

汇安多因子混合型证券投资基金 2019 年半年度报告摘要

2019 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：中国光大银行股份有限公司

送出日期：2019 年 8 月 29 日

§ 1 重要提示

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。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 8 月 28 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告期自 2019 年 4 月 30 日起至 6 月 30 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	汇安多因子混合	
基金主代码	006648	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019 年 4 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	中国光大银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	498,310,794.83 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	汇安多因子混合 A	汇安多因子混合 C
下属分级基金的交易代码:	006648	006649
报告期末下属分级基金的份额总额	280,347,760.24 份	217,963,034.59 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在有效控制风险的基础上,采用多因子投资策略,综合多方面指标,通过灵活的资产配置、策略配置与严谨的风险管理,优化调整投资组合,力争获取稳定、持续超越业绩比较基准的投资回报,实现基金资产的长期增值。
投资策略	本基金通过合理稳健的资产配置策略,将基金资产在权益类资产和债券类资产之间灵活配置,同时采取多因子股票投资策略和积极主动的债券投资策略,紧跟当下国民经济发展过程中各行业的增长机会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。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率×60%+中证综合债券指数收益率×40%
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较高的投资品种,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	中国光大银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	郭冬青	石立平
	联系电话	01056711600	010-63639180
	电子邮箱	guodq@huianfund.cn	shiliping@cebbank.com
客户服务电话		01056711690	95595
传真		01056711640	010-63639132

2.4 信息披露方式

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

§ 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	汇安多因子混合 A	汇安多因子混合 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019 年 4 月 30 日 - 2019 年 6 月 30 日)	报告期(2019 年 4 月 30 日 - 2019 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	295,379.31	47,347.16
本期利润	13,496,156.49	10,302,226.35
加权平均基金份额本期利润	0.0481	0.0473
本期基金份额净值增长率	4.81%	4.73%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019 年 6 月 30 日)	
期末可供分配基金份额利润	0.0011	0.0002
期末基金资产净值	293,843,916.73	228,265,260.94
期末基金份额净值	1.0481	1.0473

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。

4、本基金合同生效日为 2019 年 4 月 30 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

汇安多因子混合 A

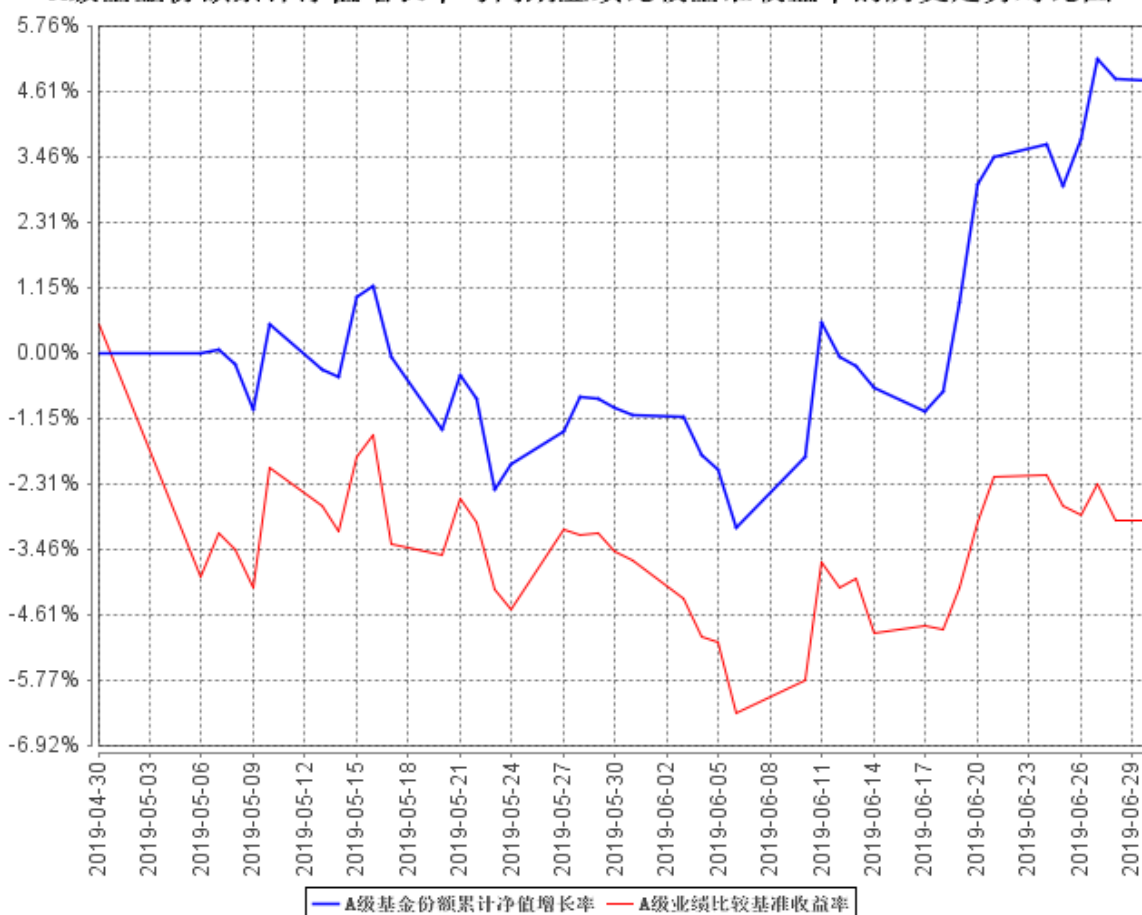
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	5.95%	0.99%	0.72%	0.83%	5.23%	0.16%
自基金合同生效起至今	4.81%	0.91%	-2.96%	1.12%	7.77%	-0.21%

汇安多因子混合 C

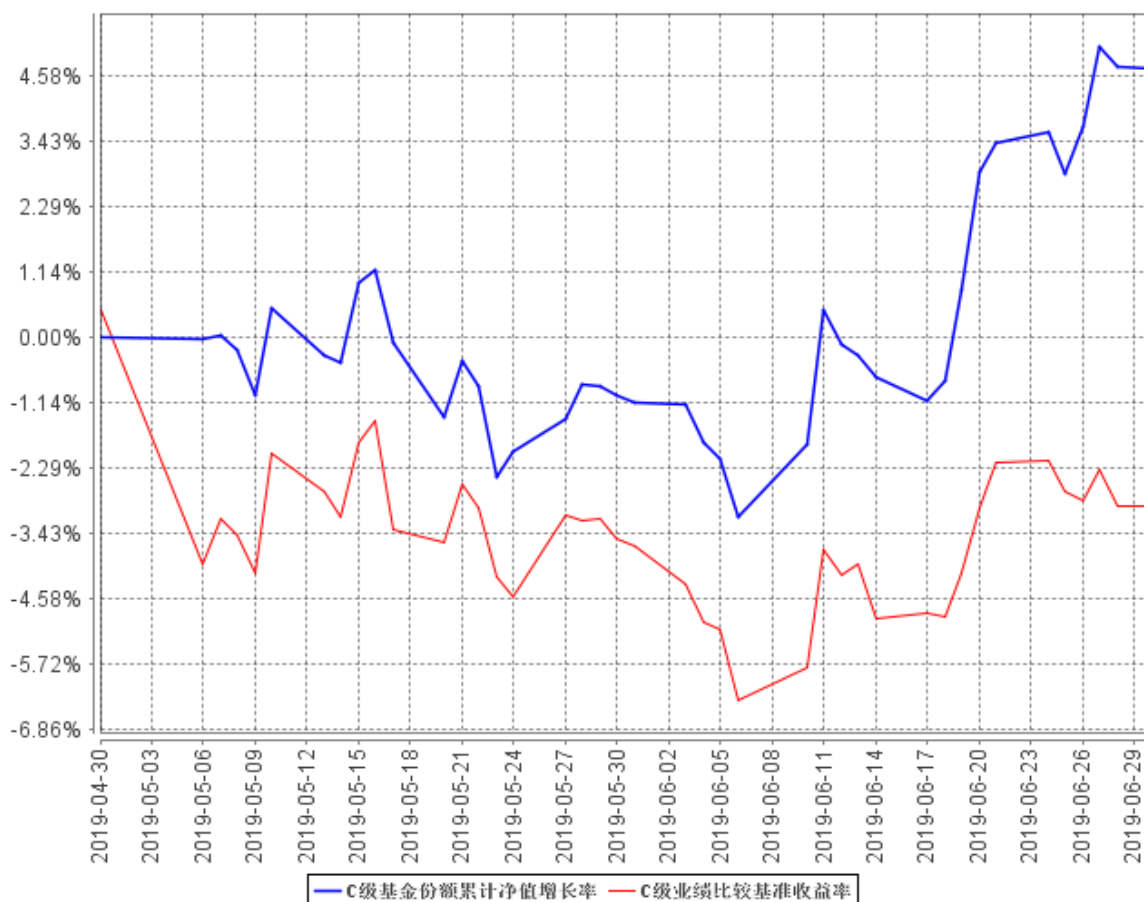
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	5.93%	0.98%	0.72%	0.83%	5.21%	0.15%
自基金合同生效起至今	4.73%	0.91%	-2.96%	1.12%	7.69%	-0.21%

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 2019 年 4 月 30 日，至本报告期末，本基金合同生效未满一年。

②根据《汇安多因子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（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、银行存款（包括协议存款、定期存款等）、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 50%-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 2019 年 6 月 30 日，公司旗下管理 25 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、汇安沪深 300 指数增强型证券投资基金、汇安丰恒灵活配置混合型证券投资基金、汇安丰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、汇安量化优选灵活配置混合型证券投资基金、汇安裕阳三年定期开放混合型证券投资基金、汇安短债债券型证券投资基金、汇安嘉鑫纯债债券型证券投资基金、富时中国 A50 交易型开放式指数证券投资基金、汇安核心成长混合型证券投资基金、汇安鼎利纯债债券型证券投资基金、汇安多因子混合型证券投资基金。

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		
陈欣	指数与量化投资部总经理、本基金的基金经理	2019 年 4 月 30 日	-	11 年	陈欣，华东理工大学企业管理硕士。11 年证券、基金行业从业经历，曾任中银基金管理有限公司渠道经理，华安基金管理有限公司指数与量化事业部高级经理，从事指数与量化投资工作。2016 年 8 月 19

					<p>日加入汇安基金管理有限责任公司，担任指数与量化投资部总经理一职。</p> <p>2018 年 3 月 21 日至 2019 年 5 月 10 日，任汇安丰利灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2019 年 4 月 30 日至今，任汇安多因子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	2019 年 4 月 30 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责任公司，担任指数与量化投资部高级经理一职。2017 年 7 月 27 日至 2018 年 8 月 9 日，任汇安丰裕灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2017 年 3 月 23 日至 2019 年 3 月 8 日，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 2019 年 3 月 8 日，任汇安丰利灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2017 年 3 月 22 日至 2019 年 4 月 19 日，任汇安丰恒灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2017 年 1 月 17 日至今，任汇安丰泽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；2018 年 7</p>

				月 26 日至今,任汇安量化优选灵活配置混合型证券投资基金基金经理; 2019 年 4 月 11 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; 2019 年 4 月 30 日至今,任汇安多因子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

2019 上半年，中国宏观经济回落预期兑现，中美贸易争端有所反复，国内政策加码，资本市场修复了去年下半年过度悲观的预期，出现了明显上涨，但市场结构分化巨大。估值合理基本面比较优秀的头部公司股价依然在不断创新高，一些因为情绪炒作的高估值题材概念股在上涨之后出现了大幅回调。从政府在债券市场打破刚兑的决心来看，在科创板注册制改革推出以后，未来将会稳步推进股市退市常态化，逐步实现有进有出的市场化优胜劣汰。在这样的大背景下，我们认为指数点位可能不会有太大下行空间，但结构出清应该还会持续，股价分化将是常态。从基本面来看，在中国经济增速换挡、转型升级的阶段，龙头企业的发展潜力和确定性也具有比较明显的优势，目前这类公司的估值仍然比较合理，本基金将坚持用量化模型优选龙头公司，努力为投资者获取良好的中长期回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末汇安多因子混合 A 基金份额净值为 1.0481 元，本报告期基金份额净值增长率为 4.81%；截至本报告期末汇安多因子混合 C 基金份额净值为 1.0473 元，本报告期基金份额净值增长率为 4.73%；同期业绩比较基准收益率为-2.96%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们认为宏观经济大概率处于不好不坏的状态。一方面，中国经济长期积累的结构矛盾需要缓慢化解，货币政策难有明显空间；另一方面，积极的财政政策仍然可期，居民收入提升带来的消费升级正在提供经济增长新动能。对于证券市场，虽然过去两年多以来市场分化很大，但我们仍然认为此刻不适用逆向思维。本轮资本市场的分化不是简单的经济周期和行业周期的轮替，大趋势是中国股市走向成熟，逐步强化市场化优胜劣汰的进程，这一进程历史上没有发生过，目前仍在途中。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本基金管理人设有估值委员会，公司运营总监担任估值委员会主席，投资部门、合规风控部和运营部指定人员担任委员。估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备

行业研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未发生利润分配情况。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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，中国光大银行股份有限公司在汇安多因子混合型证券投资基金（以下称“本基金”）托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，依法安全保管了基金的全部资产，对本基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督，对发现的问题及时提出了意见和建议。同时，按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告，没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为，诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

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，中国光大银行股份有限公司依据《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，对基金管理人的投资运作、信息披露等行为进行了复核、监督，未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金在运作中遵守了有关法律法规的要求，各重要方面由投资管理人依据基金合同及实际运作情况进行处理。

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

中国光大银行股份有限公司依法对基金管理人编制的《汇安多因子混合型证券投资基金 2019 年半年度报告》进行了复核，认为报告中相关财务指标、净值表现、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确。

§ 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：汇安多因子混合型证券投资基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2019 年 6 月 30 日
资 产：	
银行存款	128,275,800.20
结算备付金	27,775,156.04
存出保证金	115,967.76
交易性金融资产	366,999,199.43
其中：股票投资	366,999,199.43
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	-
买入返售金融资产	-
应收证券清算款	-
应收利息	29,352.69
应收股利	-
应收申购款	-
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	523,195,476.12
负债和所有者权益	本期末 2019 年 6 月 30 日
负 债：	
短期借款	-
交易性金融负债	-
衍生金融负债	-
卖出回购金融资产款	-
应付证券清算款	-
应付赎回款	-
应付管理人报酬	617,011.10
应付托管费	82,268.16
应付销售服务费	89,929.31
应付交易费用	244,162.96

应交税费	-
应付利息	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	52,926.92
负债合计	1,086,298.45
所有者权益：	
实收基金	498,310,794.83
未分配利润	23,798,382.84
所有者权益合计	522,109,177.67
负债和所有者权益总计	523,195,476.12

注：1、报告截止日 2019 年 6 月 30 日，汇安多因子混合 A 基金份额净值 1.0481 元，基金份额总额 280,347,760.24 份；汇安多因子混合 C 基金份额净值 1.0473 元，基金份额总额 217,963,034.59 份。汇安多因子混合份额总额合计为 498,310,794.83 份。

2、本基金合同生效日为 2019 年 4 月 30 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：汇安多因子混合型证券投资基金

本报告期：2019 年 4 月 30 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期
	2019 年 4 月 30 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日
一、收入	25,723,679.01
1.利息收入	325,307.63
其中：存款利息收入	325,307.63
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	-
其他利息收入	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	1,942,715.01
其中：股票投资收益	-
基金投资收益	-
债券投资收益	-
资产支持证券投资收益	-
贵金属投资收益	-
衍生工具收益	-
股利收益	1,942,715.01
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	23,455,656.37

4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	-
减：二、费用	1,925,296.17
1. 管理人报酬	1,249,125.34
2. 托管费	166,550.05
3. 销售服务费	182,081.76
4. 交易费用	274,612.10
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	52,926.92
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	23,798,382.84
减：所得税费用	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	23,798,382.84

注：本基金合同生效日为 2019 年 4 月 30 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：汇安多因子混合型证券投资基金

本报告期：2019 年 4 月 30 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 4 月 30 日(基金合同生效日)至 2019 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）	498,310,794.83	-	498,310,794.83
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	23,798,382.84	23,798,382.84
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）	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-

2. 基金赎回款	-	-	-
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）	498,310,794.83	23,798,382.84	522,109,177.67

注：本基金合同生效日为 2019 年 4 月 30 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>窦星华</u>	<u>江士</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

汇安多因子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[2018]1820号《关于准予汇安多因子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《汇安多因子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498,086,043.79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(2019)第0277号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《汇安多因子混合型证券投资基金基金合同》于2019年4月29日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为498,310,794.83份基金份额,其中认购资金利息折合224,751.04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,基金托管人为中国光大银行股份有限公司(以下简称“中国光大银行”)。

根据《汇安多因子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。在投资人认购/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,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类基金份额将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《汇安多因子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（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、银行存款（包括协议存款、定期存款等）、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 50%-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。本基金业绩比较基准：中证 500 指数收益率×60%+中证综合债券指数收益率×40%。

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 2019 年 8 月 29 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》、《汇安丰利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 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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2019 年 4 月 30 日（基金合同生效日）至 2019 年 6 月 30 日止期间的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 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 年 4 月 30 日（基金合同生效日）至 2019 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。本期财务报表的实际编制期间为 2019 年 4 月 30 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日。

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变动计入当期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。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。

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的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于证券交易所上市的股票，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。

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。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票的转让收入免征增值税。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，包括买卖股票的差价收入，股票的股息、红利收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 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 关联方关系

6.4.7.1 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。

6.4.7.2 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、基金注册登记机构、基金销售机构
中国光大银行股份有限公司(“中国光大银行”)	基金托管人、基金销售机构
何斌	基金管理人的股东

秦军	基金管理人的股东
郭小峰	基金管理人的股东
戴新华	基金管理人的股东
刘强	基金管理人的股东
郭兆强	基金管理人的股东
尹喜杰	基金管理人的股东
王福德	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期内未有应支付关联方的佣金。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2019 年 4 月 30 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,249,125.34
其中：支付销售机构的客户维护费	624,578.98

注：支付基金管理人汇安基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50%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 × 1.50%/ 当年天数。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2019 年 4 月 30 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	166,550.05

注：支付基金托管人中国光大银行的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：

日托管费=前一日基金资产净值 × 0.20%/ 当年天数。

6.4.8.2.3 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 2019 年 4 月 30 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	汇安多因子混合 A	汇安多因子混合 C	合计
汇安基金	-	-	-
光大银行	-	180,828.57	180,828.57
合计	-	180,828.57	180,828.57

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额基金资产净值 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。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内未发生与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人于本基金本报告期内未运用固有资产投资本基金。

6.4.8.4.2 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

于本基金本报告期末除基金管理人以外的其他关联方未投资本基金。

6.4.8.5 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 2019 年 4 月 30 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
中国光大银行	128,275,800.20	319,329.17

注：本基金的银行存款由基金托管人中国光大银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.9 期末（2019 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 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
300788	中信出版	2019 年 6 月 27 日	2019 年 7 月 5 日	新股流通受限	14.85	14.85	1,556	23,106.60	23,106.60	

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

§ 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	366,999,199.43	70.15
	其中：股票	366,999,199.43	70.15
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	156,050,956.24	29.83
8	其他各项资产	145,320.45	0.03
9	合计	523,195,476.12	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	3,146,154.50	0.60
B	采矿业	2,239,233.50	0.43
C	制造业	247,675,455.33	47.44
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,870,107.00	0.36
E	建筑业	1,892,275.40	0.36
F	批发和零售业	4,985,843.00	0.95
G	交通运输、仓储和邮政业	9,868,354.04	1.89
H	住宿和餐饮业	12,586,000.00	2.41
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,841,792.26	2.08
J	金融业	36,213,132.00	6.94

K	房地产业	3,580,085.80	0.69
L	租赁和商务服务业	12,863,813.00	2.46
M	科学研究和技术服务业	511,560.00	0.10
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	15,420,000.00	2.95
R	文化、体育和娱乐业	2,168,713.60	0.42
S	综合	1,136,680.00	0.22
	合计	366,999,199.43	70.29

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：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前十名股票投资明细

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	002415	海康威视	632,420	17,442,143.60	3.34
2	300630	普利制药	299,853	17,277,529.86	3.31
3	300347	泰格医药	200,000	15,420,000.00	2.95
4	600519	贵州茅台	15,500	15,252,000.00	2.92
5	000661	长春高新	43,300	14,635,400.00	2.80
6	002475	立讯精密	582,200	14,432,738.00	2.76
7	000568	泸州老窖	170,000	13,741,100.00	2.63
8	600196	复星医药	500,000	12,650,000.00	2.42
9	600258	首旅酒店	700,000	12,586,000.00	2.41
10	000858	五粮液	104,433	12,317,872.35	2.36

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于管理人网站的年度报告正文。

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	002415	海康威视	18,114,314.68	3.47

2	600519	贵州茅台	13,805,137.00	2.64
3	300630	普利制药	13,651,522.80	2.61
4	300347	泰格医药	12,780,448.00	2.45
5	002475	立讯精密	12,759,947.53	2.44
6	000661	长春高新	12,744,254.00	2.44
7	600196	复星医药	12,682,578.29	2.43
8	600258	首旅酒店	12,228,846.56	2.34
9	000568	泸州老窖	12,150,443.44	2.33
10	002027	分众传媒	11,850,098.09	2.27
11	002384	东山精密	11,533,432.88	2.21
12	300408	三环集团	11,151,121.48	2.14
13	000860	顺鑫农业	10,462,914.84	2.00
14	600104	上汽集团	10,214,391.00	1.96
15	600036	招商银行	9,995,997.40	1.91
16	000858	五粮液	9,923,363.43	1.90
17	601318	中国平安	9,633,406.82	1.85
18	600201	生物股份	9,559,499.81	1.83
19	600885	宏发股份	8,932,144.80	1.71
20	601398	工商银行	8,480,638.00	1.62

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

无。

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	343,543,543.06
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前十名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

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

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 基金投资的前十名股票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	115,967.76
2	应收证券清算款	-

3	应收股利	-
4	应收利息	29,352.69
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	145,320.45

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
汇安多因子混合 A	5,695	49,227.00	0.00	0.00%	280,347,760.24	100.00%
汇安多因子混合 C	645	337,927.19	0.00	0.00%	217,963,034.59	100.00%
合计	6,340	78,597.92	0.00	0.00%	498,310,794.83	100.00%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	汇安多因子混合 A	0.00	0.0000%
	汇安多因子混合 C	0.00	0.0000%
	合计	0.00	0.0000%

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	汇安多因子混合 A	0
	汇安多因子混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	汇安多因子混合 A	0
	汇安多因子混合 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	汇安多因子混合 A	汇安多因子混合 C
基金合同生效日（2019年4月30日）基金份额总额	280,347,760.24	217,963,034.59
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	-	-
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	280,347,760.24	217,963,034.59

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

本基金管理人 2019 年 6 月 25 日发布公告，聘任郭冬青为公司合规负责人。上述变更事项，经汇安基金管理有限责任公司第一届董事会第三十次会议审议通过，并已按规定报中国证券投资基金业协会及北京证监局备案。自新任合规负责人任职之日起，汇安基金管理有限责任公司总经理秦军先生不再代为履行合规负责人职务。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、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(2019 年 4 月 30 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。

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
国信证券	2	192,787,507.32	56.16%	137,130.05	56.16%	-
中信建投证券	2	150,474,990.04	43.84%	107,032.91	43.84%	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	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。

(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	成交金额	占当期权证成交总额的比例

				的比例		
国信证券	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-

汇安基金管理有限责任公司

2019 年 8 月 29 日