

汇安嘉盈一年持有期债券型证券投资基金

2023 年中期报告

2023 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:2023 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，并由董事长签发。

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规定，于2023年8月30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2023年1月1日起至2023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	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	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 净资产（基金净值）变动表	18
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	46
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	47
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	52
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	52
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	53
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	53
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	53
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	53
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	53
7.12 投资组合报告附注	53
§8 基金份额持有人信息	54

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	54
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	55
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	55
§9 开放式基金份额变动	55
§10 重大事件揭示	56
10.1 基金份额持有人大会决议	56
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	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	56
10.4 基金投资策略的改变	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	56
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	56
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	57
10.8 其他重大事件	58
§11 影响投资者决策的其他重要信息	59
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	59
§12 备查文件目录	59
12.1 备查文件目录	59
12.2 存放地点	60
12.3 查阅方式	60

§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	25,121,409.64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
下属分级基金的交易代码	007315	010270
报告期末下属分级基金的份额总额	13,124,220.78份	11,997,188.86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，其风险收益水平高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	汇安基金管理有限责任公司	中国邮政储蓄银行股份有限公司

信息披露负责人	姓名	郭冬青	韩笑微
	联系电话	010-56711600	010-68858113
	电子邮箱	guodq@huianfund.cn	hanxiaowei@psbcoa.com.cn
客户服务电话		010-56711690	95580
传真		010-56711640	010-68858120
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	刘建军

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
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.huianfund.cn
基金中期报告备置地点	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
---------------	-----

	(2023年01月01日-2023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
本期已实现收益	-511,885.89	-504,746.65
本期利润	-84,395.43	-102,478.07
加权平均基金份额本期利润	-0.0059	-0.0077
本期加权平均净值利润率	-0.60%	-0.78%
本期基金份额净值增长率	-0.58%	-0.77%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2023年06月30日)	
期末可供分配利润	-507,904.54	-575,795.00
期末可供分配基金份额利润	-0.0387	-0.0480
期末基金资产净值	12,985,085.55	11,755,586.90
期末基金份额净值	0.9894	0.9799
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2023年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	-1.06%	-2.01%

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

过去一个月	0.51%	0.48%	0.28%	0.09%	0.23%	0.39%
过去三个月	1.47%	0.44%	0.33%	0.08%	1.14%	0.36%
过去六个月	-0.58%	0.49%	1.06%	0.08%	-1.64%	0.41%
过去一年	-5.59%	0.43%	-0.23%	0.10%	-5.36%	0.33%
自基金合同生效起至今	-1.06%	0.30%	0.29%	0.12%	-1.35%	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
过去一个月	0.47%	0.48%	0.28%	0.09%	0.19%	0.39%
过去三个月	1.38%	0.44%	0.33%	0.08%	1.05%	0.36%
过去六个月	-0.77%	0.49%	1.06%	0.08%	-1.83%	0.41%
过去一年	-5.97%	0.43%	-0.23%	0.10%	-5.74%	0.33%
自基金合同生效起至今	-2.01%	0.30%	0.29%	0.12%	-2.30%	0.18%

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

汇安嘉盈一年持有期债券A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2021年02月02日-2023年06月30日)



汇安嘉盈一年持有期债券C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2021年02月02日-2023年06月30日)



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2023年6月30日，公司旗下管理63只公募基金——汇安嘉汇纯债债券型证券投资基金、汇安嘉裕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、汇安丰融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、汇安丰恒灵活配置混合型证券投资基金、汇安丰益灵活配置混合型证券投资基金、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、汇安裕阳三年定期开放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、汇安裕兴12个月定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、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

资基金、汇安价值先锋混合型证券投资基金、汇安裕泰纯债债券型证券投资基金、汇安裕盈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。

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		
杨坤河	固定收益投资部高级经理、本基金的基金经理	2022-07-27	-	7年	杨坤河先生，清华大学管理科学与工程硕士研究生，7年证券、基金行业从业经验。曾任中国五矿集团公司黑流中心风控主管、高级业务经理；东北证券股份有限公司研究所分析师；太平洋证券股份有限公司研究院首席分析师，2021年2月加入汇安基金管理有限责任公司任固定收益投资部基金经理。2021年9月27日至今，任汇安信利债券型证券投资基金基金经理；2022年7月27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；2023年2月2日至今，任汇安嘉诚债券型证券投资基金基金经理。

- 1、“任职日期”和“离职日期”分别指根据公司对外披露的聘任日期和解聘日期。
- 2、证券从业的含义遵从行业协会《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。
- 3、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合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，本着诚实信用、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。

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

上半年国内经济复苏不及预期，叠加海外流动性整体收紧，导致投资者风险偏好有所下降。在刺激政策不及预期、部分高频数据走弱以及央行降息等带动下，债券市场利率整体下移，超预期走出一波小牛市；而主要权益指数震荡下行，人工智能及中特古主线热度较高，但其他板块疲弱不堪；同时大宗商品价格震荡偏弱，人民币贬值压力凸显。整体看低风险资产表现更优。

报告期内，本基金在债券投资上维持较保守的短久期策略，并有效控制组合信用风险，投资方向主要以国债及可转债和股票等权益类资产为主。

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0.9894元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-0.58%，同期业绩比较基准收益率为1.06%；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0.9799元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-0.77%，同期业绩比较基准收益率为1.06%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，海外加息利空将告一段落，预计美联储7月加息后货币紧缩政策将告一段落，金融市场流动性和估值压力有望较大缓和。面对政策定力，国内经济复苏路径仍可能一波三折。但库存周期及高质量发展预期下，复苏的边际加速仍然值得期待。

当前，总体需求企稳仍然要靠政策。我们判断下半年货币政策将保持宽松，PPI触底，CPI温和上行。预计国债收益率保持低位窄幅波动；地方债需要关注“灰犀牛”风险；房地产开发持续走低，去库存压力较大，信用风险犹存；权益类资产经过调整，下跌空间有限，性价比仍然较高，指数上行弹性取决于政策发力力度。

下半年，我们将继续灵活配置，注重在人工智能、数字经济、先进科技方向优选标的；经济增速确定性企稳回升后，关注大消费和周期板块的触底反弹。同时在债券投资上，继续以获取稳定静态票息策略为主。

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，解决方案为持续营销。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。

§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遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《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：2023年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	271,048.79	384,647.80
结算备付金		450,122.65	508,933.09

存出保证金		29,439.29	23,346.22
交易性金融资产	6.4.7.2	27,024,787.83	35,360,473.02
其中：股票投资		4,901,386.00	7,551,240.00
基金投资		-	-
债券投资		22,123,401.83	27,809,233.02
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	1,000,000.00	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	2,245.82
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		28,775,398.56	36,279,645.95
负债和净资产	附注号	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022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		3,798,849.64	4,998,506.85
应付清算款		87,321.65	2,986.31

应付赎回款		23,756.55	7,329.15
应付管理人报酬		16,508.04	21,755.85
应付托管费		3,301.61	4,351.19
应付销售服务费		3,943.23	5,268.34
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	485.33
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	101,045.39	205,246.92
负债合计		4,034,726.11	5,245,929.94
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	25,121,409.64	31,300,813.50
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	-380,737.19	-267,097.49
净资产合计		24,740,672.45	31,033,716.01
负债和净资产总计		28,775,398.56	36,279,645.95

注：报告截止日2023年6月30日，基金份额总额25,121,409.64份，其中汇安嘉盈一年持有期债券A基金份额净值0.9894元，份额总额13,124,220.78份；汇安嘉盈一年持有期债券C基金份额净值0.9799元，份额总额11,997,188.86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：2023年01月01日至2023年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023年01月01日至 2023年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至 2022年06月30日
一、营业总收入		89,245.66	995,908.67
1.利息收入		7,580.41	35,457.76
其中：存款利息收入	6.4.7.9	7,237.87	24,482.15
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		342.54	10,975.61
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-748,093.79	-372,979.83
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-1,026,166.36	-1,984,205.45
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	248,275.93	1,510,201.71
资产支持证券投资	6.4.7.12	-	78,211.15
收益			
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	29,796.64	22,812.76
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
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	829,759.04	1,333,430.74
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	-	-
减：二、营业总支出		276,119.16	855,518.81
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	107,889.67	454,934.32
2. 托管费	6.4.10.2.2	21,577.96	90,986.87
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	26,035.10	74,787.76
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		79,918.83	128,603.30
其中：卖出回购金融资产		79,918.83	128,603.30

支出			
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		82.11	1,920.24
8. 其他费用	6. 4. 7. 18	40,615.49	104,286.32
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-186,873.50	140,389.86
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-186,873.50	140,389.86
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-186,873.50	140,389.86

6.3 净资产（基金净值）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：2023年01月01日至2023年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	31,300,813.50	-	-267,097.49	31,033,716.01
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	31,300,813.50	-	-267,097.49	31,033,716.01
三、本期增减变	-6,179,403.86	-	-113,639.70	-6,293,043.56

动额（减少以“-”号填列）				
（一）、综合收益总额	-	-	-186,873.50	-186,873.50
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-6,179,403.86	-	73,233.80	-6,106,170.06
其中：1.基金申购款	167,678.91	-	-721.69	166,957.22
2.基金赎回款	-6,347,082.77	-	73,955.49	-6,273,127.28
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	25,121,409.64	-	-380,737.19	24,740,672.45
项目	上年度可比期间			
	2022年01月01日至2022年06月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	260,110,942.21	-	8,462,498.49	268,573,440.70
加：会计政策变	-	-	-	-

更				
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	260,110,942.21	-	8,462,498.49	268,573,440.70
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-211,334,230.55	-	-6,244,194.88	-217,578,425.43
（一）、综合收益总额	-	-	140,389.86	140,389.86
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-211,334,230.55	-	-6,384,584.74	-217,718,815.29
其中：1.基金申购款	1,017,286.92	-	27,238.37	1,044,525.29
2.基金赎回款	-212,351,517.47	-	-6,411,823.11	-218,763,340.58
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	48,776,711.66	-	2,218,303.61	50,995,015.27

值)				
----	--	--	--	--

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《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。

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×90%+沪深300指数收益率×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2023年8月30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”)、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《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》和在财务报表附注6.4.4所列示的中国证监会、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2023年06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

基金管理人已按法规要求向中国证监会报送解决方案，解决方案为持续营销，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2023年6月30日的财务状况以及2023年1月1日至2023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[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、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》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。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。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。

(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 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日
活期存款	271,048.79
等于：本金	270,820.83
加：应计利息	227.96
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	271,048.79

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	4,746,686.12	-	4,901,386.00	154,699.88	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	16,740,608.78	329,637.45	17,043,337.45	-26,908.78
	银行间市场	4,975,360.00	80,564.38	5,080,064.38	24,140.00
	合计	21,715,968.78	410,201.83	22,123,401.83	-2,768.78
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	26,462,654.90	410,201.83	27,024,787.83	151,931.10	

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

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2023年06月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	1,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	1,000,000.00	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 其他资产

无。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023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	78,729.90
其中：交易所市场	78,729.90
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用-审计费	22,315.49
合计	101,045.39

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 2023年01月01日至2023年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额

上年度末	16,085,902.20	16,085,902.20
本期申购	58,471.30	58,471.30
本期赎回（以“-”号填列）	-3,020,152.72	-3,020,152.72
本期末	13,124,220.78	13,124,220.78

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 2023年01月01日至2023年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	15,214,911.30	15,214,911.30
本期申购	109,207.61	109,207.61
本期赎回（以“-”号填列）	-3,326,930.05	-3,326,930.05
本期末	11,997,188.86	11,997,188.86

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
本期期初	-45,669.68	-31,926.49	-77,596.17
本期利润	-511,885.89	427,490.46	-84,395.43
本期基金份额交易产生的变动数	49,651.03	-26,794.66	22,856.37
其中：基金申购款	-352.95	604.92	251.97
基金赎回款	50,003.98	-27,399.58	22,604.40
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-507,904.54	368,769.31	-139,135.23

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
本期期初	-159,596.69	-29,904.63	-189,501.32
本期利润	-504,746.65	402,268.58	-102,478.07
本期基金份额交易产 生的变动数	88,548.34	-38,170.91	50,377.43
其中：基金申购款	-1,573.62	599.96	-973.66
基金赎回款	90,121.96	-38,770.87	51,351.09
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-575,795.00	334,193.04	-241,601.96

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
活期存款利息收入	2,147.71
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	4,865.93
其他	224.23
合计	7,237.87

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 2023年01月01日至2023年06月30日
卖出股票成交总额	93,045,780.41
减：卖出股票成本总额	93,831,908.62
减：交易费用	240,038.15

买卖股票差价收入	-1,026,166.36
----------	---------------

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 2023年01月01日至2023年06月30日
债券投资收益——利息收入	231,921.26
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	16,354.67
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	248,275.93

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 2023年01月01日至2023年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	29,653,959.69
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	29,418,275.39
减：应计利息总额	218,112.42
减：交易费用	1,217.21
买卖债券差价收入	16,354.67

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 2023年01月01日至2023年06月30日
股票投资产生的股利收益	29,796.64
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	29,796.64

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
1.交易性金融资产	829,759.04
——股票投资	489,809.07
——债券投资	339,949.97
——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	829,759.04

6.4.7.17 其他收入

无。

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
审计费用	22,315.49
信息披露费	-
证券出借违约金	-
账户维护费-中债登	9,000.00
其他	600.00
账户维护费-上清所	8,700.00
合计	40,615.49

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 2023年01月01日至202 3年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至202 2年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	107,889.67	454,934.32
其中：支付销售机构的客户维护费	49,140.59	215,692.90

注：支付基金管理人汇安基金管理有限责任公司的基金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：日基金管理人报酬=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	上年度可比期间
	2023年01月01日至2023年06月30日	2022年01月01日至2022年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	21,577.96	90,986.87

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		
	2023年01月01日至2023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	合计
中国邮政储蓄银行股份有限公司	0.00	3,593.39	3,593.39
汇安基金管理有限责任公司	0.00	0.36	0.36
合计	0.00	3,593.75	3,593.75
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2022年01月01日至2022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	合计
中国邮政储蓄银行股份有限公司	0.00	14,931.94	14,931.94
合计	0.00	14,931.94	14,931.94

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值0.40%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给汇安基金管理有限责任公司，再由汇安基金管理有限责任公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日销售服务费=前一日C类基金份额的基金资产净值×0.40% / 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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 2023年01月01日至2023年06月30日		上年度可比期间 2022年01月01日至2022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	271,048.79	2,147.71	1,155,919.05	15,818.88

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

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（2023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

截至本报告期末2023年06月30日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额3,798,849.64元，截至2023年07月03日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

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同责任，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储银行，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，违约风险可能性很小；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 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	16,937,836.08	11,557,183.15
合计	16,937,836.08	11,557,183.15

注：未评级部分为政策性金融债。

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 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
AAA	-	7,515,946.19
AAA以下	-	3,603,992.72
未评级	5,185,565.75	5,132,110.96
合计	5,185,565.75	16,252,049.87

注：未评级部分为国债、政策性金融债。

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2023年6月30日，除卖出回购金融资产款余额中有3,798,849.64元将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期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上市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%。于2023年6月30日，本基金无流动性受限资产。

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2023年6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 2023 年 06 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	271,048.79	-	-	-	271,048.79
结算备付金	450,122.65	-	-	-	450,122.65
存出保证金	29,439.29	-	-	-	29,439.29

交易性金融资产	22,123,401.83	-	-	4,901,386.00	27,024,787.83
买入返售金融资产	1,000,000.00	-	-	-	1,000,000.00
资产总计	23,874,012.56	-	-	4,901,386.00	28,775,398.56
负债					
卖出回购金融资产款	3,798,849.64	-	-	-	3,798,849.64
应付清算款	-	-	-	87,321.65	87,321.65
应付赎回款	-	-	-	23,756.55	23,756.55
应付管理人报酬	-	-	-	16,508.04	16,508.04
应付托管费	-	-	-	3,301.61	3,301.61
应付销售服务费	-	-	-	3,943.23	3,943.23
其他负债	-	-	-	101,045.39	101,045.39
负债总计	3,798,849.64	-	-	235,876.47	4,034,726.11
利率敏感度缺口	20,075,162.92	-	-	4,665,509.53	24,740,672.45
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	384,647.80	-	-	-	384,647.80
结算备	508,933.09	-	-	-	508,933.09

付金					
存出保证金	23,346.22	-	-	-	23,346.22
交易性金融资产	27,809,233.02	-	-	7,551,240.00	35,360,473.02
应收申购款	-	-	-	2,245.82	2,245.82
资产总计	28,726,160.13	-	-	7,553,485.82	36,279,645.95
负债					
卖出回购金融资产款	4,998,506.85	-	-	-	4,998,506.85
应付清算款	-	-	-	2,986.31	2,986.31
应付赎回款	-	-	-	7,329.15	7,329.15
应付管理人报酬	-	-	-	21,755.85	21,755.85
应付托管费	-	-	-	4,351.19	4,351.19
应付销售服务费	-	-	-	5,268.34	5,268.34
应交税费	-	-	-	485.33	485.33
其他负债	-	-	-	205,246.92	205,246.92
负债总计	4,998,506.85	-	-	247,423.09	5,245,929.94
利率敏感度缺口	23,727,653.28	-	-	7,306,062.73	31,033,716.01

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 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
	市场利率下降25个基点	10,554.45	27,561.90
市场利率上升25个基点	-10,535.61	-27,486.95	

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 2023年06月30日		上年度末 2022年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净	公允价值	占基金 资产净

		值比例 (%)		值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	4,901,386.00	19.81	7,551,240.00	24.33
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	4,988,038.03	16.07
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	4,901,386.00	19.81	12,539,278.03	40.41

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

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 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
	沪深300指数上升5%	-	412,922.72
	沪深300指数下降5%	-	-412,922.72

注：于2023年6月30日，本基金持有的交易性权益类投资和资产支持证券投资公允价值占基金资产净值的比例为19.81%（于2022年12月31日：无），因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响（于2022年12月31日：同）。

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

金额单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	4,901,386.00	12,372,322.15
第二层次	22,123,401.83	22,988,150.87
第三层次	-	-
合计	27,024,787.83	35,360,473.02

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2023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(2022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	4,901,386.00	17.03
	其中：股票	4,901,386.00	17.03
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	22,123,401.83	76.88
	其中：债券	22,123,401.83	76.88
	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	1,000,000.00	3.48
	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	721,171.44	2.51
8	其他各项资产	29,439.29	0.10
9	合计	28,775,398.56	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	-	-
C	制造业	3,729,278.00	15.07
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	240,700.00	0.97
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	294,900.00	1.19
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	636,508.00	2.57

J	金融业	-	-
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	-	-
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	4,901,386.00	19.81

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	300502	新易盛	5,800	394,226.00	1.59
2	300260	新莱应材	8,000	316,160.00	1.28
3	600377	宁沪高速	30,000	294,900.00	1.19
4	600150	中国船舶	8,800	289,608.00	1.17
5	688502	茂莱光学	1,500	288,000.00	1.16
6	688409	富创精密	2,500	272,500.00	1.10
7	601728	中国电信	48,000	270,240.00	1.09
8	002371	北方华创	800	254,120.00	1.03
9	688120	华海清科	1,000	252,050.00	1.02
10	600863	内蒙华电	58,000	240,700.00	0.97
11	688205	德科立	2,800	204,736.00	0.83

12	688700	东威科技	2,000	199,460.00	0.81
13	002230	科大讯飞	2,800	190,288.00	0.77
14	301018	申菱环境	5,000	179,950.00	0.73
15	300360	炬华科技	10,000	178,800.00	0.72
16	603915	国茂股份	8,000	169,440.00	0.68
17	002236	大华股份	8,000	158,000.00	0.64
18	601137	博威合金	10,000	155,600.00	0.63
19	000988	华工科技	3,800	144,438.00	0.58
20	000795	英洛华	18,000	136,440.00	0.55
21	600161	天坛生物	5,000	135,750.00	0.55
22	002624	完美世界	6,000	101,340.00	0.41
23	600941	中国移动	800	74,640.00	0.30

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	300502	新易盛	2,247,005.00	7.24
2	603529	爱玛科技	1,992,246.00	6.42
3	600941	中国移动	1,950,288.00	6.28
4	688120	华海清科	1,932,521.96	6.23
5	300188	美亚柏科	1,735,143.20	5.59
6	600028	中国石化	1,626,600.00	5.24
7	600150	中国船舶	1,557,269.00	5.02
8	600809	山西汾酒	1,481,042.00	4.77
9	300226	上海钢联	1,418,869.71	4.57
10	000977	浪潮信息	1,377,475.00	4.44
11	301018	申菱环境	1,366,342.00	4.40
12	688409	富创精密	1,322,524.44	4.26
13	601888	中国中免	1,300,877.00	4.19

14	002230	科大讯飞	1,232,194.00	3.97
15	300308	中际旭创	1,188,035.00	3.83
16	300832	新产业	1,156,929.00	3.73
17	603076	乐惠国际	1,124,979.00	3.63
18	603993	洛阳钼业	1,107,800.00	3.57
19	688498	源杰科技	1,079,949.23	3.48
20	002222	福晶科技	1,063,885.00	3.43
21	600172	黄河旋风	1,062,153.00	3.42
22	300415	伊之密	1,029,560.00	3.32
23	300360	炬华科技	991,909.54	3.20
24	601890	亚星锚链	965,633.00	3.11
25	000032	深桑达 A	945,750.00	3.05
26	688256	寒武纪	942,635.59	3.04
27	002236	大华股份	926,276.00	2.98
28	688292	浩瀚深度	915,349.35	2.95
29	603658	安图生物	876,985.00	2.83
30	300496	中科创达	876,720.00	2.83
31	301030	仕净科技	850,243.00	2.74
32	000988	华工科技	839,677.00	2.71
33	688981	中芯国际	833,563.34	2.69
34	603348	文灿股份	802,559.00	2.59
35	688700	东威科技	785,759.70	2.53
36	003031	中瓷电子	771,954.00	2.49
37	600600	青岛啤酒	769,171.00	2.48
38	600418	江淮汽车	744,826.00	2.40
39	300620	光库科技	726,441.00	2.34
40	603236	移远通信	719,497.00	2.32
41	300260	新莱应材	710,770.00	2.29
42	000831	中国稀土	683,430.00	2.20
43	002821	凯莱英	682,753.00	2.20
44	002965	祥鑫科技	669,779.00	2.16

45	603986	兆易创新	656,820.00	2.12
46	002174	游族网络	631,180.00	2.03
47	002463	沪电股份	621,869.00	2.00
48	688205	德科立	621,813.56	2.00

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。

7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值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	300502	新易盛	2,278,109.00	7.34
2	603529	爱玛科技	2,011,920.00	6.48
3	688120	华海清科	1,907,794.50	6.15
4	600941	中国移动	1,889,962.00	6.09
5	300188	美亚柏科	1,695,044.00	5.46
6	600028	中国石化	1,674,443.00	5.40
7	603076	乐惠国际	1,541,107.00	4.97
8	300226	上海钢联	1,512,694.48	4.87
9	600809	山西汾酒	1,423,486.00	4.59
10	300832	新产业	1,357,785.00	4.38
11	688409	富创精密	1,353,543.54	4.36
12	600150	中国船舶	1,329,787.00	4.28
13	000977	浪潮信息	1,314,138.00	4.23
14	300308	中际旭创	1,291,467.00	4.16
15	688498	源杰科技	1,248,638.97	4.02
16	301018	申菱环境	1,200,211.00	3.87
17	601888	中国中免	1,187,858.00	3.83
18	002230	科大讯飞	1,171,441.00	3.77
19	600172	黄河旋风	1,124,605.00	3.62
20	301030	仕净科技	1,084,152.00	3.49

21	603993	洛阳钼业	1,047,887.00	3.38
22	300415	伊之密	1,047,603.00	3.38
23	002222	福晶科技	1,041,783.00	3.36
24	603658	安图生物	1,032,375.40	3.33
25	002965	祥鑫科技	992,316.00	3.20
26	601890	亚星锚链	973,824.00	3.14
27	688256	寒武纪	957,446.26	3.09
28	300496	中科创达	946,321.00	3.05
29	000032	深桑达 A	926,259.00	2.98
30	002236	大华股份	892,900.00	2.88
31	300260	新莱应材	870,500.00	2.81
32	688981	中芯国际	833,057.66	2.68
33	688292	浩瀚深度	830,435.80	2.68
34	000988	华工科技	801,635.00	2.58
35	003031	中瓷电子	784,490.00	2.53
36	300620	光库科技	756,783.00	2.44
37	600600	青岛啤酒	745,062.00	2.40
38	603236	移远通信	736,150.00	2.37
39	603348	文灿股份	719,974.60	2.32
40	300360	炬华科技	718,109.96	2.31
41	600258	首旅酒店	690,831.00	2.23
42	600418	江淮汽车	690,102.00	2.22
43	601872	招商轮船	689,550.00	2.22
44	300382	斯莱克	642,732.00	2.07
45	002821	凯莱英	638,232.00	2.06
46	002174	游族网络	633,907.00	2.04
47	000831	中国稀土	632,537.00	2.04
48	002463	沪电股份	631,206.00	2.03
49	688313	仕佳光子	628,655.38	2.03

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	90,692,245.55
卖出股票收入（成交）总额	93,045,780.41

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	11,857,771.70	47.93
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,265,630.13	41.49
	其中：政策性金融债	10,265,630.13	41.49
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	22,123,401.83	89.42

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	018008	国开1802	50,000	5,185,565.75	20.96
2	220211	22国开11	50,000	5,080,064.38	20.53
3	019688	22国债23	43,000	4,348,128.19	17.57
4	019679	22国债14	40,000	4,071,915.62	16.46
5	019694	23国债01	34,000	3,437,727.89	13.90

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

本基金投资的前十大证券的发行主体本报告期内没有被监管部门立案调查，或在报告编制期日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

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	29,439.29
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	29,439.29

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	2,301	5,703.70	1.97	0.00%	13,124,218.81	100.00%
汇安嘉盈一年持有	6,488	1,849.14	0.00	0.00%	11,997,188.86	100.00%

期债券C						
合计	8,695	2,889.18	1.97	0.00%	25,121,407.67	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	16.61	0.0001%
	汇安嘉盈一年持有期债券C	16,163.04	0.13%
	合计	16,179.65	0.06%

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
	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	0~10
	合计	0~10

§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
--	--------------	--------------

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	16,085,902.20	15,214,911.30
本报告期基金总申购份额	58,471.30	109,207.61
减：本报告期基金总赎回份额	3,020,152.72	3,326,930.05
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	13,124,220.78	11,997,188.86

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

基金管理人自2023年3月31日0:00起至2023年4月28日17:00止，以通讯方式召开汇安嘉盈一年持有期债券型证券投资基金的基金份额持有人大会，审议《关于持续运作汇安嘉盈一年持有期债券型证券投资基金的议案》。经统计，有效参加基金份额持有人大会表决的基金份额未达到法定的基金份额持有人大会召开条件。基金管理人已于2023年5月5日在指定信息披露媒介及公司网站上就会议情况进行了公告。

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，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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

自本基金成立日（2021年2月2日）起至今聘任普华永道中天会计师事务所(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、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用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	
海通证券	2	183,738,025.96	100.00%	132,530.41	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；
- 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

基金管理人根据以上标准对不同券商经纪人进行考察、选择和确定，选定的经纪人名单需经风险管理小组审批同意。基金管理人与被选择的证券经营机构签订委托协议。基金管理人与被选择的券商经纪人在签订委托代理协议时，要明确签定协议双方的公司名称、委托代理期限、佣金率、双方的权利义务等，经签章有效。委托代理协议一式三份，协议双方及证券主管机关各留存一份，基金管理人留存合规风控部备案。

(3) 交易单元变更情况

本基金本报告期内无交易单元变更。

10.7.2 基金租用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
海通证券	47,739,190.88	100.00%	556,370,000.00	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	汇安基金管理有限责任公司旗下证券投资基金2022年12月31日份额净值公告	规定报刊和/或公司网站	2023-01-01
2	汇安嘉盈一年持有期债券型证券投资基金2022年第4季度报告	规定报刊和/或公司网站	2023-01-19
3	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	2023-02-27
4	汇安嘉盈一年持有期债券型证券投资基金暂停代销渠道申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	规定报刊和/或公司网站	2023-03-06
5	汇安基金管理有限责任公司关于以通讯方式召开汇安嘉盈一年持有期债券型证券投资基金基金份额持有人大会的公告	规定报刊和/或公司网站	2023-03-27
6	汇安基金管理有限责任公司关于以通讯方式召开汇安嘉	规定报刊和/或公司网站	2023-03-28

	盈一年持有期债券型证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告		
7	汇安基金管理有限责任公司关于以通讯方式召开汇安嘉盈一年持有期债券型证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告	规定报刊和/或公司网站	2023-03-29
8	汇安嘉盈一年持有期债券型证券投资基金2022年年度报告	规定报刊和/或公司网站	2023-03-31
9	汇安嘉盈一年持有期债券型证券投资基金（2023年第1号）招募说明书（更新）	规定报刊和/或公司网站	2023-04-14
10	汇安嘉盈一年持有期债券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	2023-04-14
11	汇安嘉盈一年持有期债券型证券投资基金2023年第1季度报告	规定报刊和/或公司网站	2023-04-22
12	汇安基金管理有限责任公司关于汇安嘉盈一年持有期债券型证券投资基金基金份额持有人大会会议情况的公告	规定报刊和/或公司网站	2023-05-05

§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
二〇二三年八月三十一日