汇安嘉鑫纯债债券型证券投资基金

2019年第二季度报告

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7月17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7月16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2019年4月1日起至2019年6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	汇安嘉鑫纯债债券
基金主代码	006625
交易代码	006625
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年11月26日
报告期末基金份额总额	5,064,479.27份
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回报。
投资策略	本基金的投资策略包括大类资产配置策略、债券组合管理策略。本基金将在综合判断宏观经济周期、市场资金供需状况、大类资产估值水平对比的基础上,结合政策分析,确定不同投资期限内的大类金融资产配置和债券类属配置。同时通过严格风险评估,及时调整资产组合比例,保持资产配置风险、收益平衡,以稳健提升投资组合回报。债券组合管理策略包括利率策略、类属配置策略、信用策略、相对价值策略、债券选择策略、中小企业私募债投资策略、资产支持证券等品种投资策略、国债期货投资策略等。
业绩比较基准	中债综合指数(全价)收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金,属证券投资基金中的较低风险品种,其长期平均预期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(2019年4月1日 - 2019年6月30日)
1.本期已实现收益	22,968.04
2.本期利润	17,218.14
3.加权平均基金份额本期利润	0.0034
4.期末基金资产净值	5,791,218.82
5.期末基金份额净值	1.1436

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。

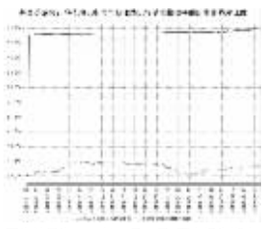
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

阶段	净值增长率①	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
过去三个月	0.30%	0.03%	-0.24%	0.06%	0.54%	-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本基金合同生效日为2018年11月26日,至本报告期末,本基金合同生效未满一年。

②根据《汇安嘉鑫纯债债券型证券投资基金基金合同》的规定,本基金的投资范围为债券(包括国内依法发行上市的国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、地方政府债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、可分离交易可转债的纯债部分、中小企业私募债)、债券回购、资产支持证券、同业存单、银行存款、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的相关规定)。基金的投资组合比例为:本基金对债券的投资比例不低于基金资产的80%,每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后,现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%,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,本基金已完成建仓但报告期末距建仓结束不满一年。建仓期为2018年11月26日至2019年5月25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 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
杨芳	固定收益投资部副总经理、本基金的基金经理	2018年11月26日	-	8年	杨芳,经济学学士,8年证券、基金行业从业经历。曾任职于华创证券,2016年7月起加入汇安基金管理有限责任公司,任固定收益投资部高级经理一职。2017年4月14日至今,任汇安嘉裕纯债债券型证券投资基金基金经理;2017年4月28日至今,任汇安嘉汇纯债债券型证券投资基金、汇安嘉源纯债债券型证券投资基金基金经理;2018年2月7日至今,任汇安裕华纯债定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理;2018年3月27日至今,任汇安稳裕债券型证券投资基金基金经理;2018年11月7日至今,任汇安短债债券型证券投资基金基金经理;2018年11月26日至今,任汇安嘉鑫纯债债券型证券投资基金基金经理;2019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;2019年3月20日至今,任汇安鼎利纯债债券型证券投资基金基金经理。

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,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 报告期内基金投资策略和运作分析

二季度国内宏观经济面临较大下行压力,地产投资一枝独秀但可能后劲不足;消费增速低位徘徊;进出口受贸易摩擦和全球宏观走弱影响较大。贸易战叠加全球经济降温,以美联储降息为代表,全球重回降息周期,中国的货币政策亦重回宽松。受到包商银行事件影响,债券市场流动性分层与信用分层持续发酵,存款机构间的回购利率频频低于1%,而非银机构则融资困难,若情况持续,未来会影响部分民营企业与城投平台债券的融资滚动。

内外需均走弱,为债券产品投资创造了良好的投资环境,但目前十年国债利率处于历史相对低点,已充分反映降准乃至降息预期,进一步下行空间有限。信用债总体收益率压缩明显,需更为小心甄别资质,在审慎信用分析的前提下可适当优选投资标的。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为1.1435元;本报告期基金份额净值增长率为0.30%,业绩比较基准收益率为-0.24%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金自2019年4月1日至2019年6月25日连续五十七个工作日基金份额持有人数量不满二百人,并且本基金自2019年4月1日至2019年6月30日连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中:股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	5,003,000.00	85.88
	其中:债券	5,003,000.00	85.88
	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	695,842.29	11.94
8	其他资产	126,746.96	2.18
9	合计	5,825,589.25	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

5.2.2 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。

5.3 报告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

本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	5,003,000.00	86.39
	其中:政策性金融债	5,003,000.00	86.39
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	5,003,000.00	86.39

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	108903	国开1804	50,000	5,003,000.00	86.39

注:本基金本报告期末仅持有上述1只债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

5.9.2 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。

5.9.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	282.42
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	126,064.86
5	应收申购款	399.68
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	126,746.96

5.10.4 报告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。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

5.10.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	5,070,146.40
报告期期间基金总申购份额	7,093.22
减:报告期期间基金总赎回份额	12,760.35
报告期期末基金份额总额	5,064,479.27

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。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

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。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

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。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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	20190401-20190630	3,016,094.73	-	-	3,016,094.73	59.55%
	2	20190401-20190630	1,999,000.00	-	-	1,999,000.00	39.47%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
本基金本报告期内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。							

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准汇安嘉鑫纯债债券型证券投资基金募集的文件

2、汇安嘉鑫纯债债券型证券投资基金基金合同

3、汇安嘉鑫纯债债券型证券投资基金托管协议

4、汇安嘉鑫纯债债券型证券投资基金招募说明书

5、报告期内在指定报刊上披露的各项公告

6、中国证监会规定的其他文件

9.2 存放地点

北京市东城区东直门南大街5号中青旅大厦13层

上海市虹口区东大名路501白玉兰大厦36层02-03室

9.3 查阅方式

投资者可到基金管理人的办公场所及网站或基金托管人的办公场所免费查阅备查文件,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。

公司网站:http://www.huianfund.cn/

汇安基金管理有限责任公司

2019年7月17日

汇安嘉源纯债债券型证券投资基金

2019年第二季度报告

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7月17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7月16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2019年4月1日起至2019年6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	汇安嘉源纯债债券
基金主代码	003888
交易代码	003888
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年12月22日
报告期末基金份额总额	693,647,910.36份
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回报。
投资策略	本基金采用的投资策略包括大类资产配置策略和债券组合管理策略,其中债券组合管理策略包括利率策略、类属配置策略、信用策略、相对价值策略、债券选择策略、中小企业私募债投资策略、资产支持证券等品种投资策略、国债期货投资证券策略。
业绩比较基准	中债新综合财富(总值)指数收益率*95%+金融机构人民币活期存款利率(税后)*5%。
风险收益特征	本基金为债券型基金,属证券投资基金中的较低风险品种,其长期平均预期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(2019年4月1日 - 2019年6月30日)
1.本期已实现收益	7,212,059.17
2.本期利润	4,803,448.73
3.加权平均基金份额本期利润	0.0069
4.期末基金资产净值	712,868,870.58
5.期末基金份额净值	1.0277

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。

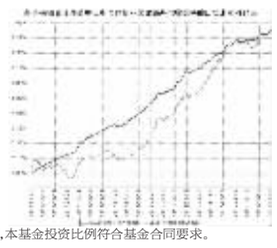
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

阶段	净值增长率①	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
过去三个月	0.68%	0.03%	0.62%	0.06%	0.06%	-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:本报告期,本基金投资比例符合基金合同要求。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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	2016年12月22日	-	13年	仇秉则,CFA,CPA,中山大学经济学学士,13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4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;2017年1月10日至2019年1月10日,任汇安丰华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;2019年5月10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。
杨芳	固定收益投资部副总经理、本基金的基金经理	2017年4月28日	-	8年	杨芳,经济学学士,8年证券、基金行业从业经历。曾任职于华创证券,2016年7月起加入汇安基金管理有限责任公司,任固定收益投资部高级经理一职。2017年4月14日至今,任汇安嘉裕纯债债券型证券投资基金基金经理;2017年4月28日至今,任汇安嘉汇纯债债券型证券投资基金、汇安嘉源纯债债券型证券投资基金基金经理;2018年2月7日至今,任汇安裕华纯债定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理;2018年3月27日至今,任汇安稳裕债券型证券投资基金基金经理;2018年11月7日至今,任汇安短债债券型证券投资基金基金经理;2018年11月26日至今,任汇安嘉鑫纯债债券型证券投资基金基金经理;2019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;2019年3月20日至今,任汇安鼎利纯债债券型证券投资基金基金经理。

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,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 报告期内基金投资策略和运作分析

二季度国内宏观经济面临较大下行压力,地产投资一枝独秀但可能后劲不足;消费增速低位徘徊;进出口受贸易摩擦和全球宏观走弱影响较大。贸易战叠加全球经济降温,以美联储降息为代表,全球重回降息周期,中国的货币政策亦重回宽松。受到包商银行事件影响,债券市场流动性分层与信用分层持续发酵,存款机构间的回购利率频频低于1%,而非银机构则融资困难,若情况持续,未来会影响部分民营企业与城投平台债券的融资滚动。

内外需均走弱,为债券产品投资创造了良好的投资环境,但目前十年国债利率处于历史相对低点,已充分反映降准乃至降息预期,进一步下行空间有限。信用债总体收益率压缩明显,需更为小心甄别资质,在审慎信用分析的前提下可适当优选投资标的。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为1.0277元;本报告期基金份额净值增长率为0.68%,业绩比较基准收益率为0.62%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中:股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	703,565,000.00	98.63
	其中:债券	703,565,000.00	98.63
	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	1,106,258.87	0.16
8	其他资产	8,672,869.22	1.22
9	合计	713,344,128.09	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

5.2.2 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。

5.3 报告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

本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	190,549,000.00	26.73
	其中:政策性金融债	160,564,000.00	22.52
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	210,734,000.00	29.56
6	中期票据	185,610,000.00	26.04
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	116,672,000.00	16.37
9	其他	-	-
10	合计	703,565,000.00	98.69

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	101760024	17合建投MTN001	600,000	62,730,000.00	8.80
2	101800070	18汇金MTN001	600,000	61,914,000.00	8.69
3	101761017	17江门建设MTN001	500,000	50,890,000.00	7.14
4	011900176	19中节能SCP001	500,000	50,225,000.00	7.05
5	011901022	19京代投SCP002	500,000	50,110,000.00	7.03

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

5.9.2 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。

5.9.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	8,672,869.22
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,672,869.22

5.10.4 报告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。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

5.10.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	693,647,910.36
报告期期间基金总申购份额	-
减:报告期期间基金总赎回份额	-
报告期期末基金份额总额	693,647,910.36

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。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

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。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

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。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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	20190401-20190630	693,646,840.80	-	-	693,646,840.80	99.9998%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
本基金本报告期内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。							

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准汇安嘉源纯债债券型证券投资基金募集的文件

2、汇安嘉源纯债债券型证券投资基金基金合同

3、汇安嘉源纯债债券型证券投资基金托管协议

4、汇安嘉源纯债债券型证券投资基金招募说明书

5、报告期内在指定报刊上披露的各项公告

6、中国证监会规定的其他文件

9.2 存放地点

北京市东城区东直门南大街5号中青旅大厦13层

上海市虹口区东大名路501白玉兰大厦36层02-03室

9.3 查阅方式

投资者可到基金管理人的办公场所及网站或基金托管人的办公场所免费查阅备查文件,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。

公司网站:http://www.huianfund.cn/

汇安基金管理有限责任公司

2019年7月17日

汇安量化优选灵活配置混合型证券投资基金

2019年第二季度报告

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7月17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7月16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2019年4月1日起至2019年6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	汇安量化优选
基金主代码	005699
交易代码	005699
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年7月26日
报告期末基金份额总额	78,006,575.72份
投资目标	本基金通过数量化方法进行投资组合管理,在严格控制风险并保持资产流动性的前提下,力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金通过合理稳健的资产配置策略,将基金资产在股票类资产和债券类资产之间灵活配置,以精确化的数学化化方式控制各个维度的风险暴露。在个股选择方面,本基金在基金管理人成熟的量化选股框架下挖掘具有超额收益的股票组合,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、债券类资产投资策略、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×55%+上证国债指数收益率×45%
风险收益特征	本基金为混合型基金,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。
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
下属分级基金的基金简称	汇安量化优选A / 汇安量化优选C
下属分级基金的交易代码	005699 / 005600
报告期末下属分级基金的份额总额	76,393,674.29份 / 1,612,901.43份

§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(2019年4月1日 - 2019年6月30日)	
	汇安量化优选A	汇安量化优选C
1. 本期已实现收益	1,166,008.65	66,366.44
2. 本期利润	3,376,271.87	-47,219.14
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0659	-0.0267
4. 期末基金资产净值	78,641,372.30	1,646,720.21
5. 期末基金份额净值	1.0294	1.0210

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

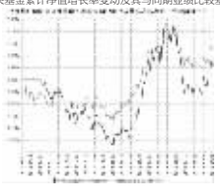
汇安量化优选A

阶段	净值增长率①	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
过去三个月	-3.81%	1.40%	0.05%	0.86%	-3.86%	0.54%

汇安量化优选C

阶段	净值增长率①	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
过去三个月	-4.01%	1.40%	0.05%	0.86%	-4.06%	0.54%

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本基金合同生效日为2018年7月26日,至本报告期末,本基金合同生效未满一年。

②根据《汇安量化优选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、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、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、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)。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。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,本基金已完成建仓但报告期末距建仓结束不满一年。建仓期为2018年7月26日至2019年1月25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 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
戴杰	指数与