

汇泉安盈回报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:汇泉基金管理有限公司
基金托管人:平安银行股份有限公司
报告送出日期:2023 年 08 月 25 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。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 月 23 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 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	5
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	6
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
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	11
§5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
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	11
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	11
§6 半年度财务会计报告(未经审计)	11
6.1 资产负债表	11
6.2 利润表	13
6.3 净资产(基金净值)变动表	14
6.4 报表附注	15
§7 投资组合报告	34
7.1 期末基金资产组合情况	34
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	35
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	35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	37
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	38
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	38
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	39
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	39
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	39
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	39
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	39
7.12 投资组合报告附注	39
§8 基金份额持有人信息	40
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	40
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	40
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	40
§9 开放式基金份额变动	41
§10 重大事件揭示	41
10.1 基金份额持有人大会决议	41

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	41
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	41
10.4 基金投资策略的改变	41
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	42
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	42
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	42
10.8 其他重大事件	42
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	43
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	43
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	43
§ 12 备查文件目录	44
12.1 备查文件目录	44
12.2 存放地点	44
12.3 查阅方式	44

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	汇泉安盈回报债券型证券投资基金		
基金简称	汇泉安盈回报债券		
基金主代码	016124		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2022 年 09 月 07 日		
基金管理人	汇泉基金管理有限公司		
基金托管人	平安银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	152,012,260.16 份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称	汇泉安盈回报债券 A	汇泉安盈回报债券 C	汇泉安盈回报债券 E
下属分级基金的交易代码	016124	016125	018684
报告期末下属分级基金的份额总额	105,152,745.36 份	9,263,192.70 份	37,596,322.10 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于债券等固定收益类金融工具，辅助投资于精选的股票，通过严谨的风险管理，力求实现基金资产持续稳定增值。
投资策略	本基金的投资策略主要包括： 1、资产配置策略；2、债券投资策略；3、股票投资策略；4、存托凭证投资策略；5、国债期货投资策略
业绩比较基准	中债综合全价（总值）指数收益率×90%+沪深 300 指数收益率×10%
风险收益特征	基金为债券型基金，其长期平均预期风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型、股票型基金。本基金如投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

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		汇泉基金管理有限公司	平安银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	寻卫国	李帅帅
	联系电话	010-81925263	0755-25878287
	电子邮箱	xunwg@springsfund.com	LISHUAISHUAI130@pingan.com.cn
客户服务电话		400-001-5252、010-81925252	95511-3
传真		010-81925299	0755-82080387
注册地址		北京市通州区贡院街 1 号院 1 号楼二层 206-40 室	广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 号
办公地址		北京市海淀区西直门外大街 168 号腾达大厦 16 层	广东省深圳市福田区益田路 5023 号平安金融中心 B 座
邮政编码		100044	518001
法定代表人		梁永强	谢永林

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.springsfund.com

基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公地址
------------	------------------

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	汇泉基金管理有限公司	北京市海淀区西直门外大街 168 号腾达大厦 16 层

§ 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）		
	汇泉安盈回报债券 A	汇泉安盈回报债券 C	汇泉安盈回报债券 E
本期已实现收益	-1,459,775.34	-324,610.49	931.13
本期利润	-69,988.02	-213,989.80	74,046.03
加权平均基金份额本期利润	-0.0006	-0.0132	0.0036
本期加权平均净值利润率	-0.06%	-1.34%	0.37%
本期基金份额净值增长率	-0.33%	-0.50%	0.31%
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	-2,155,682.91	-212,238.73	-637,621.53
期末可供分配基金份额利润	-0.0205	-0.0229	-0.0170
期末基金资产净值	103,687,162.75	9,111,570.74	37,072,946.03
期末基金份额净值	0.9861	0.9836	0.9861
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	-1.39%	-1.64%	0.31%

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、期末可供分配利润，为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的孰低数。

4、本基金自 2023 年 6 月 26 日起增设 E 类基金份额。汇泉安盈回报债券 E 基金份额的首次确认日为 2023 年 6 月 29 日，增设当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

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

汇泉安盈回报债券 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	0.34%	0.24%	0.28%	0.09%	0.06%	0.15%
过去三个月	-0.33%	0.19%	0.33%	0.08%	-0.66%	0.11%
过去六个月	-0.33%	0.17%	1.06%	0.08%	-1.39%	0.09%
自基金合同生效	-1.39%	0.14%	-0.23%	0.10%	-1.16%	0.04%

起至今						
-----	--	--	--	--	--	--

汇泉安盈回报债券 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	0.31%	0.24%	0.28%	0.09%	0.03%	0.15%
过去三个月	-0.41%	0.19%	0.33%	0.08%	-0.74%	0.11%
过去六个月	-0.50%	0.17%	1.06%	0.08%	-1.56%	0.09%
自基金合同生效 起至今	-1.64%	0.14%	-0.23%	0.10%	-1.41%	0.04%

汇泉安盈回报债券 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
自 2023 年 6 月 26 日起至今	0.31%	0.10%	0.07%	0.09%	0.24%	0.01%

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

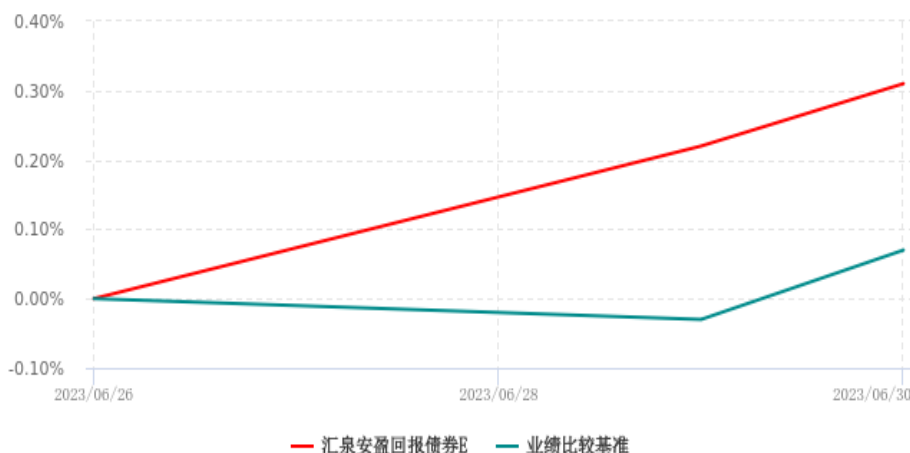
汇泉安盈回报债券A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2022年09月07日-2023年06月30日)



汇泉安盈回报债券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
(2022年09月07日-2023年06月30日)



汇泉安盈回报债券E累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2023年06月26日-2023年06月30日)



注：1、本基金合同于 2022 年 9 月 7 日生效，截至报告期末本基金合同生效未满一年；

2、按照本基金合同和招募说明书的约定，自基金成立日起 6 个月内为建仓期，建仓期结束时各项资产配置比例符合约定；

3、本基金自 2023 年 6 月 26 日起增设 E 类基金份额。汇泉安盈回报债券 E 基金份额的首次确认为 2023 年 6 月 29 日。

§ 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

汇泉基金管理有限公司（以下简称“我公司”）经中国证券监督管理委员会证监许可【2020】1028 号文批准，于 2020 年 6 月 15 日在北京市注册成立，注册资本 1 亿元人民币。并于 2020 年 12 月 21 日取得中国证券监督管理委员会核发的《经营证券期货业务许可证》。我公司目前股东及其出资比例：杨宇先生 55.30%，梁永强先生 30.00%，北京溪泉企业管理中心（有限合伙）4.90%，上

海澱泉企业管理中心（有限合伙）4.90%，上海沛泉企业管理中心（有限合伙）4.90%。

截至本报告期末，我公司共管理 5 只公募基金，具体包括汇泉策略优选混合型证券投资基金、汇泉臻心致远混合型证券投资基金、汇泉兴至未来一年持有期混合型证券投资基金、汇泉安盈回报债券型证券投资基金、汇泉匠心智选一年持有期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期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘文超	固定收益投资部总监、基金经理	2022-09-07	-	8 年	中国国籍，硕士研究生，具有基金从业资格。曾任北京大宗商品交易所有限公司大宗商品研究员，北京金融资产交易所有限公司业务经理，华安财保资产管理有限责任公司投资经理，东证融汇证券资产管理有限公司投资经理。现任汇泉基金管理有限公司固定收益投资部总监、基金经理。

注：1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期；对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2、证券从业的含义遵从《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

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，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金运作合法合规，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

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

本报告期内，未出现违反公平交易制度的情况，公司旗下各基金不存在因非公平交易等导致的利益输送行为，公平交易制度的整体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的

交易所公开竞价，未出现同日反向交易成交较少的单边交易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

报告期内，在大类资产配置层面，债券部分维持标配，以票息收益和信用利差收缩带来的信用债资本利得为主要收益来源。二季度债券市场利率债表现好于信用债，久期暴露稍显不足，后续操作中将对利率债波段机会的捕捉。股票部分以中性偏高仓位为主，配置方式采取哑铃策略，在积极布局 TMT 为主要方向的积极成长个股的同时，搭配以公用事业为代表的传统经济行业中的高股息品种，力求做到守住成长股的核心标的的同时，平抑组合短期过大回撤。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末汇泉安盈回报债券 A 基金份额净值为 0.9861 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-0.33%，同期业绩比较基准收益率为 1.06%；截至报告期末汇泉安盈回报债券 C 基金份额净值为 0.9836 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-0.50%，同期业绩比较基准收益率为 1.06%；截至报告期末汇泉安盈回报债券 E 基金份额净值为 0.9861 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 0.31%，同期业绩比较基准收益率为 0.07%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年的债券市场，地产、城投领域的融资约束将是未来的长期趋势，宏观经济偏弱、货币维持宽松仍是大概率事件。目前，高等级信用债的信用利差已大幅压缩，中低评级信用债存在较大估值波动风险，信用债投资在类属资产配置中的性价比相对下降。利率债投资的比重在下半年将适度提升，尤其关注在重大经济会议前夕，市场预期朦胧时段及地缘事件的冲击带来的长久期利率债交易性机会。

下半年股票方面，将适度回避 7 月份中央经济工作会议前市场对经济刺激政策预期被证伪的风险，阶段性降低权益敞口。同时 7 月份也是业绩密集发布期，TMT 行业的业绩释放仍需时间，前期涨幅较大的成长股存在一定的回调概率。如政策层面仍以结构性改革为主要思路而非传统的总量刺激，那么大市值股票估值水平也将受到压制。从市场平均估值水平和大类资产性价比的角度，权益市场如出现短期进一步调整，下半年战略性加大权益仓位的机会将会浮现。行业配置方向，信创、机器人、军工等高端制造方向值得持续重点关注，算力、游戏、教育、数据要素、机器人产业链等子方向相对确定性更优。此外，电力、水务等高股息价值标的对组合平衡具有重要作用，且今年以来业绩确定性在宏观偏弱的背景下相对稀缺，静态股息率较高的标的，相较高等级信用债亦具备相对性价比。

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、中国证券投资基金业协会相关指引和

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。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

本基金管理人设有估值委员会，负责对估值政策和程序进行定期评价和适时调整，指导和监督估值流程。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，具备基金估值运作、行业研究、风险管理和法律合规等领域的专业胜任能力。基金经理参与估值委员会会议，但不介入基金日常估值业务。

本报告期内，本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

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

报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，平安银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本报告期，本托管人复核的财务指标、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真实、准确、完整。

§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：汇泉安盈回报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	407,126.85	2,696,542.61
结算备付金		106,921.15	—

存出保证金		450,341.74	1,734,494.63
交易性金融资产	6.4.7.2	138,174,980.28	151,912,987.94
其中：股票投资		20,354,885.08	7,850,638.55
基金投资		-	-
债券投资		117,820,095.20	144,062,349.39
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	-	55,987,899.47
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		16,999,009.99	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		156,138,380.01	212,331,924.65
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		5,999,269.38	-
应付清算款		-	718,507.45
应付赎回款		98,305.82	182,895.76
应付管理人报酬		55,919.19	111,603.74
应付托管费		9,319.87	18,600.62
应付销售服务费		2,285.49	4,753.67
应付投资顾问费		-	-
应交税费		5,309.42	7,974.78
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	96,291.32	113,381.36
负债合计		6,266,700.49	1,157,717.38
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	152,012,260.16	213,441,981.67
其他综合收益		-	-

未分配利润	6.4.7.8	-2,140,580.64	-2,267,774.40
净资产合计		149,871,679.52	211,174,207.27
负债和净资产总计		156,138,380.01	212,331,924.65

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额总额 152,012,260.16 份。其中汇泉安盈回报债券 A 基金份额净值 0.9861 元，基金份额总额 105,152,745.36 份；汇泉安盈回报债券 C 基金份额净值 0.9836 元，基金份额总额 9,263,192.70 份；汇泉安盈回报债券 E 基金份额净值 0.9861 元，基金份额总额 37,596,322.10 份。

6.2 利润表

会计主体：汇泉安盈回报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
一、营业总收入		511,411.35
1. 利息收入		64,472.55
其中：存款利息收入	6.4.7.9	24,066.36
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		40,406.19
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-1,211,898.80
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-2,567,134.36
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.11	1,260,863.31
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	94,372.25
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	1,573,522.91
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	85,314.69
减：二、营业总支出		721,343.14
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	413,310.38

2. 托管费	6.4.10.2.2	68,885.02
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	23,582.07
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		105,282.86
其中：卖出回购金融资产支出		105,282.86
6. 信用减值损失		-
7. 税金及附加		5,396.49
8. 其他费用	6.4.7.18	104,886.32
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-209,931.79
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-209,931.79
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		-209,931.79

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：汇泉安盈回报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）	213,441,981.67	-	-2,267,774.40	211,174,207.27
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）	213,441,981.67	-	-2,267,774.40	211,174,207.27
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-61,429,721.51	-	127,193.76	-61,302,527.75
（一）、综合收益总额	-	-	-209,931.79	-209,931.79
（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）	-61,429,721.51	-	337,125.55	-61,092,595.96
其中：1. 基金申购款	150,604,938.38	-	-1,793,141.11	148,811,797.27
2. 基金赎回款	-	-	2,130,266.66	-209,904,393.23
（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）	152,012,260.16	-	-2,140,580.64	149,871,679.52

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：

梁永强	陈磊	武翌
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

汇泉安盈回报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[2022]1262 号《关于准予汇泉安盈回报债券型证券投资基金注册的批复》注册，由汇泉基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《汇泉安盈回报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 318,152,865.44 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(2022)第 0782 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《汇泉安盈回报债券型证券投资基金基金合同》于 2022 年 9 月 7 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 318,212,956.77 份基金份额，其中认购资金利息折合 60,091.33 份基金份额。本基金的基金管理人为汇泉基金管理有限公司，基金托管人为平安银行股份有限公司。

根据本基金的基金管理人汇泉基金管理有限公司于 2023 年 6 月 21 日发布的《汇泉基金管理有限公司关于汇泉安盈回报债券型证券投资基金增设 E 类基金份额并修改基金合同和托管协议的公告》以及更新后的《汇泉安盈回报债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，自 2023 年 6 月 26 日起，本基金增设 E 类基金份额。本基金根据申购费用、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人申购时收取申购费用，并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，包括 A 类基金份额、E 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费，并不收取认购/申购费用的基金份额，称为 C 类基金份额。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，分别计算并公布基金份额净值和基金份额累计净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《汇泉安盈回报债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围包括债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府机构债券、地方政府债券、可交换债券、可转换债券(含分离交易可转债)及其他经中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、同业

存单、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、国债期货、国内依法发行上市的股票(含主板、创业板及其他经中国证监会允许基金投资的股票、存托凭证)、港股通标的股票(包括沪港通股票及深港通股票)以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人将在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围,并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。基金的投资组合比例为:本基金投资于债券的比例不低于基金资产的 80%,投资于股票、可转换债券、可交换债券等资产的比例合计不超过基金资产的 20%,港股通标的股票的投资比例为股票资产的 0%-50%;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,基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%,本基金所指的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:中债综合全价(总值)指数收益率 $\times$ 90%+沪深 300 指数收益率 $\times$ 10%。

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》、《汇泉安盈回报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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2023 年中期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 日止期间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和会计估计与最近一期年度报告一致。

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《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《财政部、国家税务总局、证监会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[2014]81 号《财政部、国家税务总局、证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101 号《财政部、国家税务总局、证监会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《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《财政部、国家税务总局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《财政部、国家税务总局关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127 号《财政部、国家税务总局、证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140 号《财政部、国家税务总局关于明确金融 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《财政部、国家税务总局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《财政部、税务总局关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《财政部、税务总局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。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中国结算”）提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(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。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(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	407,126.85
等于：本金	407,083.76
加：应计利息	43.09
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	407,126.85

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	19,839,957.11	—	20,354,885.08	514,927.97
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—	—

债券	交易所市场	55,752,510.65	790,556.73	56,274,857.53	-268,209.85
	银行间市场	60,346,989.61	1,106,237.67	61,545,237.67	92,010.39
	合计	116,099,500.26	1,896,794.40	117,820,095.20	-176,199.46
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		135,939,457.37	1,896,794.40	138,174,980.28	338,728.51

注：股票投资的成本、公允价值及公允价值变动均包含中国存托凭证的成本、公允价值及公允价值变动。

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

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	705.00
其中：交易所市场	-
银行间市场	705.00
应付利息	-
预提费用	95,586.32
合计	96,291.32

6.4.7.7 实收基金

汇泉安盈回报债券 A

金额单位：人民币元

项目	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	198,876,512.98	198,876,512.98
本期申购	91,319,740.15	91,319,740.15
本期赎回（以“-”号填列）	-185,043,507.77	-185,043,507.77
本期末	105,152,745.36	105,152,745.36

汇泉安盈回报债券 C

金额单位：人民币元

项目	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	14,565,468.69	14,565,468.69
本期申购	21,688,876.13	21,688,876.13
本期赎回（以“-”号填列）	-26,991,152.12	-26,991,152.12
本期末	9,263,192.70	9,263,192.70

汇泉安盈回报债券 E

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 06 月 26 日（新增份额日）至 2023 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	-	-
本期申购	37,596,322.10	37,596,322.10
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	37,596,322.10	37,596,322.10

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

汇泉安盈回报债券 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-1,384,761.02	-715,373.54	-2,100,134.56
本期利润	-1,459,775.34	1,389,787.32	-69,988.02
本期基金份额交易产生的变动数	688,853.45	15,686.52	704,539.97
其中：基金申购款	-918,029.38	-45,632.48	-963,661.86
基金赎回款	1,606,882.83	61,319.00	1,668,201.83
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-2,155,682.91	690,100.30	-1,465,582.61

汇泉安盈回报债券 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-115,257.45	-52,382.39	-167,639.84
本期利润	-324,610.49	110,620.69	-213,989.80
本期基金份额交易产生的变动数	227,629.21	2,378.47	230,007.68
其中：基金申购款	-232,764.91	707.76	-232,057.15
基金赎回款	460,394.12	1,670.71	462,064.83
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-212,238.73	60,616.77	-151,621.96

汇泉安盈回报债券 E

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	931.13	73,114.90	74,046.03
本期基金份额交易产生的变动数	-638,552.66	41,130.56	-597,422.10
其中：基金申购款	-638,552.66	41,130.56	-597,422.10
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-637,621.53	114,245.46	-523,376.07

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	7,170.94
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	6,921.15
其他	9,974.27
合计	24,066.36

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
卖出股票成交总额	402,399,845.71
减：卖出股票成本总额	403,866,981.65
减：交易费用	1,099,998.42
买卖股票差价收入	-2,567,134.36

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	1,790,618.62
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-529,755.31
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	1,260,863.31

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	209,526,608.44
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	208,117,026.59
减：应计利息总额	1,931,081.06
减：交易费用	8,256.10
买卖债券差价收入	-529,755.31

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.13 贵金属投资收益

无。

6.4.7.14 衍生工具收益

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	94,372.25
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	94,372.25

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	1,573,522.91
——股票投资	524,420.26
——债券投资	1,049,102.65
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——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	1,573,522.91

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日
基金赎回费收入	85,314.69
合计	85,314.69

注：1、本基金的赎回费率按持有期间递减，将赎回费收入全额归入基金资产。

2、本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，将转出基金的赎回费全额归入转出基金的基金资产。

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	26,778.95
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	18,600.00
合计	104,886.32

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

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

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

本报告期与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

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
汇泉基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
平安银行股份有限公司(“平安银行”)	基金托管人、基金销售机构
杨宇	基金管理人股东
梁永强	基金管理人股东
上海沛泉企业管理中心(有限合伙)	基金管理人股东
上海澹泉企业管理中心(有限合伙)	基金管理人股东
北京溪泉企业管理中心(有限合伙)	基金管理人股东

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 2023 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	413,310.38
其中：支付销售机构的客户维护费	30,812.40

注：支付基金管理人汇泉基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.60%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 × 0.60% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	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托管费	68,885.02

注：支付基金托管人平安银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.10% / 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			
	汇泉安盈回报债券 A	汇泉安盈回报债券 C	汇泉安盈回报债券 E	合计
汇泉基金管理有限公司	-	6,654.89	-	6,654.89
平安银行	-	-	-	-

合计	-	6,654.89	-	6,654.89
----	---	----------	---	----------

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值 0.30% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给基金管理人，再由基金管理人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 类基金资产净值 × 0.30% / 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

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	
	期末余额	当期利息收入
平安银行	407,126.85	7,170.94

注：本基金的银行存款由基金托管人平安银行保管，按银行同业利率或约定利率计息。

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

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，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 5,999,269.38 元，于 2023 年 07 月 03 日（先后）到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，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

本基金是债券型基金，预期风险和预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资和债券投资等。本基金在日常投资管理中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金可投资港股通标的股票，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括港股市场股价波动较大的风险、汇率风险、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险等。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险管理委员会、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险管理委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估，督察长负责组织指导监察稽核工作。

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。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，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平安银行，其他存款存放于国海证券股份有限公司，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	7,583,944.52	13,089,130.14
合计	7,583,944.52	13,089,130.14

注：未评级债券为国债。

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 2023 年 06 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
AAA	79,108,946.94	90,297,405.15
AAA 以下	5,753,599.64	20,948,565.48
未评级	25,373,604.10	19,727,248.62
合计	110,236,150.68	130,973,219.25

注：未评级债券为国债。

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随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于 2023 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 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，本基金未持有流

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为 117,429,312.66 元，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	407,126.85	-	-	-	407,126.85
结算备	106,921.15	-	-	-	106,921.15

付金					
存出保证金	450,341.74	-	-	-	450,341.74
交易性金融资产	32,018,694.79	85,100,925.97	700,474.44	20,354,885.08	138,174,980.28
应收申购款	-	-	-	16,999,009.99	16,999,009.99
资产总计	32,983,084.53	85,100,925.97	700,474.44	37,353,895.07	156,138,380.01
负债					
卖出回购金融资产款	5,999,269.38	-	-	-	5,999,269.38
应付赎回款	-	-	-	98,305.82	98,305.82
应付管理人报酬	-	-	-	55,919.19	55,919.19
应付托管费	-	-	-	9,319.87	9,319.87
应付销售服务费	-	-	-	2,285.49	2,285.49
应交税费	-	-	-	5,309.42	5,309.42
其他负债	-	-	-	96,291.32	96,291.32
负债总计	5,999,269.38	-	-	267,431.11	6,266,700.49
利率敏感度缺口	26,983,815.15	85,100,925.97	700,474.44	37,086,463.96	149,871,679.52
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	2,696,542.61	-	-	-	2,696,542.61
存出保证金	1,734,494.63	-	-	-	1,734,494.63
交易性	23,166,348.77	101,168,752.00	19,727,248.62	7,850,638.55	151,912,987.94

金融资产					
买入返售金融资产	55,987,899.47	-	-	-	55,987,899.47
资产总计	83,585,285.48	101,168,752.00	19,727,248.62	7,850,638.55	212,331,924.65
负债					
应付清算款	-	-	-	718,507.45	718,507.45
应付赎回款	-	-	-	182,895.76	182,895.76
应付管理人报酬	-	-	-	111,603.74	111,603.74
应付托管费	-	-	-	18,600.62	18,600.62
应付销售服务费	-	-	-	4,753.67	4,753.67
应交税费	-	-	-	7,974.78	7,974.78
其他负债	-	-	-	113,381.36	113,381.36
负债总计	-	-	-	1,157,717.38	1,157,717.38
利率敏感度缺口	83,585,285.48	101,168,752.00	19,727,248.62	6,692,921.17	211,174,207.27

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
	1. 市场利率上升 25 个基点	-274,138.28	-804,354.92
	2. 市场利率下降 25 个基点	275,164.16	816,545.67

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

持有不以记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 06 月 30 日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				
资产合计	-	-	-	-
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	-	-	-
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	1,750,630.55	-	1,750,630.55
资产合计	-	1,750,630.55	-	1,750,630.55
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	1,750,630.55	-	1,750,630.55

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇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
	1. 所有外币相对人民币升值 5%	-	87,531.53
	2. 所有外币相对人民币贬值 5%	-	-87,531.53

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，采用“自上而下”的策略，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%，投资于股票、可转换债券、可交换债券等资产的比例合计不超过基金资产的 20%，港股通标的股票的投资比例为股票资产的 0%-50%；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，基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，本基金所指的现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。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，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，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	20,354,885.08	13.58	7,850,638.55	3.72
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
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	20,354,885.08	13.58	7,850,638.55	3.72

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数收益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
	1. 沪深 300 指数收益率上升 5%	848,576.25	—
	2. 沪深 300 指数收益率下降 5%	-848,576.25	—

注：于 2022 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性权益类投资公允价值占基金净资产的比例并不重大，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净资产无重大影响。

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 2023 年 06 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	26,108,484.72	7,823,998.55
第二层次	112,066,495.56	144,088,989.39
第三层次	-	-
合计	138,174,980.28	151,912,987.94

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、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

无。

§ 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	20,354,885.08	13.04
	其中：股票	20,354,885.08	13.04
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	117,820,095.20	75.46
	其中：债券	117,820,095.20	75.46
	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	514,048.00	0.33
8	其他各项资产	17,449,351.73	11.18
9	合计	156,138,380.01	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	15,574,265.08	10.39
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,629,750.00	1.09
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,754,970.00	1.84
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	395,900.00	0.26
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	20,354,885.08	13.58

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

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	占基金资产净值比例(%)
1	600900	长江电力	50,000	1,103,000.00	0.74
2	689009	九号公司	20,000	737,000.00	0.49
3	300866	安克创新	7,000	612,500.00	0.41
4	002422	科伦药业	20,000	593,600.00	0.40

5	600150	中国船舶	18,000	592,380.00	0.40
6	603662	柯力传感	14,970	550,896.00	0.37
7	600161	天坛生物	20,000	543,000.00	0.36
8	600674	川投能源	35,000	526,750.00	0.35
9	300124	汇川技术	8,000	513,680.00	0.34
10	002025	航天电器	8,000	510,400.00	0.34
11	688017	绿的谐波	3,000	487,200.00	0.33
12	688320	禾川科技	10,000	482,200.00	0.32
13	601126	四方股份	30,000	455,700.00	0.30
14	002599	盛通股份	50,000	452,500.00	0.30
15	002396	星网锐捷	20,000	451,800.00	0.30
16	600580	卧龙电驱	30,000	438,300.00	0.29
17	002851	麦格米特	12,000	437,640.00	0.29
18	603416	信捷电气	10,000	413,100.00	0.28
19	002801	微光股份	15,000	405,900.00	0.27
20	603728	鸣志电器	5,000	401,500.00	0.27
21	605098	行动教育	10,000	395,900.00	0.26
22	300101	振芯科技	20,000	387,800.00	0.26
23	605358	立昂微	9,996	367,153.08	0.24
24	002409	雅克科技	5,000	364,400.00	0.24
25	002979	雷赛智能	15,000	356,400.00	0.24
26	002555	三七互娱	10,000	348,800.00	0.23
27	300452	山河药辅	20,000	348,800.00	0.23
28	002600	领益智造	50,000	345,500.00	0.23
29	688088	虹软科技	8,000	342,000.00	0.23
30	688072	拓荆科技	800	340,776.00	0.23
31	300502	新易盛	5,000	339,850.00	0.23
32	688258	卓易信息	5,000	333,650.00	0.22
33	688686	奥普特	2,000	328,960.00	0.22
34	301101	明月镜片	8,000	328,240.00	0.22
35	600633	浙数文化	20,000	324,200.00	0.22
36	301117	佳缘科技	5,000	323,100.00	0.22
37	300418	昆仑万维	8,000	322,240.00	0.22
38	300445	康斯特	20,000	317,000.00	0.21
39	000960	锡业股份	20,000	311,000.00	0.21
40	002281	光迅科技	8,000	296,720.00	0.20
41	688036	传音控股	2,000	294,000.00	0.20
42	688008	澜起科技	5,000	287,100.00	0.19
43	688031	星环科技	2,000	266,480.00	0.18
44	003021	兆威机电	3,000	263,190.00	0.18
45	688515	裕太微	1,500	257,490.00	0.17
46	688095	福昕软件	2,000	252,760.00	0.17
47	688568	中科星图	3,000	241,740.00	0.16

48	688153	唯捷创芯	3,000	219,480.00	0.15
49	688205	德科立	3,000	219,360.00	0.15
50	002351	漫步者	10,000	206,800.00	0.14
51	002475	立讯精密	5,000	162,250.00	0.11
52	603019	中科曙光	3,000	152,700.00	0.10

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	688111	金山办公	7,219,815.95	3.42
2	688031	星环科技	6,559,888.23	3.11
3	603444	吉比特	6,359,117.00	3.01
4	688017	绿的谐波	5,374,815.87	2.55
5	600009	上海机场	4,947,305.00	2.34
6	688072	拓荆科技	4,857,781.65	2.30
7	688088	虹软科技	4,621,451.61	2.19
8	603019	中科曙光	4,358,728.24	2.06
9	688041	海光信息	4,299,952.10	2.04
10	600633	浙数文化	4,108,286.00	1.95
11	300383	光环新网	3,884,516.18	1.84
12	601668	中国建筑	3,836,532.00	1.82
13	002230	科大讯飞	3,806,007.00	1.80
14	002555	三七互娱	3,743,988.00	1.77
15	000617	中油资本	3,732,120.00	1.77
16	300496	中科创达	3,728,458.00	1.77
17	300379	东方通	3,652,324.34	1.73
18	000938	紫光股份	3,619,518.00	1.71
19	600862	中航高科	3,588,021.00	1.70
20	300101	振芯科技	3,552,005.00	1.68

注：本项的“买入金额”按买入成交金额（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	688111	金山办公	7,254,429.01	3.44
2	603444	吉比特	6,678,726.53	3.16
3	688031	星环科技	6,420,645.86	3.04
4	688017	绿的谐波	4,945,769.08	2.34

5	600009	上海机场	4,803,389.00	2.27
6	688072	拓荆科技	4,459,487.59	2.11
7	688041	海光信息	4,422,258.69	2.09
8	688088	虹软科技	4,304,338.43	2.04
9	601668	中国建筑	4,209,430.00	1.99
10	603019	中科曙光	4,159,586.00	1.97
11	300383	光环新网	3,973,009.64	1.88
12	002230	科大讯飞	3,909,837.00	1.85
13	600862	中航高科	3,787,215.00	1.79
14	000617	中油资本	3,746,774.00	1.77
15	300379	东方通	3,733,025.00	1.77
16	600633	浙数文化	3,717,569.00	1.76
17	300496	中科创达	3,630,611.00	1.72
18	002555	三七互娱	3,568,688.00	1.69
19	000938	紫光股份	3,541,566.40	1.68
20	300413	芒果超媒	3,313,794.00	1.57

注：本项的“卖出金额”均按卖出成交金额（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	415,846,807.92
卖出股票收入（成交）总额	402,399,845.71

注：本项的“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	32,957,548.62	21.99
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	27,714,273.65	18.49
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	51,394,673.29	34.29
7	可转债(可交换债)	5,753,599.64	3.84
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	117,820,095.20	78.61

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	102101393	21 招金 MTN003	100,000	10,404,583.56	6.94
2	102101383	21 物产中大 MTN001	100,000	10,380,643.84	6.93
3	155639	19 国管 02	100,000	10,373,019.18	6.92
4	102101964	21 蓝星 MTN001	100,000	10,262,769.86	6.85
5	102281478	22 中石油 MTN001	100,000	10,225,424.66	6.82

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

无。

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

无。

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

无。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

无。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

无。

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监管部门立案调查或报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形说明

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 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本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	450,341.74
2	应收清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	16,999,009.99
6	其他应收款	—

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	17,449,351.73

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	113061	拓普转债	4,050,729.04	2.70
2	127036	三花转债	1,002,396.16	0.67
3	110091	合力转债	700,474.44	0.47

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

§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
汇泉安盈回 报债券 A	60	1,752,545.76	103,305,591.23	98.24%	1,847,154.13	1.76%
汇泉安盈回 报债券 C	277	33,441.13	0.00	0.00%	9,263,192.70	100.00%
汇泉安盈回 报债券 E	3	12,532,107.37	37,596,322.10	100.00%	0.00	0.00%
合计	340	447,094.88	140,901,913.33	92.69%	11,110,346.83	7.31%

注：1、机构/个人投资者持有基金份额占总份额比例的计算中，针对下属分级份额，比例的分母采用各自级别的份额；对合计数，比例的分母采用下属分级份额的合计数（即期末基金份额总额）。

2、户均持有的基金份额的合计数=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

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	汇泉安盈回报债券 A	4,967.37	0.0047%
	汇泉安盈回报债券 C	2,039.64	0.0220%
	汇泉安盈回报债券 E	0.00	0.0000%
	合计	7,007.01	0.0046%

注：分级基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

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	汇泉安盈回报债券 A	0
	汇泉安盈回报债券 C	0
	汇泉安盈回报债券 E	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	汇泉安盈回报债券 A	0~10
	汇泉安盈回报债券 C	0
	汇泉安盈回报债券 E	0
	合计	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	汇泉安盈回报债券 A	汇泉安盈回报债券 C	汇泉安盈回报 债券 E
基金合同生效日（2022 年 09 月 07 日）基金份额总额	291,661,135.48	26,551,821.29	—
本报告期期初基金份额总额	198,876,512.98	14,565,468.69	—
本报告期基金总申购份额	91,319,740.15	21,688,876.13	37,596,322.10
减：本报告期基金总赎回份额	185,043,507.77	26,991,152.12	—
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	—	—	—
本报告期期末基金份额总额	105,152,745.36	9,263,192.70	37,596,322.10

注：1、总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

2、本基金自 2023 年 6 月 26 日起增设 E 类基金份额。汇泉安盈回报债券 E 基金份额的首次确认为 2023 年 6 月 29 日，增设当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本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

1. 基金管理人的重大人事变动

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

2. 基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，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，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略无变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金所聘用的会计师事务所无变化。

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

本报告期内，本基金管理人及其高级管理人员没有发生受稽查或处罚的情况。

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到稽查或处罚等情况。

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	
国海证券	2	818,246,653.63	100.00%	605,285.76	100.00%	-

注：1、本基金使用证券公司交易结算模式，可免于执行《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》关于交易佣金分仓的规定。

2、本基金管理人负责选择证券经纪商，使用其交易单元作为本基金的交易单元。基金证券经纪商选择标准包括：公司基本面评价（财务情况、资信状况、经营情况）、公司券商结算模式服务评价（稳定性、及时性）等方面。根据前述标准由基金管理人考察后确定选用证券经纪商，并与其签订证券经纪服务协议。

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
国海证券	296,930,915.29	100.00%	751,200,000.00	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	汇泉安盈回报债券型证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2023-01-20

2	汇泉安盈回报债券型证券投资基金 2022 年年度报告	中国证监会指定报刊及网站	2023-03-31
3	汇泉安盈回报债券型证券投资基金 2023 年第一季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2023-04-21
4	汇泉基金管理有限公司关于汇泉安盈回报债券型证券投资基金增设 E 类基金份额并修改基金合同和托管协议的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-06-21
5	汇泉安盈回报债券型证券投资基金更新的招募说明书(2023 年第 1 期)	中国证监会指定报刊及网站	2023-06-21
6	汇泉安盈回报债券型证券投资基金(A 类份额)基金产品资料概要(更新)	中国证监会指定报刊及网站	2023-06-21
7	汇泉安盈回报债券型证券投资基金(C 类份额)基金产品资料概要(更新)	中国证监会指定报刊及网站	2023-06-21
8	汇泉安盈回报债券型证券投资基金(E 类份额)基金产品资料概要	中国证监会指定报刊及网站	2023-06-21
9	汇泉安盈回报债券型证券投资基金托管协议	中国证监会指定报刊及网站	2023-06-21
10	汇泉安盈回报债券型证券投资基金基金合同	中国证监会指定报刊及网站	2023-06-21

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20230101-20230630	50,012,400.00	-	-	50,012,400.00	32.90%
产品特有风险							
本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额 20%的情形,在市场流动性不足的情况下,如遇投资者巨额赎回或集中赎回,基金管理人可能无法以合理的价格及时变现基金资产,有可能对基金净值产生一定的影响,甚至可能引发基金的流动性风险。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,并将采取有效措施保证中小投资者的合法权益。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

为了更好地满足投资者投资需求,经与托管人协商一致,本基金管理人决定于 2023 年 6 月 26 日起,在本基金现有份额的基础上增设 E 类基金份额(基金代码为:018684),并相应修改基金合同等法律文件。具体信息请参见基金管理人在规定媒介披露的《汇泉基金管理有限公司关于汇泉安盈

第43页,共44页

回报债券型证券投资基金增设 E 类基金份额并修改基金合同和托管协议的公告》。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准汇泉安盈回报债券型证券投资基金设立的文件；
- 2、《汇泉安盈回报债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇泉安盈回报债券型证券投资基金托管协议》；
- 4、《汇泉安盈回报债券型证券投资基金招募说明书》；
- 5、基金管理人业务资格批件和营业执照。

12.2 存放地点

北京市海淀区西直门外大街 168 号腾达大厦 16 层。

12.3 查阅方式

投资者可免费查阅，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。相关公开披露的法律文件，投资者还可在本基金管理人网站（www.springsfund.com）查阅。

汇泉基金管理有限公司

二〇二三年八月二十五日