

# 汇安趋势动力股票型证券投资基金 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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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 4 月 25 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>11</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	14
<b>§5 托管人报告</b>	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
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	15
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>16</b>
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	18

6.4 报表附注 .....	19
<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 .....	43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	44
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 .....	44
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 .....	44
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 .....	44
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 .....	44
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	45
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	45
7.12 投资组合报告附注 .....	45
<b>§8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>47</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	47
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	47
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 .....	47
<b>§9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>48</b>
<b>§10 重大事件揭示 .....</b>	<b>49</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	49
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 .....	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	49
10.4 基金投资策略的改变 .....	49
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	49
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 .....	49
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	49
10.8 其他重大事件 .....	50
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>51</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 .....	51

11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	51
<b>§12 备查文件目录 .....</b>	<b>52</b>
12.1 备查文件目录 .....	52
12.2 存放地点 .....	52
12.3 查阅方式 .....	52

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	汇安趋势动力股票型证券投资基金	
基金简称	汇安趋势动力股票	
基金主代码	005628	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018年4月25日	
基金管理人	汇安基金管理有限责任公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	119,981,947.36份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	汇安趋势动力A	汇安趋势动力C
下属分级基金的交易代码:	005628	005629
报告期末下属分级基金的份额总额	105,879,872.55份	14,102,074.81份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于在现行趋势下具有持续增长潜力的优质上市公司，在有效控制投资组合风险的前提下，通过积极主动的资产配置，力争获得超越业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金投资策略主要包括资产配置策略、行业配置策略、股票配置策略、债券投资组合策略、流通受限证券投资策略、权证投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略等。
业绩比较基准	中证800指数收益率*80%+中证综合债券指数收益率*20%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人	
名称	汇安基金管理有限责任公司	中国工商银行股份有限公司	
信息披露负责人	姓名	孙运英	郭明
	联系电话	01056711605	010-66105798
	电子邮箱	sunyy@huianfund.cn	custoday@icbc.com.cn
客户服务电话	01056711690	-	
传真	01056711640	010-66105799	

注册地址	上海市虹口区欧阳路 218 弄 1 号 2 楼 215 室	北京市西城区复兴门内大街 55 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	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	100007	100140
法定代表人	秦军	易会满

## 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	汇安趋势动力 A	汇安趋势动力 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2018年4月25日 - 2018年6月30日)	报告期(2018年4月25日 - 2018年6月30日)
本期已实现收益	264,378.51	202,803.04
本期利润	232,899.68	197,481.48
加权平均基金份额本期利润	0.0021	0.0025
本期加权平均净值利润率	0.21%	0.25%
本期基金份额净值增长率	0.20%	0.05%
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	207,857.96	7,501.04
期末可供分配基金份额利润	0.0020	0.0005
期末基金资产净值	106,087,730.51	14,109,575.85
期末基金份额净值	1.0020	1.0005
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	0.20%	0.05%

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；

4、本基金合同生效日为2018年4月25日，至本报告期末，本基金合同生效未满一年。

### 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

汇安趋势动力 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④



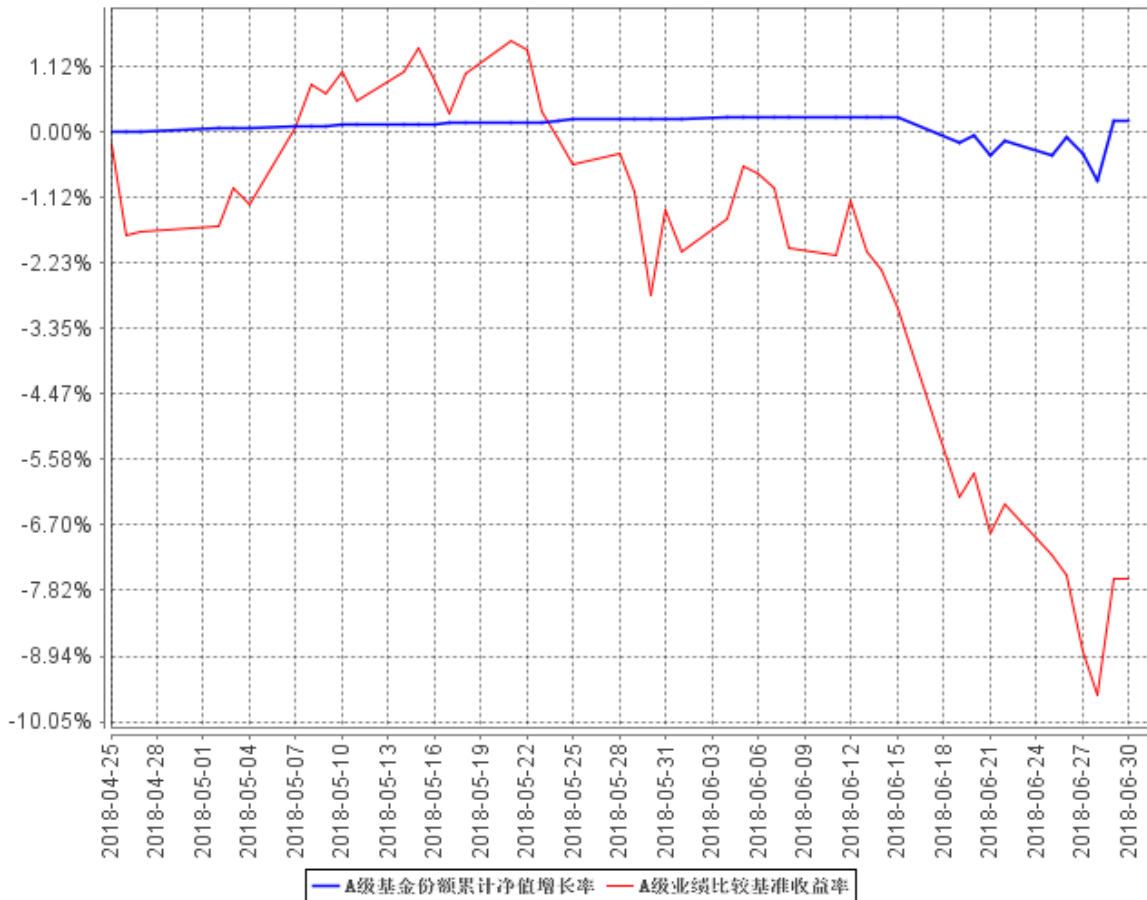
过去一个月	-0.03%	0.31%	-6.38%	1.11%	6.35%	-0.80%
自基金合同生效起至今	0.20%	0.21%	-7.61%	0.94%	7.81%	-0.73%

汇安趋势动力 C

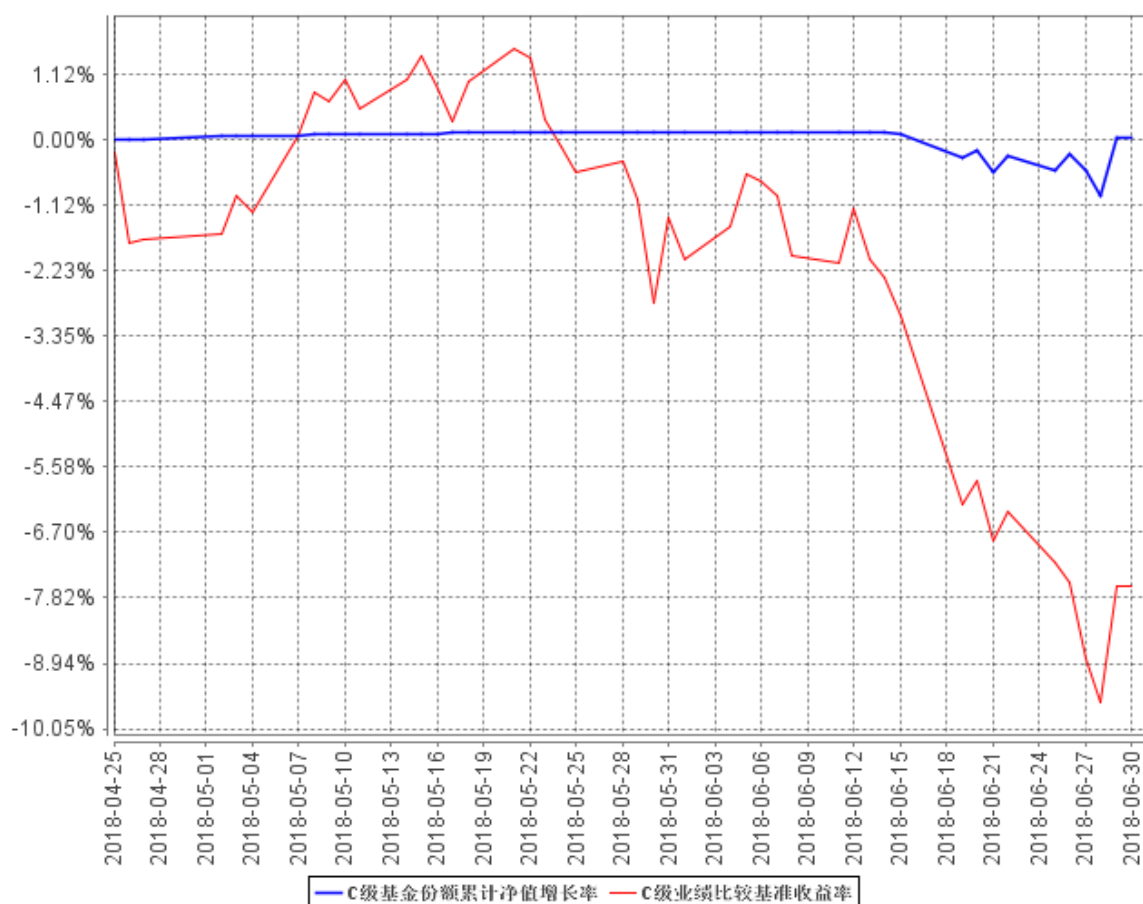
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-0.08%	0.30%	-6.38%	1.11%	6.30%	-0.81%
自基金合同生效起至今	0.05%	0.20%	-7.61%	0.94%	7.66%	-0.74%

### 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2018年4月25日，至本报告期末，本基金合同生效未满一年。

②根据《汇安趋势动力股票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（包括中小板、创业板和其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、债券回购、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、权证、资产支持证券、股指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）。基金的投资组合比例为：本基金投资于股票的比例占基金资产的80%-95%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值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。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，本基金仍处于建仓期。

## § 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		
邓宇翔	权益投资部高级经理、本基金的基金经理	2018 年 4 月 25 日	-	8 年	邓宇翔，南京航空航天大学物理学博士，8 年证券、基金行业从业经历，曾任江苏瑞华投资高级研究员，上海浦发银行金融市场交易员，西部利得基金高级研究员、投资经理。2016 年 7 月加入汇安基金管理有限责任公司，担任权益投资部高级经理一职。2017 年 11 月 28 日起至今，任汇安丰泰灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2018 年 4 月 25 日至今，任汇安趋势动力股票型证券投资基金基金经理。
邹唯	首席投资官、本基金的	2018 年 4 月 26 日	-	18 年	邹唯，理科硕士，18 年证券、基金行业从业经历，曾任长城证券有限公司研究部行业分析师，嘉实基金管理有限公

	基金经 理				司行业分析师、基金经理、主题策略组组长,中信产业基金金融投资部董事总经理,嘉实基金管理有限公司基金经理、主题策略组组长、董事总经理。2017年12月1日加入汇安基金管理有限责任公司,担任首席投资官,董事总经理。2018年4月26日至今,任汇安趋势动力股票型证券投资基金基金经理。
张媛	研究部 副总监、 本基金 的基金 经理助 理	2018年4 月25日	-	10年	张媛,中国科学技术大学管理科学与工程硕士,伦敦商学院金融硕士,10年证券、基金行业从业经历,曾任国泰君安证券任机构客户销售,新宝集投资任主题研究总监。2017年11月1日加入汇安基金管理有限责任公司研究部,任研究部副总监一职。2018年4月25日至今,任汇安趋势动力股票型证券投资基金基金经理助理。

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。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

基金管理人严格控制不同投资组合之间的同日反向交易,禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。本报告期内,本基金未发现可能的异常交易情况,不存在所有投资组合参与

的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边成交量超过该证券当日成交量的 5%的情况。

#### **4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明**

##### **4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析**

本基金 2018 年 4 月 25 日成立，基于对市场绝对收益时间窗口尚未打开的判断，采取暂缓建仓的策略。在美国出台对 500 亿美元中国产品加征关税，继而提出 2000 亿美元征税清单后，A 股市场反应剧烈。我们担忧的外部风险得到部分释放，开始逐步建仓，买入军工、资源、银行、新兴消费等股票。截至本报告期末本基金仓位较低。

##### **4.4.2 报告期内基金的业绩表现**

截至本报告期末汇安趋势动力 A 基金份额净值为 1.0020 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.20%；截至本报告期末汇安趋势动力 C 基金份额净值为 1.0005 元，本报告期基金份额净值增长率 0.05%，同期业绩比较基准收益率为-7.61%。

#### **4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望**

2018 年上半年市场出现较大调整，过去一年表现优异的权重股连续两季度下跌，创业板在一季度表现亮眼，但二季度跌幅超过 15%，市场避险情绪明显上升。中美贸易冲突带来的影响超出市场预期，科技、制造业首当其冲。

当前贸易冲突仍有升级可能，国内微观经济恶化加速，此外随着联储加息新兴市场流动性面临整体收紧。在这些不利因素影响下，三季度股票市场有进一步下跌风险，我们将保持较低仓位作为应对。

但同时，政策底部正在形成，中国经济转型的内生动力也仍然强劲。我们坚定看好在转型中有较强确定性的主题，如：1. 中美冲突给军工、核心自主科技、知识产权保护带来的投资机会；2. 环保政策加强改变上游资源品供需格局，行业龙头受益涨价；3、新一线城市崛起和年轻一代消费能力提升带动的新兴消费；4、新零售与智能物流等。

#### **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，本基金托管人在对汇安趋势动力股票型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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

本报告期内汇安趋势动力股票型证券投资基金的管理人——汇安基金管理有限责任公司在汇安趋势动力股票型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 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

本托管人依法对汇安基金管理有限责任公司编制和披露的汇安趋势动力股票型证券投资基金2018年半年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：汇安趋势动力股票型证券投资基金

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
<b>资产：</b>		
银行存款	6.4.7.1	31,080,277.14
结算备付金		3,317,727.27
存出保证金		-
交易性金融资产	6.4.7.2	40,539,528.50
其中：股票投资		40,539,528.50
基金投资		-
债券投资		-
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	45,000,000.00
应收证券清算款		38,547.13
应收利息	6.4.7.5	-3,262.55
应收股利		-
应收申购款		494,770.10
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		120,467,587.59
<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>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		-
应付赎回款		29,269.89
应付管理人报酬		147,944.27
应付托管费		24,657.35
应付销售服务费		5,877.57
应付交易费用	6.4.7.7	28,862.05



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	33,670.10
负债合计		270,281.23
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	6.4.7.9	119,981,947.36
未分配利润	6.4.7.10	215,359.00
所有者权益合计		120,197,306.36
负债和所有者权益总计		120,467,587.59

注：1，报告截止日 2018 年 6 月 30 日，汇安趋势动力 A 基金份额净值 1.0020 元，基金份额总额 105,879,872.55 份；汇安趋势动力 C 基金份额净值 1.0005 元，基金份额总额 14,102,074.81 份。汇安趋势动力股票份额总额合计为 119,981,947.36 份。

2，本基金合同生效日为 2018 年 4 月 25 日，至本报告期末，本基金合同生效未满一年。

## 6.2 利润表

会计主体：汇安趋势动力股票型证券投资基金

本报告期：2018 年 4 月 25 日(基金合同生效日)至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2018 年 4 月 25 日(基金合同生效 日)至 2018 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		1,166,439.16
1.利息收入		1,139,129.48
其中：存款利息收入	6.4.7.11	264,586.07
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		874,543.41
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		20,401.00
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	-
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	20,401.00
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-36,800.39

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	43,709.07
<b>减：二、费用</b>		736,058.00
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	512,600.74
2. 托管费	6.4.10.2.2	85,433.44
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	70,564.95
4. 交易费用	6.4.7.19	32,459.54
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	34,999.33
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		430,381.16
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		430,381.16

注：本基金合同生效日为2018年4月25日，至本报告期末，本基金合同生效未满一年。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汇安趋势动力股票型证券投资基金

本报告期：2018年4月25日(基金合同生效日)至2018年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2018年4月25日(基金合同生效日)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)	269,413,274.01	-	269,413,274.01
二、本期经营活动产生的 基金净值变动数(本期 利润)	-	430,381.16	430,381.16
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)	-149,431,326.65	-215,022.16	-149,646,348.81
其中：1.基金申购款	726,630.90	-3,772.41	722,858.49
2.基金赎回款	-150,157,957.55	-211,249.75	-150,369,207.30
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)	119,981,947.36	215,359.00	120,197,306.36

注：本基金合同生效日为 2018 年 4 月 25 日，至本报告期末，本基金合同生效未满一年。

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：

<u>秦军</u>	<u>杜海岚</u>	<u>杜海岚</u>
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

汇安趋势动力股票型证券投资基金(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[2018]135号《关于准予汇安趋势动力股票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《汇安趋势动力股票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 269,363,866.94 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(2018)第 0259 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《汇安趋势动力股票型证券投资基金基金合同》于 2018 年 4 月 25 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 269,413,274.01 份基金份额,其中认购资金利息折合 49,407.07 份基金份额。本基金的基金管理人为汇安基金管理有限责任公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司(以下简称“工商银行”)。

根据《汇安趋势动力股票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《汇安趋势动力股票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（包括中小板、创业板和其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、债券回购、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、权证、资产支持证券、股指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）。本基金投资于股票的比例占基金资产的 80%-95%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 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。本基金的业绩比较基准为：中证 800 指数收益率\*80%+中证综合债券指数收益率\*20%。

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》、《汇安趋势动力股票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 4 月 25 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 重要会计政策和会计估计**

##### **6.4.4.1 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。本财务报表的实际编制期间为 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日止期间。

#### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

##### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

##### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。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。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

#### 6.4.4.4 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于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的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起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的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。

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。

#### **6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则**

本基金持有的股票投资和债券投资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。

#### **6.4.4.6 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。

#### **6.4.4.7 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。

#### **6.4.4.8 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基金净值比例计算的金额。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基金净值比例计算的金额。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)。

#### **6.4.4.9 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。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

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。

#### **6.4.4.10 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逐日确认。

其他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。

#### **6.4.4.11 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所有者权益转出。

#### **6.4.4.12 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。

#### **6.4.4.13 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和债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》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2) 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、资产支持证券和私募债券除外)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《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度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、资产支持证券和私募债券除外)，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央国债登记结算有限责任公司所独立提供的估值结果确定公允价值。



## 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	31,080,277.14
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：	31,080,277.14

### 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	40,576,328.89	40,539,528.50	-36,800.39
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		40,576,328.89	40,539,528.50	-36,800.39

### 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

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
买入返售证券	45,000,000.00	-
合计	45,000,000.00	-

#### 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	8,093.50
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	1,493.00
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	-12,849.05
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-

合计	-3,262.55
----	-----------

#### 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	28,862.05
银行间市场应付交易费用	-
合计	28,862.05

#### 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	36.77
预提费用	33,633.33
合计	33,670.10

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

汇安趋势动力 A		
项目	本期 2018年4月25日(基金合同生效日)至2018年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	116,888,719.53	116,888,719.53
本期申购	625,756.17	625,756.17
本期赎回(以“-”号填列)	-11,634,603.15	-11,634,603.15
本期末	105,879,872.55	105,879,872.55

金额单位：人民币元

汇安趋势动力 C	
项目	本期

	2018年4月25日(基金合同生效日)至2018年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	152,524,554.48	152,524,554.48
本期申购	100,874.73	100,874.73
本期赎回(以“-”号填列)	-138,523,354.40	-138,523,354.40
本期末	14,102,074.81	14,102,074.81

注：1. 本基金自2018年3月26日至2018年4月20日止期间公开发售，共募集有效净认购资金269,363,866.94元，其中A类基金有效净认购资金116,862,366.94元，C类基金有效净认购资金152,501,500.00元。根据《汇安趋势动力股票型证券投资基金基金合同生效公告》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入49,407.07元（其中A类基金26,352.59元，C类基金23,054.48元），在本基金成立后，折算为49,407.07份基金份额（其中A类基金26,352.59份，C类基金23,054.48份），划入基金份额持有人账户。

2. 根据《汇安趋势动力股票型证券投资基金基金开放申购、赎回及定期定额投资业务的公告》的相关规定，本基金自2018年5月24日起开始办理日常申购、赎回及定期定额投资业务。

3. 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

汇安趋势动力 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	264,378.51	-31,478.83	232,899.68
本期基金份额交易产生的变动数	-20,341.50	-4,700.22	-25,041.72
其中：基金申购款	1,332.50	-5,230.18	-3,897.68
基金赎回款	-21,674.00	529.96	-21,144.04
本期已分配利润	-	-	-
本期末	244,037.01	-36,179.05	207,857.96

单位：人民币元

汇安趋势动力 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	202,803.04	-5,321.56	197,481.48
本期基金份额交易产生的变动数	-190,480.34	499.90	-189,980.44
其中：基金申购款	126.03	-0.76	125.27
基金赎回款	-190,606.37	500.66	-190,105.71

本期已分配利润	-	-	-
本期末	12,322.70	-4,821.66	7,501.04

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年4月25日(基金合同生效日)至2018年6月30日
活期存款利息收入	67,690.30
定期存款利息收入	191,111.11
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	5,784.66
其他	-
合计	264,586.07

#### 6.4.7.12 股票投资收益

本基金本报告期内未发生股票投资收益。

#### 6.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期内未发生债券投资收益。

#### 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4月25日(基金合同生效日)至2018年6月30日
股票投资产生的股利收益	20,401.00
基金投资产生的股利收益	-
合计	20,401.00

#### 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4月25日(基金合同生效日)至2018 年6月30日
1. 交易性金融资产	-36,800.39
——股票投资	-36,800.39
——债券投资	-
——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	-36,800.39

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年4月25日(基金合同生效日)至2018年 6月30日
基金赎回费收入	43,709.07
合计	43,709.07

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，A类基金份额不低于赎回费总额的25%归入基金资产，C类基金份额赎回费全部归入基金财产所有。

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年4月25日(基金合同生效日)至2018年 6月30日
交易所市场交易费用	32,459.54
银行间市场交易费用	-
合计	32,459.54

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年4月25日(基金合同生效日)至2018 年6月30日
审计费用	16,015.68
信息披露费	17,617.65
银行划款手续费	966.00
证券账户开户费	400.00
合计	34,999.33

#### 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
中国工商银行股份有限公司(“工商银行”)	基金托管人、基金销售机构
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

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行交易，亦未发生支付给关联方的佣金。

##### 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
	2018年4月25日(基金合同生效日)至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	512,600.74
其中：支付销售机构的客户维护费	265,635.47

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 1.5%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 × 1.5% / 当年天数。

###### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2018年4月25日(基金合同生效日)至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	85,433.44

注：支付基金托管人中国工商银行股份有限公司的基金托管费按前一日基金资产净值 0.25%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：日基金托管费=前一日基金资产净值 × 0.25% / 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4月25日(基金合同生效日)至2018年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	汇安趋势动力A	汇安趋势动力C	合计
汇安基金管理有限责任公司	-	21,391.40	21,391.40
中国工商银行股份有限公司	-	49,130.72	49,130.72

合计	-	70,522.12	70,522.12
----	---	-----------	-----------

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 0.50% 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 × 0.50% / 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

本基金本报告期末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，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4月25日(基金合同生效日)至2018年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
工商银行	31,080,277.14	258,801.41

注：本基金的银行存款由基金托管人工商银行保管，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

本基金本报告期末未参与关联方承销证券的买卖。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项的说明。

#### 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**

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券流通受限的证券。

### **6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

### **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**

本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。

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

公司建立董事会领导下的风险管理体系，包括董事会的下设的风险控制委员会、总经理下设的风险管理委员会、督察长、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。本基金的银行存款存放在本基金的托管行工商银行，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	31,080,277.14	-	-	-	31,080,277.14
结算备付金	3,317,727.27	-	-	-	3,317,727.27
交易性金融资产	-	-	-	40,539,528.50	40,539,528.50
买入返售金融资产	45,000,000.00	-	-	-	45,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	38,547.13	38,547.13
应收利息	-	-	-	-3,262.55	-3,262.55
应收申购款	-	-	-	494,770.10	494,770.10
其他资产	-	-	-	-	-

资产总计	79,398,004.41	-	-	41,069,583.18	120,467,587.59
负债					
应付赎回款		-	-	29,269.89	29,269.89
应付管理人报酬		-	-	147,944.27	147,944.27
应付托管费		-	-	24,657.35	24,657.35
应付销售服务费		-	-	5,877.57	5,877.57
应付交易费用		-	-	28,862.05	28,862.05
其他负债		-	-	33,670.10	33,670.10
负债总计		-	-	270,281.23	270,281.23
利率敏感度缺口	79,398,004.41	-	-	40,799,301.95	120,197,306.36

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2018年6月30日，本基金未持有债券投资，因此市场利率变动对于本基金资产净值无影响。

#### 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的股票，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80%-95%，每个交易日日终在扣除股指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。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	40,539,528.50	33.73	-	-
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	40,539,528.50	33.73	-	-

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于2018年6月30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	40,539,528.50	33.65
	其中：股票	40,539,528.50	33.65
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	45,000,000.00	37.35
	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	34,398,004.41	28.55
8	其他各项资产	530,054.68	0.44
9	合计	120,467,587.59	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	3,432,710.00	2.86
B	采矿业	1,045,014.00	0.87
C	制造业	17,196,976.50	14.31
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	1,009,484.00	0.84
F	批发和零售业	2,860,591.00	2.38
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	418,037.00	0.35
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,194,698.00	2.66
J	金融业	9,344,091.00	7.77
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	382,103.00	0.32
M	科学研究和技术服务业	205,920.00	0.17
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-



O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	1,449,904.00	1.21
S	综合	-	-
	合计	40,539,528.50	33.73

### 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	601628	中国人寿	53,700	1,209,324.00	1.01
2	601998	中信银行	194,300	1,206,603.00	1.00
3	601336	新华保险	27,700	1,187,776.00	0.99
4	601988	中国银行	323,100	1,166,391.00	0.97
5	601601	中国太保	36,200	1,152,970.00	0.96
6	600036	招商银行	42,900	1,134,276.00	0.94
7	601939	建设银行	172,300	1,128,565.00	0.94
8	300188	美亚柏科	60,600	1,108,980.00	0.92
9	300579	数字认证	35,000	1,046,500.00	0.87
10	300182	捷成股份	137,100	1,039,218.00	0.86
11	000547	航天发展	131,500	1,027,015.00	0.85
12	603607	京华激光	38,700	1,025,550.00	0.85
13	601858	中国科传	108,200	1,024,654.00	0.85
14	601989	中国重工	249,600	1,008,384.00	0.84
15	300498	温氏股份	31,400	691,428.00	0.58
16	002746	仙坛股份	60,800	689,472.00	0.57
17	002321	华英农业	112,500	688,500.00	0.57
18	002299	圣农发展	44,300	686,207.00	0.57
19	600975	新五丰	169,700	677,103.00	0.56
20	601288	农业银行	171,500	589,960.00	0.49
21	601318	中国平安	9,700	568,226.00	0.47
22	002235	安妮股份	80,400	544,308.00	0.45
23	300065	海兰信	37,300	525,184.00	0.44
24	002151	北斗星通	20,000	514,000.00	0.43

25	002413	雷科防务	95,300	513,667.00	0.43
26	000519	江南红箭	65,600	509,712.00	0.42
27	300600	瑞特股份	13,400	507,592.00	0.42
28	300589	江龙船艇	37,200	502,572.00	0.42
29	300531	优博讯	30,450	438,784.50	0.37
30	600865	百大集团	70,700	427,028.00	0.36
31	603466	风语筑	16,200	425,250.00	0.35
32	002042	华孚色纺	57,100	424,824.00	0.35
33	600039	四川路桥	128,000	419,840.00	0.35
34	601007	金陵饭店	37,900	418,037.00	0.35
35	600859	王府井	19,600	416,892.00	0.35
36	002277	友阿股份	90,400	416,744.00	0.35
37	600315	上海家化	10,500	416,115.00	0.35
38	000501	鄂武商 A	33,700	414,173.00	0.34
39	600814	杭州解百	66,400	411,680.00	0.34
40	000530	大冷股份	109,500	410,625.00	0.34
41	600729	重庆百货	11,800	388,810.00	0.32
42	002697	红旗连锁	79,600	385,264.00	0.32
43	300109	新开源	10,700	371,290.00	0.31
44	002067	景兴纸业	94,100	368,872.00	0.31
45	600273	嘉化能源	40,200	364,212.00	0.30
46	603663	三祥新材	20,000	358,400.00	0.30
47	600456	宝钛股份	24,700	358,150.00	0.30
48	300398	飞凯材料	18,300	357,948.00	0.30
49	002669	康达新材	16,600	351,422.00	0.29
50	601168	西部矿业	55,900	351,052.00	0.29
51	600531	豫光金铅	70,900	350,246.00	0.29
52	300437	清水源	21,000	349,020.00	0.29
53	002149	西部材料	48,800	348,920.00	0.29
54	600160	巨化股份	47,600	348,432.00	0.29
54	600259	广晟有色	11,900	348,432.00	0.29
55	000822	山东海化	49,700	346,409.00	0.29
56	600111	北方稀土	30,400	345,952.00	0.29
57	600497	驰宏锌锗	63,400	345,530.00	0.29
58	601678	滨化股份	55,500	342,990.00	0.29
59	002246	北化股份	39,900	341,943.00	0.28
60	000630	铜陵有色	154,600	341,666.00	0.28
61	002157	正邦科技	83,500	339,845.00	0.28
62	000565	渝三峡 A	69,500	330,125.00	0.27

63	600038	中直股份	7,500	299,925.00	0.25
64	002376	新北洋	13,200	218,328.00	0.18
65	002563	森马服饰	14,900	213,070.00	0.18
66	002396	星网锐捷	10,400	212,888.00	0.18
67	603196	日播时尚	19,900	206,562.00	0.17
68	603018	中设集团	13,000	205,920.00	0.17
69	603025	大豪科技	10,500	203,070.00	0.17
70	002713	东易日盛	9,800	201,390.00	0.17
71	603608	天创时尚	22,000	199,980.00	0.17
72	603899	晨光文具	6,300	199,647.00	0.17
73	603388	元成股份	14,200	198,374.00	0.17
74	002352	鼎泰新材	4,400	198,000.00	0.16
75	600138	中青旅	9,800	195,314.00	0.16
76	600132	重庆啤酒	7,000	193,830.00	0.16
77	002081	金螳螂	18,800	189,880.00	0.16
78	600419	天润乳业	9,900	188,397.00	0.16
79	601888	中国国旅	2,900	186,789.00	0.16
80	600362	江西铜业	11,300	179,105.00	0.15

## 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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	601628	中国人寿	1,254,993.00	1.04
2	601601	中国太保	1,246,440.00	1.04
3	601336	新华保险	1,245,538.00	1.04
4	601939	建设银行	1,219,956.00	1.01
5	600036	招商银行	1,215,440.61	1.01
6	601998	中信银行	1,208,191.19	1.01
7	601988	中国银行	1,207,958.00	1.00
8	300182	捷成股份	1,036,270.00	0.86
9	000547	航天发展	1,011,708.00	0.84
10	300579	数字认证	1,009,770.00	0.84
11	601858	中国科传	1,007,921.00	0.84
12	601989	中国重工	994,447.00	0.83
13	603607	京华激光	986,801.60	0.82

14	300188	美亚柏科	938,632.00	0.78
15	002746	仙坛股份	702,584.40	0.58
16	300498	温氏股份	698,505.00	0.58
17	002321	华英农业	682,349.72	0.57
18	002299	圣农发展	679,552.00	0.57
19	600975	新五丰	677,498.00	0.56
20	601288	农业银行	620,760.00	0.52

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末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期内未进行股票卖出交易。

#### 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	40,576,328.89
卖出股票收入（成交）总额	-

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

本基金本报告期末未投资股指期货。

## 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** 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

### 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	-
2	应收证券清算款	38,547.13
3	应收股利	-
4	应收利息	-3,262.55
5	应收申购款	494,770.10
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	530,054.68
---	----	------------

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

#### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
汇安趋势动力 A	277	382,237.81	39,999,000.00	37.78%	65,880,872.55	62.22%
汇安趋势动力 C	119	118,504.83	0.00	0.00%	14,102,074.81	100.00%
合计	396	302,984.72	39,999,000.00	33.34%	79,982,947.36	66.66%

### 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	汇安趋势动力 A	59.30	0.000056%
	汇安趋势动力 C	-	-
	合计	59.30	0.000049%

### 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	汇安趋势动力 A	0
	汇安趋势动力 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	汇安趋势动力 A	0
	汇安趋势动力 C	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	汇安趋势动力 A	汇安趋势动力 C
基金合同生效日（2018 年 4 月 25 日）基金份额总额	116,888,719.53	152,524,554.48
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	625,756.17	100,874.73
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	11,634,603.15	138,523,354.40
本报告期期末基金份额总额	105,879,872.55	14,102,074.81

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，基金管理人及基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本基金在报告期内基金投资策略没有改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

自本基金成立日(2018年4月25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	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	
东北证券	2	40,576,328.89	100.00%	28,862.05	100.00%	-
国金证券	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。

(3) 交易单元变更情况

以上交易单元均为本报告期内新增交易单元。

### 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
东北证券	-	-	1,629,900,000.00	88.15%	-	-
国金证券	-	-	219,200,000.00	11.85%	-	-

### 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	汇安趋势动力股票型证券投资基金开放申购、赎回及定期定额投资业务的公告	证券时报及公司官网	2018年5月21日
2	汇安趋势动力股票型证券投资基金基金经理变更公告（赠品邹唯）	证券时报及公司官网	2018年4月27日
3	汇安趋势动力股票型证券投资基金基金合同生效公告	证券时报及公司官网	2018年4月26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	20180525-20180630	39,999,000.00	-	-	39,999,000.00	33.34%
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趋势动力股票型证券投资基金募集的文件
- (2) 《汇安趋势动力股票型证券投资基金基金合同》
- (3) 《汇安趋势动力股票型证券投资基金招募说明书》
- (4) 《汇安趋势动力股票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