汇安丰利灵活配置混合型证券投资基金

2019 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:兴业银行股份有限公司
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。

基金托管人兴业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。

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2019年1月1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	汇安丰利混合	
基金主代码	003886	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016年12月19日	
基金管理人	汇安基金管理有限责任公司	
基金托管人	兴业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	138,078,153.10份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	汇安丰利混合A	汇安丰利混合C
下属分级基金的交易代码:	003886	003887
报告期末下属分级基金的份额总额	135,829.08份	137,942,324.02份

2.2基金产品说明

投资目标	本基金在深入的基本面研究的基础上,通过灵活的资产配置、策略配置与严谨的风险管理,力争实现基金资产的持续稳定增值。
投资策略	本基金通过合理稳健的资产配置策略,将基金资产在权益类资产和固定收益类资产之间灵活配置,同时采取积极主动的股票投资和债券投资策略,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、固定收益类资产投资策略、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×50%+上证国债指数收益率×50%。
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中等的投资品种,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	兴业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	郭冬青	曾麓燕
	联系电话	01056711600	021-52629999-212040
	电子邮箱	guodq@huianfund.cn	zengluyan@cib.com.cn
客户服务电话		01056711690	95561
传真		01056711640	021-62535823

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	汇安丰利混合A	汇安丰利混合C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019年1月1日 - 2019年6月30日)	报告期(2019年1月1日 - 2019年6月30日)
本期已实现收益	-2,992.05	-1,927,391.40
本期利润	53,726.77	-1,669,138.22
加权平均基金份额本期利润	0.1106	-0.0259
本期基金份额净值增长率	2.16%	2.70%
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	-0.1635	-0.1711
期末基金资产净值	121,542.79	121,693,685.94
期末基金份额净值	0.8948	0.8822

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。

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

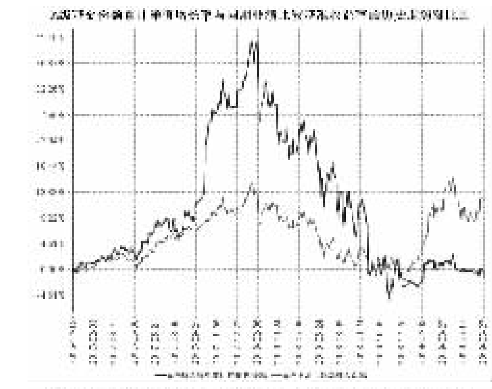
汇安丰利混合A

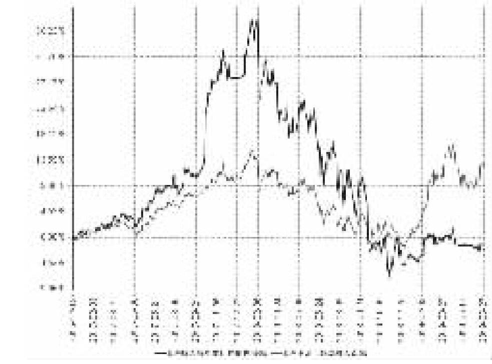
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-0.75%	0.32%	2.92%	0.59%	-3.67%	-0.27%
过去三个月	-2.10%	0.31%	-0.06%	0.77%	-2.04%	-0.46%
过去六个月	2.16%	0.40%	14.27%	0.78%	-12.11%	-0.38%
过去一年	-14.91%	0.98%	7.61%	0.76%	-22.52%	0.22%
自基金合同生效起至今	-0.90%	0.86%	12.61%	0.58%	-13.51%	0.28%

汇安丰利混合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	-0.75%	0.32%	2.92%	0.59%	-3.67%	-0.27%
过去三个月	-2.18%	0.30%	-0.06%	0.77%	-2.12%	-0.47%
过去六个月	2.70%	0.40%	14.27%	0.78%	-11.57%	-0.38%
过去一年	-14.41%	0.98%	7.61%	0.76%	-22.02%	0.22%
自基金合同生效起至今	-2.22%	0.85%	12.61%	0.58%	-14.83%	0.27%

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





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	2018年3月21日	2019年5月10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。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。
仇秉则	固定收益投资部副总经理、本基金的基金经理	2019年5月10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6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。
朱晨歌	指数与量化投资部高级经理、本基金的基金经理	2018年2月8日	2019年5月10日	4年	朱晨歌,复旦大学理论物理硕士,4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事业部数量分析师、投资经理,从事量化投资研究工作。2017年12月29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。2018年2月8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;2018年4月26日至2019年5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;2018年2月8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8月9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;2018年8月22日至今,任汇安沪深300指数增强型证券投资基金;2019年3月13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;2019年6月14日至今,任富时中国A50交易型开放式指数证券投资基金基金经理。
戴杰	指数与量化投资部高级经理、本基金的基金经理	2017年7月19日	2019年3月8日	5年	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

上半年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。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末汇安丰利混合A基金份额净值为0.8948元,本报告期基金份额净值增长率为2.16%;截至本报告期末汇安丰利混合C基金份额净值为0.8822元,本报告期基金份额净值增长率为2.70%;同期业绩比较基准收益率为14.27%。

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:内外需均走弱,为利率债投资创造了良好的投资环境,但目前国债与政策性金融债的利率处于历史相对低点,已较为充分的反映了降准乃至降息预期。信用债总体收益率压缩明显,需更为小心甄别资质。股票市场演绎结构化行情,核心资产总体处合理估值区间,是较具吸引力的资产类属。

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

报告期内,本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,诚信、尽责地履行了基金托管人义务,不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内,本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查,未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为;基金管理人在报告期内,严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规,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

本托管人认真复核了本半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,认为其真实、准确和完整,不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§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:汇安丰利灵活配置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	上年度末 2018年12月31日
资 产:		
银行存款	146,848,626.85	11,442,048.82
结算备付金	115,310.08	-
存出保证金	32,445.45	102,886.17
交易性金融资产	-	1,234,015.30
其中:股票投资	-	1,234,015.30
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	4,607,596.79	-
应收利息	42,608.30	2,153.44
应收股利	-	-
应收申购款	-	199.70
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	151,646,587.47	12,781,303.43
负债和所有者权益	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31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	29,568,080.36	-
应付管理人报酬	51,734.39	1,454.65
应付托管费	8,622.39	242.45
应付销售服务费	8,612.35	101.26
应付交易费用	92,711.85	26,059.83
应交税费	0.36	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	101,597.04	140,000.00
负债合计	29,831,358.74	167,858.19
所有者权益:		
实收基金	138,078,153.10	14,656,569.46
未分配利润	-16,262,924.37	-2,043,124.22
所有者权益合计	121,815,228.73	12,613,445.24
负债和所有者权益总计	151,646,587.47	12,781,303.43

注:报告截止日2019年6月30日,汇安丰利混合A基金份额净值0.8948元,基金份额总额135,829.08份;汇安丰利混合C基金份额净值0.8822元,基金份额总额137,942,324.02份。汇安丰利混合份额总额合计138,078,153.10份。

6.2利润表

会计主体:汇安丰利灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2019年1月1日至2019年6月30日

单位:人民币元

项 目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
一、收入	-1,152,955.46	-13,851,780.94
1.利息收入	549,639.19	576,575.76
其中:存款利息收入	288,654.21	233,160.40
债券利息收入	244,817.65	190,108.87
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	16,167.33	153,306.49
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	-2,049,292.32	-9,073,560.02
其中:股票投资收益	-1,793,166.66	-10,531,459.12
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-270,464.63	123,582.57
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	126,702.00
股利收益	14,338.97	1,207,614.53
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	314,972.00	-8,631,972.79
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	31,725.67	3,277,176.11
减:二、费用	462,455.99	1,462,762.62
1.管理人报酬	169,648.13	485,721.56
2.托管费	28,274.63	80,953.57
3.销售服务费	28,047.51	14,561.58
4.交易费用	205,246.40	777,827.52
5.利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6.税金及附加	6.54	858.17
7.其他费用	31,232.78	102,840.22
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	-1,615,411.45	-15,314,543.56
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	-1,615,411.45	-15,314,543.56

6.3所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:汇安丰利灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2019年1月1日至2019年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2019年1月1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)	14,656,569.46	-2,043,124.22	12,613,445.24
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-1,615,411.45	-1,615,411.45
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)	123,421,583.64	-12,604,388.70	110,817,194.94
其中:1.基金申购款	183,973,484.28	-19,438,515.03	164,534,969.25
2.基金赎回款	-60,551,900.64	6,834,126.33	-53,717,774.31
五、期末所有者权益(基金净值)	138,078,153.10	-16,262,924.37	121,815,228.73
项目	上年度可比期间 2018年1月1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)	528,233,165.61	95,600,110.69	623,833,276.30
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-15,314,543.56	-15,314,543.56
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)	-415,863,554.21	-74,700,837.58	-490,564,391.79
其中:1.基金申购款	48,508,810.02	7,932,838.36	56,441,648.38
2.基金赎回款	-464,372,364.23	-82,633,675.94	-547,006,040.17
五、期末所有者权益(基金净值)	112,369,611.40	5,584,729.55	117,954,340.95

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:

秦军	窦星华	江士
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

汇安丰利灵活配置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[2016]2721号《关于准予汇安丰利灵活配置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《汇安丰利灵活配置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299,000,067.04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(2016)第1664号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《汇安丰利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2016年12月19日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为299,013,522.04份基金份额,其中认购资金利息折合13,455.00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,基金托管人为兴业银行股份有限公司(以下简称"兴业银行")。

根据《汇安丰利灵活配置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《汇安丰利灵活配置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、中小企业私募债等)、债券回购、同业存单、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)。本基金的投资组合比例为: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、国债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,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等;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。本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×50%+上证国债指数收益率×50%。

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2019年6月30日的财务状况以及2019年1月1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本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

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、登记机构、基金销售机构
兴业银行股份有限公司("兴业银行")	基金托管人
何斌	基金管理人股东
秦军	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

注:1. 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

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

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1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	169,648.13	485,721.56
其中:支付销售机构的客户维护费	25.48	24.42

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0.60%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 X 0.60% / 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1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	28,274.63	80,953.57

注:支付基金托管人兴业银行的托管费按前一日基金资产净值0.10%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 X 0.10% / 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1月1日至2019年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	汇安丰利混合A	汇安丰利混合C	合计
汇安基金	-	28,043.46	28,043.46
兴业银行	-	-	-
合计	-	28,043.46	28,043.46
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	汇安丰利混合A	汇安丰利混合C	合计
汇安基金	-	14,552.77	14,552.77
兴业银行	-	-	-
合计	-	14,552.77	14,552.77

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0.10%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× 0.10% / 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

本基金本报告期内及上年度可比期间未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及上年度可比期间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及上年度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1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
兴业银行	146,848,626.85	286,709.59	13,859,912.61	188,588.38

注:本基金的活期银行存款由基金托管人兴业银行保管,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

本基金本报告期内及上年度可比期间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

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

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

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。

6.4.9.2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。

6.4.9.3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(%)
7	银行存款和结算备付金合计	146,963,936.93	96.91
8	其他各项资产	4,682,650.54	3.09
9	合计	151,646,587.47	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

本基金本报告期末未持有股票。

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前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

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初基金资产净值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	占期初基金资产净值比例(%)
1	002396	星网锐捷	9,367,462.17	74.27
2	002129	中环股份	9,180,028.00	72.78
3	600010	包钢股份	8,746,752.00	69.34
4	300316	晶盛机电	7,564,345.16	59.97
5	000651	格力电器	5,249,820.00	41.62
6	603019	中科曙光	5,222,948.00	41.41
7	600332	白云山	4,741,345.08	37.59
8	300065	海兰信	4,202,058.24	33.31
9	600588	用友网络	3,688,136.90	29.24
10	600486	扬农化工	3,520,659.40	27.91
11	002049	紫光国芯	3,313,845.00	26.27
12	002191	劲嘉股份	2,002,314.62	15.87
13	002589	瑞康医药	1,892,101.00	15.00
14	600583	海油工程	1,481,680.00	11.75
15	600572	康恩贝	1,282,334.00	10.17
16	601818	光大银行	1,251,400.00	9.92
17	601869	长飞光纤	1,145,280.00	9.08
18	000690	宝新能源	829,700.29	6.58
19	002151	北斗星通	713,048.00	5.65
20	600372	中航电子	596,400.00	4.73
21	600490	鹏欣资源	592,958.00	4.70
22	600460	士兰微	506,852.00	4.02
23	603020	爱普股份	409,153.00	3.24
24	002050	三花智控	305,448.00	2.42
25	603066	音飞储存	254,361.00	2.02

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初基金资产净值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	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002396	星网锐捷	9,250,771.00	73.34
2	002129	中环股份	9,239,641.00	73.25
3	600010	包钢股份	8,600,000.00	68.18
4	300316	晶盛机电	7,393,748.60	58.62
5	000651	格力电器	5,134,864.00	40.71
6	600332	白云山	4,836,425.04	38.34
7	603019	中科曙光	4,612,618.40	36.57
8	300065	海兰信	4,294,609.76	34.05
9	600588	用友网络	3,762,913.71	29.83
10	600486	扬农化工	3,326,268.88	26.37
11	002049	紫光国芯	3,316,081.00	26.29
12	002191	劲嘉股份	1,920,101.00	15.22
13	002589	瑞康医药	1,729,447.50	13.71
14	600572	康恩贝	1,365,155.45	10.82
15	601138	工业富联	1,342,005.70	10.64
16	600583	海油工程	1,331,226.36	10.55
17	601818	光大银行	1,237,000.00	9.81
18	601869	长飞光纤	971,555.00	7.70
19	000690	宝新能源	737,665.00	5.85
20	002151	北斗星通	711,202.00	5.64
21	600490	鹏欣资源	640,188.00	5.08
22	600372	中航电子	592,062.00	4.69
23	600460	士兰微	475,500.00	3.77
24	603020	爱普股份	407,020.00	3.23
25	002050	三花智控	305,700.00	2.42
26	603606	东方电缆	292,800.00	2.32

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。

7.4.3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	78,301,428.76
卖出股票收入(成交)总额	78,057,249.40

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

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

本基金本报告期末未投资国债期货。

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

本基金本报告期未投资国债期货。

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	32,445.45
2	应收证券清算款	4,607,596.79
4	应收利息	42,608.30
9	合计	4,682,650.54

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
汇安丰利混合A	220	617.40	133,236.14	98.091027%	2,592.94	1.908973%
汇安丰利混合C	7	19,706,046.29	137,940,740.54	99.998852%	1,583.48	0.001148%
合计	227	608,273.80	138,073,976.68	99.996975%	4,176.42	0.003025%

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	汇安丰利混合A	83.98	0.06182770%
	汇安丰利混合C	0.00	0.00000000%
	合计	83.98	0.00006082%

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	汇安丰利混合A	0
	汇安丰利混合C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	汇安丰利混合A	0
	汇安丰利混合C	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位:份

项目	汇安丰利混合A	汇安丰利混合C
基金合同生效日(2016年12月19日)基金份额总额	294,013,297.04	5,000,225.00
本报告期期初基金份额总额	1,366,085.61	13,290,483.85
本报告期期间基金总申购份额	22,596.37	183,950,887.91
减:本报告期期间基金总赎回份额	1,252,852.90	59,299,047.74
本报告期期末基金份额总额	135,829.08	137,942,324.02

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。

自2019年1月22日起,叶文煌先生担任基金托管人资产托管部总经理,全面主持资产托管部相关工作,吴若曼女士不再担任基金托管人资产托管部总经理。

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(2016年12月19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	
银河证券	2	156,358,678.16	100.00%	111,218.16	100.00%	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
山西证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	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

本基金本报告期内无交易单元变更。

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
银河证券	52,845,165.92	78.66%	109,000,000.00	100.00%	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	14,334,635.63	21.34%	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-

§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	20190101-20190220	5,823,433.50	-	-	5,823,433.50	4.2175%
	2	20190319-20190626	-	33,482,142.86	33,482,142.86	-	0.0000%
	3	20190221-20190423	-	16,668,518.72	-	16,668,518.72	12.0718%
	4	20190221-20190402	-	18,335,370.60	18,335,370.60	-	-
	5	20190424-20190630	-	28,305,028.31	-	28,305,028.31	20.4993%
	6	20190424-20190630	-	30,525,030.53	-	30,525,030.53	22.1071%
	7	20190627-20190630	-	56,618,729.48	-	56,618,729.48	41.0048%
个人	1	20190101-20190102	6,347,542.51	-	6,347,542.51	-	0.0000%
-	-	-	-	-	-	-	-
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。							

汇安基金管理有限责任公司

2019年8月29日