汇泉安盈回报债券型证券投资基金

2024 年年度报告

2024 年 12 月 31 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:2025 年 03 月 28 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。本年度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 2025 年 3 月 27 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。

本报告中财务资料已经审计。容诚会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况 6
3.1 主要会计数据和财务指标 6
3.2 基金净值表现 7
3.3 过去三年基金的利润分配情况 10
§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遵规守信情况的说明 11
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
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 14
4.9 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 14
§5 托管人报告 14
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 14
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 15
§6 审计报告 15
6.1 审计报告基本信息 15
6.2 审计报告的基本内容 15
§7 年度财务报表 17
7.1 资产负债表 17
7.2 利润表 18
7.3 净资产变动表 19
7.4 报表附注 20
§8 投资组合报告 45
8.1 期末基金资产组合情况 45
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 46
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 46
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 61
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 61
8.6 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 62
8.7 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 62
8.8 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 62

8.9 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 62
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 62
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 62
8.12 投资组合报告附注 62
§9 基金份额持有人信息 63
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 63
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 64
9.3 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 64
§10 开放式基金份额变动 64
§11 重大事件揭示 64
11.1 基金份额持有人大会决议 64
11.2 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 64
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 65
11.4 基金投资策略的改变 65
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 65
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 65
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 65
11.8 其他重大事件 66
§12 影响投资者决策的其他重要信息 67
12.1 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 67
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 67
§13 备查文件目录 67
13.1 备查文件目录 67
13.2 存放地点 67
13.3 查阅方式 68

§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	265,513,526.95 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	204,466,931.06 份	21,929,700.94 份	39,116,894.95 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	张强	潘琦
	联系电话	010-81925261	0755-22168257
	电子邮箱	zhangqiang@springsfund.com	PANQI003@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

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.springsfund.com
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	容诚会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市西城区阜成门外大街 22 号 1 幢外经贸大厦 901-22 至 901-26
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、基金净值表现及利润分配情况

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	2024 年			2023 年			2022 年 09 月 07 日（基金合同生效日）-2022 年 12 月 31 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	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	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	1,693,252.36	7,460,443.64	1,193,635.54	-1,881,520.87	-633,465.54	-92,330.58	-1,367,266.78	-153,065.90	-
本期利润	922,812.81	7,796,403.20	594,404.20	-623,499.40	2,303,444.34	-133,568.87	-2,495,189.42	-259,937.66	-
加权平均基金份额本期利润	0.0240	0.0521	0.0237	-0.0074	0.0285	-0.0255	-0.0094	-0.0107	-
本期加权平均净值利润率	2.35%	5.19%	2.32%	-0.75%	2.91%	-2.60%	-0.95%	-1.08%	-
本期基金份额净值增	4.47%	4.22%	2.82%	-0.11%	-0.41%	-0.41%	-1.06%	-1.15%	-

长率									
3.1.2 期末数据和指标	2024 年末			2023 年末			2022 年末		
期末可供分配利润	4,884,360.08	378,001.67	1,285,380.54	-529,276.87	-5,808,024.06	-	-2,100,134.56	-167,639.84	-
期末可供分配基金份额利润	0.0239	0.0172	0.0329	-0.0207	-0.0246	-	-0.0106	-0.0115	-
期末基金资产净值	211,110,193.56	22,496,911.11	40,402,275.49	25,237,971.63	232,157,081.60	0.00	196,776,378.42	14,397,828.85	-
期末基金份额净值	1.0325	1.0259	1.0329	0.9883	0.9844	-	0.9894	0.9885	-
3.1.3 累计期末指标	2024 年末			2023 年末			2022 年末		
基金份额累计净值增长率	3.25%	2.59%	5.07%	-1.17%	-1.56%	-0.41%	-1.06%	-1.15%	-

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。

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
过去三个月	0.98%	0.06%	1.88%	0.18%	-0.90%	-0.12%
过去六个月	1.28%	0.05%	3.73%	0.16%	-2.45%	-0.11%
过去一年	4.47%	0.04%	6.13%	0.13%	-1.66%	-0.09%
自基金合同	3.25%	0.09%	5.52%	0.11%	-2.27%	-0.02%

生效起至今						

汇泉安盈回报债券 C

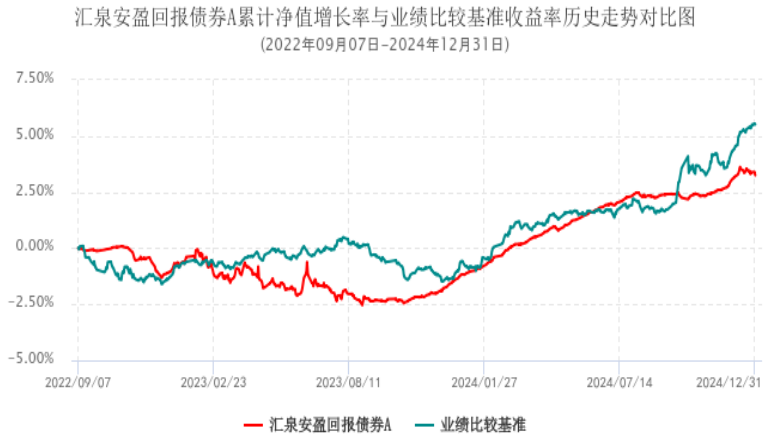
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	0.90%	0.06%	1.88%	0.18%	-0.98%	-0.12%
过去六个月	1.13%	0.05%	3.73%	0.16%	-2.60%	-0.11%
过去一年	4.22%	0.04%	6.13%	0.13%	-1.91%	-0.09%
自基金合同生效起至今	2.59%	0.09%	5.52%	0.11%	-2.93%	-0.02%

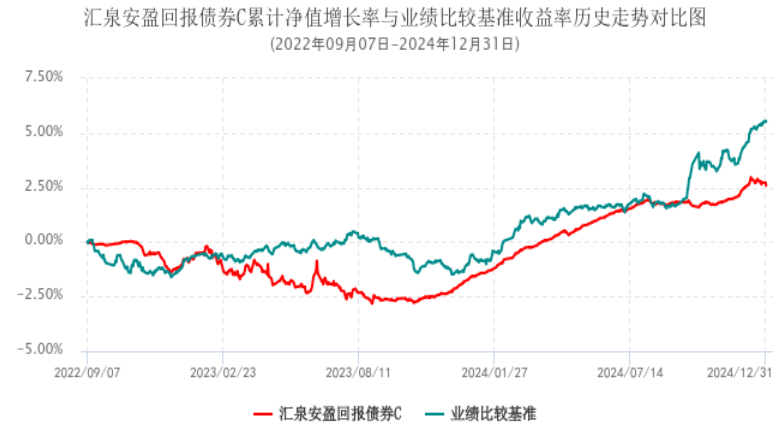
汇泉安盈回报债券 E

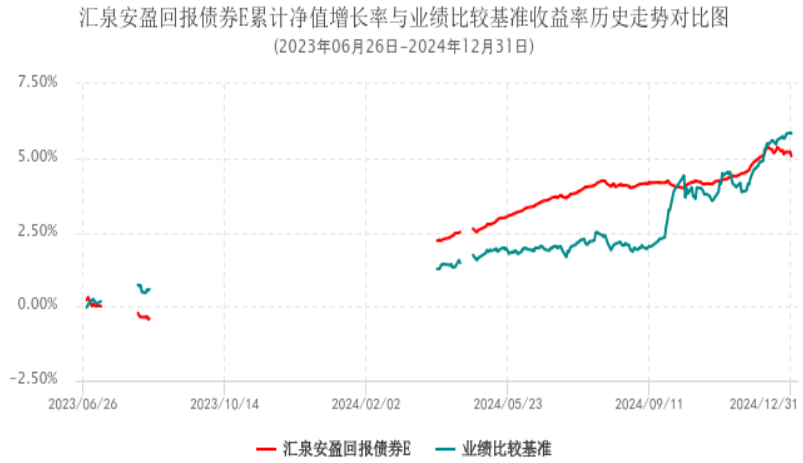
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	0.97%	0.06%	1.88%	0.18%	-0.91%	-0.12%
过去六个月	1.31%	0.05%	3.73%	0.16%	-2.42%	-0.11%
过去一年	2.82%	0.04%	4.59%	0.14%	-1.77%	-0.10%
自 2023 年 6 月 26 日起至今	5.07%	0.04%	5.83%	0.12%	-0.76%	-0.08%

注：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 3 月 28 日，2024 年 4 月 17 日至 2024 年 4 月 25 日期间，汇泉安盈回报债券 E 类基金份额为零。

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



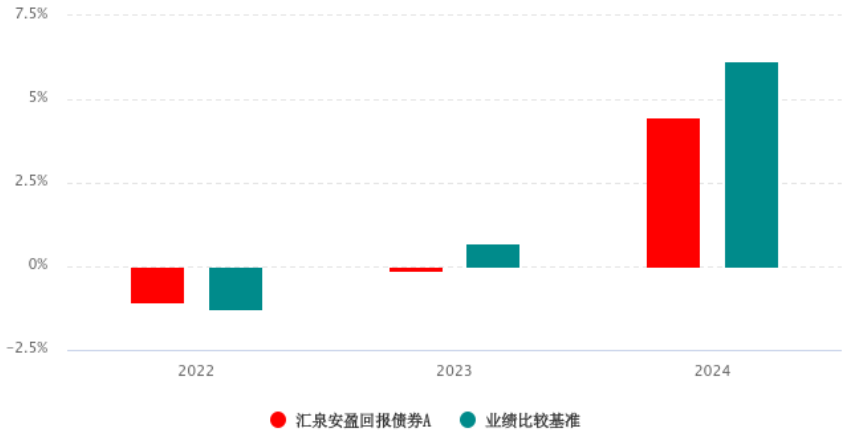


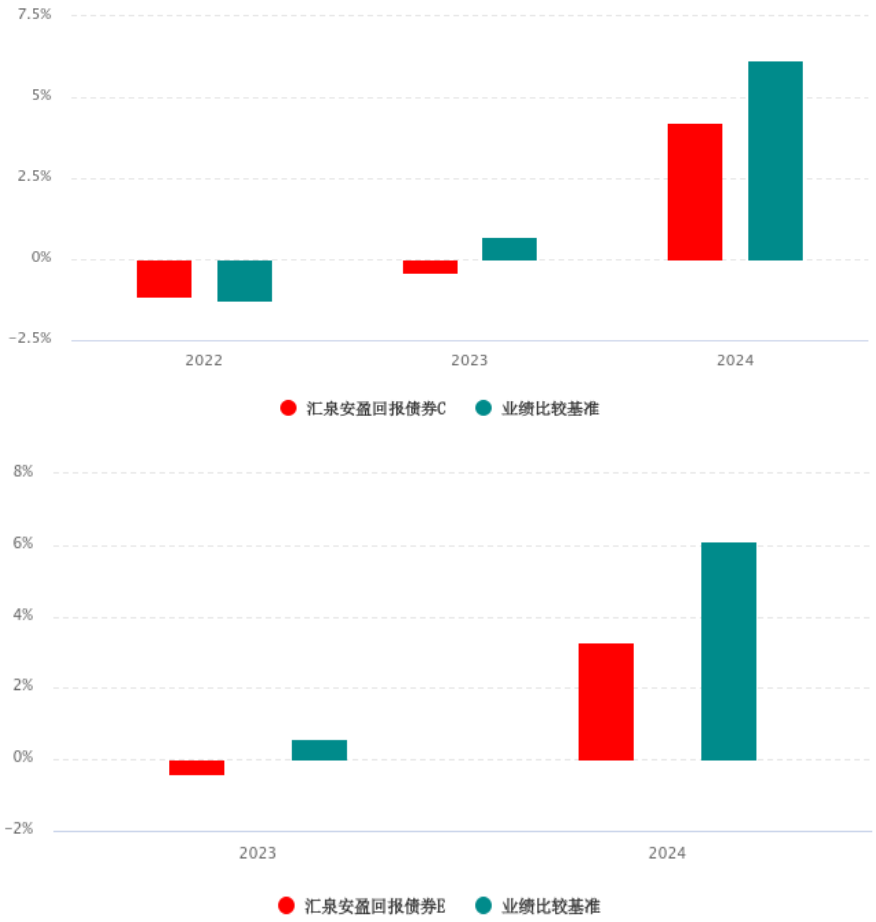


注：1、本基金自 2023 年 6 月 26 日起增设 E 类基金份额。汇泉安盈回报债券 E 基金份额的首次确认日为 2023 年 6 月 29 日。

2、2024 年 1 月 1 日至 2024 年 3 月 28 日，2024 年 4 月 17 日至 2024 年 4 月 25 日期间，汇泉安盈回报债券 E 类基金份额为零。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较





注：1、本基金合同于 2022 年 9 月 7 日生效，合同生效当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

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。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自基金合同生效日（2022 年 9 月 7 日）至本报告期末未发生利润分配。

§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为：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%，上海澹泉企业管理中心（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 9 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、汇泉启元未来混合型发起式证券投资基金、汇泉中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、汇泉安阳纯债债券型证券投资基金、汇泉智享量化选股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		
杨宇	本基金的基金经理	2023-09-22	-	26 年	中国国籍，硕士研究生，具有基金从业资格。曾任万家（天同）基金管理有限公司投资管理部总经理，金贝塔网络金融科技（深圳）有限公司联席 CEO，嘉实基金管理有限公司董事总经理、指数及量化首席投资官、基金经理。现任汇泉基金管理有限公司基金经理。
汪雨晨	本基金的基金经理助理	2024-10-15	-	3 年	中国国籍，硕士研究生，具有基金从业资格。曾任汇泉基金管理有限公司固收研究员，现任汇泉基金管理有限公司基金经理。
刘文超	固定收益投资部总监、本基金的基金经理	2022-09-07	2024-01-29	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，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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和有关法律法规的规定，针对所有投资对象的一级市场申购和二级市场交易等投资管理活动，以及授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资和交易管理活动相关的各个业务环节，并建立了股票、债券等证券库管理办法，投资管理制度，公平交易管理办法，异常交易管理办法等与公平交易相关的公司基本制度和部门制度。通过加强投资决策、交易执行的内部控制，完善对投资交易行为的日常监控和事后分析评估，以及履行相关的报告和信息披露义务，切实防范投资管理业务中的不公平交易和利益输送行为，保护投资者合法权益。

4.3.2 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。

公司于每季度、每年度对旗下管理的不同投资组合的整体收益率、分投资类别（股票、债券）的收益率进行分析，对连续四个季度期间内不同时间窗下（日内、3 日内、5 日内、10 日内）公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析。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。

4.3.3 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

2024 年，国内经济整体延续平稳缓慢修复，财政政策延续积极基调，货币政策维持宽松基调，在平衡稳增长和稳汇率的同时，完善货币政策框架，增设创新工具加强流动性管理，重启国债现券买卖操作，增设临时正逆回购，明确目标政策利率。2024 年前三季度有效需求不足，通胀低位运行，机构欠配压力较大，债券收益率震荡下行。随着四季度宏观政策转向后，财政发力预期促使债市大幅调整，但随后在供给冲击证伪、货币政策进一步宽松预期以及非银活期存款利率新规等的推动下，债券收益率再次迅速下行。

从投资操作看，前三季度组合总体维持较高久期，基本配置高等级城投债券，并实时进行利率

债波段交易。考虑权益市场的情况，权益资产维持低仓位运行。四季度在保持现有配置的基础上，利率债久期有所降低，季末又适度抬升，并在 12 月初开始适当增加权益仓位。

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 1.0325 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 4.47%，同期业绩比较基准收益率为 6.13%；截至报告期末汇泉安盈回报债券 C 基金份额净值为 1.0259 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 4.22%，同期业绩比较基准收益率为 6.13%；截至报告期末汇泉安盈回报债券 E 基金份额净值为 1.0329 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 2.82%，同期业绩比较基准收益率为 4.59%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，稳增长基调不变，货币政策方面，当前债券市场已经反应了部分降息预期，需要注意降息幅度和节奏与市场预期之间的差异。财政政策方面，大概率会有更加积极的政策空间落地。预计债市整体风险不大，呈现宽幅震荡中枢略下移，不排除一季度末有一定上行压力。本组合总体配置仍以城投债券为主，适当降低利率债比例，以哑铃型组合为主，并加强利率债波段操作。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人的监察稽核工作一切从合规运作、防范和控制风险、保障基金份额持有人利益出发，由督察长领导的独立于各业务部门的监察稽核部按照规定的权限和程序，严格认真履行职责，对公司、基金运作及员工行为的合法性、合规性进行定期和不定期监督和检查。

本报告期，本基金管理人全面开展基金运作监察稽核工作，确保基金投资、营销及后台运作等各环节的合法合规。有关本基金的监察稽核主要工作如下：

1、研究环节，加强完善研究业务的程序合规和质量控制，规范新股等询价申购的内部流程。检查证券库的入库及维护依据，并负责关联方关系的日常维护；

2、投资交易环节，采用事前防范、事中控制和事后监督的工作方式，持续完善相关合规风控制度流程和系统，加强流动性指标等重要指标的监控和内幕交易防控，有效确保投研交易业务合规运作；

3、从业人员管理环节，加强对投资管理人员即时聊天工具、办公电话、终端设备等合规监控。监督从业人员投资信息申报工作、投资管理人员交易时段通讯工具集中管理的有效执行。采取各种有效方式杜绝老鼠仓、非公平交易及各种形式的利益输送行为；

4、基金募集与营销环节，对基金宣传推介材料及利用互联网平台营销等基金销售业务活动开展事前合规检查，做到事前防范风险，并督促落实投资者适当性管理制度，保障基金营销合法合规。此外，监督落实客户投诉处理工作，切实保障投资者利益；

5、基金运营环节，加强对注册登记、会计核算、基金清算、估值工作的稽核审计，保证基金运营安全、准确；

6、信息披露环节，严格按照法律法规及公司制度的规定，保障所披露信息的真实性、准确性和完整性。

报告期内，本基金整体运作合法合规。本基金管理人将继续以合规运作、防范和控制风险、保障基金份额持有人利益出发，提高内部控制和风险管理的科学性和有效性，切实保障基金安全、合规运作。

4.7 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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.9 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损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度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 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	容诚审字[2025]200Z0763 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	汇泉安盈回报债券型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了汇泉安盈回报债券型证券投资基金（以下简称“汇泉安盈回报债券基金”）财务报表，包括 2024 年 12 月 31 日的资产负债表，2024 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了汇泉安盈回报债券基金 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度的经营成果和净资产变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于汇泉安盈回报债券基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	汇泉安盈回报债券基金的基金管理人汇泉基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）管理层对其他信息负责。其他信息包括汇泉安盈回报债券基金 2024 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。 基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务	基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金

报表的责任	业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。 在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估汇泉安盈回报债券基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算汇泉安盈回报债券基金、终止运营或别无其他现实的选择。 基金管理人治理层负责监督汇泉安盈回报债券基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。 在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作： （1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。 （2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。 （3）评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。 （4）对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对汇泉安盈回报债券基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致汇泉安盈回报债券基金不能持续经营。 （5）评价财务报表的总体列报、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。
会计师事务所的名称	容诚会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	沈兆杰　　罗佳
会计师事务所的地址	北京市西城区阜成门外大街 22 号 1 幢外经贸大厦 901-22 至 901-26
审计报告日期	2025-03-28

§7 年度财务报表

7.1 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：2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	7.4.7.1	5,834,827.56	8,589,965.82
结算备付金		37,100,086.84	20,017,307.13
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	165,852,620.01	224,393,441.77
其中：股票投资		21,699,088.00	-
基金投资		-	-
债券投资		144,153,532.01	224,393,441.77
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	56,017,126.35	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		10,122,984.07	4,801,184.20
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		274,927,644.83	257,801,898.92
负债和净资产	**附注号**	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		653,424.83	591.46
应付管理人报酬		69,998.46	126,489.23
应付托管费		11,666.41	21,081.54
应付销售服务费		6,026.52	56,840.03
应付投资顾问费		-	-
应交税费		3,024.30	16,060.93
应付利润		-	-

递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	174,124.15	185,782.50
负债合计		918,264.67	406,845.69
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	265,513,526.95	261,383,417.82
未分配利润	7.4.7.8	8,495,853.21	-3,988,364.59
净资产合计		274,009,380.16	257,395,053.23
负债和净资产总计		274,927,644.83	257,801,898.92

注：报告截止日 2024 年 12 月 31 日，基金份额总额 265,513,526.95 份，其中汇泉安盈回报债券 A 类基金份额净值 1.0325 元，基金份额 204,466,931.06 份；汇泉安盈回报债券 C 类基金份额净值 1.0259 元，基金份额 21,929,700.94 份；汇泉安盈回报债券 E 类基金份额净值 1.0329 元，基金份额 39,116,894.95 份。

7.2 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：2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日
一、营业总收入		11,553,499.87	3,285,203.04
1.利息收入		177,678.73	114,043.76
其中：存款利息收入	7.4.7.9	127,203.93	67,520.20
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		50,474.80	46,523.56
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		12,353,672.69	197,804.58
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-18,507.89	-3,454,200.64
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	12,365,887.95	3,518,056.79
资产支持证券投资收益	7.4.7.12	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.13	-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	6,292.63	133,948.43
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-1,033,711.33	2,886,761.98
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	55,859.78	86,592.72

减：二、营业总支出		2,239,879.66	1,738,826.97
1．管理人报酬	7.4.10.2.1	1,301,241.58	998,296.73
2．托管费	7.4.10.2.2	216,873.58	166,382.76
3．销售服务费	7.4.10.2.3	453,933.52	239,224.42
4．投资顾问费		-	-
5．利息支出		57,049.49	114,523.95
其中：卖出回购金融资产支出		57,049.49	114,523.95
6．信用减值损失		-	-
7．税金及附加		13,581.16	8,706.43
8．其他费用	7.4.7.18	197,200.33	211,692.68
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		9,313,620.21	1,546,376.07
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		9,313,620.21	1,546,376.07
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		9,313,620.21	1,546,376.07

7.3 净资产变动表

会计主体：汇泉安盈回报债券型证券投资基金

本报告期：2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	261,383,417.82	-3,988,364.59	257,395,053.23
二、本期期初净资产	261,383,417.82	-3,988,364.59	257,395,053.23
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	4,130,109.13	12,484,217.80	16,614,326.93
（一）、综合收益总额	-	9,313,620.21	9,313,620.21
（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）	4,130,109.13	3,170,597.59	7,300,706.72
其中：1.基金申购款	865,653,863.15	11,614,725.23	877,268,588.38
2.基金赎回款	-861,523,754.02	-8,444,127.64	-869,967,881.66
（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	265,513,526.95	8,495,853.21	274,009,380.16
项 目	**上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日**		
	实收基金	**未分配利润**	**净资产合计**
一、上期期末净资产	213,441,981.67	-2,267,774.40	211,174,207.27
二、本期期初净资产	213,441,981.67	-2,267,774.40	211,174,207.27
三、本期增减变动额（减少以	47,941,436.15	-1,720,590.19	46,220,845.96

“-”号填列）			
（一）、综合收益总额	-	1,546,376.07	1,546,376.07
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	47,941,436.15	-3,266,966.26	44,674,469.89
其中：1.基金申购款	709,906,148.85	-15,599,206.11	694,306,942.74
2.基金赎回款	-661,964,712.70	12,332,239.85	-649,632,472.85
（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	261,383,417.82	-3,988,364.59	257,395,053.23

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署:

梁永强	陈磊	武曌
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 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。

根据基金管理人于 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》，自 2023 年 6 月 26 日起，本基金增加 E 类基金份额，本次增加该类基金份额后，本基金将设置三类基金份额，在投资人申购基金时收取申购费用，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。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×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泉基金管理有限公司于 2025 年 3 月 28 日批准报出。

7.4.2 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 7.4.4 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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2024 年度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 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产、金融负债或权益工具。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负

债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

(3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征：(1) 赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利，这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位，并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量；(2) 该工具所属的类别次于其他所有工具类别，

即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具，且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权；(3) 该工具所属的类别中(该类别次于其他所有工具类别)，所有工具具有相同的特征(例如它们必须都具有可回售特征，并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同)；(4) 除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外，该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征；(5) 该工具在存续期内的预计现金流量总额，应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括本基金的任何影响)。

可回售工具，是指根据合同约定，持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融资产的权利，或者在未来某一不确定事项发生或者持有方死亡或退休时，自动回售给发行方的金融工具。

本基金没有同时具备下列特征的其他金融工具或合同：(1) 现金流量总额实质上基于基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括该基金或合同的任何影响)；(2) 实质上限制或固定了上述工具持有方所获得的剩余回报。

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息后的净额确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

7.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务

的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6 号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566 号《关于发布<关于固定收益品种的估值处理标准>的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 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。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 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。

7.4.6 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。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。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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
活期存款	5,047,709.06	8,350,710.13
等于：本金	5,045,215.47	8,349,857.32
加：应计利息	2,493.59	852.81
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	787,118.50	239,255.69
等于：本金	787,104.35	239,195.21
加：应计利息	14.15	60.48
减：坏账准备	-	-
合计	5,834,827.56	8,589,965.82

注：其他存款为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2024 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		22,359,671.13	-	21,699,088.00	-660,583.13
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	23,048,767.90	339,109.59	23,878,809.59	490,932.10
	银行间市场	117,856,992.72	1,629,822.42	120,274,722.42	787,907.28
	合计	140,905,760.62	1,968,932.01	144,153,532.01	1,278,839.38
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		163,265,431.75	1,968,932.01	165,852,620.01	618,256.25
项目		上年度末 2023 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		-	-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合		-	-	-	-

约					
债券	交易所市场	66,082,911.84	1,353,503.89	68,408,207.79	971,792.06
	银行间市场	153,307,924.48	1,997,133.98	155,985,233.98	680,175.52
	合计	219,390,836.32	3,350,637.87	224,393,441.77	1,651,967.58
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		219,390,836.32	3,350,637.87	224,393,441.77	1,651,967.58

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。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 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 2024 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	56,017,126.35	-
合计	56,017,126.35	-
项目	上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
合计	-	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

7.4.7.5 其他资产

无。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 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	4,824.15	2,482.50
其中：交易所市场	-	-
银行间市场	4,824.15	2,482.50

应付利息	-	-
预提费用	169,300.00	183,300.00
合计	174,124.15	185,782.50

7.4.7.7 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 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	25,536,998.98	25,536,998.98
本期申购	242,170,004.47	242,170,004.47
本期赎回（以“-”号填列）	-63,240,072.39	-63,240,072.39
本期末	204,466,931.06	204,466,931.06

汇泉安盈回报债券 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	235,846,418.84	235,846,418.84
本期申购	456,712,785.82	456,712,785.82
本期赎回（以“-”号填列）	-670,629,503.72	-670,629,503.72
本期末	21,929,700.94	21,929,700.94

汇泉安盈回报债券 E

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	-	-
本期申购	166,771,072.86	166,771,072.86
本期赎回（以“-”号填列）	-127,654,177.91	-127,654,177.91
本期末	39,116,894.95	39,116,894.95

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

7.4.7.8 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	-529,276.87	230,249.52	-299,027.35
本期期初	-529,276.87	230,249.52	-299,027.35
本期利润	1,693,252.36	-770,439.55	922,812.81
本期基金份额交易产生的变动数	3,720,384.59	2,299,092.45	6,019,477.04
其中：基金申购款	3,957,734.33	2,786,911.71	6,744,646.04
基金赎回款	-237,349.74	-487,819.26	-725,169.00
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,884,360.08	1,758,902.42	6,643,262.50

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	-5,808,024.06	2,118,686.82	-3,689,337.24
本期期初	-5,808,024.06	2,118,686.82	-3,689,337.24
本期利润	7,460,443.64	335,959.56	7,796,403.20
本期基金份额交易产生的变动数	-1,274,417.91	-2,265,437.88	-3,539,855.79
其中：基金申购款	-6,577,666.18	7,972,818.23	1,395,152.05
基金赎回款	5,303,248.27	-10,238,256.11	-4,935,007.84
本期已分配利润	-	-	-
本期末	378,001.67	189,208.50	567,210.17

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	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	1,193,635.54	-599,231.34	594,404.20
本期基金份额交易产生的变动数	567,246.89	123,729.45	690,976.34
其中：基金申购款	5,536,173.39	-2,061,246.25	3,474,927.14
基金赎回款	-4,968,926.50	2,184,975.70	-2,783,950.80
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,760,882.43	-475,501.89	1,285,380.54

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	34,452.43	28,047.45
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	10,561.64	14,047.36
结算备付金利息收入	80,779.71	25,425.39
其他	1,410.15	-
合计	127,203.93	67,520.20

注：其他存款利息收入所列金额为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金的利息收入。

7.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	-	533,143,035.34

减：卖出股票成本总额	-	535,167,820.73
减：交易费用	18,507.89	1,429,415.25
买卖股票差价收入	-18,507.89	-3,454,200.64

7.4.7.11 债券投资收益

7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日
债券投资收益——利息收入	6,438,242.14	4,508,201.06
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	5,927,645.81	-990,144.27
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	12,365,887.95	3,518,056.79

7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	649,900,427.33	662,171,084.47
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	633,791,592.48	655,080,743.31
减：应计利息总额	10,159,181.48	8,056,139.71
减：交易费用	22,007.56	24,345.72
买卖债券差价收入	5,927,645.81	-990,144.27

7.4.7.12 资产支持证券投资收益

无。

7.4.7.13 贵金属投资收益

无。

7.4.7.14 衍生工具收益

无。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	6,292.63	133,948.43
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	6,292.63	133,948.43

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日
1.交易性金融资产	-1,033,711.33	2,886,761.98
——股票投资	-660,583.13	9,492.29
——债券投资	-373,128.20	2,877,269.69
——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	-1,033,711.33	2,886,761.98

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	55,859.78	86,392.72
其他	-	200.00
合计	55,859.78	86,592.72

注：1.本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25%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，其中不低于转出基金的赎回费的 25%归入转出基金的基金资产。

7.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日
审计费用	40,000.00	54,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
账户维护费	37,200.00	37,200.00
存托服务费	0.33	9.54
其他	-	400.00
证券组合费	-	83.14
合计	197,200.33	211,692.68

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 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。

7.4.8.2 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。

7.4.9 关联方关系

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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

无。

7.4.10.1.2 权证交易

无。

7.4.10.1.3 债券交易

无。

7.4.10.1.4 债券回购交易

无。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日

当期发生的基金应支付的管理费	1,301,241.58	998,296.73
其中：应支付销售机构的客户维护费	475,193.14	250,376.98
应支付基金管理人的净管理费	826,048.44	747,919.75

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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	216,873.58	166,382.76

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。

7.4.10.2.3 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 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 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	-	3,172.95	-	3,172.95
合计	-	3,172.95	-	3,172.95
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 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	-	6,658.10	-	6,658.10
合计	-	6,658.10	-	6,658.10

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。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金	利息收	交易金	利息支

			额	入	额	出
平安银行	-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
平安银行	20,765,667.87	81,748,929.04	-	-	-	-

7.4.10.4 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

7.4.10.4.1 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。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.10.5.2 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

汇泉安盈回报债券 C

份额单位：份

关联方名称	本期末 2024 年 12 月 31 日		上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
杨宇	1,227.78	0.01%	-	-

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方投资本基金费率按本基金招募说明书的规定费率执行。

7.4.10.6 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 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
平安银行	5,047,709.06	34,452.43	8,350,710.13	28,047.45

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。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。**7.4.10.8 其他关联交易事项的说明**

无。

7.4.11 利润分配情况

无。

7.4.12 期末（2024 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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、风险管理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风险管理部负责，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合规风控工作。

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。

7.4.13.2 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。

7.4.13.2.1 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 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	10,079,202.19	16,310,864.66
合计	10,079,202.19	16,310,864.66

注：未评级债券为国债、短期融资券。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	20,874,020.76	19,853,728.52
合计	20,874,020.76	19,853,728.52

7.4.13.2.4 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 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
AAA	36,544,541.36	90,362,621.18
AAA 以下	11,554,919.18	5,682,986.97
未评级	65,100,848.52	92,183,240.44
合计	113,200,309.06	188,228,848.59

注：未评级债券为国债、政策性金融债。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

7.4.13.3 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 2024 年 12 月 31 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。

7.4.13.3.1 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时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金

的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。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 2024 年 12 月 31 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 2024 年 12 月 31 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 227,702,066.18 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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 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	5,834,827.56	-	-	-	5,834,827.56
结算备付金	37,100,086.84	-	-	-	37,100,086.84
交易性金融资产	51,319,179.66	71,615,009.80	21,219,342.55	21,699,088.00	165,852,620.01
买入返售金融资产	56,017,126.35	-	-	-	56,017,126.35
应收申购款	-	-	-	10,122,984.07	10,122,984.07
资产总计	150,271,220.41	71,615,009.80	21,219,342.55	31,822,072.07	274,927,644.83
负债					
应付赎回款	-	-	-	653,424.83	653,424.83
应付管理人报酬	-	-	-	69,998.46	69,998.46
应付托管费	-	-	-	11,666.41	11,666.41
应付销售服务费	-	-	-	6,026.52	6,026.52
应交税费	-	-	-	3,024.30	3,024.30
其他负债	-	-	-	174,124.15	174,124.15
负债总计	-	-	-	918,264.67	918,264.67
利率敏感度缺口	150,271,220.41	71,615,009.80	21,219,342.55	30,903,807.40	274,009,380.16
上年度末 2023 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	8,589,965.82	-	-	-	8,589,965.82
结算备付金	20,017,307.13	-	-	-	20,017,307.13
存出保证金	0.00	-	-	-	0.00
交易性金融资产	36,164,593.18	172,705,389.69	15,523,458.90	-	224,393,441.77
应收申购	-	-	-	4,801,184.20	4,801,184.20

款					
资产总计	64,771,866.13	172,705,389.69	15,523,458.90	4,801,184.20	257,801,898.92
负债					
应付赎回款	-	-	-	591.46	591.46
应付管理人报酬	-	-	-	126,489.23	126,489.23
应付托管费	-	-	-	21,081.54	21,081.54
应付销售服务费	-	-	-	56,840.03	56,840.03
应交税费	-	-	-	16,060.93	16,060.93
其他负债	-	-	-	185,782.50	185,782.50
负债总计	-	-	-	406,845.69	406,845.69
利率敏感度缺口	64,771,866.13	172,705,389.69	15,523,458.90	4,394,338.51	257,395,053.23

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。

7.4.13.4.1.2 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 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
	1.市场利率上升 25 个基点	-936,819.54	-1,014,985.99
	2.市场利率下降 25 个基点	949,276.20	1,022,575.99

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日		上年度末 2023 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	21,699,088.00	7.92	-	-
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	21,699,088.00	7.92	-	-

7.4.13.4.3.2 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 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
	1. 沪深 300 指数收益率上升 5%	-32,921.35	-
	2. 沪深 300 指数收益率下降 5%	32,921.35	-

注：于 2023 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性权益类投资，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。

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 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 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	21,699,088.00	-
第二层次	144,153,532.01	224,393,441.77
第三层次	-	-
合计	165,852,620.01	224,393,441.77

7.4.14.2.2 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。

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2024 年 12 月 31 日,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2023 年 12 月 31 日：同)。

7.4.14.4 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。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§8 投资组合报告

8.1 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	21,699,088.00	7.89
	其中：股票	21,699,088.00	7.89
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	144,153,532.01	52.43

	其中：债券	144,153,532.01	52.43
	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	56,017,126.35	20.38
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	42,934,914.40	15.62
8	其他各项资产	10,122,984.07	3.68
9	合计	274,927,644.83	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	178,551.00	0.07
B	采矿业	914,941.00	0.33
C	制造业	15,835,285.00	5.78
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	553,634.00	0.20
E	建筑业	192,373.00	0.07
F	批发和零售业	287,946.00	0.11
G	交通运输、仓储和邮政业	454,567.00	0.17
H	住宿和餐饮业	48,128.00	0.02
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,258,462.00	0.46
J	金融业	833,497.00	0.30
K	房地产业	271,260.00	0.10
L	租赁和商务服务业	263,524.00	0.10
M	科学研究和技术服务业	177,804.00	0.06
N	水利、环境和公共设施管理业	92,888.00	0.03
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	29,772.00	0.01
Q	卫生和社会工作	148,173.00	0.05
R	文化、体育和娱乐业	158,283.00	0.06
S	综合	-	-
	合计	21,699,088.00	7.92

8.3 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	1,900	505,400.00	0.18
2	600519	贵州茅台	300	457,200.00	0.17
3	000333	美的集团	4,200	315,924.00	0.12
4	300502	新易盛	2,700	312,066.00	0.11
5	002463	沪电股份	7,200	285,480.00	0.10
6	000858	五粮液	1,900	266,076.00	0.10

7	002475	立讯精密	4,900	199,724.00	0.07
8	300760	迈瑞医疗	700	178,500.00	0.07
9	601899	紫金矿业	11,600	175,392.00	0.06
10	002273	水晶光电	6,800	151,096.00	0.06
11	603986	兆易创新	1,400	149,520.00	0.05
12	600809	山西汾酒	800	147,368.00	0.05
13	000423	东阿阿胶	2,200	137,984.00	0.05
14	300308	中际旭创	1,100	135,861.00	0.05
15	600660	福耀玻璃	2,100	131,040.00	0.05
16	600031	三一重工	7,800	128,544.00	0.05
17	600418	江淮汽车	3,200	120,000.00	0.04
18	300394	天孚通信	1,300	118,768.00	0.04
19	600900	长江电力	4,000	118,200.00	0.04
20	601058	赛轮轮胎	8,200	117,506.00	0.04
21	002625	光启技术	2,400	114,720.00	0.04
22	300661	圣邦股份	1,400	114,492.00	0.04
23	300054	鼎龙股份	4,300	111,886.00	0.04
24	300433	蓝思科技	5,100	111,690.00	0.04
25	688099	晶晨股份	1,600	109,888.00	0.04
26	601225	陕西煤业	4,700	109,322.00	0.04
27	688008	澜起科技	1,600	108,640.00	0.04
28	300866	安克创新	1,100	107,404.00	0.04
29	601127	赛力斯	800	106,712.00	0.04
30	688361	中科飞测	1,200	105,060.00	0.04
31	603501	韦尔股份	1,000	104,410.00	0.04
32	601919	中远海控	6,600	102,300.00	0.04
33	605117	德业股份	1,200	101,760.00	0.04
34	300724	捷佳伟创	1,600	101,136.00	0.04
35	601857	中国石油	11,300	101,022.00	0.04
36	000568	泸州老窖	800	100,160.00	0.04
37	000651	格力电器	2,200	99,990.00	0.04
38	600066	宇通客车	3,700	97,606.00	0.04
39	300529	健帆生物	3,300	96,822.00	0.04
40	002180	纳思达	3,400	95,778.00	0.03
41	000988	华工科技	2,200	95,260.00	0.03
42	000807	云铝股份	7,000	94,710.00	0.03
43	002202	金风科技	8,800	90,904.00	0.03
44	601988	中国银行	16,300	89,813.00	0.03
45	601939	建设银行	10,200	89,658.00	0.03
46	300274	阳光电源	1,200	88,596.00	0.03
47	688169	石头科技	400	87,716.00	0.03
48	002262	恩华药业	3,600	87,660.00	0.03
49	600008	首创环保	26,400	86,592.00	0.03

50	688122	西部超导	2,000	85,640.00	0.03
51	002594	比亚迪	300	84,798.00	0.03
52	600160	巨化股份	3,500	84,420.00	0.03
53	300498	温氏股份	5,000	82,550.00	0.03
54	601169	北京银行	13,400	82,410.00	0.03
55	601989	中国重工	16,800	80,808.00	0.03
56	002595	豪迈科技	1,600	80,304.00	0.03
57	300339	润和软件	1,600	80,048.00	0.03
58	300002	神州泰岳	6,900	79,971.00	0.03
59	600309	万华化学	1,100	78,485.00	0.03
60	002371	北方华创	200	78,200.00	0.03
61	600115	中国东航	19,500	78,000.00	0.03
62	002011	盾安环境	7,200	77,832.00	0.03
63	002414	高德红外	10,200	75,786.00	0.03
64	601916	浙商银行	26,000	75,660.00	0.03
65	300360	炬华科技	4,500	75,465.00	0.03
66	601138	工业富联	3,500	75,250.00	0.03
67	002916	深南电路	600	75,000.00	0.03
68	300474	景嘉微	800	74,792.00	0.03
69	300012	华测检测	6,000	74,580.00	0.03
70	600862	中航高科	2,900	73,254.00	0.03
71	601609	金田股份	12,300	72,570.00	0.03
72	603369	今世缘	1,600	72,368.00	0.03
73	688578	艾力斯	1,200	71,880.00	0.03
74	600096	云天化	3,200	71,360.00	0.03
75	000783	长江证券	10,400	70,928.00	0.03
76	600941	中国移动	600	70,896.00	0.03
77	601168	西部矿业	4,400	70,708.00	0.03
78	300048	合康新能	14,000	70,560.00	0.03
79	002384	东山精密	2,400	70,080.00	0.03
80	002001	新和成	3,100	68,107.00	0.02
81	600109	国金证券	7,800	68,094.00	0.02
82	600489	中金黄金	5,600	67,368.00	0.02
83	000725	京东方 A	15,300	67,167.00	0.02
84	002456	欧菲光	5,600	67,088.00	0.02
85	002179	中航光电	1,700	66,810.00	0.02
86	688176	亚虹医药	9,800	66,542.00	0.02
87	300604	长川科技	1,500	66,195.00	0.02
88	002138	顺络电子	2,100	66,108.00	0.02
89	002920	德赛西威	600	66,066.00	0.02
90	688779	五矿新能	12,400	65,968.00	0.02
91	002028	思源电气	900	65,430.00	0.02
92	002340	格林美	10,000	65,300.00	0.02

93	600312	平高电气	3,400	65,280.00	0.02
94	600064	南京高科	8,400	65,268.00	0.02
95	688120	华海清科	400	65,196.00	0.02
96	300015	爱尔眼科	4,900	64,925.00	0.02
97	601727	上海电气	8,000	64,880.00	0.02
98	600177	雅戈尔	7,200	64,080.00	0.02
99	002311	海大集团	1,300	63,765.00	0.02
100	002126	银轮股份	3,400	63,648.00	0.02
101	600885	宏发股份	2,000	63,640.00	0.02
102	600879	航天电子	6,900	61,824.00	0.02
103	600839	四川长虹	6,400	61,760.00	0.02
104	300346	南大光电	1,600	61,744.00	0.02
105	000975	山金国际	3,900	59,943.00	0.02
106	600863	内蒙华电	13,600	58,888.00	0.02
107	600559	老白干酒	2,800	58,772.00	0.02
108	600482	中国动力	2,400	58,728.00	0.02
109	688278	特宝生物	800	58,696.00	0.02
110	600000	浦发银行	5,700	58,653.00	0.02
111	600664	哈药股份	14,200	58,646.00	0.02
112	002409	雅克科技	1,000	57,950.00	0.02
113	688772	珠海冠宇	3,600	57,888.00	0.02
114	002281	光迅科技	1,100	57,387.00	0.02
115	600989	宝丰能源	3,400	57,256.00	0.02
116	603508	思维列控	2,400	57,072.00	0.02
117	688223	晶科能源	8,000	56,880.00	0.02
118	002738	中矿资源	1,600	56,800.00	0.02
119	601600	中国铝业	7,600	55,860.00	0.02
120	000933	神火股份	3,300	55,770.00	0.02
121	601997	贵阳银行	9,200	55,200.00	0.02
122	600036	招商银行	1,400	55,020.00	0.02
123	000338	潍柴动力	4,000	54,800.00	0.02
124	301029	怡合达	2,200	54,384.00	0.02
125	300017	网宿科技	5,100	53,907.00	0.02
126	002422	科伦药业	1,800	53,874.00	0.02
127	600057	厦门象屿	8,300	53,867.00	0.02
128	600256	广汇能源	8,000	53,840.00	0.02
129	300207	欣旺达	2,400	53,544.00	0.02
130	002497	雅化集团	4,500	52,650.00	0.02
131	600019	宝钢股份	7,500	52,500.00	0.02
132	300441	鲍斯股份	6,000	52,320.00	0.02
133	600998	九州通	10,200	52,224.00	0.02
134	002027	分众传媒	7,400	52,022.00	0.02
135	600157	永泰能源	30,400	51,984.00	0.02

136	002444	巨星科技	1,600	51,760.00	0.02
137	600027	华电国际	9,200	51,612.00	0.02
138	600905	三峡能源	11,600	50,692.00	0.02
139	002847	盐津铺子	800	50,080.00	0.02
140	002714	牧原股份	1,300	49,972.00	0.02
141	600988	赤峰黄金	3,200	49,952.00	0.02
142	002413	雷科防务	11,400	49,704.00	0.02
143	603259	药明康德	900	49,536.00	0.02
144	600352	浙江龙盛	4,800	49,392.00	0.02
145	601567	三星医疗	1,600	49,216.00	0.02
146	300763	锦浪科技	800	48,856.00	0.02
147	600887	伊利股份	1,600	48,288.00	0.02
148	600985	淮北矿业	3,400	47,838.00	0.02
149	603995	甬金股份	2,600	47,554.00	0.02
150	301236	软通动力	800	46,968.00	0.02
151	002185	华天科技	4,000	46,440.00	0.02
152	601333	广深铁路	13,500	46,305.00	0.02
153	600486	扬农化工	800	46,296.00	0.02
154	300408	三环集团	1,200	46,212.00	0.02
155	300627	华测导航	1,100	45,980.00	0.02
156	600522	中天科技	3,200	45,824.00	0.02
157	300136	信维通信	1,800	45,792.00	0.02
158	002085	万丰奥威	2,400	45,480.00	0.02
159	601966	玲珑轮胎	2,500	45,100.00	0.02
160	000960	锡业股份	3,200	44,896.00	0.02
161	002353	杰瑞股份	1,200	44,388.00	0.02
162	603893	瑞芯微	400	44,024.00	0.02
163	000066	中国长城	3,000	43,710.00	0.02
164	002739	万达电影	3,600	43,704.00	0.02
165	002517	恺英网络	3,200	43,552.00	0.02
166	600426	华鲁恒升	2,000	43,220.00	0.02
167	300558	贝达药业	800	43,144.00	0.02
168	600895	张江高科	1,600	42,880.00	0.02
169	002472	双环传动	1,400	42,868.00	0.02
170	600361	创新新材	11,100	42,846.00	0.02
171	600699	均胜电子	2,700	42,309.00	0.02
172	000404	长虹华意	5,700	42,180.00	0.02
173	603606	东方电缆	800	42,040.00	0.02
174	300144	宋城演艺	4,500	41,805.00	0.02
175	002078	太阳纸业	2,800	41,636.00	0.02
176	601898	中煤能源	3,400	41,412.00	0.02
177	002156	通富微电	1,400	41,370.00	0.02
178	601860	紫金银行	14,400	41,040.00	0.01

179	002468	申通快递	4,000	40,520.00	0.01
180	600549	厦门钨业	2,100	40,467.00	0.01
181	000063	中兴通讯	1,000	40,400.00	0.01
182	601615	明阳智能	3,200	40,352.00	0.01
183	600567	山鹰国际	20,400	39,984.00	0.01
184	300475	香农芯创	1,400	39,886.00	0.01
185	600690	海尔智家	1,400	39,858.00	0.01
186	300383	光环新网	2,700	39,393.00	0.01
187	601618	中国中冶	11,900	39,270.00	0.01
188	002025	航天电器	800	38,848.00	0.01
189	000683	远兴能源	6,900	38,571.00	0.01
190	002405	四维图新	4,000	38,560.00	0.01
191	002532	天山铝业	4,800	37,776.00	0.01
192	603486	科沃斯	800	37,600.00	0.01
193	300014	亿纬锂能	800	37,392.00	0.01
194	300001	特锐德	1,700	37,315.00	0.01
195	300058	蓝色光标	4,000	37,120.00	0.01
196	002043	兔宝宝	3,100	36,828.00	0.01
197	300896	爱美客	200	36,500.00	0.01
198	301269	华大九天	300	36,330.00	0.01
199	603596	伯特利	800	35,672.00	0.01
200	000738	航发控制	1,600	35,584.00	0.01
201	002436	兴森科技	3,200	35,552.00	0.01
202	600763	通策医疗	800	35,520.00	0.01
203	002465	海格通信	3,200	35,136.00	0.01
204	600498	烽火通信	1,800	35,028.00	0.01
205	002008	大族激光	1,400	35,000.00	0.01
206	002312	川发龙蟒	2,400	34,728.00	0.01
207	600141	兴发集团	1,600	34,720.00	0.01
208	000630	铜陵有色	10,500	33,915.00	0.01
209	000830	鲁西化工	2,900	33,901.00	0.01
210	300676	华大基因	800	33,576.00	0.01
211	603008	喜临门	2,000	33,520.00	0.01
212	600663	陆家嘴	3,400	33,456.00	0.01
213	000039	中集集团	4,300	33,411.00	0.01
214	603929	亚翔集成	1,200	33,276.00	0.01
215	600765	中航重机	1,600	32,752.00	0.01
216	002064	华峰化学	4,000	32,720.00	0.01
217	600487	亨通光电	1,900	32,718.00	0.01
218	002432	九安医疗	800	32,624.00	0.01
219	603338	浙江鼎力	500	32,260.00	0.01
220	300073	当升科技	800	32,224.00	0.01
221	600143	金发科技	3,700	31,968.00	0.01

222	002120	韵达股份	4,200	31,584.00	0.01
223	600132	重庆啤酒	500	31,510.00	0.01
224	603129	春风动力	200	31,414.00	0.01
225	600610	中毅达	7,400	31,302.00	0.01
226	600497	驰宏锌锗	5,600	31,192.00	0.01
227	601766	中国中车	3,700	31,006.00	0.01
228	600038	中直股份	800	30,848.00	0.01
229	600968	海油发展	7,200	30,744.00	0.01
230	002065	东华软件	4,200	30,492.00	0.01
231	002558	巨人网络	2,400	30,456.00	0.01
232	000009	中国宝安	3,300	30,195.00	0.01
233	002756	永兴材料	800	30,176.00	0.01
234	300395	菲利华	800	30,088.00	0.01
235	300253	卫宁健康	4,200	30,072.00	0.01
236	600398	海澜之家	4,000	30,000.00	0.01
237	300037	新宙邦	800	29,952.00	0.01
238	002831	裕同科技	1,100	29,810.00	0.01
239	300641	正丹股份	1,200	29,808.00	0.01
240	300769	德方纳米	800	29,504.00	0.01
241	600170	上海建工	11,100	29,415.00	0.01
242	000878	云南铜业	2,400	29,256.00	0.01
243	002223	鱼跃医疗	800	29,192.00	0.01
244	002389	航天彩虹	1,600	28,880.00	0.01
245	601677	明泰铝业	2,400	28,872.00	0.01
246	600820	隧道股份	4,000	28,760.00	0.01
247	300024	机器人	1,600	28,720.00	0.01
248	603298	杭叉集团	1,600	28,624.00	0.01
249	600521	华海药业	1,600	28,592.00	0.01
250	600048	保利发展	3,200	28,352.00	0.01
251	600704	物产中大	5,600	28,336.00	0.01
252	601233	桐昆股份	2,400	28,320.00	0.01
253	600803	新奥股份	1,300	28,184.00	0.01
254	000034	神州数码	800	28,040.00	0.01
255	002152	广电运通	2,400	27,984.00	0.01
256	603650	彤程新材	800	27,976.00	0.01
257	300699	光威复材	800	27,720.00	0.01
258	000623	吉林敖东	1,600	27,632.00	0.01
259	600299	安迪苏	2,200	27,610.00	0.01
260	300459	汤姆猫	4,800	27,552.00	0.01
261	603288	海天味业	600	27,540.00	0.01
262	300285	国瓷材料	1,600	27,264.00	0.01
263	300003	乐普医疗	2,400	27,216.00	0.01
264	002004	华邦健康	6,000	27,120.00	0.01

265	000932	华菱钢铁	6,400	26,752.00	0.01
266	300315	掌趣科技	4,800	26,400.00	0.01
267	002237	恒邦股份	2,600	26,260.00	0.01
268	300088	长信科技	4,000	26,160.00	0.01
269	300514	友讯达	1,800	25,992.00	0.01
270	300068	南都电源	1,600	25,824.00	0.01
271	002241	歌尔股份	1,000	25,810.00	0.01
272	600269	赣粤高速	4,600	25,806.00	0.01
273	002044	美年健康	5,600	25,704.00	0.01
274	600316	洪都航空	800	25,696.00	0.01
275	600637	东方明珠	3,300	25,608.00	0.01
276	002003	伟星股份	1,800	25,506.00	0.01
277	002195	岩山科技	6,400	25,408.00	0.01
278	002439	启明星辰	1,600	25,312.00	0.01
279	600153	建发股份	2,400	25,248.00	0.01
280	601216	君正集团	4,800	25,248.00	0.01
281	600926	杭州银行	1,700	24,837.00	0.01
282	002624	完美世界	2,400	24,792.00	0.01
283	002294	信立泰	800	24,744.00	0.01
284	002131	利欧股份	8,000	24,720.00	0.01
285	600392	盛和资源	2,400	24,672.00	0.01
286	600859	王府井	1,600	24,656.00	0.01
287	601689	拓普集团	500	24,500.00	0.01
288	603225	新凤鸣	2,200	24,486.00	0.01
289	600018	上港集团	4,000	24,480.00	0.01
290	002837	英维克	600	24,240.00	0.01
291	600004	白云机场	2,500	24,000.00	0.01
292	000538	云南白药	400	23,980.00	0.01
293	002176	江特电机	3,200	23,712.00	0.01
294	300182	捷成股份	4,000	23,480.00	0.01
295	600258	首旅酒店	1,600	23,472.00	0.01
296	300568	星源材质	2,400	23,328.00	0.01
297	600516	方大炭素	4,800	23,184.00	0.01
298	300628	亿联网络	600	23,160.00	0.01
299	600535	天士力	1,600	23,136.00	0.01
300	000519	中兵红箭	1,600	23,120.00	0.01
301	603688	石英股份	800	22,984.00	0.01
302	000591	太阳能	4,800	22,848.00	0.01
303	601668	中国建筑	3,800	22,800.00	0.01
304	002123	梦网科技	2,100	22,701.00	0.01
305	300251	光线传媒	2,400	22,656.00	0.01
306	300438	鹏辉能源	800	22,488.00	0.01
307	000831	中国稀土	800	22,440.00	0.01

308	600816	建元信托	6,400	22,400.00	0.01
309	603816	顾家家居	800	22,064.00	0.01
310	600973	宝胜股份	3,500	22,050.00	0.01
311	000400	许继电气	800	22,024.00	0.01
312	603882	金域医学	800	22,024.00	0.01
313	603885	吉祥航空	1,600	21,920.00	0.01
314	600118	中国卫星	800	21,840.00	0.01
315	600531	豫光金铅	3,400	21,828.00	0.01
316	601328	交通银行	2,800	21,756.00	0.01
317	603019	中科曙光	300	21,696.00	0.01
318	600754	锦江酒店	800	21,488.00	0.01
319	000792	盐湖股份	1,300	21,398.00	0.01
320	000069	华侨城 A	8,000	21,360.00	0.01
321	603296	华勤技术	300	21,285.00	0.01
322	603613	国联股份	800	21,264.00	0.01
323	300832	新产业	300	21,255.00	0.01
324	600755	厦门国贸	3,200	21,248.00	0.01
325	002151	北斗星通	800	21,232.00	0.01
326	601222	林洋能源	3,000	21,210.00	0.01
327	000887	中鼎股份	1,600	20,992.00	0.01
328	601728	中国电信	2,900	20,938.00	0.01
329	600633	浙数文化	2,000	20,920.00	0.01
330	688200	华峰测控	200	20,900.00	0.01
331	600131	国网信通	1,100	20,801.00	0.01
332	002533	金杯电工	2,100	20,664.00	0.01
333	600529	山东药玻	800	20,616.00	0.01
334	300296	利亚德	3,200	20,608.00	0.01
335	600655	豫园股份	3,200	20,576.00	0.01
336	300070	碧水源	4,000	20,240.00	0.01
337	601888	中国中免	300	20,103.00	0.01
338	688543	国科军工	400	20,048.00	0.01
339	688777	中控技术	400	19,868.00	0.01
340	605358	立昂微	800	19,816.00	0.01
341	600129	太极集团	800	19,776.00	0.01
342	000768	中航西飞	700	19,768.00	0.01
343	603077	和邦生物	9,600	19,584.00	0.01
344	002142	宁波银行	800	19,448.00	0.01
345	601880	辽港股份	11,200	19,376.00	0.01
346	600867	通化东宝	2,400	19,344.00	0.01
347	603939	益丰药房	800	19,304.00	0.01
348	300567	精测电子	300	19,290.00	0.01
349	002407	多氟多	1,600	19,200.00	0.01
350	300118	东方日升	1,600	19,168.00	0.01

351	300457	赢合科技	1,000	19,140.00	0.01
352	601155	新城控股	1,600	19,136.00	0.01
353	002607	中公教育	5,600	19,040.00	0.01
354	689009	九号公司	400	19,000.00	0.01
355	003816	中国广核	4,600	18,998.00	0.01
356	002368	太极股份	800	18,944.00	0.01
357	000785	居然智家	5,300	18,921.00	0.01
358	600323	瀚蓝环境	800	18,896.00	0.01
359	600959	江苏有线	5,600	18,760.00	0.01
360	300212	易华录	800	18,720.00	0.01
361	600499	科达制造	2,400	18,720.00	0.01
362	600208	衢州发展	6,300	18,648.00	0.01
363	603075	热威股份	1,000	18,630.00	0.01
364	001286	陕西能源	2,000	18,560.00	0.01
365	300390	天华新能	800	18,440.00	0.01
366	000629	钒钛股份	6,400	18,432.00	0.01
367	600325	华发股份	3,200	18,432.00	0.01
368	603156	养元饮品	800	18,272.00	0.01
369	601717	郑煤机	1,400	18,172.00	0.01
370	603899	晨光股份	600	18,150.00	0.01
371	601958	金钼股份	1,800	18,108.00	0.01
372	600166	福田汽车	7,200	18,072.00	0.01
373	000690	宝新能源	4,000	17,920.00	0.01
374	000998	隆平高科	1,600	17,872.00	0.01
375	600688	上海石化	5,900	17,818.00	0.01
376	002284	亚太股份	2,300	17,802.00	0.01
377	600285	羚锐制药	800	17,728.00	0.01
378	600938	中国海油	600	17,706.00	0.01
379	603000	人民网	800	17,632.00	0.01
380	002236	大华股份	1,100	17,600.00	0.01
381	000547	航天发展	2,400	17,544.00	0.01
382	601088	中国神华	400	17,392.00	0.01
383	300133	华策影视	2,400	17,328.00	0.01
384	603568	伟明环保	800	17,304.00	0.01
385	300454	深信服	300	17,220.00	0.01
386	002508	老板电器	800	17,144.00	0.01
387	002544	普天科技	800	17,144.00	0.01
388	002245	蔚蓝锂芯	1,600	17,104.00	0.01
389	002145	中核钛白	4,000	16,960.00	0.01
390	600795	国电电力	3,700	16,946.00	0.01
391	603605	珀莱雅	200	16,940.00	0.01
392	001914	招商积余	1,600	16,912.00	0.01
393	300476	胜宏科技	400	16,836.00	0.01

394	601636	旗滨集团	3,000	16,830.00	0.01
395	601866	中远海发	6,400	16,704.00	0.01
396	600667	太极实业	2,400	16,608.00	0.01
397	603345	安井食品	200	16,296.00	0.01
398	300811	铂科新材	300	16,173.00	0.01
399	300972	万辰集团	200	16,082.00	0.01
400	002032	苏泊尔	300	15,963.00	0.01
401	300442	润泽科技	300	15,588.00	0.01
402	000035	中国天楹	3,200	15,584.00	0.01
403	000977	浪潮信息	300	15,564.00	0.01
404	600745	闻泰科技	400	15,512.00	0.01
405	301327	华宝新能	200	15,342.00	0.01
406	000818	航锦科技	800	15,280.00	0.01
407	002396	星网锐捷	800	15,192.00	0.01
408	300595	欧普康视	800	15,160.00	0.01
409	600771	广誉远	800	15,088.00	0.01
410	688443	智翔金泰	600	15,054.00	0.01
411	300303	聚飞光电	2,200	15,004.00	0.01
412	002139	拓邦股份	1,100	14,971.00	0.01
413	002984	森麒麟	600	14,796.00	0.01
414	002801	微光股份	600	14,676.00	0.01
415	600845	宝信软件	500	14,630.00	0.01
416	002230	科大讯飞	300	14,496.00	0.01
417	600298	安琪酵母	400	14,420.00	0.01
418	002541	鸿路钢构	800	14,344.00	0.01
419	600585	海螺水泥	600	14,268.00	0.01
420	603195	公牛集团	200	14,048.00	0.01
421	600399	抚顺特钢	2,400	13,920.00	0.01
422	600050	中国联通	2,600	13,806.00	0.01
423	600276	恒瑞医药	300	13,770.00	0.01
424	002572	索菲亚	800	13,744.00	0.01
425	300601	康泰生物	800	13,720.00	0.01
426	301376	致欧科技	700	13,384.00	0.00
427	688469	芯联集成	2,600	13,338.00	0.00
428	688334	西高院	800	13,064.00	0.00
429	002268	电科网安	800	13,000.00	0.00
430	002410	广联达	1,100	12,936.00	0.00
431	600916	中国黄金	1,500	12,930.00	0.00
432	600406	国电南瑞	500	12,610.00	0.00
433	600176	中国巨石	1,100	12,529.00	0.00
434	600901	江苏金租	2,400	12,528.00	0.00
435	002266	浙富控股	4,000	12,480.00	0.00
436	002666	德联集团	2,800	12,208.00	0.00

437	688386	泛亚微透	400	12,088.00	0.00
438	000967	盈峰环境	2,400	11,928.00	0.00
439	600884	杉杉股份	1,600	11,920.00	0.00
440	603766	隆鑫通用	1,300	11,830.00	0.00
441	002091	江苏国泰	1,600	11,712.00	0.00
442	002240	盛新锂能	800	11,024.00	0.00
443	603456	九洲药业	800	10,944.00	0.00
444	688127	蓝特光学	400	10,840.00	0.00
445	601117	中国化学	1,300	10,777.00	0.00
446	002601	龙佰集团	600	10,602.00	0.00
447	002080	中材科技	800	10,464.00	0.00
448	300083	创世纪	1,600	10,416.00	0.00
449	000963	华东医药	300	10,380.00	0.00
450	300225	金力泰	1,600	10,336.00	0.00
451	002212	天融信	1,600	10,320.00	0.00
452	002372	伟星新材	800	10,104.00	0.00
453	600368	五洲交通	2,100	10,017.00	0.00
454	000528	柳工	800	9,648.00	0.00
455	003006	百亚股份	400	9,596.00	0.00
456	603600	永艺股份	800	9,512.00	0.00
457	600084	中信尼雅	1,800	9,468.00	0.00
458	600661	昂立教育	800	9,376.00	0.00
459	600346	恒力石化	600	9,210.00	0.00
460	600167	联美控股	1,600	9,168.00	0.00
461	600750	江中药业	400	9,080.00	0.00
462	002637	赞宇科技	900	8,865.00	0.00
463	002035	华帝股份	1,200	8,808.00	0.00
464	002081	金螳螂	2,400	8,568.00	0.00
465	002832	比音勒芬	400	8,564.00	0.00
466	605033	美邦股份	700	8,421.00	0.00
467	600570	恒生电子	300	8,397.00	0.00
468	603588	高能环境	1,600	8,384.00	0.00
469	600354	敦煌种业	1,400	8,288.00	0.00
470	300453	三鑫医疗	1,100	8,206.00	0.00
471	300770	新媒股份	200	8,082.00	0.00
472	600873	梅花生物	800	8,024.00	0.00
473	002683	广东宏大	300	7,944.00	0.00
474	002155	湖南黄金	500	7,865.00	0.00
475	300979	华利集团	100	7,865.00	0.00
476	600029	南方航空	1,200	7,788.00	0.00
477	600861	北京人力	400	7,740.00	0.00
478	300218	安利股份	500	7,700.00	0.00
479	600757	长江传媒	800	7,656.00	0.00

480	000513	丽珠集团	200	7,600.00	0.00
481	002648	卫星化学	400	7,516.00	0.00
482	603383	顶点软件	200	7,500.00	0.00
483	002470	金正大	3,800	7,448.00	0.00
484	002841	视源股份	200	7,382.00	0.00
485	600778	友好集团	800	7,272.00	0.00
486	300919	中伟股份	200	7,224.00	0.00
487	002891	中宠股份	200	7,140.00	0.00
488	601965	中国汽研	400	7,048.00	0.00
489	603889	新澳股份	1,000	7,010.00	0.00
490	002265	建设工业	300	6,981.00	0.00
491	002292	奥飞娱乐	800	6,920.00	0.00
492	601319	中国人保	900	6,858.00	0.00
493	002852	道道全	800	6,608.00	0.00
494	601101	昊华能源	800	6,584.00	0.00
495	002249	大洋电机	1,100	6,457.00	0.00
496	600582	天地科技	1,000	6,180.00	0.00
497	300638	广和通	300	6,045.00	0.00
498	300415	伊之密	300	6,018.00	0.00
499	002216	三全食品	500	6,000.00	0.00
500	000997	新大陆	300	5,985.00	0.00
501	601568	北元集团	1,400	5,880.00	0.00
502	600894	广日股份	400	5,840.00	0.00
503	601021	春秋航空	100	5,767.00	0.00
504	600380	健康元	500	5,635.00	0.00
505	301158	德石股份	400	5,612.00	0.00
506	000938	紫光股份	200	5,566.00	0.00
507	002733	雄韬股份	400	5,536.00	0.00
508	002511	中顺洁柔	800	5,448.00	0.00
509	603496	恒为科技	200	5,436.00	0.00
510	300773	拉卡拉	300	5,310.00	0.00
511	600500	中化国际	1,300	5,226.00	0.00
512	000895	双汇发展	200	5,192.00	0.00
513	002576	通达动力	300	5,142.00	0.00
514	002661	克明食品	500	5,030.00	0.00
515	300307	慈星股份	600	4,944.00	0.00
516	600007	中国国贸	200	4,892.00	0.00
517	300232	洲明科技	700	4,809.00	0.00
518	601992	金隅集团	2,700	4,806.00	0.00
519	300525	博思软件	300	4,674.00	0.00
520	300650	太龙股份	400	4,600.00	0.00
521	603888	新华网	200	4,468.00	0.00
522	300373	扬杰科技	100	4,352.00	0.00

523	002543	万和电气	400	4,096.00	0.00
524	002763	汇洁股份	600	3,984.00	0.00
525	000726	鲁泰A	600	3,912.00	0.00
526	002489	浙江永强	1,200	3,888.00	0.00
527	603619	中曼石油	200	3,872.00	0.00
528	601118	海南橡胶	700	3,787.00	0.00
529	002322	理工能科	300	3,777.00	0.00
530	300758	七彩化学	300	3,594.00	0.00
531	605166	聚合顺	300	3,591.00	0.00
532	600986	浙文互联	600	3,588.00	0.00
533	002153	石基信息	500	3,570.00	0.00
534	603093	南华期货	300	3,570.00	0.00
535	600059	古越龙山	400	3,552.00	0.00
536	688079	美迪凯	400	3,464.00	0.00
537	001206	依依股份	200	3,306.00	0.00
538	688098	申联生物	600	3,282.00	0.00
539	002612	朗姿股份	200	3,272.00	0.00
540	600588	用友网络	300	3,219.00	0.00
541	002306	中科云网	1,100	3,168.00	0.00
542	000786	北新建材	100	3,031.00	0.00
543	002296	辉煌科技	300	2,943.00	0.00
544	601061	中信金属	400	2,904.00	0.00
545	600137	浪莎股份	200	2,810.00	0.00
546	601686	友发集团	500	2,730.00	0.00
547	601886	江河集团	500	2,700.00	0.00
548	300451	创业慧康	600	2,688.00	0.00
549	002907	华森制药	200	2,600.00	0.00
550	002088	鲁阳节能	200	2,558.00	0.00
551	002803	吉宏股份	200	2,536.00	0.00
552	600662	外服控股	500	2,535.00	0.00
553	002753	永东股份	400	2,508.00	0.00
554	601311	骆驼股份	300	2,487.00	0.00
555	000652	泰达股份	600	2,484.00	0.00
556	002550	千红制药	400	2,480.00	0.00
557	002609	捷顺科技	300	2,478.00	0.00
558	002404	嘉欣丝绸	400	2,476.00	0.00
559	300682	朗新集团	200	2,440.00	0.00
560	300986	志特新材	200	2,428.00	0.00
561	002539	云图控股	300	2,346.00	0.00
562	301112	信邦智能	100	2,337.00	0.00
563	603299	苏盐井神	200	2,228.00	0.00
564	600858	银座股份	400	2,220.00	0.00
565	603908	牧高笛	100	2,210.00	0.00

566	001380	华纬科技	100	2,190.00	0.00
567	600827	百联股份	200	2,186.00	0.00
568	000420	吉林化纤	600	2,166.00	0.00
569	300369	绿盟科技	300	2,157.00	0.00
570	002108	沧州明珠	600	2,154.00	0.00
571	600348	华阳股份	300	2,127.00	0.00
572	600452	涪陵电力	200	2,118.00	0.00
573	300201	海伦哲	400	2,104.00	0.00
574	002367	康力电梯	300	2,061.00	0.00
575	301216	万凯新材	200	2,040.00	0.00
576	003012	东鹏控股	300	1,983.00	0.00
577	600320	振华重工	500	1,960.00	0.00
578	603518	锦泓集团	200	1,960.00	0.00
579	002376	新北洋	300	1,956.00	0.00
580	601678	滨化股份	500	1,880.00	0.00
581	000563	陕国投 A	500	1,780.00	0.00
582	300673	佩蒂股份	100	1,773.00	0.00
583	000626	远大控股	300	1,725.00	0.00
584	600158	中体产业	200	1,654.00	0.00
585	301193	家联科技	100	1,653.00	0.00
586	600273	嘉化能源	200	1,594.00	0.00
587	600643	爱建集团	300	1,551.00	0.00
588	000007	全新好	200	1,406.00	0.00
589	600987	航民股份	200	1,388.00	0.00
590	002659	凯文教育	300	1,356.00	0.00
591	600210	紫江企业	200	1,322.00	0.00
592	600871	石化油服	600	1,224.00	0.00
593	002613	北玻股份	300	1,212.00	0.00
594	002948	青岛银行	300	1,164.00	0.00
595	002063	远光软件	200	1,152.00	0.00
596	603558	健盛集团	100	1,076.00	0.00
597	002354	天娱数科	200	1,074.00	0.00
598	002125	湘潭电化	100	1,008.00	0.00
599	002392	北京利尔	200	944.00	0.00
600	600369	西南证券	200	934.00	0.00
601	600979	广安爱众	200	924.00	0.00
602	001203	大中矿业	100	866.00	0.00
603	600408	安泰集团	400	820.00	0.00
604	003037	三和管桩	100	737.00	0.00
605	002752	昇兴股份	100	635.00	0.00
606	002442	龙星科技	100	601.00	0.00
607	002697	红旗连锁	100	591.00	0.00
608	600409	三友化工	100	540.00	0.00

609	002285	世联行	200	518.00	0.00
610	300237	美晨科技	200	436.00	0.00
611	002663	普邦股份	100	199.00	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	300750	宁德时代	494,204.00	0.19
2	600519	贵州茅台	457,180.00	0.18
3	300502	新易盛	324,082.00	0.13
4	000333	美的集团	313,524.00	0.12
5	002463	沪电股份	282,323.00	0.11
6	000858	五粮液	271,684.00	0.11
7	002475	立讯精密	200,455.00	0.08
8	601899	紫金矿业	181,224.00	0.07
9	300760	迈瑞医疗	178,827.00	0.07
10	600809	山西汾酒	150,980.00	0.06
11	002273	水晶光电	150,833.00	0.06
12	300308	中际旭创	149,901.00	0.06
13	603986	兆易创新	149,560.00	0.06
14	300394	天孚通信	137,265.00	0.05
15	000423	东阿阿胶	134,385.00	0.05
16	600031	三一重工	131,480.00	0.05
17	600660	福耀玻璃	127,030.00	0.05
18	300661	圣邦股份	121,846.00	0.05
19	688008	澜起科技	121,232.00	0.05
20	601058	赛轮轮胎	119,750.00	0.05

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。

8.4.2 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

无。

8.4.3 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	22,359,671.13
卖出股票收入（成交）总额	-

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。

8.5 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	2,084,517.81	0.76
2	央行票据	-	-
3	金融债券	63,016,330.71	23.00
	其中：政策性金融债	63,016,330.71	23.00
4	企业债券	27,928,494.52	10.19
5	企业短期融资券	10,079,202.19	3.68
6	中期票据	20,170,966.02	7.36
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	20,874,020.76	7.62
9	其他	-	-
10	合计	144,153,532.01	52.61

8.6 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	240205	24 国开 05	100,000	10,979,969.95	4.01
2	240203	24 国开 03	100,000	10,532,322.40	3.84
3	230208	23 国开 08	100,000	10,514,580.82	3.84
4	210203	21 国开 03	100,000	10,501,849.32	3.83
5	230313	23 进出 13	100,000	10,253,794.52	3.74

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

无。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

无。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。

8.12.2 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。

8.12.3 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	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	10,122,984.07
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,122,984.07

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

§9 基金份额持有人信息

9.1 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	696	293,774.33	194,340,958.10	95.05%	10,125,972.96	4.95%
汇泉安盈回报债券 C	1,335	16,426.74	0.00	0.00%	21,929,700.94	100.00%
汇泉安盈回报债券 E	4	9,779,223.74	39,116,894.95	100.00%	0.00	0.00%
合计	2,035	130,473.48	233,457,853.05	87.93%	32,055,673.90	12.07%

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。

9.2 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	13,700.54	0.01%
	汇泉安盈回报债券 C	64,336.47	0.29%
	汇泉安盈回报债券 E	0.00	0.00%
	合计	78,037.01	0.03%

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）。

9.3 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	0~10
	汇泉安盈回报债券 C	0~10
	汇泉安盈回报债券 E	0
	合计	0~10
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
	汇泉安盈回报债券 C	0~10
	汇泉安盈回报债券 E	0
	合计	0~10

§10 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	25,536,998.98	235,846,418.84	0.00
本报告期基金总申购份额	242,170,004.47	456,712,785.82	166,771,072.86
减：本报告期基金总赎回份额	63,240,072.39	670,629,503.72	127,654,177.91
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	204,466,931.06	21,929,700.94	39,116,894.95

注：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。

§11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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

2024 年 12 月 9 日，根据工作安排，宋菁女士不再担任平安银行股份有限公司资产托管部副总经理。

11.3 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。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略无变化。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金提供审计服务的机构由普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）变更为容诚会计师事务所(特殊普通合伙)。本基金本年度支付给容诚会计师事务所(特殊普通合伙)的报酬为 40,000.00 元人民币，目前该事务所已向本基金提供连续 1 年的审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 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。

11.6.2 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	22,359,671.13	100.00%	29,194.92	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）、公司合规风控能力评价、公司券商结算模式服务评价（稳定性、及时性）等方面，如拟使用证券经纪商的研究服务，需对公司

研究服务进行评价（研究成果、研究团队）。基金证券经纪商选择程序为：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。

3、交易单元变更情况

2024 年 1 月 9 日本基金新增山西证券交易单元 2 个，于 2024 年 12 月 26 日终止使用。本报告期内，该证券交易单元未发生交易。

4、根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》和《关于通报 2022 年市场平均股票交易佣金费率的通知》的相关规定，公司已于 2024 年 6 月 30 日前完成对本证券经纪商股票交易佣金费率的调整。本基金属于其他类型基金，自 2024 年 7 月 1 日起股票交易佣金费率不高于万分之 5.24。

11.7.2 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	567,657,035.41	100.00%	473,900,000.00	100.00%	-	-	-	-

11.8 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 2023 年第四季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2024-01-22
2	汇泉安盈回报债券型证券投资基金基金经理变更公告	中国证监会指定报刊及网站	2024-01-31
3	汇泉安盈回报债券型证券投资基金更新的招募说明书（2024 年第 1 期）	中国证监会指定报刊及网站	2024-02-01
4	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	2024-02-01
5	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	2024-02-01
6	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（更新）	中国证监会指定报刊及网站	2024-02-01
7	汇泉安盈回报债券型证券投资基金 2023 年年度报告	中国证监会指定报刊及网站	2024-03-29
8	汇泉安盈回报债券型证券投资基金 2024 年第一季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2024-04-20
9	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	2024-06-26

10	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	2024-06-26
11	汇泉安盈回报债券型证券投资基金（E 类份额）基金产品资料概要更新	中国证监会指定报刊及网站	2024-06-26
12	汇泉安盈回报债券型证券投资基金 2024 年第二季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2024-07-19
13	汇泉安盈回报债券型证券投资基金 2024 年中期报告	中国证监会指定报刊及网站	2024-08-30
14	汇泉安盈回报债券型证券投资基金 2024 年第三季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2024-10-25

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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
产品	1	20240920-20240926	-	29,449,199.96	-	29,449,199.96	11.09%
	2	20241010-20241225	-	29,449,199.96	-	29,449,199.96	11.09%
	3	20241226-20241231	-	96,795,953.93	-	96,795,953.93	36.46%
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。							

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§13 备查文件目录

13.1 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。

13.2 存放地点

北京市海淀区西直门外大街 168 号腾达大厦 16 层。

13.3 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

二〇二五年三月二十八日