇安基金 管理有限 责任公司	0.00	0.17	0.00	0.17
中国邮政 储蓄银行 股份有限 公司	0.00	1,851.73	0.00	1,851. 73
合计	-	1,851.90	-	1,851. 90

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、E类基金份额的基金资产净值的约定年费率计提，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。C类基金份额、E类基金份额约定的销售服务费年费率分别为0.40%、0.10%。其计算公式为：

日销售服务费=前一日C/E类基金份额的基金资产净值 × 约定年费率/ 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 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
中国邮政储蓄银行股份有限公司	522,769.42	1,491.88	71,605.71	863.85

注：本基金的银行存款由基金托管人中国邮政储蓄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

于本报告期内，基金管理人自主承担本基金部分审计费等固定费用。(上年度对比期间：同。)

6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

无。

6.4.12 期末（2026年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

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

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

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	5,120,967.37	1,212,115.73
合计	5,120,967.37	1,212,115.73

注：未评级部分为国债。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
AAA	-	-
AAA以下	-	-

未评级	4,324,366.47	9,344,560.33
合计	4,324,366.47	9,344,560.33

注：未评级部分为国债。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可依据基金合同约定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。

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026年 06月30 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	522,769.42	-	-	-	522,769.42
结算备付金	18,378.58	-	-	-	18,378.58
存出保证金	1,446.74	-	-	-	1,446.74
交易性金融资产	5,120,967.37	4,324,366.47	-	1,420,473.26	10,865,807.10
应收申购款	-	-	-	50,098.00	50,098.00
资产总计	5,663,562.11	4,324,366.47	-	1,470,571.26	11,458,499.84
负债					
应付赎回款	-	-	-	12,842.75	12,842.75
应付管理人报酬	-	-	-	7,570.65	7,570.65
应付托管费	-	-	-	1,514.16	1,514.16
应付销售服务费	-	-	-	1,512.58	1,512.58
应交税	-	-	-	274.54	274.54

费					
其他负债	-	-	-	109.98	109.98
负债总计	-	-	-	23,824.66	23,824.66
利率敏感度缺口	5,663,562.11	4,324,366.47	-	1,446,746.60	11,434,675.18
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	479,751.61	-	-	-	479,751.61
存出保证金	999.96	-	-	-	999.96
交易性金融资产	4,533,071.65	6,023,604.41	-	1,122,105.80	11,678,781.86
买入返售金融资产	700,038.36	-	-	-	700,038.36
应收申购款	-	-	-	238.00	238.00
资产总计	5,713,861.58	6,023,604.41	-	1,122,343.80	12,859,809.79
负债					
应付赎回款	-	-	-	9,393.25	9,393.25
应付管	-	-	-	8,795.46	8,795.46

理人报酬					
应付托管费	-	-	-	1,759.10	1,759.10
应付销售服务费	-	-	-	1,759.06	1,759.06
其他负债	-	-	-	245.21	245.21
负债总计	-	-	-	21,952.08	21,952.08
利率敏感度缺口	5,713,861.58	6,023,604.41	-	1,100,391.72	12,837,857.71

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币元)	
		本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
	市场利率下降25个基点	31,543.89	41,283.95
	市场利率上升25个基点	-31,329.73	-40,966.93

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。本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%，每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。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	1,420,473.26	12.42	1,122,105.80	8.74
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	1,420,473.26	12.42	1,122,105.80	8.74
----	--------------	-------	--------------	------

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%	-	60,010.92
	沪深300指数下降5%	-	-60,010.92

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	1,420,473.26	1,122,105.80
第二层次	9,445,333.84	10,556,676.06
第三层次	-	-
合计	10,865,807.10	11,678,781.86

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	1,420,473.26	12.40
	其中：股票	1,420,473.26	12.40
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	9,445,333.84	82.43
	其中：债券	9,445,333.84	82.43
	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	541,148.00	4.72

8	其他各项资产	51,544.74	0.45
9	合计	11,458,499.84	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	10,171.00	0.09
B	采矿业	71,118.80	0.62
C	制造业	924,103.60	8.08
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	45,594.00	0.40
E	建筑业	16,406.00	0.14
F	批发和零售业	9,674.00	0.08
G	交通运输、仓储和邮政业	35,788.00	0.31
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	50,029.00	0.44
J	金融业	201,113.46	1.76
K	房地产业	10,677.00	0.09
L	租赁和商务服务业	11,311.80	0.10
M	科学研究和技术服务业	14,901.00	0.13
N	水利、环境和公共设施管理业	3,673.60	0.03
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	540.00	0.00
Q	卫生和社会工作	4,906.00	0.04
R	文化、体育和娱乐业	7,108.00	0.06
S	综合	3,358.00	0.03
	合计	1,420,473.26	12.42

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	300750	宁德时代	100	39,301.00	0.34
2	002384	东山精密	100	26,235.00	0.23
3	601318	中国平安	400	19,096.00	0.17
4	000988	华工科技	100	18,461.00	0.16
5	600183	生益科技	100	17,340.00	0.15
6	300408	三环集团	100	16,690.00	0.15
7	300274	阳光电源	100	15,902.00	0.14
8	002463	沪电股份	100	15,280.00	0.13
9	002353	杰瑞股份	100	15,250.00	0.13
10	000333	美的集团	200	15,106.00	0.13
11	002008	大族激光	100	15,011.00	0.13
12	600036	招商银行	400	14,200.00	0.12
13	002475	立讯精密	200	14,080.00	0.12
14	601899	紫金矿业	500	12,570.00	0.11
15	603259	药明康德	100	12,451.00	0.11
16	300136	信维通信	100	11,925.00	0.10
17	600487	亨通光电	100	10,934.00	0.10
18	603019	中科曙光	100	10,723.00	0.09
19	300054	鼎龙股份	100	10,597.00	0.09
20	600900	长江电力	400	10,588.00	0.09
21	000725	京东方 A	1,200	10,416.00	0.09
22	600276	恒瑞医药	200	10,408.00	0.09
23	600584	长电科技	100	10,355.00	0.09
24	300285	国瓷材料	100	10,318.00	0.09
25	002407	多氟多	200	10,046.00	0.09
26	601166	兴业银行	600	9,936.00	0.09
27	000657	中钨高新	100	9,572.00	0.08

28	300346	南大光电	100	9,265.00	0.08
29	002080	中材科技	100	9,000.00	0.08
30	600030	中信证券	300	8,619.00	0.08
31	600549	厦门钨业	100	8,520.00	0.07
32	300059	东方财富	400	8,152.00	0.07
33	002594	比亚迪	100	7,970.00	0.07
34	601398	工商银行	1,100	7,777.00	0.07
35	600418	江淮汽车	300	7,749.00	0.07
36	002156	通富微电	100	7,587.00	0.07
37	000651	格力电器	200	7,500.00	0.07
38	000858	五 粮 液	100	7,400.00	0.06
39	600498	烽火通信	100	7,360.00	0.06
40	002138	顺络电子	100	7,310.00	0.06
41	600176	中国巨石	100	7,288.00	0.06
42	601211	国泰海通	400	7,280.00	0.06
43	000636	风华高科	100	7,224.00	0.06
44	601138	工业富联	100	7,215.00	0.06
45	600309	万华化学	100	6,841.00	0.06
46	600150	中国船舶	200	6,758.00	0.06
47	300124	汇川技术	100	6,633.00	0.06
48	002460	赣锋锂业	100	6,540.00	0.06
49	300014	亿纬锂能	100	6,503.00	0.06
50	000021	深科技	100	6,427.00	0.06
51	605589	圣泉集团	100	6,357.00	0.06
52	600522	中天科技	100	6,068.00	0.05
53	002738	中矿资源	100	5,899.00	0.05
54	002487	大金重工	100	5,797.00	0.05
55	601328	交通银行	900	5,787.00	0.05
56	000831	中国稀土	100	5,549.00	0.05
57	600460	士兰微	100	5,466.00	0.05
58	601288	农业银行	900	5,463.00	0.05

59	000338	潍柴动力	200	5,450.00	0.05
60	600919	江苏银行	500	5,390.00	0.05
61	300433	蓝思科技	100	5,366.00	0.05
62	600160	巨化股份	100	5,301.00	0.05
63	603993	洛阳钼业	300	5,265.00	0.05
64	002709	天赐材料	100	5,143.00	0.04
65	002436	兴森科技	100	5,095.00	0.04
66	600660	福耀玻璃	100	5,044.00	0.04
67	002126	银轮股份	100	4,980.00	0.04
68	600885	宏发股份	140	4,828.60	0.04
69	603799	华友钴业	100	4,826.00	0.04
70	600111	北方稀土	100	4,805.00	0.04
71	600887	伊利股份	200	4,792.00	0.04
72	002202	金风科技	200	4,780.00	0.04
73	600141	兴发集团	100	4,697.00	0.04
74	002179	中航光电	100	4,620.00	0.04
75	601816	京沪高铁	1,000	4,530.00	0.04
76	600089	特变电工	200	4,500.00	0.04
77	002240	盛新锂能	100	4,483.00	0.04
78	002185	华天科技	200	4,462.00	0.04
79	002050	三花智控	100	4,383.00	0.04
80	000960	锡业股份	100	4,269.00	0.04
81	688469	芯联集成	400	4,244.00	0.04
82	002472	双环传动	100	4,151.00	0.04
83	601688	华泰证券	200	4,124.00	0.04
84	000893	亚钾国际	100	4,089.00	0.04
85	002230	科大讯飞	100	4,084.00	0.04
86	000100	TCL科技	700	4,074.00	0.04
87	300450	先导智能	100	4,072.00	0.04
88	688387	信科移动	200	3,968.00	0.03
89	601088	中国神华	100	3,904.00	0.03

90	300058	蓝色光标	280	3,852.80	0.03
91	300339	润和软件	100	3,851.00	0.03
92	600893	航发动力	100	3,834.00	0.03
93	300001	特锐德	100	3,783.00	0.03
94	600895	张江高科	100	3,725.00	0.03
95	600298	安琪酵母	100	3,620.00	0.03
96	000063	中兴通讯	100	3,619.00	0.03
97	601995	中金公司	100	3,615.00	0.03
98	002273	水晶光电	100	3,548.00	0.03
99	002714	牧原股份	100	3,499.00	0.03
100	601857	中国石油	400	3,472.00	0.03
101	600031	三一重工	200	3,456.00	0.03
102	600000	浦发银行	400	3,444.00	0.03
103	002415	海康威视	100	3,420.00	0.03
104	600673	东阳光	100	3,358.00	0.03
105	603288	海天味业	100	3,316.00	0.03
106	600580	卧龙电驱	100	3,310.00	0.03
107	000426	兴业银锡	100	3,296.00	0.03
108	600482	中国动力	100	3,280.00	0.03
109	601231	环旭电子	100	3,240.00	0.03
110	002294	信立泰	100	3,189.00	0.03
111	002352	顺丰控股	100	3,126.00	0.03
112	002444	巨星科技	100	3,110.00	0.03
113	300748	金力永磁	100	3,085.00	0.03
114	002056	横店东磁	100	3,048.00	0.03
115	600096	云天化	100	3,040.00	0.03
116	601668	中国建筑	700	3,038.00	0.03
117	002625	光启技术	100	3,032.00	0.03
118	000792	盐湖股份	100	3,019.00	0.03
119	000001	平安银行	300	3,015.00	0.03
120	001203	大中矿业	100	2,995.00	0.03

121	601179	中国西电	200	2,984.00	0.03
122	600392	盛和资源	100	2,977.00	0.03
123	002142	宁波银行	100	2,969.00	0.03
124	601066	中信建投	100	2,907.00	0.03
125	603659	璞泰来	100	2,893.00	0.03
126	600926	杭州银行	200	2,890.00	0.03
127	601939	建设银行	300	2,889.00	0.03
128	000938	紫光股份	100	2,886.00	0.03
129	600875	东方电气	100	2,877.00	0.03
130	601988	中国银行	500	2,860.00	0.03
131	601601	中国太保	100	2,852.00	0.02
132	002001	新 和 成	100	2,842.00	0.02
133	601958	金钼股份	100	2,811.00	0.02
134	002261	拓维信息	100	2,801.00	0.02
135	300115	长盈精密	100	2,794.00	0.02
136	600060	海信视像	100	2,787.00	0.02
137	600601	方正科技	200	2,768.00	0.02
138	002558	巨人网络	100	2,756.00	0.02
139	600938	中国海油	100	2,715.00	0.02
140	601168	西部矿业	100	2,714.00	0.02
141	601985	中国核电	300	2,709.00	0.02
142	600066	宇通客车	100	2,681.00	0.02
143	601919	中远海控	200	2,652.00	0.02
144	600988	赤峰黄金	100	2,632.00	0.02
145	601012	隆基绿能	200	2,624.00	0.02
146	601229	上海银行	300	2,604.00	0.02
147	300017	网宿科技	200	2,602.00	0.02
148	601728	中国电信	500	2,595.00	0.02
149	002402	和而泰	100	2,583.00	0.02
150	600016	民生银行	800	2,576.00	0.02
151	002223	鱼跃医疗	100	2,566.00	0.02

152	000032	深桑达 A	100	2,495.00	0.02
153	601600	中国铝业	300	2,466.00	0.02
154	300498	温氏股份	200	2,464.00	0.02
155	601169	北京银行	500	2,450.00	0.02
156	000425	徐工机械	300	2,427.00	0.02
157	600497	驰宏锌锗	200	2,422.00	0.02
157	600352	浙江龙盛	200	2,422.00	0.02
158	600426	华鲁恒升	100	2,392.00	0.02
159	002318	久立特材	100	2,390.00	0.02
160	002155	湖南黄金	100	2,387.00	0.02
161	600500	中化国际	300	2,349.00	0.02
161	002648	卫星化学	100	2,349.00	0.02
162	000776	广发证券	100	2,340.00	0.02
163	002128	电投能源	100	2,312.00	0.02
164	600009	上海机场	100	2,310.00	0.02
165	600547	山东黄金	100	2,309.00	0.02
166	600406	国电南瑞	100	2,285.00	0.02
166	002203	海亮股份	100	2,285.00	0.02
167	002241	歌尔股份	100	2,253.00	0.02
168	603882	金域医学	100	2,248.00	0.02
169	600196	复星医药	100	2,247.00	0.02
170	600028	中国石化	500	2,230.00	0.02
171	600909	华安证券	200	2,222.00	0.02
172	000807	云铝股份	100	2,214.00	0.02
173	000400	许继电气	100	2,170.00	0.02
174	601233	桐昆股份	100	2,165.00	0.02
175	600699	均胜电子	100	2,161.00	0.02
176	002532	天山铝业	200	2,146.00	0.02
177	600879	航天电子	100	2,129.00	0.02
178	000933	神火股份	100	2,120.00	0.02
179	600570	恒生电子	100	2,119.00	0.02

180	600999	招商证券	100	2,110.00	0.02
181	000519	中兵红箭	100	2,107.00	0.02
182	002966	苏州银行	300	2,088.00	0.02
183	001696	宗申动力	100	2,081.00	0.02
184	601766	中国中车	400	2,080.00	0.02
185	000768	中航西飞	100	2,048.00	0.02
186	600690	海尔智家	100	2,041.00	0.02
187	601225	陕西煤业	100	2,035.00	0.02
188	600989	宝丰能源	100	2,033.00	0.02
189	300432	富临精工	100	2,009.00	0.02
190	600332	白云山	100	2,004.00	0.02
191	600050	中国联通	500	2,000.00	0.02
192	002340	格林美	300	1,983.00	0.02
193	601009	南京银行	200	1,978.00	0.02
194	603225	新凤鸣	100	1,965.00	0.02
195	002195	岩山科技	300	1,962.00	0.02
196	600416	湘电股份	200	1,960.00	0.02
197	600104	上汽集团	200	1,952.00	0.02
198	000783	长江证券	200	1,950.00	0.02
199	300024	机器人	100	1,933.00	0.02
200	600157	永泰能源	1,200	1,932.00	0.02
201	000630	铜陵有色	300	1,908.00	0.02
202	000066	中国长城	100	1,905.00	0.02
203	002131	利欧股份	400	1,900.00	0.02
204	300207	欣旺达	100	1,899.00	0.02
205	002130	沃尔核材	100	1,896.00	0.02
206	600958	东方证券	200	1,888.00	0.02
207	002555	三七互娱	100	1,887.00	0.02
208	002262	恩华药业	100	1,875.00	0.02
209	600905	三峡能源	500	1,855.00	0.02
210	603568	伟明环保	120	1,845.60	0.02

211	600529	山东药玻	100	1,845.00	0.02
212	601006	大秦铁路	400	1,844.00	0.02
213	000738	航发控制	100	1,829.00	0.02
214	600489	中金黄金	100	1,805.00	0.02
215	600862	中航高科	100	1,803.00	0.02
216	603939	益丰药房	100	1,798.00	0.02
217	002557	洽洽食品	100	1,796.00	0.02
218	600026	中远海能	100	1,794.00	0.02
219	000887	中鼎股份	100	1,789.00	0.02
220	600188	兖矿能源	100	1,777.00	0.02
221	000623	吉林敖东	100	1,773.00	0.02
222	600346	恒力石化	100	1,771.00	0.02
223	601838	成都银行	100	1,770.00	0.02
224	600312	平高电气	100	1,766.00	0.02
225	601872	招商轮船	100	1,757.00	0.02
226	600109	国金证券	200	1,756.00	0.02
227	601577	长沙银行	200	1,742.00	0.02
228	601001	晋控煤业	100	1,739.00	0.02
229	601818	光大银行	600	1,734.00	0.02
229	002600	领益智造	100	1,734.00	0.02
230	601665	齐鲁银行	300	1,731.00	0.02
231	601108	财通证券	200	1,730.00	0.02
232	000975	山金国际	100	1,700.00	0.01
233	600585	海螺水泥	100	1,695.00	0.01
234	600707	彩虹股份	100	1,689.00	0.01
235	603806	福斯特	100	1,679.00	0.01
236	603185	弘元绿能	100	1,669.00	0.01
237	300015	爱尔眼科	200	1,652.00	0.01
238	002236	大华股份	100	1,649.00	0.01
239	002601	龙佰集团	100	1,648.00	0.01
240	002180	奔图科技	100	1,636.00	0.01

241	000997	新大陆	100	1,630.00	0.01
242	600019	宝钢股份	300	1,629.00	0.01
243	002517	恺英网络	100	1,625.00	0.01
244	601156	东航物流	100	1,612.00	0.01
245	600602	云赛智联	100	1,608.00	0.01
246	000878	云南铜业	100	1,588.00	0.01
247	601555	东吴证券	200	1,584.00	0.01
248	600233	圆通速递	100	1,575.00	0.01
249	300009	安科生物	200	1,570.00	0.01
250	600010	包钢股份	700	1,561.00	0.01
251	600801	华新建材	100	1,560.00	0.01
252	600741	华域汽车	100	1,552.00	0.01
253	600143	金发科技	100	1,545.00	0.01
254	600011	华能国际	200	1,518.00	0.01
255	002299	圣农发展	100	1,516.00	0.01
256	000060	中金岭南	200	1,514.00	0.01
257	601633	长城汽车	100	1,509.00	0.01
258	000998	隆平高科	200	1,508.00	0.01
259	600021	上海电力	100	1,507.00	0.01
260	002603	以岭药业	100	1,500.00	0.01
261	601825	沪农商行	200	1,498.00	0.01
261	000728	国元证券	200	1,498.00	0.01
262	601567	三星电气	100	1,494.00	0.01
263	000778	新兴铸管	400	1,484.00	0.01
264	601128	常熟银行	253	1,472.46	0.01
265	600131	国网信通	100	1,460.00	0.01
266	002027	分众传媒	300	1,452.00	0.01
266	000818	航锦科技	100	1,452.00	0.01
267	601788	光大证券	100	1,443.00	0.01
268	600521	华海药业	100	1,440.00	0.01
269	002373	千方科技	200	1,436.00	0.01

270	000625	长安汽车	200	1,434.00	0.01
271	002690	美亚光电	100	1,433.00	0.01
272	601699	潞安环能	100	1,428.00	0.01
273	600674	川投能源	100	1,417.00	0.01
274	601991	大唐发电	200	1,416.00	0.01
275	601669	中国电建	300	1,410.00	0.01
276	600985	淮北矿业	100	1,405.00	0.01
277	600795	国电电力	300	1,401.00	0.01
278	002368	太极股份	100	1,399.00	0.01
279	600839	四川长虹	200	1,396.00	0.01
280	000157	中联重科	200	1,394.00	0.01
281	601717	中创智领	100	1,391.00	0.01
282	601998	中信银行	200	1,386.00	0.01
282	300012	华测检测	100	1,386.00	0.01
283	600499	科达制造	100	1,380.00	0.01
284	603456	九洲药业	100	1,366.00	0.01
285	601198	东兴证券	100	1,359.00	0.01
286	600129	太极集团	100	1,357.00	0.01
286	000703	恒逸石化	100	1,357.00	0.01
287	600884	杉杉股份	100	1,355.00	0.01
288	601162	天风证券	400	1,348.00	0.01
288	601099	太平洋	400	1,348.00	0.01
289	600886	国投电力	100	1,331.00	0.01
290	002414	高德红外	100	1,326.00	0.01
291	600535	天士力	100	1,323.00	0.01
292	000166	申万宏源	300	1,320.00	0.01
293	601916	浙商银行	500	1,315.00	0.01
294	002797	第一创业	200	1,314.00	0.01
295	002984	森麒麟	100	1,307.00	0.01
296	300142	沃森生物	100	1,299.00	0.01
297	002673	西部证券	200	1,298.00	0.01

298	000559	万向钱潮	100	1,293.00	0.01
299	600977	中国电影	100	1,292.00	0.01
299	600765	中航重机	100	1,292.00	0.01
300	002268	电科网安	100	1,290.00	0.01
301	603712	七一二	100	1,289.00	0.01
302	600015	华夏银行	200	1,278.00	0.01
303	002465	海格通信	100	1,277.00	0.01
304	601696	中银证券	100	1,265.00	0.01
304	002439	启明星辰	100	1,265.00	0.01
305	601881	中国银河	100	1,257.00	0.01
306	601390	中国中铁	300	1,251.00	0.01
307	002078	太阳纸业	100	1,249.00	0.01
308	300118	东方日升	100	1,245.00	0.01
309	300383	光环新网	100	1,244.00	0.01
310	002624	完美世界	100	1,242.00	0.01
311	600516	方大炭素	200	1,234.00	0.01
312	600737	中粮糖业	100	1,233.00	0.01
313	600995	南网储能	100	1,230.00	0.01
314	601077	渝农商行	200	1,222.00	0.01
315	002007	华兰生物	100	1,219.00	0.01
316	601898	中煤能源	100	1,218.00	0.01
317	600438	通威股份	100	1,211.00	0.01
318	601377	兴业证券	200	1,208.00	0.01
319	002129	TCL中环	100	1,202.00	0.01
320	000830	鲁西化工	100	1,200.00	0.01
321	000155	川能动力	100	1,198.00	0.01
322	603766	隆鑫通用	100	1,193.00	0.01
323	601186	中国铁建	200	1,190.00	0.01
324	002271	东方雨虹	100	1,187.00	0.01
325	300003	乐普医疗	100	1,185.00	0.01
326	003816	中国广核	300	1,173.00	0.01

327	300122	智飞生物	100	1,169.00	0.01
328	601615	明阳智能	100	1,157.00	0.01
329	601058	赛轮轮胎	100	1,153.00	0.01
330	000683	博源化工	200	1,152.00	0.01
331	000301	东方盛虹	100	1,145.00	0.01
332	600115	中国东航	300	1,143.00	0.01
333	300601	康泰生物	100	1,134.00	0.01
334	002157	正邦科技	400	1,124.00	0.01
335	600435	北方导航	100	1,120.00	0.01
336	400289	德邦5	100	1,119.00	0.01
337	601611	中国核建	100	1,115.00	0.01
337	002867	周大生	100	1,115.00	0.01
338	600350	山东高速	100	1,113.00	0.01
339	300251	光线传媒	100	1,109.00	0.01
339	002085	万丰奥威	100	1,109.00	0.01
340	000750	国海证券	300	1,104.00	0.01
341	603883	老百姓	100	1,096.00	0.01
342	600546	山煤国际	100	1,093.00	0.01
343	600967	内蒙一机	100	1,085.00	0.01
343	600372	中航机载	100	1,085.00	0.01
344	600755	厦门国贸	200	1,084.00	0.01
344	600598	北大荒	100	1,084.00	0.01
345	002507	涪陵榨菜	100	1,080.00	0.01
346	002493	荣盛石化	100	1,075.00	0.01
347	000582	北部湾港	100	1,073.00	0.01
348	601868	中国能建	400	1,068.00	0.01
349	000967	盈峰环境	100	1,053.00	0.01
350	601865	福莱特	100	1,051.00	0.01
351	002429	兆驰股份	100	1,039.00	0.01
352	600029	南方航空	200	1,036.00	0.01
353	603885	吉祥航空	100	1,029.00	0.01

354	601997	贵阳银行	200	1,026.00	0.01
354	601155	新城控股	100	1,026.00	0.01
355	601636	旗滨集团	100	1,023.00	0.01
356	601966	玲珑轮胎	100	1,019.00	0.01
356	600483	福能股份	100	1,019.00	0.01
357	601212	白银有色	200	1,016.00	0.01
357	600415	小商品城	100	1,016.00	0.01
358	001286	陕西能源	100	1,014.00	0.01
359	000729	燕京啤酒	100	1,013.00	0.01
360	002266	浙富控股	200	1,012.00	0.01
361	600739	辽宁成大	100	1,011.00	0.01
362	002044	美年健康	200	1,006.00	0.01
363	000629	钒钛股份	300	1,002.00	0.01
364	002736	国信证券	100	999.00	0.01
365	000050	深天马 A	100	991.00	0.01
366	601098	中南传媒	100	984.00	0.01
367	603565	中谷物流	100	981.00	0.01
368	002739	儒意电影	100	960.00	0.01
369	688009	中国通号	200	952.00	0.01
370	688223	晶科能源	200	950.00	0.01
370	601878	浙商证券	100	950.00	0.01
371	002064	华峰化学	100	949.00	0.01
372	600704	物产中大	200	944.00	0.01
373	600380	健康元	100	942.00	0.01
374	600863	华能蒙电	200	940.00	0.01
375	600998	九州通	200	938.00	0.01
375	002408	齐翔腾达	200	938.00	0.01
375	002152	广电运通	100	938.00	0.01
376	002019	亿帆医药	100	935.00	0.01
377	603077	和邦生物	400	928.00	0.01
378	600048	保利发展	200	926.00	0.01

379	000591	太阳能	200	920.00	0.01
380	600859	王府井	100	918.00	0.01
380	600588	用友网络	100	918.00	0.01
380	600282	南钢股份	200	918.00	0.01
381	002312	川发龙蟒	100	917.00	0.01
382	001965	招商公路	100	916.00	0.01
383	300146	汤臣倍健	100	904.00	0.01
384	601216	君正集团	200	892.00	0.01
385	600025	华能水电	100	889.00	0.01
386	601456	国联民生	100	884.00	0.01
387	601928	凤凰传媒	100	879.00	0.01
388	600056	中国医药	100	875.00	0.01
389	600642	申能股份	100	873.00	0.01
389	600166	福田汽车	300	873.00	0.01
390	601360	三六零	100	869.00	0.01
391	002252	上海莱士	200	868.00	0.01
392	601918	新集能源	100	859.00	0.01
393	600208	衢州发展	300	849.00	0.01
394	002531	天顺风能	100	843.00	0.01
395	002939	长城证券	100	834.00	0.01
396	600637	东方明珠	100	831.00	0.01
397	601000	唐山港	200	830.00	0.01
398	002423	中粮资本	100	823.00	0.01
399	002958	青农商行	300	822.00	0.01
400	002372	伟星新材	100	819.00	0.01
401	002926	华西证券	100	817.00	0.01
402	600008	首创环保	300	816.00	0.01
402	002410	广联达	100	816.00	0.01
403	000415	渤海租赁	200	814.00	0.01
404	000039	中集集团	100	811.00	0.01
405	002459	晶澳科技	100	810.00	0.01

406	688425	铁建重工	200	804.00	0.01
406	600867	通化东宝	100	804.00	0.01
406	600369	西南证券	200	804.00	0.01
407	001227	兰州银行	400	800.00	0.01
408	600219	南山铝业	200	798.00	0.01
409	600153	建发股份	100	793.00	0.01
410	600039	四川路桥	100	782.00	0.01
410	000987	越秀资本	100	782.00	0.01
411	300002	神州泰岳	100	781.00	0.01
412	688538	和辉光电	300	780.00	0.01
413	601016	节能风电	200	776.00	0.01
414	002583	海能达	100	769.00	0.01
415	600348	华阳股份	100	765.00	0.01
416	002244	滨江集团	100	760.00	0.01
417	000543	皖能电力	100	757.00	0.01
418	000528	柳 工	100	755.00	0.01
419	600177	雅戈尔	100	753.00	0.01
419	600095	湘财股份	100	753.00	0.01
420	600848	上海临港	100	749.00	0.01
421	600906	财达证券	100	746.00	0.01
422	601117	中国化学	100	735.00	0.01
422	600873	梅花生物	100	735.00	0.01
423	000537	绿发电力	100	731.00	0.01
424	600004	白云机场	100	726.00	0.01
425	002153	石基信息	100	723.00	0.01
426	601901	方正证券	100	720.00	0.01
427	601666	平煤股份	100	715.00	0.01
428	002065	东华软件	100	714.00	0.01
429	600970	中材国际	100	713.00	0.01
430	600032	浙江新能	100	705.00	0.01
431	000932	华菱钢铁	200	694.00	0.01

432	002608	江苏国信	100	690.00	0.01
433	601236	红塔证券	100	682.00	0.01
434	000539	粤电力 A	100	681.00	0.01
435	601992	金隅集团	500	680.00	0.01
436	601319	中国人保	100	676.00	0.01
437	000723	美锦能源	200	670.00	0.01
438	000401	金隅冀东	200	668.00	0.01
439	600170	上海建工	300	666.00	0.01
440	600373	中文传媒	100	663.00	0.01
441	601106	中国一重	200	660.00	0.01
442	600528	中铁工业	100	659.00	0.01
442	000617	中油资本	100	659.00	0.01
443	600271	航天信息	100	658.00	0.01
444	601990	南京证券	100	657.00	0.01
445	600061	国投资本	100	655.00	0.01
446	600578	京能电力	100	645.00	0.01
447	001979	招商蛇口	100	643.00	0.01
448	000598	兴蓉环境	100	642.00	0.01
449	601019	山东出版	100	640.00	0.01
450	002120	韵达股份	100	636.00	0.01
451	600663	陆家嘴	100	628.00	0.01
452	000876	新 希 望	100	627.00	0.01
453	000009	中国宝安	100	623.00	0.01
454	000027	深圳能源	100	620.00	0.01
455	600126	杭钢股份	100	613.00	0.01
456	601111	中国国航	100	605.00	0.01
457	000002	万 科 A	200	592.00	0.01
458	600098	广州发展	100	591.00	0.01
459	003035	南网能源	100	582.00	0.01
460	300144	宋城演艺	100	581.00	0.01
461	000983	山西焦煤	100	580.00	0.01

462	600959	江苏有线	200	578.00	0.01
463	600901	江苏金租	100	575.00	0.01
464	601800	中国交建	100	571.00	0.00
465	601933	永辉超市	200	568.00	0.00
466	601139	深圳燃气	100	566.00	0.00
467	000958	电投产融	100	564.00	0.00
468	601880	辽港股份	400	552.00	0.00
468	600155	华创云信	100	552.00	0.00
468	002385	大北农	200	552.00	0.00
468	000563	陕国投 A	200	552.00	0.00
469	601333	广深铁路	200	550.00	0.00
470	600515	海南机场	200	548.00	0.00
471	002607	中公教育	300	540.00	0.00
472	600918	中泰证券	100	532.00	0.00
473	600023	浙能电力	100	526.00	0.00
474	600398	海澜之家	100	523.00	0.00
475	600820	隧道股份	100	521.00	0.00
476	601238	广汽集团	100	508.00	0.00
477	002563	森马服饰	100	504.00	0.00
478	600583	海油工程	100	503.00	0.00
479	300140	节能环保	100	497.00	0.00
480	601598	中国外运	100	496.00	0.00
481	601118	海南橡胶	100	492.00	0.00
482	601618	中国中冶	200	488.00	0.00
482	600816	建元信托	200	488.00	0.00
483	600720	中交设计	100	482.00	0.00
484	601608	中信重工	100	477.00	0.00
484	600930	华电新能	100	477.00	0.00
485	600517	国网英大	100	468.00	0.00
486	600390	五矿资本	100	456.00	0.00
487	600582	天地科技	100	445.00	0.00

487	600027	华电国际	100	445.00	0.00
488	601866	中远海发	200	442.00	0.00
489	000937	冀中能源	110	437.80	0.00
490	000883	湖北能源	100	432.00	0.00
491	600655	豫园股份	100	411.00	0.00
492	000088	盐田港	100	409.00	0.00
493	600871	石化油服	200	406.00	0.00
494	600925	苏能股份	100	401.00	0.00
495	000785	居然智家	200	400.00	0.00
496	000709	河钢股份	200	388.00	0.00
497	600606	绿地控股	300	363.00	0.00
498	600361	创新新材	100	360.00	0.00
499	000959	首钢股份	100	351.00	0.00
500	601399	国机重装	100	350.00	0.00
501	000825	太钢不锈	100	341.00	0.00
502	601568	北元化工	100	340.00	0.00
503	001213	中铁特货	100	335.00	0.00
504	600968	海油发展	100	333.00	0.00
505	600928	西安银行	100	327.00	0.00
506	300070	碧水源	100	319.00	0.00
507	601018	宁波港	100	315.00	0.00
508	600339	中油工程	100	307.00	0.00
509	600688	上海石化	100	293.00	0.00
510	601228	广州港	100	282.00	0.00
511	600808	马钢股份	100	250.00	0.00
512	600325	华发股份	100	231.00	0.00
513	000898	鞍钢股份	100	187.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金 资产净值比 例(%)
1	300308	中际旭创	59,813.00	0.47
2	300274	阳光电源	17,038.00	0.13
3	600118	中国卫星	10,232.00	0.08
4	002837	英维克	10,114.00	0.08
5	600036	招商银行	8,286.00	0.06
6	000333	美的集团	7,894.00	0.06
7	002353	杰瑞股份	7,289.00	0.06
8	600150	中国船舶	7,186.00	0.06
9	601899	紫金矿业	7,184.00	0.06
10	002463	沪电股份	7,122.00	0.06
11	002281	光迅科技	7,070.00	0.06
12	600183	生益科技	7,051.00	0.05
13	601318	中国平安	6,995.00	0.05
14	002460	赣锋锂业	6,440.00	0.05
15	600276	恒瑞医药	6,321.00	0.05
16	601138	工业富联	6,120.00	0.05
17	600030	中信证券	5,706.00	0.04
18	300346	南大光电	5,620.00	0.04
19	002475	立讯精密	5,495.00	0.04
20	600900	长江电力	5,452.00	0.04

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金 资产净值比 例(%)
1	300308	中际旭创	61,606.00	0.48

2	002281	光迅科技	9,091.00	0.07
3	002837	英维克	8,433.00	0.07
4	002384	东山精密	8,081.00	0.06
5	600118	中国卫星	7,831.00	0.06
6	300390	天华新能	5,852.00	0.05
7	600487	亨通光电	5,801.00	0.05
8	300037	新宙邦	5,273.00	0.04
9	601138	工业富联	5,261.00	0.04
10	002625	光启技术	5,029.00	0.04
11	605358	立昂微	4,146.00	0.03
12	601088	中国神华	4,130.00	0.03
13	600036	招商银行	3,952.00	0.03
14	002683	广东宏大	3,761.00	0.03
15	600536	中国软件	3,541.00	0.03
16	002422	科伦药业	3,491.00	0.03
17	603816	顾家家居	3,377.00	0.03
18	002074	国轩高科	3,370.00	0.03
19	300699	光威复材	3,337.00	0.03
20	601899	紫金矿业	3,292.00	0.03

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	523,995.00
卖出股票收入（成交）总额	276,072.00

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	9,445,333.84	82.60
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	9,445,333.84	82.60

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	019827	26国债01	26,000	2,616,852.99	22.89
2	019835	26国债09	25,000	2,504,114.38	21.90
3	019832	26国债06	22,000	2,210,597.37	19.33
4	019830	26国债04	21,000	2,113,769.10	18.49

注：本基金本报告期末仅持有以上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

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

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

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

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,446.74
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	50,098.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	51,544.74

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 嘉盈 一年 持有 期债 券A	1,100	6,420.45	0.00	0.00%	7,062,496.27	100.00%
汇安 嘉盈 一年 持有 期债 券C	2,974	1,661.70	0.00	0.00%	4,941,895.60	100.00%
汇安 嘉盈 一年 持有 期债 券E	13	11,642.38	0.00	0.00%	151,350.95	100.00%
合计	4,038	3,010.34	0.00	0.00%	12,155,742.82	100.00%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比 例
基金管理人所有从业人员持有本基金	汇安嘉盈一年持有期债券A	0.00	0.0000%
	汇安嘉盈一年持有期债券C	0.00	0.0000%
	汇安嘉盈一年持有期债券E	110.24	0.0728%
	合计	110.24	0.0009%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区 间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	汇安嘉盈一年持有期债券A	0
	汇安嘉盈一年持有期债券C	0
	汇安嘉盈一年持有期债券E	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	汇安嘉盈一年持有期债券A	0
	汇安嘉盈一年持有期债券C	0
	汇安嘉盈一年持有期债券E	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	汇安嘉盈一年持有期债券A	汇安嘉盈一年持有期债券C	汇安嘉盈一年持有期债券E
基金合同生效日(2021年02月02日)基金份额总额	196,148,646.19	60,448,898.75	-
本报告期期初基金份额总额	8,205,044.95	5,525,882.77	323.60
本报告期基金总申购份额	47,388.65	292,533.55	151,027.35
减：本报告期基金总赎回份额	1,189,937.33	876,520.72	-
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	7,062,496.27	4,941,895.60	151,350.95

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，本基金托管人托管业务部门未受到调查或处罚。

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未受到调查或处罚。

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	
国泰海通证券	3	800,067.00	100.00%	348.67	100.00%	-

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:国泰海通证券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
国泰海通 证券	26,019,878.00	100.00%	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	汇安嘉盈一年持有期债券型证券投资基金2025年第4季度报告	规定报刊和/或公司网站	2026-01-22
2	汇安基金管理有限责任公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025年度）	规定报刊和/或公司网站	2026-03-31

3	汇安嘉盈一年持有期债券型证券投资基金2025年年度报告	规定报刊和/或公司网站	2026-03-31
4	汇安基金管理有限责任公司关于提请投资者及时更新已过期身份证件及其他身份基本信息的公告	规定报刊和/或公司网站	2026-04-03
5	汇安嘉盈一年持有期债券型证券投资基金2026年第1季度报告	规定报刊和/或公司网站	2026-04-22
6	汇安基金管理有限责任公司关于浙江分公司成立的公告	规定报刊和/或公司网站	2026-04-22

§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嘉盈一年持有期债券型证券投资基金募集的文件
- (2) 《汇安嘉盈一年持有期债券型证券投资基金基金合同》
- (3) 《汇安嘉盈一年持有期债券型证券投资基金招募说明书》
- (4) 《汇安嘉盈一年持有期债券型证券投资基金托管协议》
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照
- (6) 在规定报刊及规定网站上披露的各项公告
- (7) 中国证监会规定的其他文件

12.2 存放地点

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

12.3 查阅方式

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

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

公司网站：<http://www.huianfund.cn>

汇安基金管理有限责任公司

二〇二六年八月三十一日