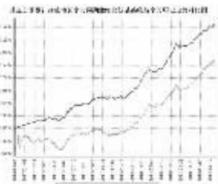


汇安嘉汇纯债债券型证券投资基金

2018年第四季度报告



注:本报告期,本基金投资比例符合基金合同要求。

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金基金经理的期限	学历及学位	职称
魏斌	基金经理	2016年12月12日至今	硕士研究生	中级经济师
魏斌	基金经理	2017年4月28日至今	硕士研究生	中级经济师

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明
 本报告期内,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、招募说明书等有关基金法律文件的规定,依照诚实信用、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最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明
 4.3.1 公平交易制度的执行情况
 报告期内,本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。本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
 本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。

4.3 公平交易专项说明
 4.3.1 公平交易制度的执行情况
 报告期内,本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。本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
 本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。

4.3 公平交易专项说明
 4.3.1 公平交易制度的执行情况
 报告期内,本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。本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
 本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。

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
 报告送出日期:2019年1月21日

§ 1 重要提示
 基金管理人的董事会及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责任。
 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2019年1月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。
 本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年10月1日起至12月31日止。
 § 2 基金产品概况

基金名称	汇安嘉汇纯债债券型证券投资基金
基金代码	004702
交易场所	深圳证券交易所
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年01月21日
报告期末基金份额总额	796,202,288.69
投资策略	本基金为纯债债券型基金,投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%。本基金主要投资于信用评级较高的债券,包括国债、金融债、企业债、中期票据、短期融资券、资产支持证券、地方政府债、证券公司短期融资券、公开发行的次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、央行票据、中期票据、短期融资券、资产支持证券、地方政府债、证券公司短期融资券、公开发行的次级债、可转换债券(含分离交易可转债)等固定收益类金融工具,并视情况适当参与新股申购、股票二级市场投资等权益类资产投资。
业绩比较基准	中债综合全价指数(总值)收益率*90%+银行人民币同业存款利率(税后)*10%
风险收益特征	本基金为债券型基金,属于证券投资基金中较低风险品种,其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金和混合型基金,高于货币市场基金。
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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现
 3.1 主要财务指标
 单位:人民币元

主要财务指标	报告期: 2018年10月1日 - 2018年12月31日
本期已实现收益	5,786,366.60
本期利润	56,327,854.14
加权平均基金份额本期利润	0.0708
期末基金份额净值	0.991,241,209.67
期末基金资产净值	1,209,674,000.00

注:1、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。
 2、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。

3.2 基金净值表现
 3.2.1 本报告期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

项目	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	净值增长率标准差	①-③	②-④
过去三个月	1.83%	0.05%	2.03%	0.05%	-0.20%	-0.03%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

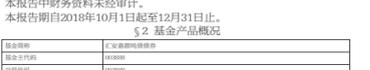


注:1、本基金已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
 2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现
 3.2.1 本报告期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

项目	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	净值增长率标准差	①-③	②-④
过去三个月	1.83%	0.05%	2.03%	0.05%	-0.20%	-0.03%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:1、本基金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。
 2、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。

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
 报告送出日期:2019年1月21日

§ 1 重要提示
 基金管理人的董事会及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责任。
 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2019年1月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。
 本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年10月1日起至12月31日止。
 § 2 基金产品概况

基金名称	汇安嘉源纯债债券型证券投资基金
基金代码	004809
交易场所	深圳证券交易所
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年01月21日
报告期末基金份额总额	669,467,293.68
投资策略	本基金为纯债债券型基金,投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%。本基金主要投资于信用评级较高的债券,包括国债、金融债、企业债、中期票据、短期融资券、资产支持证券、地方政府债、证券公司短期融资券、公开发行的次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、央行票据、中期票据、短期融资券、资产支持证券、地方政府债、证券公司短期融资券、公开发行的次级债、可转换债券(含分离交易可转债)等固定收益类金融工具,并视情况适当参与新股申购、股票二级市场投资等权益类资产投资。
业绩比较基准	中债综合全价指数(总值)收益率*90%+银行人民币同业存款利率(税后)*10%
风险收益特征	本基金为债券型基金,属于证券投资基金中较低风险品种,其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金和混合型基金,高于货币市场基金。
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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现
 3.1 主要财务指标
 单位:人民币元

主要财务指标	报告期: 2018年10月1日 - 2018年12月31日
本期已实现收益	10,239,869.63
本期利润	11,248,862.04
加权平均基金份额本期利润	0.0168
期末基金份额净值	0.991,241,209.67
期末基金资产净值	1,209,674,000.00

注:1、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。
 2、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。

3.2 基金净值表现
 3.2.1 本报告期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

项目	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	净值增长率标准差	①-③	②-④
过去三个月	1.20%	0.05%	2.03%	0.05%	-0.83%	-0.03%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:1、本基金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。
 2、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。

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
 报告送出日期:2019年1月21日

§ 1 重要提示
 基金管理人的董事会及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责任。
 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2019年1月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。
 本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年10月1日起至12月31日止。
 § 2 基金产品概况

基金名称	汇安量化优选灵活配置混合型证券投资基金
基金代码	004809
交易场所	深圳证券交易所
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年01月21日
报告期末基金份额总额	669,467,293.68
投资策略	本基金为混合型基金,投资于股票资产的比例不低于基金资产的30%。本基金主要投资于信用评级较高的债券,包括国债、金融债、企业债、中期票据、短期融资券、资产支持证券、地方政府债、证券公司短期融资券、公开发行的次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、央行票据、中期票据、短期融资券、资产支持证券、地方政府债、证券公司短期融资券、公开发行的次级债、可转换债券(含分离交易可转债)等固定收益类金融工具,并视情况适当参与新股申购、股票二级市场投资等权益类资产投资。
业绩比较基准	中证500指数收益率*60%+中债综合全价指数(总值)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中等风险品种,其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金,高于债券型基金和货币市场基金。
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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现
 3.1 主要财务指标
 单位:人民币元

主要财务指标	报告期: 2018年10月1日 - 2018年12月31日
本期已实现收益	-3,761,625.97
本期利润	-4,261,809.64
加权平均基金份额本期利润	-0.0063
期末基金份额净值	0.991,241,209.67
期末基金资产净值	1,209,674,000.00

注:1、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。
 2、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。

3.2 基金净值表现
 3.2.1 本报告期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

项目	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	净值增长率标准差	①-③	②-④
过去三个月	-1.02%	1.00%	-0.23%	0.00%	-0.79%	0.00%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:1、本基金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。
 2、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。

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
 报告送出日期:2019年1月21日

§ 1 重要提示
 基金管理人的董事会及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责任。
 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2019年1月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。
 本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年10月1日起至12月31日止。
 § 2 基金产品概况

基金名称	汇安量化优选灵活配置混合型证券投资基金
基金代码	004809
交易场所	深圳证券交易所
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年01月21日
报告期末基金份额总额	669,467,293.68
投资策略	本基金为混合型基金,投资于股票资产的比例不低于基金资产的30%。本基金主要投资于信用评级较高的债券,包括国债、金融债、企业债、中期票据、短期融资券、资产支持证券、地方政府债、证券公司短期融资券、公开发行的次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、央行票据、中期票据、短期融资券、资产支持证券、地方政府债、证券公司短期融资券、公开发行的次级债、可转换债券(含分离交易可转债)等固定收益类金融工具,并视情况适当参与新股申购、股票二级市场投资等权益类资产投资。
业绩比较基准	中证500指数收益率*60%+中债综合全价指数(总值)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中等风险品种,其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金,高于债券型基金和货币市场基金。
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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现
 3.1 主要财务指标
 单位:人民币元

主要财务指标	报告期: 2018年10月1日 - 2018年12月31日
本期已实现收益	-3,761,625.97
本期利润	-4,261,809.64
加权平均基金份额本期利润	-0.0063
期末基金份额净值	0.991,241,209.67
期末基金资产净值	1,209,674,000.00

注:1、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。
 2、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。

3.2 基金净值表现
 3.2.1 本报告期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

项目	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	净值增长率标准差	①-③	②-④
过去三个月	-1.02%	1.00%	-0.23%	0.00%	-0.79%	0.00%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:1、本基金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。
 2、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。

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
 报告送出日期:2019年1月21日

§ 1 重要提示
 基金管理人的董事会及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责任。
 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2019年1月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。
 本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年10月1日起至12月31日止。
 § 2 基金产品概况

基金名称	汇安量化优选灵活配置混合型证券投资基金
基金代码	004809
交易场所	深圳证券交易所
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年01月21日
报告期末基金份额总额	669,467,293.68
投资策略	本基金为混合型基金,投资于股票资产的比例不低于基金资产的30%。本基金主要投资于信用评级较高的债券,包括国债、金融债、企业债、中期票据、短期融资券、资产支持证券、地方政府债、证券公司短期融资券、公开发行的次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、央行票据、中期票据、短期融资券、资产支持证券、地方政府债、证券公司短期融资券、公开发行的次级债、可转换债券(含分离交易可转债)等固定收益类金融工具,并视情况适当参与新股申购、股票二级市场投资等权益类资产投资。
业绩比较基准	中证500指数收益率*60%+中债综合全价指数(总值)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中等风险品种,其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金,高于债券型基金和货币市场基金。
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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现
 3.1 主要财务指标
 单位:人民币元

主要财务指标	报告期: 2018年10月1日 - 2018年12月31日
本期已实现收益	-3,761,625.97
本期利润	-4,261,809.64
加权平均基金份额本期利润	-0.0063
期末基金份额净值	0.991,241,209.67
期末基金资产净值	1,209,674,000.00

注:1、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。
 2、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。

3.2 基金净值表现
 3.2.1 本报告期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

项目	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	净值增长率标准差	①-③	②-④
过去三个月	-1.02%	1.00%	-0.23%	0.00%	-0.79%	0.00%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:1、本基金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。
 2、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。

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
 报告送出日期:2019年1月21日

§ 1 重要提示
 基金管理人的董事会及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责任。
 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2019年1月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。
 本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年10月1日起至12月31日止。
 § 2 基金产品概况

基金名称	汇安量化优选灵活配置混合型证券投资基金
基金代码	004809
交易场所	深圳证券交易所
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年01月21日
报告期末基金份额总额	669,467,293.68
投资策略	本基金为混合型基金,投资于股票资产的比例不低于基金资产的30%。本基金主要投资于信用评级较高的债券,包括国债、金融债、企业债、中期票据、短期融资券、资产支持证券、地方政府债、证券公司短期融资券、公开发行的次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、央行票据、中期票据、短期融资券、资产支持证券、地方政府债、证券公司短期融资券、公开发行的次级债、可转换债券(含分离交易可转债)等固定收益类金融工具,并视情况适当参与新股申购、股票二级市场投资等权益类资产投资。
业绩比较基准	中证500指数收益率*60%+中债综合全价指数(总值)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中等风险品种,其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金,高于债券型基金和货币市场基金。
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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现
 3.1 主要财务指标
 单位:人民币元

主要财务指标	报告期: 2018年10月1日 - 2018年12月31日
本期已实现收益	-3,761,625.97
本期利润	-4,261,809.64
加权平均基金份额本期利润	-0.0063
期末基金份额净值	0.991,241,209.67
期末基金资产净值	1,209,674,000.00

注:1、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。
 2、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。

3.2 基金净值表现
 3.2.1