

# 汇安丰恒灵活配置混合型证券投资基金 2018 年半年度报告

2018 年 6 月 30 日

基金管理人：汇安基金管理有限责任公司

基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司

送出日期：2018 年 8 月 24 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。本半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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 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 2018 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§2 基金简介</b>	<b>6</b>
2.1 基金基本情况	6
2.2 基金产品说明	6
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	8
<b>§4 管理人报告</b>	<b>12</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	16
<b>§5 托管人报告</b>	<b>17</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	17
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	17
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>18</b>
6.1 资产负债表	18
6.2 利润表	19
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	20

6.4 报表附注 .....	21
<b>§7 投资组合报告 .....</b>	<b>40</b>
7.1 期末基金资产组合情况 .....	40
7.2 期末按行业分类的股票投资组合 .....	40
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 .....	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	48
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 .....	49
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 .....	49
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 .....	49
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 .....	49
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	49
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	49
7.12 投资组合报告附注 .....	49
<b>§8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>51</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	51
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	51
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的情况 .....	51
<b>§9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>52</b>
<b>§10 重大事件揭示 .....</b>	<b>53</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	53
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 .....	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	53
10.4 基金投资策略的改变 .....	53
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	53
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 .....	53
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	53
10.8 其他重大事件 .....	55
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>56</b>
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 .....	56

11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	56
<b>§12 备查文件目录 .....</b>	<b>57</b>
12.1 备查文件目录 .....	57
12.2 存放地点 .....	57
12.3 查阅方式 .....	57

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	汇安丰恒灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	汇安丰恒混合	
基金主代码	003845	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017年3月13日	
基金管理人	汇安基金管理有限责任公司	
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	128,757,836.84份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	汇安丰恒混合 A	汇安丰恒混合 C
下属分级基金的交易代码:	003845	003846
报告期末下属分级基金的份额总额	123,755,868.60份	5,001,968.24份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在深入的基本面研究的基础上，通过灵活的资产配置、策略配置与严谨的风险管理，力争实现基金资产的持续稳定增值。
投资策略	本基金通过合理稳健的资产配置策略，进行积极主动的股票投资和债券投资，把握中国经济增长和资本市场发展机遇，严格控制下行风险，力争实现基金份额净值的长期平稳增长。 本基金投资策略主要包括资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、股指期货和国债期货投资策略、权证投资策略等。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×50%+上证国债指数收益率×50%
风险收益特征	本基金为混合型基金，属于证券投资基金中预期风险与预期收益中等的投资品种，其风险收益水平高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人	
名称	汇安基金管理有限责任公司	上海浦东发展银行股份有限公司	
信息披露负责人	姓名	孙运英	胡波
	联系电话	01056711605	021-61618888
	电子邮箱	sunyy@huianfund.cn	hub5@spdb.com.cn
客户服务电话	01056711690	95528	

传真	01056711640	021-63602540
注册地址	上海市虹口区欧阳路 218 弄 1 号 2 楼 215 室	上海市中山东一路 12 号
办公地址	北京市东城区东直门南大街 5 号中青旅大厦 13-14 层; 上海市浦东新区银城中路 68 号时代金融中心 2901-2903 室	上海市北京东路 689 号
邮政编码	100007	200001
法定代表人	秦军	高国富

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.huianfund.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人办公地点

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	汇安基金管理有限责任公司	北京东城区东直门南大街 5 号中青旅大厦 1301

## § 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

基金级别	汇安丰恒混合 A	汇安丰恒混合 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2018年1月1日 - 2018年6月30日)	报告期(2018年1月1日 - 2018年6月30日)
本期已实现收益	-1,315,396.83	-183,679.16
本期利润	-11,312,960.74	-854,182.24
加权平均基金份额本期利润	-0.0839	-0.0984
本期加权平均净值利润率	-7.74%	-9.08%
本期基金份额净值增长率	-9.29%	-9.34%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)	
期末可供分配利润	-1,879,912.49	-82,111.88
期末可供分配基金份额利润	-0.0152	-0.0164
期末基金资产净值	121,875,956.11	4,919,856.36
期末基金份额净值	0.9848	0.9836
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2018年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	-1.52%	-1.64%

注：1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

3、对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分余额的孰低数。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

汇安丰恒混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-7.00%	1.72%	-3.65%	0.64%	-3.35%	1.08%



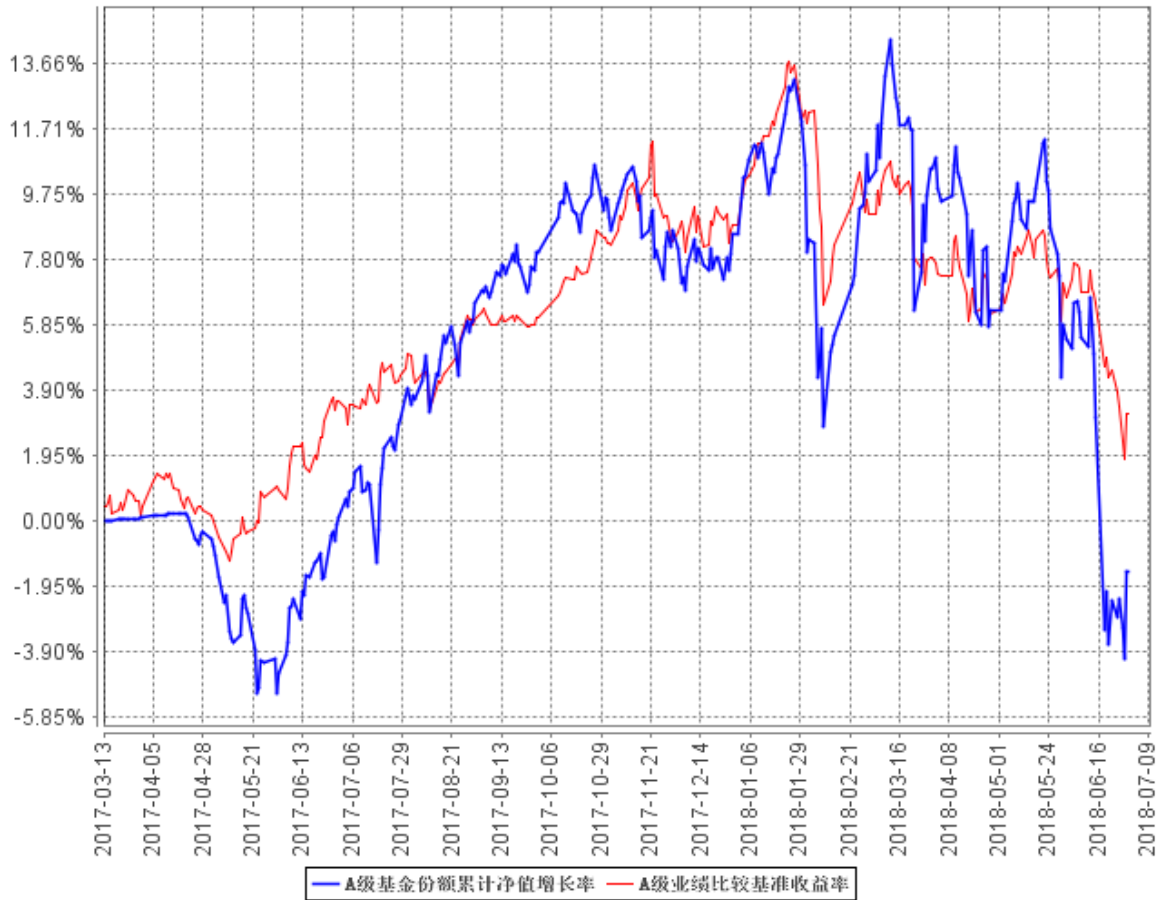
过去三个月	-10.92%	1.31%	-4.28%	0.57%	-6.64%	0.74%
过去六个月	-9.29%	1.26%	-5.15%	0.58%	-4.14%	0.68%
过去一年	-1.63%	0.96%	-0.34%	0.48%	-1.29%	0.48%
自基金合同 生效起至今	-1.52%	0.87%	3.23%	0.44%	-4.75%	0.43%

汇安丰恒混合 C

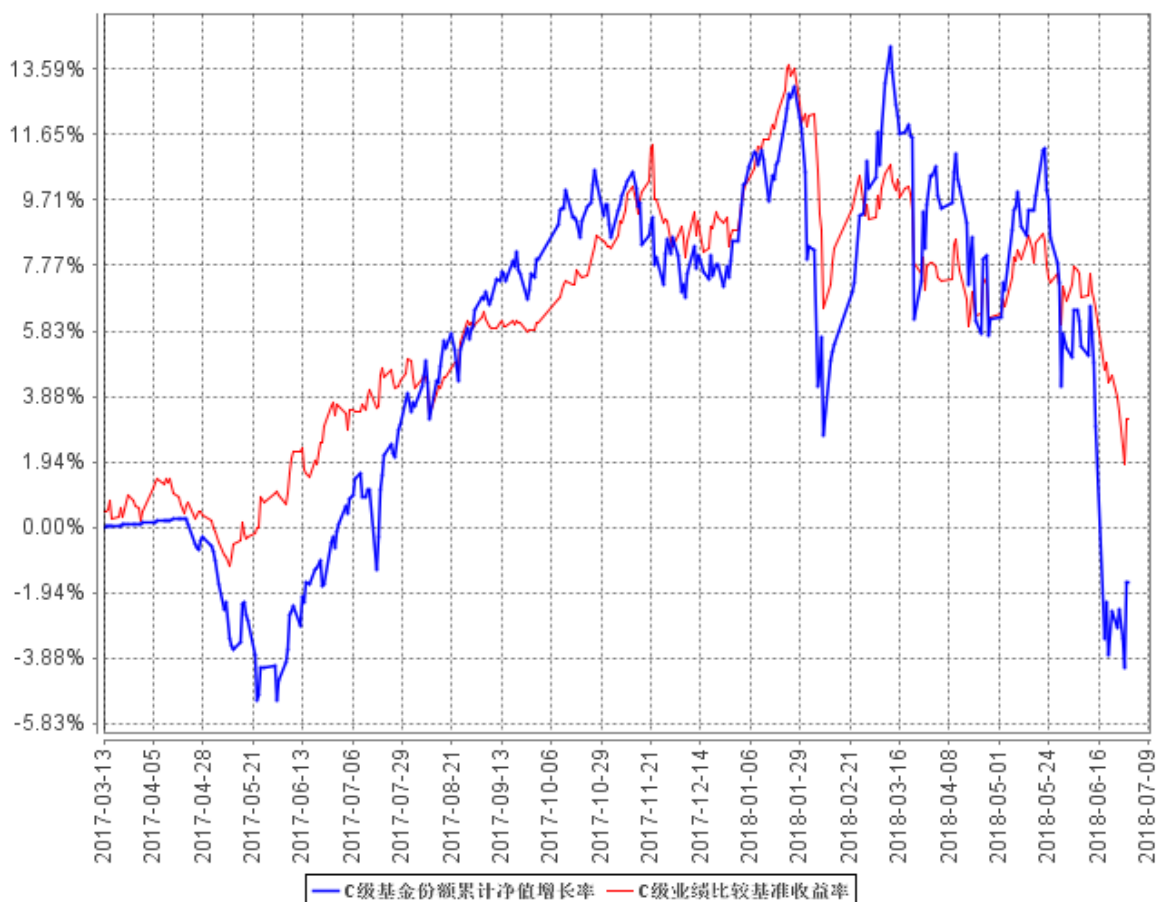
阶段	份额净值增 长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	-7.00%	1.72%	-3.65%	0.64%	-3.35%	1.08%
过去三个月	-10.93%	1.31%	-4.28%	0.57%	-6.65%	0.74%
过去六个月	-9.34%	1.26%	-5.15%	0.58%	-4.19%	0.68%
过去一年	-1.72%	0.96%	-0.34%	0.48%	-1.38%	0.48%
自基金合同 生效起至今	-1.64%	0.87%	3.23%	0.44%	-4.87%	0.43%

### 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

A级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：①本基金合同生效日为2017年3月13日，至本报告期末，本基金合同生效已满一年。

②根据《汇安丰恒灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、可转换债券、中小企业私募债等）、债券回购、同业存单、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金的投资组合比例为：本基金股票资产投资比例为基金资产的0-95%；每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值的5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券；权证、股指期货、国债期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。根据基金合同的规定，自基金合同生效之日起6个月内基金各项资产配置比例需符合基金合同要求。截至本报告期末，本基金已完成建仓但报告期末距建仓结束不满一年。建仓期为2017年3月13日至2017年9月12日，建仓结束时各项资产比例符合合同约定。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截至 2018 年 6 月 30 日，公司旗下管理 17 只公募基金——汇安嘉汇纯债债券型证券投资基金、汇安嘉裕纯债债券型证券投资基金、汇安丰利灵活配置混合型证券投资基金、汇安丰融灵活配置混合型证券投资基金、汇安嘉源纯债债券型证券投资基金、汇安丰华灵活配置混合型证券投资基金、汇安丰泽灵活配置混合型证券投资基金、汇安丰泰灵活配置混合型证券投资基金、汇安丰恒灵活配置混合型证券投资基金、汇安丰裕灵活配置混合型证券投资基金、汇安丰益灵活配置混合型证券投资基金、汇安多策略灵活配置混合型证券投资基金、汇安资产轮动灵活配置混合型证券投资基金、汇安裕华纯债定期开放债券型发起式证券投资基金、汇安成长优选灵活配置混合型证券投资基金、汇安稳裕债券型证券投资基金、汇安趋势动力股票型证券投资基金。

#### 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		
仇秉则	固定收益投资部副总经理、本基金的基金经理	2017 年 3 月 13 日	2018 年 5 月 14 日	12 年	仇秉则，CFA，CPA，中山大学经济学学士，12 年证券、基金行业从业经历，曾任普华永道中天会计师事务所审计经理，嘉实基金管理有限公司固定收益部高级信用分析师。2016 年 6 月加入汇安基金管理有限责任公司，担任固定收益投资部副总经理一职，从事信用债投资研究工作。2016 年 12 月 19 日至 2018 年 2 月 9 日，任汇

					<p>安丰利灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2017年1月25日至2018年2月9日，任汇安丰泰灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2017年1月13日至2018年5月14日，任汇安丰泽灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2017年3月13日至2018年5月14日，任汇安丰恒灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2016年12月2日至今，任汇安嘉汇纯债债券型证券投资基金基金经理；2016年12月5日至今，任汇安嘉裕纯债债券型证券投资基金基金经理；2016年12月22日至今，任汇安丰融灵活配置混合型证券投资基金、汇安嘉源纯债债券型证券投资基金基金经理；2017年1月10日至今，任汇安丰华灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2017年7月27日至今，任汇安丰裕灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2017年8月10日至今，任汇安丰益灵活配置混合型证券投资基金基金经理。</p>
戴杰	指数与量化投资部高级经理、本基金的基金经理	2017年3月22日	-	5年	<p>戴杰，复旦大学数学本科、硕士，5年证券、基金行业从业经历，曾任华安基金管理有限公司指数与量化投资部先后担任数量分析师和投资经理。2016年10月24日加入汇安基金管理有限公司，担任指数与量化投资部高级经理一职。2017年1月17日至今，任汇安丰泽灵活</p>

					配置混合型证券投资基金基金经理;2017年3月22日至今,任汇安丰恒灵活配置混合型证券投资基金基金经理;2017年3月23日至今,任汇安丰华灵活配置混合型证券投资基金基金经理;2017年7月19日至今,任汇安丰利灵活配置混合型证券投资基金基金经理;2017年7月27日至今,任汇安丰裕灵活配置混合型证券投资基金基金经理;2017年11月22日至今,任汇安多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理;2018年2月13日至今,任汇安成长优选灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	--

注:1、“任职日期”和“离职日期”分别指根据公司对外披露的聘任日期和解聘日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

3、本基金无基金经理助理。

#### 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法》、《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求利益,无损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

平交易制度得到良好的贯彻执行，未发现存在违反公平交易原则的情况。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2018 年上半年，受到贸易冲突疑云密布、国内金融去杠杆以及汇率大幅波动等因素的影响，股票市场短期出现了较大幅度的系统性下跌。出于对中期市场估值水平的认可，本报告期本基金仓位维持了比较高的水平，因此净值出现了一些波动。我们认为，近期市场的走势，主要受到情绪波动的影响，事实上每一次市场恐慌性的下跌，看似有各式各样“非常严重”风险，但长期来看绝大多数所谓的风险都是历史长河中的短期扰动。我们认为从理性的角度来看，“贸易战”最终会达成和解，只是谈判过程不可能一帆风顺，金融去杠杆虽然短期会造成一些麻烦，但这正是中国经济坚决升级转型必须要走的道路，长期来看只会使得经济更加健康。我们认为监管层会充分评估宏观经济和金融市场承受能力，储备一些定向宽松、减税等政策对冲负面影响。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末汇安丰恒混合 A 基金份额净值为 0.9848 元，本报告期基金份额净值增长率为-9.29%；截至本报告期末汇安丰恒混合 C 基金份额净值为 0.9836 元，本报告期基金份额净值增长率为-9.34%；同期业绩比较基准收益率为-5.15%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，2018 年将延续“严监管、宽货币、紧信用、强改革”政策组合，贸易战阴影下政策将更具灵活性。当前时点，A 股市场的整体估值已经接近历史上最低的水准，我们判断市场大概率进入底部区域，下行空间比较有限。诚然短期走势受到不确定事件和情绪影响较多，难以精准把握拐点，但资本市场逐步消化和适应了短期扰动因素之后，我们对接下来的行情并不悲观。中期乃至相当长一段时间来看，我们依然认为权益资产相对其它大类资产更有吸引力。即便如此，我们同时也认为经过本次市场调整出清，未来 A 股市场仍然会继续分化，上演结构性行情，不太

会出现历史上大幅波动的普涨普跌。随着金融对外开放提速，国内投资者不断成熟，我们认为重视基本面的投资理念不可逆，优秀公司股价会不断创出新高，不具备基本面支撑的一些股票会持续创出新低，优胜劣汰是有效市场运转的必然结果。

#### **4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明**

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

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

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

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

#### **4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

本基金本报告期内未发生利润分配情况。

#### **4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明**

本报告期，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

本报告期内，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对汇安丰恒灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，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

本报告期内，本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对汇安丰恒灵活配置混合型证券投资基金的投资运作进行了监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金本报告期内未进行利润分配。

### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由汇安基金管理有限责任公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在本托管人复核范围内）、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：汇安丰恒灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2018年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	8,449,984.93	1,894,854.81
结算备付金		701,494.44	751,296.09
存出保证金		53,216.02	35,916.75
交易性金融资产	6.4.7.2	120,330,250.23	199,216,435.41
其中：股票投资		120,330,250.23	141,564,435.41
基金投资		-	-
债券投资		-	57,652,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	17,000,000.00
应收证券清算款		-	263,591.40
应收利息	6.4.7.5	3,950.68	1,544,059.90
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		129,538,896.30	220,706,154.36
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2018年6月30日</b>	<b>上年度末 2017年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		2,353,427.22	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		65,096.02	111,523.11
应付托管费		10,849.33	18,587.17
应付销售服务费		446.13	533.59
应付交易费用	6.4.7.7	233,923.78	162,730.03

应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	79,341.35	143,000.00
负债合计		2,743,083.83	436,373.90
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	128,757,836.84	202,879,213.05
未分配利润	6.4.7.10	-1,962,024.37	17,390,567.41
所有者权益合计		126,795,812.47	220,269,780.46
负债和所有者权益总计		129,538,896.30	220,706,154.36

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，汇安丰恒混合 A 基金份额净值 0.9848 元，基金份额总额 123,755,868.6 份；汇安丰恒混合 C 基金份额净值 0.9836 元，基金份额总额 5,001,968.24 份。汇安丰恒混合份额总额合计为 128,757,836.84 份。

## 6.2 利润表

会计主体：汇安丰恒灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 3 月 13 日(基金 合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		-10,370,106.11	798,035.51
1.利息收入		343,164.45	1,135,576.45
其中：存款利息收入	6.4.7.11	90,290.58	599,538.54
债券利息收入		195,623.06	285,161.63
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		57,250.81	250,876.28
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-49,871.95	-1,173,091.01
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-1,324,198.30	-2,244,041.97
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-9,220.00	3,520.00
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	1,283,546.35	1,067,430.96
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-10,668,066.99	835,550.07

4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	4,668.38	-
<b>减：二、费用</b>		1,797,036.87	778,706.86
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	465,039.57	363,412.34
2. 托管费	6.4.10.2.2	77,506.56	60,568.77
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	4,642.89	2,706.49
4. 交易费用	6.4.7.19	1,150,774.96	295,980.85
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.20	99,072.89	56,038.41
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-12,167,142.98	19,328.65
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-12,167,142.98	19,328.65

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汇安丰恒灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2018年1月1日至2018年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	202,879,213.05	17,390,567.41	220,269,780.46
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-12,167,142.98	-12,167,142.98
三、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）	-74,121,376.21	-7,185,448.80	-81,306,825.01
其中：1. 基金申购款	32,314,018.71	3,267,910.56	35,581,929.27

2. 基金赎回款	-106,435,394.92	-10,453,359.36	-116,888,754.28
四、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)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	128,757,836.84	-1,962,024.37	126,795,812.47
项目	上年度可比期间 2017年3月13日(基金合同生效日)至2017年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	200,086,316.11	-	200,086,316.11
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	19,328.65	19,328.65
三、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)	3,028,543.19	200,068.69	3,228,611.88
其中: 1.基金申购款	8,525,794.56	-21,470.54	8,504,324.02
2. 基金赎回款	-5,497,251.37	221,539.23	-5,275,712.14
四、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)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	203,114,859.30	219,397.34	203,334,256.64

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:

秦军

杜海岚

杜海岚

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

#### 6.4.1 基金基本情况

汇安丰恒灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2016]2693号《关于准予汇安丰恒灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》核准,由汇安基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《汇安丰恒灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式证券投资基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 200,086,315.98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(2017)第 260 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《汇安丰恒灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 3 月 13 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 200,086,316.11 份基金份额,其中认购资金利息折合 0.13 份基金份额。本基金的基金管理人为汇安基金管理有限责任公司,基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司(以下简称“浦发银行”)。

根据《汇安丰恒灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》,本基金根据认购费、申购费、赎回费和销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购基金时收取认购/申购费用,在赎回时根据持有期限收取赎回费用,并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为 A 类基金份额;在投资人认购/申购时不收取认购/申购费用,而是从本类别基金资产中计提销售服务费,并在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额,称为 C 类基金份额。由于基金费用的不同,本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别计算并公布基金份额净值和基金份额累计净值。投资人可自行选择认购/申购的基金份额类别。本基金不同基金份额类别之间不得互相转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《汇安丰恒灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、可转换债券、分离交易的可转换债券、中小企业私募债等)、债券回购、同业存单、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金的投资组合比例为:本基金股票资产投资比例为基金资产的 0-95%;每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后,保持不低于基金资产净值的 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等;权证、股指期货、国债期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定

执行。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×50%+上证国债指数收益率×50%。

本财务报表由本基金的基金管理人汇安基金管理有限责任公司于 2018 年 8 月 24 日批准报出。

#### **6.4.2 会计报表的编制基础**

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(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<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《汇安丰恒灵活配置混合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 2018 年 6 月 30 日的财务状况以及 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### **6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明**

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### **6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

##### **6.4.5.1 会计政策变更的说明**

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### **6.4.5.2 会计估计变更的说明**

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### **6.4.5.3 差错更正的说明**

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### **6.4.6 税项**

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、

财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费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 2018年6月30日
活期存款	8,449,984.93
定期存款	-
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	-
合计:	8,449,984.93

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	135,429,528.33	120,330,250.23	-15,099,278.10
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	135,429,528.33	120,330,250.23	-15,099,278.10

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产或衍生金融负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	3,611.08
应收定期存款利息	-

应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	315.70
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	23.90
合计	3,950.68

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
交易所市场应付交易费用	233,923.78
银行间市场应付交易费用	-
合计	233,923.78

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	79,341.35
合计	79,341.35

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

汇安丰恒混合 A		
项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	197,050,618.11	197,050,618.11

本期申购	23,141,495.63	23,141,495.63
本期赎回(以“-”号填列)	-96,436,245.14	-96,436,245.14
本期末	123,755,868.60	123,755,868.60

金额单位：人民币元

汇安丰恒混合 C		
项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	5,828,594.94	5,828,594.94
本期申购	9,172,523.08	9,172,523.08
本期赎回(以“-”号填列)	-9,999,149.78	-9,999,149.78
本期末	5,001,968.24	5,001,968.24

注：本期申购包含红利再投、转换入份额；本期赎回包含转换出份额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

汇安丰恒混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	21,043,587.89	-4,147,739.84	16,895,848.05
本期利润	-1,315,396.83	-9,997,563.91	-11,312,960.74
本期基金份额交易产生的变动数	-8,912,647.60	1,449,847.80	-7,462,799.80
其中：基金申购款	2,373,813.27	34,740.37	2,408,553.64
基金赎回款	-11,286,460.87	1,415,107.43	-9,871,353.44
本期已分配利润	-	-	-
本期末	10,815,543.46	-12,695,455.95	-1,879,912.49

单位：人民币元

汇安丰恒混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	617,321.36	-122,602.00	494,719.36
本期利润	-183,679.16	-670,503.08	-854,182.24
本期基金份额交易产生的变动数	-3,175.51	280,526.51	277,351.00
其中：基金申购款	1,129,653.93	-270,297.01	859,356.92
基金赎回款	-1,132,829.44	550,823.52	-582,005.92
本期已分配利润	-	-	-
本期末	430,466.69	-512,578.57	-82,111.88

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
活期存款利息收入	81,874.49
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	7,568.31
其他	847.78
合计	90,290.58

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
卖出股票成交总额	446,496,739.96
减：卖出股票成本总额	447,820,938.26
买卖股票差价收入	-1,324,198.30

#### 6.4.7.13 债券投资收益

##### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-9,220.00
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	-9,220.00

##### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交	59,462,559.94

总额	
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	57,759,940.00
减：应收利息总额	1,711,839.94
买卖债券差价收入	-9,220.00

#### 6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内未发生资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

#### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,283,546.35
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,283,546.35

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
1. 交易性金融资产	-10,668,066.99
——股票投资	-10,776,006.99
——债券投资	107,940.00
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-

合计	-10,668,066.99
----	----------------

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
基金赎回费收入	4,668.38
合计	4,668.38

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
交易所市场交易费用	1,150,174.96
银行间市场交易费用	600.00
合计	1,150,774.96

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
审计费用	29,752.78
信息披露费	49,588.57
银行划款手续费	1,131.54
上清所证书使用费	600.00
账户维护费	18,000.00
合计	99,072.89

#### 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

本基金本报告期内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
汇安基金管理有限责任公司（“汇安基金”）	基金管理人、登记机构、基金销售机构
上海浦东发展银行股份有限公司（“浦发银行”）	基金托管人
何斌	基金管理人股东
秦军	基金管理人股东
赵毅	基金管理人股东
郭小峰	基金管理人股东
戴新华	基金管理人股东
刘强	基金管理人股东
郭兆强	基金管理人股东
尹喜杰	基金管理人股东
王福德	基金管理人股东

### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行交易，亦无应支付关联方的佣金。

#### 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	上年度可比期间
	2018年1月1日至2018年6月30日	2017年3月13日(基金合同生效日)至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	465,039.57	363,412.34
其中：支付销售机构的客户维护费	0.94	-

注：支付基金管理人汇安基金管理有限责任公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值0.6%的

年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日基金管理人报酬=前一日基金资产净值 × 0.6% / 当年天数。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018年1月1日至2018年6月30日	2017年3月13日(基金合同生效日)至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	77,506.56	60,568.77

注：支付基金托管人浦发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		
	2018年1月1日至2018年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	汇安丰恒混合 A	汇安丰恒混合 C	合计
汇安基金管理有限责任公司	-	4,642.81	4,642.81
上海浦东发展银行股份有限公司	-	-	-
合计	-	4,642.81	4,642.81
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2017年3月13日(基金合同生效日)至2017年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	汇安丰恒混合 A	汇安丰恒混合 C	合计
汇安基金管理有限责任公司	-	2,706.49	2,706.49
上海浦东发展银行股份有限公司	-	-	-
合计	-	2,706.49	2,706.49

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 0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给汇安基金，再由汇安基金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×0.10%/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

本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

报告期内及上年度可比期间内,基金管理人未运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的基金份额。

##### 6.4.10.4.2 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

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方没有投资本基金的情况。

#### 6.4.10.5 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 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年3月13日(基金合同生效日)至 2017年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
浦发银行	8,449,984.93	81,874.49	6,453,881.49	184,992.33

注:本基金的活期银行存款由基金托管人浦发银行保管,按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末(2018年6月30日)本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位:人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别:股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
603693	江苏新能	2018年6月25日	2018年7月3日	新股流通受限	9.00	9.00	5,384	48,456.00	48,456.00	-

603706	东方环宇	2018年6月29日	2018年7月9日	新股流通受限	13.09	13.09	1,765	23,103.85	23,103.85	-
603105	芯能科技	2018年6月29日	2018年7月9日	新股流通受限	4.83	4.83	3,410	16,470.30	16,470.30	-

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
300324	旋极信息	2018年5月30日	重大事项	9.49	-	-	133,670	1,373,692.70	1,268,528.30	-
600022	山东钢铁	2018年3月27日	重大事项	2.02	2018年8月16日	1.83	622,200	1,396,147.51	1,256,844.00	-
002102	冠福股份	2018年6月1日	重大事项	4.07	-	-	249,300	1,078,895.00	1,014,651.00	-
000666	经纬纺机	2018年3月12日	重大事项	18.08	-	-	53,100	1,028,470.01	960,048.00	-
002573	清新环境	2018年6月19日	重大事项	11.55	-	-	67,800	822,190.00	783,090.00	-
600122	宏图高科	2018年6月19日	重大事项	7.40	-	-	102,700	808,790.00	759,980.00	-
000426	兴业矿业	2018年6月19日	重大事项	7.21	-	-	102,900	897,055.00	741,909.00	-
002668	奥马电器	2018年6月15日	重大事项	20.10	-	-	27,500	564,928.80	552,750.00	-
600750	江中药业	2018年5月2日	重大事项	17.75	2018年8月1日	16.12	10,920	202,368.00	193,830.00	-
600850	华东电脑	2018年5月14日	重大事项	18.99	2018年8月15日	18.00	9,700	179,159.00	184,203.00	-

注：本基金截至2018年6月30日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

#### 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

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购余额，因此没有作为抵押的债券。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购余额，因此没有作为抵押的债券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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

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

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

#### **6.4.13.2 信用风险**

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

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

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

于 2018 年 6 月 30 日，本基金未持有债券投资。

#### **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 2018 年 6 月 30 日，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)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。

#### 6.4.13.4 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现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资、买入返售金融资产等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2018 年 6 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	8,449,984.93	-	-	-	8,449,984.93
结算备付金	701,494.44	-	-	-	701,494.44
存出保证金	53,216.02	-	-	-	53,216.02

交易性金融资产	-	-	-	-120,330,250.23	120,330,250.23
应收利息	-	-	-	3,950.68	3,950.68
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	9,204,695.39	-	-	-120,334,200.91	129,538,896.30
负债					
应付证券清算款	-	-	-	2,353,427.22	2,353,427.22
应付管理人报酬	-	-	-	65,096.02	65,096.02
应付托管费	-	-	-	10,849.33	10,849.33
应付销售服务费	-	-	-	446.13	446.13
应付交易费用	-	-	-	233,923.78	233,923.78
其他负债	-	-	-	79,341.35	79,341.35
负债总计	-	-	-	2,743,083.83	2,743,083.83
利率敏感度缺口	9,204,695.39	-	-	-117,591,117.08	126,795,812.47
上年度末 2017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	1,894,854.81	-	-	-	1,894,854.81
结算备付金	751,296.09	-	-	-	751,296.09
存出保证金	35,916.75	-	-	-	35,916.75
交易性金融资产	57,652,000.00	-	-	-141,564,435.41	199,216,435.41
买入返售金融资产	17,000,000.00	-	-	-	17,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	263,591.40	263,591.40
应收利息	-	-	-	1,544,059.90	1,544,059.90
资产总计	77,334,067.65	-	-	-143,372,086.71	220,706,154.36
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	111,523.11	111,523.11
应付托管费	-	-	-	18,587.17	18,587.17
应付销售服务费	-	-	-	533.59	533.59
应付交易费用	-	-	-	162,730.03	162,730.03
其他负债	-	-	-	143,000.00	143,000.00
负债总计	-	-	-	436,373.90	436,373.90
利率敏感度缺口	77,334,067.65	-	-	-142,935,712.81	220,269,780.46

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约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（2018年6月30日）	上年度末（2017年12月31日）

	市场利率上升 25 个基点	-	-56,339.00
	市场利率下降 25 个基点	-	56,480.00

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票资产投资比例为基金资产的 0-95%，每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值的 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；权证、股指期货、国债期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日		上年度末 2017 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	120,330,250.23	94.90	141,564,435.41	64.27

交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	120,330,250.23	94.90	141,564,435.41	64.27

#### 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（2018年6月30日）	上年度末（2017年12月31日）
	沪深 300 收益率下降 5%	-5,824,300.32	-
	沪深 300 收益率上升 5%	5,824,300.32	-

注：于 2017 年 12 月 31 日，本基金成立尚未满一年，无足够历史经验数据计算其他价格风险对基金资产净值的影响。

## § 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	120,330,250.23	92.89
	其中：股票	120,330,250.23	92.89
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	9,151,479.37	7.06
8	其他各项资产	57,166.70	0.04
9	合计	129,538,896.30	100.00

### 7.2 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

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	3,552,313.00	2.80
C	制造业	72,158,377.54	56.91
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,944,359.85	2.32
E	建筑业	3,213,628.80	2.53
F	批发和零售业	8,522,671.00	6.72
G	交通运输、仓储和邮政业	3,405,086.00	2.69
H	住宿和餐饮业	543,400.00	0.43
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,473,150.90	7.47



J	金融业	2,999,773.00	2.37
K	房地产业	6,825,349.00	5.38
L	租赁和商务服务业	1,098,346.00	0.87
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	2,446,425.14	1.93
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	2,499,568.00	1.97
S	综合	647,802.00	0.51
	合计	120,330,250.23	94.90

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601138	工业富联	112,490	1,844,836.00	1.45
2	300324	旋极信息	133,670	1,268,528.30	1.00
3	600022	山东钢铁	622,200	1,256,844.00	0.99
4	600256	广汇能源	272,000	1,112,480.00	0.88
5	600879	航天电子	150,700	1,059,421.00	0.84
6	002102	冠福股份	249,300	1,014,651.00	0.80
7	600201	生物股份	56,680	968,661.20	0.76
8	000963	华东医药	20,000	965,000.00	0.76
9	000581	威孚高科	43,500	961,785.00	0.76
10	000666	经纬纺机	53,100	960,048.00	0.76
11	002195	二三四五	222,170	950,887.60	0.75
12	000513	丽珠集团	20,670	908,446.50	0.72
13	000488	晨鸣纸业	69,600	899,232.00	0.71
14	000997	新大陆	56,500	889,875.00	0.70
15	600525	长园集团	83,600	883,652.00	0.70
16	002745	木林森	49,600	882,384.00	0.70
17	600183	生益科技	96,200	881,192.00	0.69

18	600808	马钢股份	245,400	880,986.00	0.69
19	600160	巨化股份	117,900	863,028.00	0.68
20	600388	龙净环保	66,000	843,480.00	0.67
21	300274	阳光电源	93,300	836,901.00	0.66
22	600056	中国医药	45,600	833,112.00	0.66
23	600755	厦门国贸	112,700	821,583.00	0.65
24	300113	顺网科技	47,000	818,270.00	0.65
25	002244	滨江集团	156,500	813,800.00	0.64
26	300287	飞利信	111,800	803,842.00	0.63
27	600511	国药股份	29,800	803,110.00	0.63
28	600216	浙江医药	62,300	795,571.00	0.63
29	002002	鸿达兴业	172,000	792,920.00	0.63
30	600499	科达洁能	115,400	791,644.00	0.62
31	000028	国药一致	15,800	788,420.00	0.62
32	300115	长盈精密	60,600	785,982.00	0.62
33	002573	清新环境	67,800	783,090.00	0.62
34	600122	宏图高科	102,700	759,980.00	0.60
35	600978	宜华生活	110,800	756,764.00	0.60
36	000598	兴蓉环境	185,800	754,348.00	0.59
37	002317	众生药业	70,900	749,413.00	0.59
38	601678	滨化股份	120,500	744,690.00	0.59
39	000426	兴业矿业	102,900	741,909.00	0.59
40	600582	天地科技	201,300	738,771.00	0.58
41	600835	上海机电	39,100	737,426.00	0.58
42	600064	南京高科	100,400	736,936.00	0.58
43	002056	横店东磁	104,300	731,143.00	0.58
44	600557	康缘药业	58,900	727,415.00	0.57
45	600971	恒源煤电	101,600	725,424.00	0.57
46	601717	郑煤机	124,400	722,764.00	0.57
47	600597	光明乳业	72,700	717,549.00	0.57
48	300297	蓝盾股份	88,400	716,924.00	0.57
49	300159	新研股份	101,100	715,788.00	0.56
50	603328	依顿电子	64,500	699,825.00	0.55
51	000501	鄂武商A	56,900	699,301.00	0.55
52	002152	广电运通	118,800	698,544.00	0.55
53	600694	大商股份	21,300	692,463.00	0.55
54	600422	昆药集团	89,300	692,075.00	0.55
55	601000	唐山港	290,800	683,380.00	0.54
56	000400	许继电气	87,400	682,594.00	0.54

57	002118	紫鑫药业	92,300	659,945.00	0.52
58	600757	长江传媒	115,900	659,471.00	0.52
59	600366	宁波韵升	106,900	652,090.00	0.51
60	600777	新潮能源	295,800	647,802.00	0.51
61	600900	长江电力	40,000	645,600.00	0.51
62	600618	氯碱化工	73,100	622,081.00	0.49
63	002001	新和成	32,500	616,200.00	0.49
64	600031	三一重工	68,000	609,960.00	0.48
65	600068	葛洲坝	84,200	607,082.00	0.48
66	600338	西藏珠峰	28,900	598,808.00	0.47
67	002025	航天电器	25,700	593,670.00	0.47
68	600741	华域汽车	25,000	593,000.00	0.47
69	000861	海印股份	236,000	592,360.00	0.47
70	300251	光线传媒	57,600	586,368.00	0.46
71	601318	中国平安	10,000	585,800.00	0.46
72	603368	柳药股份	17,300	584,394.00	0.46
73	300038	梅泰诺	54,800	584,168.00	0.46
74	601012	隆基股份	35,000	584,150.00	0.46
75	000157	中联重科	141,500	581,565.00	0.46
76	600369	西南证券	150,900	580,965.00	0.46
77	600285	羚锐制药	64,800	577,368.00	0.46
78	601908	京运通	125,500	574,790.00	0.45
79	300065	海兰信	40,800	574,464.00	0.45
80	002601	佰利联	44,200	571,506.00	0.45
81	002061	*ST江化	54,500	570,615.00	0.45
82	300045	华力创通	61,500	570,105.00	0.45
83	600081	东风科技	56,400	569,640.00	0.45
84	600567	山鹰纸业	147,500	569,350.00	0.45
85	002236	大华股份	25,200	568,260.00	0.45
86	600438	通威股份	82,300	567,870.00	0.45
87	600352	浙江龙盛	47,400	566,430.00	0.45
88	002518	科士达	56,800	566,296.00	0.45
89	603799	华友钴业	5,800	565,326.00	0.45
90	600705	中航资本	120,700	563,669.00	0.44
91	600208	新湖中宝	147,500	563,450.00	0.44
92	300533	冰川网络	15,100	561,569.00	0.44
93	300075	数字政通	41,600	561,184.00	0.44
94	600089	特变电工	80,800	559,944.00	0.44
95	600018	上港集团	93,800	559,048.00	0.44

96	002496	辉丰股份	204,200	557,466.00	0.44
97	002334	英威腾	95,200	556,920.00	0.44
98	002421	达实智能	137,500	556,875.00	0.44
99	300406	九强生物	38,600	555,840.00	0.44
100	600269	赣粤高速	135,900	555,831.00	0.44
101	300447	全信股份	42,900	555,126.00	0.44
102	600383	金地集团	54,400	554,336.00	0.44
103	600015	华夏银行	74,400	554,280.00	0.44
104	002626	金达威	31,900	553,465.00	0.44
105	002668	奥马电器	27,500	552,750.00	0.44
106	002279	久其软件	55,500	550,005.00	0.43
107	002462	嘉事堂	28,300	549,020.00	0.43
108	600674	川投能源	62,700	546,744.00	0.43
109	000100	TCL 集团	188,500	546,650.00	0.43
110	600512	腾达建设	242,800	546,300.00	0.43
111	000404	华意压缩	126,100	546,013.00	0.43
112	300252	金信诺	60,190	545,923.30	0.43
113	002454	松芝股份	92,900	545,323.00	0.43
114	600477	杭萧钢构	113,700	544,623.00	0.43
115	600708	光明地产	126,600	544,380.00	0.43
116	600987	航民股份	57,600	544,320.00	0.43
117	600963	岳阳林纸	105,000	543,900.00	0.43
118	600219	南山铝业	200,700	543,897.00	0.43
119	000423	东阿阿胶	10,100	543,481.00	0.43
120	600258	首旅酒店	20,000	543,400.00	0.43
121	300367	东方网力	43,400	542,500.00	0.43
122	002501	利源精制	87,400	541,880.00	0.43
123	601222	林洋能源	108,700	541,326.00	0.43
124	000625	长安汽车	60,100	540,900.00	0.43
125	600390	五矿资本	69,700	540,175.00	0.43
126	000069	华侨城 A	74,600	539,358.00	0.43
127	600548	深高速	68,600	538,510.00	0.42
128	000822	山东海化	77,000	536,690.00	0.42
129	600516	方大炭素	22,000	536,360.00	0.42
130	300011	鼎汉技术	84,000	535,920.00	0.42
131	300204	舒泰神	49,400	534,508.00	0.42
132	601006	大秦铁路	65,100	534,471.00	0.42
133	000965	天保基建	120,900	534,378.00	0.42
134	002335	科华恒盛	29,600	534,280.00	0.42

135	600480	凌云股份	55,500	533,910.00	0.42
136	601599	鹿港文化	131,100	533,577.00	0.42
137	000059	华锦股份	77,400	533,286.00	0.42
138	000826	启迪桑德	30,500	533,140.00	0.42
139	601636	旗滨集团	119,700	532,665.00	0.42
140	600873	梅花生物	127,400	532,532.00	0.42
141	600704	物产中大	101,500	530,845.00	0.42
142	002380	科远股份	40,800	530,400.00	0.42
143	002091	江苏国泰	83,500	530,225.00	0.42
144	000915	山大华特	26,300	528,893.00	0.42
145	600706	曲江文旅	46,700	527,710.00	0.42
146	600197	伊力特	23,400	527,670.00	0.42
147	002304	洋河股份	4,000	526,400.00	0.42
148	300027	华谊兄弟	85,400	526,064.00	0.41
149	300033	同花顺	13,500	524,745.00	0.41
150	000858	五粮液	6,900	524,400.00	0.41
151	000725	京东方 A	147,900	523,566.00	0.41
152	600340	华夏幸福	20,300	522,725.00	0.41
153	002146	荣盛发展	59,800	522,054.00	0.41
154	002033	丽江旅游	71,700	521,259.00	0.41
155	002217	合力泰	63,100	520,575.00	0.41
156	600522	中天科技	58,900	518,909.00	0.41
157	002443	金洲管道	76,600	517,816.00	0.41
158	000568	泸州老窖	8,500	517,310.00	0.41
159	000040	东旭蓝天	51,200	517,120.00	0.41
160	000070	特发信息	71,100	515,475.00	0.41
161	300426	唐德影视	41,700	514,995.00	0.41
162	600519	贵州茅台	700	512,022.00	0.40
163	000591	太阳能	139,800	511,668.00	0.40
164	002597	金禾实业	25,200	511,056.00	0.40
165	002245	澳洋顺昌	78,800	509,836.00	0.40
166	600459	贵研铂业	47,200	509,760.00	0.40
167	600730	中国高科	106,500	508,005.00	0.40
168	600057	厦门象屿	101,400	505,986.00	0.40
169	600153	建发股份	56,000	503,440.00	0.40
170	002425	凯撒文化	105,700	502,075.00	0.40
171	300221	银禧科技	50,700	501,930.00	0.40
172	601028	玉龙股份	99,700	500,494.00	0.39
173	600094	大名城	86,100	495,936.00	0.39

174	002383	合众思壮	29,800	493,190.00	0.39
175	601231	环旭电子	54,100	490,687.00	0.39
176	600376	首开股份	69,700	489,991.00	0.39
177	000811	烟台冰轮	97,800	464,550.00	0.37
178	002385	大北农	110,100	454,713.00	0.36
179	600502	安徽水利	106,440	427,888.80	0.34
180	600507	方大特钢	39,500	422,255.00	0.33
181	000685	中山公用	52,000	414,440.00	0.33
182	601666	平煤股份	89,400	373,692.00	0.29
183	000413	东旭光电	60,500	366,630.00	0.29
184	000661	长春高新	1,500	341,550.00	0.27
185	002675	东诚药业	33,500	341,365.00	0.27
186	603026	石大胜华	14,300	326,612.00	0.26
187	300213	佳讯飞鸿	45,900	289,170.00	0.23
188	600655	豫园股份	25,400	240,030.00	0.19
189	600633	浙数文化	25,500	212,670.00	0.17
190	600750	江中药业	10,920	193,830.00	0.15
191	600075	新疆天业	28,400	184,600.00	0.15
192	600850	华东电脑	9,700	184,203.00	0.15
193	600312	平高电气	30,900	174,276.00	0.14
194	002429	兆驰股份	59,600	147,808.00	0.12
195	601939	建设银行	21,200	138,860.00	0.11
196	300747	锐科激光	1,543	123,995.48	0.10
197	601515	东风股份	15,000	115,800.00	0.09
198	000898	鞍钢股份	17,600	98,032.00	0.08
199	002176	江特电机	8,500	82,620.00	0.07
200	601330	绿色动力	4,971	81,226.14	0.06
201	600521	华海药业	2,800	74,732.00	0.06
202	300424	航新科技	3,800	73,796.00	0.06
203	600426	华鲁恒升	4,100	72,119.00	0.06
204	603766	隆鑫通用	11,800	64,074.00	0.05
205	603019	中科曙光	1,200	55,044.00	0.04
206	600382	广东明珠	5,200	54,860.00	0.04
207	603650	彤程新材	2,376	50,988.96	0.04
208	603693	江苏新能	5,384	48,456.00	0.04
209	002080	中材科技	4,900	41,650.00	0.03
210	000848	承德露露	3,600	38,124.00	0.03
211	000416	民生控股	7,600	36,024.00	0.03
212	600549	厦门钨业	2,210	33,547.80	0.03

213	603958	哈森股份	3,200	32,000.00	0.03
214	002468	申通快递	1,400	24,010.00	0.02
215	603706	东方环宇	1,765	23,103.85	0.02
216	000830	鲁西化工	1,300	22,204.00	0.02
217	603105	芯能科技	3,410	16,470.30	0.01
218	002049	紫光国芯	200	8,824.00	0.01
219	000703	恒逸石化	100	1,488.00	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300115	长盈精密	4,039,307.47	1.83
2	000078	海王生物	3,878,036.50	1.76
3	000581	威孚高科	3,271,983.00	1.49
4	600483	福能股份	3,027,929.55	1.37
5	002092	中泰化学	3,016,101.00	1.37
6	600201	生物股份	2,997,577.69	1.36
7	600056	中国医药	2,945,639.00	1.34
8	600516	方大炭素	2,871,708.00	1.30
9	600978	宜华生活	2,707,289.80	1.23
10	600757	长江传媒	2,703,395.73	1.23
11	002152	广电运通	2,700,219.00	1.23
12	000965	天保基建	2,667,961.41	1.21
13	600285	羚锐制药	2,631,592.98	1.19
14	600823	世茂股份	2,558,011.96	1.16
15	000513	丽珠集团	2,494,310.74	1.13
16	600280	中央商场	2,365,682.00	1.07
17	603328	依顿电子	2,316,242.00	1.05
18	002444	巨星科技	2,298,881.09	1.04
19	000997	新大陆	2,274,191.70	1.03
20	603369	今世缘	2,252,069.00	1.02

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

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601398	工商银行	4,598,000.00	2.09
2	600068	葛洲坝	4,251,775.55	1.93
3	000078	海王生物	3,728,366.00	1.69
4	600757	长江传媒	3,068,458.73	1.39
5	600483	福能股份	3,054,801.03	1.39
6	600491	龙元建设	3,046,853.30	1.38
7	600285	羚锐制药	2,997,498.00	1.36
8	002027	分众传媒	2,982,400.00	1.35
9	300115	长盈精密	2,952,996.00	1.34
10	000513	丽珠集团	2,908,368.00	1.32
11	002092	中泰化学	2,856,985.00	1.30
12	002152	广电运通	2,851,584.00	1.29
13	002019	亿帆医药	2,826,367.38	1.28
14	600729	重庆百货	2,820,033.24	1.28
15	600580	卧龙电气	2,797,385.85	1.27
16	600563	法拉电子	2,777,936.00	1.26
17	601328	交通银行	2,756,000.00	1.25
18	300182	捷成股份	2,746,720.79	1.25
19	600183	生益科技	2,734,681.76	1.24
20	603369	今世缘	2,716,502.76	1.23

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

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	437,362,760.07
卖出股票收入（成交）总额	446,496,739.96

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

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。



## **7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细**

本基金本报告期末未持有债券。

## **7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细**

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## **7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细**

本基金本报告期末未持有贵金属。

## **7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细**

本基金本报告期末未持有权证。

## **7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**

### **7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末未持有股指期货。

### **7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策**

本基金本报告期末投资股指期货。

## **7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

### **7.11.1 本期国债期货投资政策**

本基金本报告期末投资国债期货。

### **7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末未持有国债期货。

### **7.11.3 本期国债期货投资评价**

本基金本报告期末投资国债期货。

## **7.12 投资组合报告附注**

### **7.12.1**

本基金该报告期内投资前十名证券的发行主体均无被监管部门立案调查和在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

### **7.12.2**

基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	53,216.02
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,950.68
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	57,166.70

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	601138	工业富联	1,844,836.00	1.45	新股锁定
2	300324	旋极信息	1,268,528.30	1.00	重大事项
3	600022	山东钢铁	1,256,844.00	0.99	重大事项
4	002102	冠福股份	1,014,651.00	0.80	重大事项
5	000666	经纬纺机	960,048.00	0.76	重大事项

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
汇安丰恒混合 A	217	570,303.54	99,095,289.12	80.070000%	24,660,579.48	19.930000%
汇安丰恒混合 C	2	2,500,984.12	5,000,000.00	99.960651%	1,968.24	0.039349%
合计	219	587,935.33	104,095,289.12	80.850000%	24,662,547.72	19.150000%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	汇安丰恒混合 A	20,270.73	0.02000000%
	汇安丰恒混合 C	-	-
	合计	20,270.73	0.01574000%

### 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的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	汇安丰恒混合 A	0
	汇安丰恒混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	汇安丰恒混合 A	0
	汇安丰恒混合 C	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	汇安丰恒混合 A	汇安丰恒混合 C
基金合同生效日（2017 年 3 月 13 日）基金份额总额	195,086,316.11	5,000,000.00
本报告期期初基金份额总额	197,050,618.11	5,828,594.94
本报告期基金总申购份额	23,141,495.63	9,172,523.08
减：本报告期基金总赎回份额	96,436,245.14	9,999,149.78
本报告期末基金份额总额	123,755,868.60	5,001,968.24

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。

## § 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

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“公司”）根据工作需要，任命孔建先生担任公司资产托管部总经理，主持资产托管部相关工作。孔建先生的托管人高级管理人员任职信息已经在中国证券投资基金业协会备案。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本基金在报告期内基金投资策略没有改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

自本基金成立日(2017年3月13日)起至今聘任普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金提供审计服务，本报告期内未发生变动。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 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	股票交易	应支付该券商的佣金
------	------	-----------

	交易单元数量	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	备注
川财证券	1	404,025,081.83	45.93%	287,384.20	45.93%	新增席位
东方证券	2	267,495,237.80	30.41%	190,272.28	30.41%	-
东北证券	2	148,214,010.10	16.85%	105,424.61	16.85%	新增席位
国金证券	1	59,842,965.53	6.80%	42,566.13	6.80%	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
湘财证券	2	-	-	-	-	-
中信建投证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-

注：选择专用席位的标准和程序：

(1) 选择标准

券商经纪人财务状况良好、经营行为规范、风险管理先进、投资风格与基金管理人具有互补性、在最近一年内无重大违规行为。

券商经纪人具有较强的研究能力：能及时、全面、定期向基金管理人提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析的报告及丰富全面的信息咨询服务；有很强的行业分析能力，能根据基金管理人所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力。

券商经纪人能提供最优惠合理的佣金率：与其他券商经纪人相比，该券商经纪人能够提供最优惠、最合理的佣金率。

(2) 选择程序

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

### 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	
	成交金额	占当期债券成交总额的比	成交金额	占当期债券回购	成交金额	占当期权证成交总额的

		例		成交总额 的比例		比例
川财证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	200,000,000.00	100.00%	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
中信建投证 券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	汇安丰恒灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告（解聘仇秉则）	证券时报及公司官网	2018年5月16日
2	关于汇安基金管理有限责任公司旗下基金增加销售机构的公告	证券时报及公司官网	2018年3月28日
3	关于汇安基金管理有限责任公司旗下基金开通定期定额投资业务的公告	证券时报及公司官网	2018年3月26日
4	汇安基金管理有限责任公司关于汇安丰恒灵活配置混合型证券投资基金修改基金合同、托管协议的公告及其变更修改对照表	证券时报及公司官网	2018年3月24日
5	关于汇安基金管理有限责任公司旗下基金开通网上直销业务的公告	证券时报及公司官网	2018年3月17日
6	关于汇安基金管理有限责任公司旗下基金增加销售机构的公告	证券时报及公司官网	2018年3月6日
7	关于汇安基金管理有限责任公司旗下基金增加销售机构的公告	证券时报及公司官网	2018年2月6日
8	关于汇安基金管理有限责任公司旗下基金增加销售机构的公告	证券时报及公司官网	2018年1月11日

## § 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	20180101-20180630	199,989,000.00	-	95,893,710.88	104,095,289.12	80.8458%
个人	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
<p>本基金本报告期末存在单一基金份额持有人持有基金份额比例超过 20%的情况，投资人在投资本基金时，可能面临本基金因持有人集中度较高而产生的相应风险，具体包括：巨额赎回风险、流动性风险、基金资产净值持续低于 5000 万元的风险、基金份额净值大幅波动风险以及基金收益水平波动风险。本基金管理人将在基金运作中对以上风险进行严格的监控和管理，保护中小投资者利益。</p>							

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

根据《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》（财税[2016]36号）、《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》（财税[2016]140号）、《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》（财税[2017]2号）、《关于资管产品增值税有关问题的通知》（财税[2017]56号）、《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》（财税[2017]90号）等有关规定，自 2018 年 1 月 1 日起，我司旗下所有证券投资基金发生的增值税应税行为，将适用简易计税方法，按照适用法规缴纳增值税以及相关附加，相应税费需由各基金财产承担。上述新的税费可能对基金财产收益水平有所影响。



## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会批准汇安丰恒灵活配置混合型证券投资基金募集的文件
- (2) 《汇安丰恒灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- (3) 《汇安丰恒灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》
- (4) 《汇安丰恒灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照
- (6) 报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告

### 12.2 存放地点

北京市东城区东直门南大街 5 号中青旅大厦 1301 室

上海市浦东新区银城中路 68 号时代金融中心 2901

### 12.3 查阅方式

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

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

网址：<http://www.huianfund.cn>

汇安基金管理有限责任公司

2018 年 8 月 24 日