

# 汇安嘉源纯债债券型证券投资基金 2018年年度报告摘要

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  
基金合同生效日期:2016年7月30日

1.1 重要提示  
基金管理人的董事、监事和高级管理人员不存在虚假记载、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法律责任。本年度报告已三分之二以上独立董事审阅,并由董事长签发。

基金管理人、基金托管人按照《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、基金托管协议的约定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则履行受托管理职责,但不保证基金一定盈利,也不保证基金份额持有人资产不受损失。

基金的过往业绩并不预示其未来表现,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,应阅读年度报告正文。本报告期内自2018年1月1日起至2018年12月31日止。

基金名称	汇安嘉源纯债债券型证券投资基金
基金代码	040808
基金简称	嘉源纯债
基金合同生效日	2016年07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
报告期内基金托管人变更情况	不适用
基金的投资范围	债券

2.2 基金产品说明	本基金在严格控制投资组合风险的前提下,力争长期内实现超越业绩比较基准的投资目标。
投资目标	本基金在严格控制投资组合风险的前提下,力争长期内实现超越业绩比较基准的投资目标。
业绩比较基准	中债综合财富(总值)指数收益率*95%+银行间同业拆放利率(一年期)*5%
风险收益特征	本基金为债券型基金,属于证券投资基金中的较低风险品种,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,高于货币型基金。

2.3 基金管理人及基金托管人		
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
法定代表人	秦力军	陈健
注册地址	北京市海淀区中关村大街18号17层1701B	上海市浦东新区中环路1469号
办公地址	北京市海淀区中关村大街18号17层1701B	上海市浦东新区中环路1469号
电话	010-66711000	8620
传真	010-66711040	021-40098240

2.4 信息披露方式	
基金年度报告全文披露网站及网址	www.huanfund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人办公地点
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	

3.1 主要会计数据和财务指标			
项目	2018年	2017年	2016年12月31日至2018年12月31日
本期利润总额	63,493,384.38	32,319,326.69	287,798,234.24
本期净利润	62,862,716.27	32,469,475.69	287,798,234.24
归属于母公司股东的净利润	60,623	30,818	287,798,234.24
本期可供分配利润	5,279	3,039	0.12%
期末可供分配利润	0.0020	0.0031	0.0012
期末未分配利润	702,467,849.63	1,102,714,794.63	200,247,685.09
期末未分配利润占期末净资产的比例	1.02%	1.00%	1.00%

3.2 基金净值表现			
期间	净值增长率	业绩比较基准	净值增长率-业绩比较基准
过去三个月	1.23%	0.02%	2.03%
过去六个月	2.64%	0.03%	3.08%
过去一年	5.37%	0.03%	7.80%
自基金合同生效以来	95.1%	0.03%	81.7%

3.3 基金自合同生效以来基金净值表现及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较			
期间	基金净值增长率	业绩比较基准	基金净值增长率-业绩比较基准
2016	0.86%	-	-
2017	0.86%	-	-
2018	0.86%	-	-

3.4 基金管理人及基金托管人		
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
法定代表人	秦力军	陈健
注册地址	北京市海淀区中关村大街18号17层1701B	上海市浦东新区中环路1469号
办公地址	北京市海淀区中关村大街18号17层1701B	上海市浦东新区中环路1469号
电话	010-66711000	8620
传真	010-66711040	021-40098240

3.5 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况			
项目	2018年	2017年	2016年12月31日至2018年12月31日
本期利润总额	63,493,384.38	32,319,326.69	287,798,234.24
本期净利润	62,862,716.27	32,469,475.69	287,798,234.24
归属于母公司股东的净利润	60,623	30,818	287,798,234.24
本期可供分配利润	5,279	3,039	0.12%
期末可供分配利润	0.0020	0.0031	0.0012
期末未分配利润	702,467,849.63	1,102,714,794.63	200,247,685.09
期末未分配利润占期末净资产的比例	1.02%	1.00%	1.00%

3.6 基金管理人及基金托管人		
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
法定代表人	秦力军	陈健
注册地址	北京市海淀区中关村大街18号17层1701B	上海市浦东新区中环路1469号
办公地址	北京市海淀区中关村大街18号17层1701B	上海市浦东新区中环路1469号
电话	010-66711000	8620
传真	010-66711040	021-40098240

3.7 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况			
项目	2018年	2017年	2016年12月31日至2018年12月31日
本期利润总额	63,493,384.38	32,319,326.69	287,798,234.24
本期净利润	62,862,716.27	32,469,475.69	287,798,234.24
归属于母公司股东的净利润	60,623	30,818	287,798,234.24
本期可供分配利润	5,279	3,039	0.12%
期末可供分配利润	0.0020	0.0031	0.0012
期末未分配利润	702,467,849.63	1,102,714,794.63	200,247,685.09
期末未分配利润占期末净资产的比例	1.02%	1.00%	1.00%

3.8 基金管理人及基金托管人		
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
法定代表人	秦力军	陈健
注册地址	北京市海淀区中关村大街18号17层1701B	上海市浦东新区中环路1469号
办公地址	北京市海淀区中关村大街18号17层1701B	上海市浦东新区中环路1469号
电话	010-66711000	8620
传真	010-66711040	021-40098240

3.9 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况			
项目	2018年	2017年	2016年12月31日至2018年12月31日
本期利润总额	63,493,384.38	32,319,326.69	287,798,234.24
本期净利润	62,862,716.27	32,469,475.69	287,798,234.24
归属于母公司股东的净利润	60,623	30,818	287,798,234.24
本期可供分配利润	5,279	3,039	0.12%
期末可供分配利润	0.0020	0.0031	0.0012
期末未分配利润	702,467,849.63	1,102,714,794.63	200,247,685.09
期末未分配利润占期末净资产的比例	1.02%	1.00%	1.00%

3.10 基金管理人及基金托管人		
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
法定代表人	秦力军	陈健
注册地址	北京市海淀区中关村大街18号17层1701B	上海市浦东新区中环路1469号
办公地址	北京市海淀区中关村大街18号17层1701B	上海市浦东新区中环路1469号
电话	010-66711000	8620
传真	010-66711040	021-40098240

3.11 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况			
项目	2018年	2017年	2016年12月31日至2018年12月31日
本期利润总额	63,493,384.38	32,319,326.69	287,798,234.24
本期净利润	62,862,716.27	32,469,475.69	287,798,234.24
归属于母公司股东的净利润	60,623	30,818	287,798,234.24
本期可供分配利润	5,279	3,039	0.12%
期末可供分配利润	0.0020	0.0031	0.0012
期末未分配利润	702,467,849.63	1,102,714,794.63	200,247,685.09
期末未分配利润占期末净资产的比例	1.02%	1.00%	1.00%

3.12 基金管理人及基金托管人		
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
法定代表人	秦力军	陈健
注册地址	北京市海淀区中关村大街18号17层1701B	上海市浦东新区中环路1469号
办公地址	北京市海淀区中关村大街18号17层1701B	上海市浦东新区中环路1469号
电话	010-66711000	8620
传真	010-66711040	021-40098240

3.13 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况			
项目	2018年	2017年	2016年12月31日至2018年12月31日
本期利润总额	63,493,384.38	32,319,326.69	287,798,234.24
本期净利润	62,862,716.27	32,469,475.69	287,798,234.24
归属于母公司股东的净利润	60,623	30,818	287,798,234.24
本期可供分配利润	5,279	3,039	0.12%
期末可供分配利润	0.0020	0.0031	0.0012
期末未分配利润	702,467,849.63	1,102,714,794.63	200,247,685.09
期末未分配利润占期末净资产的比例	1.02%	1.00%	1.00%

3.14 基金管理人及基金托管人		
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
法定代表人	秦力军	陈健
注册地址	北京市海淀区中关村大街18号17层1701B	上海市浦东新区中环路1469号
办公地址	北京市海淀区中关村大街18号17层1701B	上海市浦东新区中环路1469号
电话	010-66711000	8620
传真	010-66711040	021-40098240

3.15 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况			
项目	2018年	2017年	2016年12月31日至2018年12月31日
本期利润总额	63,493,384.38	32,319,326.69	287,798,234.24
本期净利润	62,862,716.27	32,469,475.69	287,798,234.24
归属于母公司股东的净利润	60,623	30,818	287,798,234.24
本期可供分配利润	5,279	3,039	0.12%
期末可供分配利润	0.0020	0.0031	0.0012
期末未分配利润	702,467,849.63	1,102,714,794.63	200,247,685.09
期末未分配利润占期末净资产的比例	1.02%	1.00%	1.00%

3.16 基金管理人及基金托管人		
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
法定代表人	秦力军	陈健
注册地址	北京市海淀区中关村大街18号17层1701B	上海市浦东新区中环路1469号
办公地址	北京市海淀区中关村大街18号17层1701B	上海市浦东新区中环路1469号
电话	010-66711000	8620
传真	010-66711040	021-40098240

3.17 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况			
项目	2018年	2017年	2016年12月31日至2018年12月31日
本期利润总额	63,493,384.38	32,319,326.69	287,798,234.24
本期净利润	62,862,716.27	32,469,475.69	287,798,234.24
归属于母公司股东的净利润	60,623	30,818	287,798,234.24
本期可供分配利润	5,279	3,039	0.12%
期末可供分配利润	0.0020	0.0031	0.0012
期末未分配利润	702,467,849.63	1,102,714,794.63	200,247,685.09
期末未分配利润占期末净资产的比例	1.02%	1.00%	1.00%

3.18 基金管理人及基金托管人		
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
法定代表人	秦力军	陈健
注册地址	北京市海淀区中关村大街18号17层1701B	上海市浦东新区中环路1469号
办公地址	北京市海淀区中关村大街18号17层1701B	上海市浦东新区中环路1469号
电话	010-66711000	8620
传真	010-66711040	021-40098240

3.19 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况			
项目	2018年	2017年	2016年12月31日至2018年12月31日
本期利润总额	63,493,384.38	32,319,326.69	287,798,234.24
本期净利润	62,862,716.27	32,469,475.69	287,798,234.24
归属于母公司股东的净利润	60,623	30,818	287,798,234.24
本期可供分配利润	5,279	3,039	0.12%
期末可供分配利润	0.0020	0.0031	0.0012
期末未分配利润	702,467,849.63	1,102,714,794.63	200,247,685.09
期末未分配利润占期末净资产的比例	1.02%	1.00%	1.00%

3.20 基金管理人及基金托管人		
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
法定代表人	秦力军	陈健
注册地址	北京市海淀区中关村大街18号17层1701B	上海市浦东新区中环路1469号
办公地址	北京市海淀区中关村大街18号17层1701B	上海市浦东新区中环路1469号
电话	010-66711000	8620
传真	010-66711040	021-40098240

3.21 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况			
项目	2018年	2017年	2016年12月31日至2018年12月31日
本期利润总额	63,493,384.38	32,319,326.69	287,798,234.24
本期净利润	62,862,716.27	32,469,475.69	287,798,234.24
归属于母公司股东的净利润	60,623	30,818	287,798,234.24
本期可供分配利润	5,279	3,039	0.12%
期末可供分配利润	0.0020	0.0031	0.0012
期末未分配利润	702,467,849.63	1,102,714,794.63	200,247,685.09
期末未分配利润占期末净资产的比例	1.02%	1.00%	1.00%

力度,基建投资加码下仅实现部分的对冲,宽松的货币政策延续,调控节奏也更为丰富与有创造性,宏观环境有利于债券投资。但未来伴随经济下行,信用违约风险持续发生,信用收缩风险亦在增加,信用风险管理将是基金投资管理的核心内容之一。

4.6 管理人对于报告期内基金投资运作情况的说明  
本基金管理人按照《基金合同》、中国证监会相关规定和基金合同关于投资范围的约定,对基金所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任,投资部门、合规风控部和运营部担任成员。估值委员会负责制定和适时修订基金估值政策和程序,指导和监督估值流程,检查估值委员会成员多年从业,基金从业经验,熟悉相关法律法规,具备专业胜任,风险管理,法律合规等基本估值操作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证指数有限公司签订中证指数有限公司数据服务协议,由其提供分别按照银行间同业拆放及交易所市场的债券品种的估值数据。

4.7 管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明  
本报告期内基金分配情况如下:  
本基金以截至2018年12月31日基金可供分配收益15,382,348.00元为基准,以2018年11月1日为权益登记日,除息日,于2018年11月2日向本基金的基金持有人派发第二次分红,每10份基金份额派发红利0.0154元。

本基金以截至2018年12月14日基金可供分配收益7,077,429.84元为基准,以2018年12月20日为权益登记日,除息日,于2018年12月21日向本基金的基金持有人派发第四次分红,每10份基金份额派发红利0.0066元。

4.8 报告期内管理人对于本基金持有人或基金资产净值预期影响的说明  
报告期内,本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

5 托管人报告  
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明  
本报告期内,上海浦东发展银行股份有限公司(以下简称“本托管人”)在对汇安嘉源纯债债券型证券投资基金的投资过程中,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、托管协议的约定,不存在损害基金份额持有人的利益行为,完全尽到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,本托管人依据《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、托管协议的约定,对汇安嘉源纯债债券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。本基金报告期内进行了两次利润分配,分别金额为740,242.74元/0.009,300,400元,15,382,348.00元,15,382,348.00元,15,382,348.00元。

5.3 托管人对本报告期基金资产净值及基金份额净值、基金份额变动情况的说明  
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、净值数据、收益分配情况、财务会计报告(注:财务会计报告中的“金融工具及风险管理”部分)未在托管人复核范围内,投资组合报告内容真实、准确、完整。

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计了汇安嘉源纯债债券型证券投资基金以下简称“汇安嘉源纯债基金”的财务报表,包括2018年12月31日的资产负债表,2018年的利润表和所有者权益变动表以及财务报表附注,并出具了标准无保留意见的审计报告。

7 资产负债表  
会计主体:汇安嘉源纯债债券型证券投资基金  
报告截止日:2018年12月31日