

汇安沪深 300 指数增强型证券投资基金 2019 年半年度报告

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：上海浦东发展银行股份有限公司

送出日期：2019 年 8 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

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 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。

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
§4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	14
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.....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
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.....	15
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	16
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	16
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	17
6.1 资产负债表.....	17
6.2 利润表.....	18
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19

6.4 报表附注.....	20
§7 投资组合报告.....	39
7.1 期末基金资产组合情况.....	39
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	39
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	51
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.....	51
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序所有资产支持证券投资明细.....	51
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.....	51
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.....	51
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	52
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	52
7.12 投资组合报告附注.....	53
§8 基金份额持有人信息.....	54
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	54
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	54
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.....	54
§9 开放式基金份额变动.....	55
§10 重大事件揭示.....	56
10.1 基金份额持有人大会决议.....	56
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.....	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	56
10.4 基金投资策略的改变.....	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	56
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.....	56
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	56
10.8 其他重大事件.....	58
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	59
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.....	59

§12 备查文件目录	60
12.1 备查文件目录.....	60
12.2 存放地点.....	60
12.3 查阅方式.....	60

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	汇安沪深 300 指数增强型证券投资基金	
基金简称	汇安沪深 300 增强	
基金主代码	003884	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 7 月 3 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	
报告期末基金份额总额	65,518,607.25 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	汇安沪深 300 增强 A	汇安沪深 300 增强 C
下属分级基金的交易代码:	003884	003885
报告期末下属分级基金的份额总额	60,156,669.07 份	5,361,938.18 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为增强型股票指数基金,在严格控制对沪深 300 指数跟踪误差的基础上,通过量化投资方式进行积极的组合管理和风险控制,力求实现超越沪深 300 指数的投资收益和基金财产的长期增值。
投资策略	本基金为增强型股票指数基金,在目标指数成分股权重的基础上根据量化模型优化投资组合,力争在控制跟踪误差的基础上获取超越目标指数的投资收益。本基金投资策略主要包括资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、中小企业私募债投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、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×95%+银行活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金,其风险收益水平高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。本基金为指数型基金,具有与标的指数相似的风险收益特征。

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	上海浦东发展银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	郭冬青
	联系电话	01056711600
	电子邮箱	guodq@huianfund.cn
客户服务电话	01056711690	95528
传真	01056711640	021-63602540
注册地址	上海市虹口区欧阳路 218	上海市中山东一路 12 号

	弄 1 号 2 楼 215 室	
办公地址	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 号白玉兰大厦 36 层	上海市北京东路 689 号
邮政编码	100007	200001
法定代表人	秦军	高国富

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	汇安基金管理有限责任公司	北京东城区东直门南大街 5 号中青旅大厦 1301

§ 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	汇安沪深 300 增强 A	汇安沪深 300 增强 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	1,869,840.06	122,177.73
本期利润	4,783,545.33	228,539.38
加权平均基金份额本期利润	0.2569	0.2199
本期加权平均净值利润率	24.10%	21.91%
本期基金份额净值增长率	22.21%	22.07%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	2,652,140.91	-153,777.95
期末可供分配基金份额利润	0.0441	-0.0287
期末基金资产净值	67,096,206.82	5,571,986.88
期末基金份额净值	1.1154	1.0392
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	11.54%	3.92%

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

汇安沪深 300 增强 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	4.41%	1.08%	5.13%	1.10%	-0.72%	-0.02%
过去三个月	-0.99%	1.44%	-1.11%	1.45%	0.12%	-0.01%
过去六个月	22.21%	1.45%	25.65%	1.47%	-3.44%	-0.02%

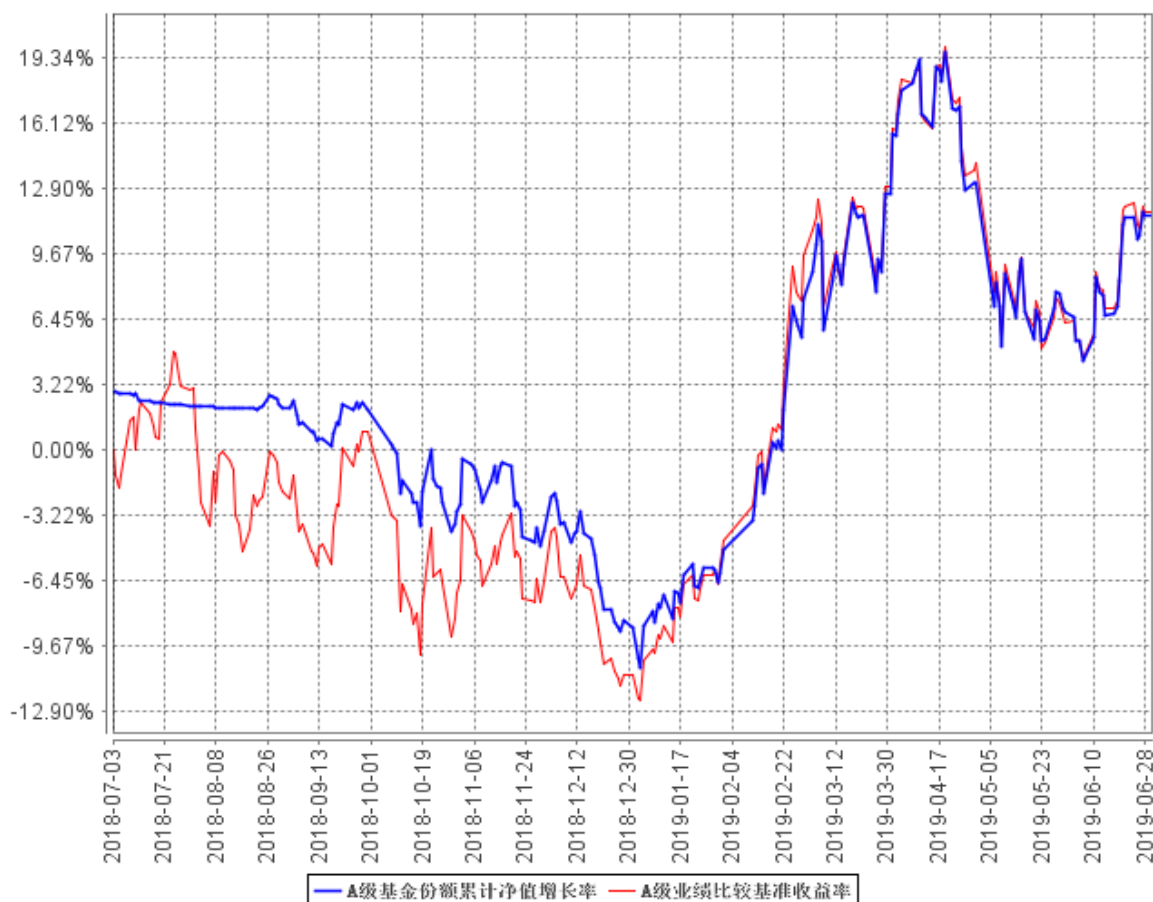
自基金合同生效起至今	11.54%	1.14%	11.78%	1.45%	-0.24%	-0.31%
------------	--------	-------	--------	-------	--------	--------

汇安沪深 300 增强 C

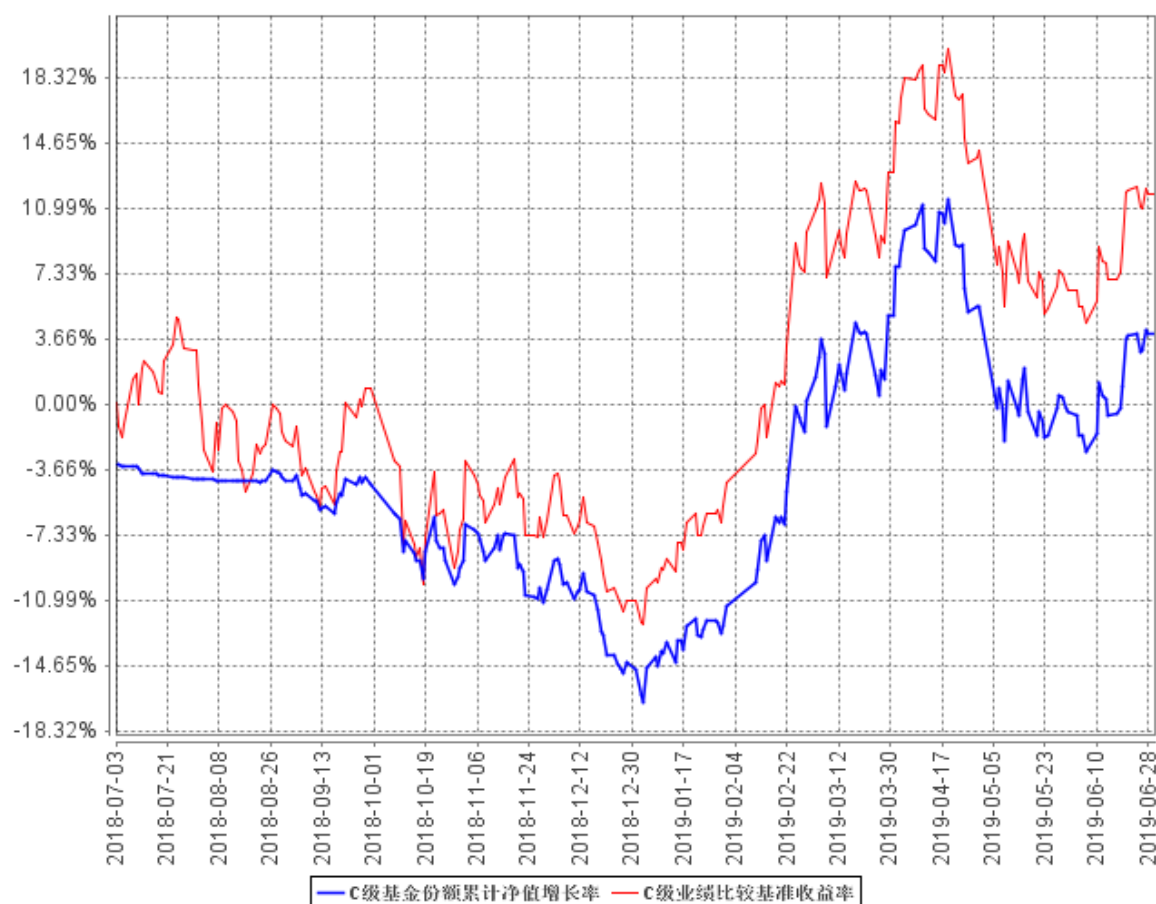
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	4.39%	1.08%	5.13%	1.10%	-0.74%	-0.02%
过去三个月	-0.99%	1.44%	-1.11%	1.45%	0.12%	-0.01%
过去六个月	22.07%	1.45%	25.65%	1.47%	-3.58%	-0.02%
自基金合同生效起至今	3.92%	1.15%	11.78%	1.45%	-7.86%	-0.30%

3.2.2 自基金转型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本基金实施转型日为 2018 年 7 月 3 日，至本报告期末，本基金实施转型未满一年。

②根据《汇安沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》的规定，本基金投资于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、超短期融资券、可交换债券、可转换债券（含分离交易可转债）、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、通知存款及其他银行存款）、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：本基金股票资产投资比例不低于基金资产的 80%，其中投资于沪深 300 指数成分股及其备选成分股的比例不低于非现金基金资产的 80%；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，本基金持有现金或者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。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。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 3 日至 2019 年 1 月 2 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		
计伟	指数与量化投资部副总经理、本基金的基金经理	2018 年 1 月 11 日	-	12 年	计伟，ACCA，工商管理硕士，12 年证券、基金行业从业经历，曾任中国国际金融有限公司运作分析师；华安基金管理有限公司指数与量化投资事业总部专户投资经理、公募基金经理与事业部产品负责人，同时担任华安基金风险管理委员会委员。2016 年 7 月 1 日加入汇安基金管理有限责任

					公司，任指数与量化投资部副总经理一职。2018 年 1 月 11 日至 2018 年 7 月 2 日，任汇安丰泰灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2018 年 3 月 7 日至 2019 年 4 月 4 日，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 4 月 2 日至 2019 年 4 月 4 日，任汇安稳裕债券型证券投资基金基金经理；2017 年 9 月 6 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；2018 年 7 月 3 日至今，任汇安沪深 300 指数增强型证券投资基金基金经理；2018 年 12 月 21 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。
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 8 月 22 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。

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 年上半年，在政策托底和情绪改善的作用下，权益市场在一季度大幅上涨；二季度，经济基本面数据并未明显改善，对经济复苏的预期有所回落，再加上中美贸易谈判出现反复，对投资者风险偏好造成一定压制，市场整体呈现震荡态势。投资者对经济基本面和外部环境的担忧也反映在了股市中，各个行业的龙头企业超额收益仍然十分明显，尤其是大消费板块，反映出较强的逆周期属性，也获得了资金的持续青睐。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末汇安沪深 300 增强 A 基金份额净值为 1.1154 元，本报告期基金份额净值增长率为 22.21%；截至本报告期末汇安沪深 300 增强 C 基金份额净值为 1.0392 元，本报告期基金份额净值增长率为 22.07%；同期业绩比较基准收益率为 25.65%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望三季度，宏观经济仍在筑底过程中，中美贸易谈判仍有不确定性，市场预计将更多呈现结构性行情。在我国金融市场改革开放的大背景下，优质白马蓝筹股作为中国资本市场的核心资产，仍将是海内外中长期投资者的首选配置标的；另外随着科创板正式开板，投资者对于相关板块的关注度将有所提高，一些质地优良，估值合理的成长股同样存在机会。作为基金管理人，我们将继续勤勉尽责，采用量化方法适度增强，力争为投资者获得长期稳定的回报。

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

本基金自 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 14 日连续一百零八个工作日基金资产净值低于五千万万元。

§ 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”）在对汇安沪深 300 指数增强型证券投资基金的托管过程中，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、托管协议的规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行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，本托管人依照《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、托管协议的规定，对汇安沪深 300 指数增强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。该基金本报告期内未进行利润分配。

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、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在本托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 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：汇安沪深 300 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	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	6.4.7.1	4,377,372.82	1,140,607.84
结算备付金		3,864,687.68	107,345.87
存出保证金		608,421.83	8,318.89
交易性金融资产	6.4.7.2	63,805,578.99	11,224,405.00
其中：股票投资		63,805,578.99	11,224,405.00
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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	2,798.69	780.23
应收股利		-	-
应收申购款		360,040.78	21,805.19
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		73,018,900.79	12,503,263.02
负债和所有者权益	附注号	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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		27,354.27	28,097.31
应付管理人报酬		41,194.38	10,503.97
应付托管费		4,119.43	1,050.41
应付销售服务费		715.98	61.72
应付交易费用	6.4.7.7	47,787.08	41,282.12

应交税费		4,693.17	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	224,842.78	273,948.91
负债合计		350,707.09	354,944.44
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	65,518,607.25	13,351,206.61
未分配利润	6.4.7.10	7,149,586.45	-1,202,888.03
所有者权益合计		72,668,193.70	12,148,318.58
负债和所有者权益总计		73,018,900.79	12,503,263.02

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，汇安沪深 300 增强 A 基金份额净值 1.1154 元，基金份额总额 60,156,669.07 份；汇安沪深 300 增强 C 基金份额净值 1.0392 元，基金份额总额 5,361,938.18 份。汇安沪深 300 增强份额总额合计为 65,518,607.25 份。

6.2 利润表

会计主体：汇安沪深 300 指数增强型证券投资基金

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	附注号	本期	
		2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	
一、收入		5,410,600.87	
1.利息收入		21,670.34	
其中：存款利息收入	6.4.7.11	21,670.34	
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）		2,349,929.83	
其中：股票投资收益	6.4.7.12	1,780,983.96	
基金投资收益		-	
债券投资收益	6.4.7.13	-	
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.1	-	
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	
衍生工具收益	6.4.7.15	140,935.92	
股利收益	6.4.7.16	428,009.95	
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	3,020,066.92	
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	

5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	18,933.78
减：二、费用		398,516.16
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	101,543.98
2. 托管费	6.4.10.2.2	10,154.39
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	2,026.76
4. 交易费用	6.4.7.19	146,621.64
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		465.09
7. 其他费用	6.4.7.20	137,704.30
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		5,012,084.71
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		5,012,084.71

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汇安沪深 300 指数增强型证券投资基金

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）	13,351,206.61	-1,202,888.03	12,148,318.58
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	5,012,084.71	5,012,084.71
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）	52,167,400.64	3,340,389.77	55,507,790.41
其中：1.基金申购款	62,077,090.79	4,037,909.86	66,115,000.65
2. 基金赎回款	-9,909,690.15	-697,520.09	-10,607,210.24
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)	65,518,607.25	7,149,586.45	72,668,193.70

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

汇安沪深 300 指数增强型证券投资基金(以下简称“本基金”)是由汇安丰泰灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“汇安丰泰混合基金”)基金转型而来。根据本基金的基金管理人于 2018 年 7 月 3 日发布的《汇安基金管理有限责任公司关于汇安丰泰灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，基金份额持有人大会于 2018 年 7 月 2 日表决通过了《关于汇安丰泰灵活配置混合型证券投资基金转型的有关事项的议案》，同时根据《关于准予汇安丰泰灵活配置混合型证券投资基金变更注册的批复》(证监许可[2018]737 号)准予注册的批复，汇安丰泰混合基金于 2018 年 7 月 3 日实施转型。同日起，《汇安沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》生效，原《汇安丰泰灵活配置混合型证券投资基金基金合同》失效。原汇安丰泰混合基金 A 类基金份额转为本基金 A 类基金份额，原汇安丰泰混合基金 C 类基金份额转为本基金 C 类基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为汇安基金管理有限责任公司，基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司(以下简称“浦发银行”)。

根据《汇安沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》和《汇安沪深 300 指数增强型证券投资基金招募说明书》，本基金根据申购费与销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者申购基金时收取申购费用，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；在投资人申购时不收取申购费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，并在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额的，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。投资人可自行选择申购的基金份额类别。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《汇安沪深 300 指数增强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、超短期融资券、可交换债券、可转换债券(含分离交易可转)、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、通知存款及其他银行存款)、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:股票资产投资比例不低于基金资产的 80%,其中投资于沪深 300 指数成分股及其备选成分股的比例不低于非现金基金资产的 80%;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,本基金持有现金或者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;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 \times 95%+银行活期存款利率(税后) \times 5%。

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》、《汇安成长优选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 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
活期存款	4,377,372.82
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计：	4,377,372.82

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	61,145,810.93	63,805,578.99	2,659,768.06
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-

其他	-	-	-
合计	61,145,810.93	63,805,578.99	2,659,768.06

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日			备注
	合同/名义金 额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	4,462,944.00	-	-	
股指期货	4,462,944.00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	4,462,944.00	-	-	

注：衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。于 2019 年 6 月 30 日，本基金持有 2 手沪深 300 股指期货 IF1907、1 手沪深 300 股指期货 IF1908、1 手沪深 300 股指期货 IF1909，合约市值合计为 4,559,400.00，公允价值变动合计为 96,456.00 元；

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应收活期存款利息	2,626.79
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	97.30
应收债券利息	-

应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	67.50
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	7.10
合计	2,798.69

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
交易所市场应付交易费用	47,787.08
银行间市场应付交易费用	-
合计	47,787.08

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	47.59
预提费用	124,795.19
其他应付款_指数使用费	100,000.00
合计	224,842.78

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

汇安沪深 300 增强 A		
项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	12,749,148.20	12,749,148.20
本期申购	55,831,199.09	55,831,199.09
本期赎回(以“-”号填列)	-8,423,678.22	-8,423,678.22

本期末	60,156,669.07	60,156,669.07
-----	---------------	---------------

金额单位：人民币元

汇安沪深 300 增强 C		
项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	602,058.41	602,058.41
本期申购	6,245,891.70	6,245,891.70
本期赎回(以“-”号填列)	-1,486,011.93	-1,486,011.93
本期末	5,361,938.18	5,361,938.18

注：本期申购包含红利再投、转换入份额；本期赎回包含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

汇安沪深 300 增强 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-1,111,626.95	-1,749.43	-1,113,376.38
本期利润	1,869,840.06	2,913,705.27	4,783,545.33
本期基金份额交易产生的变动数	1,893,927.80	1,375,441.00	3,269,368.80
其中：基金申购款	1,928,987.07	2,105,304.06	4,034,291.13
基金赎回款	-35,059.27	-729,863.06	-764,922.33
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,652,140.91	4,287,396.84	6,939,537.75

单位：人民币元

汇安沪深 300 增强 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-90,241.83	730.18	-89,511.65
本期利润	122,177.73	106,361.65	228,539.38
本期基金份额交易产生的变动数	-185,713.85	256,734.82	71,020.97
其中：基金申购款	-307,931.21	311,549.94	3,618.73
基金赎回款	122,217.36	-54,815.12	67,402.24
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-153,777.95	363,826.65	210,048.70

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	20,623.57
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	946.91
其他	99.86
合计	21,670.34

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	41,556,912.52
减：卖出股票成本总额	39,775,928.56
买卖股票差价收入	1,780,983.96

6.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期内未发生债券投资收益。

6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额
----	--------

	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
国债期货投资收益	-
股指期货-投资收益	140,935.92

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	428,009.95
基金投资产生的股利收益	-
合计	428,009.95

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	2,923,610.92
——股票投资	2,923,610.92
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	96,456.00
减：应税金融商品公允价值变动产生的预 估增值税	-
合计	3,020,066.92

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	18,933.78
合计	18,933.78

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	146,621.64
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	146,621.64

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
审计费用	24,795.19
信息披露费	-
银行划款手续费	509.11
上清所证书使用费	400.00
账户维护费	12,000.00
其他费用_指数使用费	100,000.00
合计	137,704.30

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 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。

6.4.9.2 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
上海浦东发展银行股份有限公司（“浦发银行”）	基金托管人
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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 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
当期发生的基金应支付的管理费	101,543.98
其中：支付销售机构的客户维护费	51,572.03

注：支付基金管理人汇安基金管理有限责任公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 0.6% 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：日基金管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.6% / 当年天数。

6.4.10.2.2 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
当期发生的基金应支付的托管费	10,154.39

注：支付基金托管人浦发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×0.10% / 当年天数。

6.4.10.2.3 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		
	汇安沪深 300 增强 A	汇安沪深 300 增强 C	合计
汇安基金	-	842.54	842.54
浦发银行	-	-	-
合计	-	842.54	842.54

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× 0.40% / 当年天数。

6.4.10.3 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与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 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。

6.4.10.4.2 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

于本基金本报告期内除基金管理人以外的其他关联方未投资本基金。

6.4.10.5 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	
	期末余额	当期利息收入
浦发银行	4,377,372.82	20,623.57

注：本基金的活期银行存款由基金托管人浦发银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 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。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2019 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 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。

6.4.12.2 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。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 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。

6.4.12.3.2 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。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为股票型基金，其风险收益水平高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。本基金为指数型基金，具有与标的指数相似的风险收益特征。

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过管理及信息系统持续监控上述各类风险。

公司建立董事会领导下的风险管理体系，包括董事会的下设的风险控制委员会、总经理下设的风险管理委员会、督察长、合规风控部以及各个业务部门组成。

公司致力于实行全面、系统的风险管理，通过制定系统化的风险管理程序，对风险管理的整个流程进行评估和改进。公司奉行分工明确、相互协作、彼此牵制的风险管理组织结构，构建由

四大防线共同筑成的风险管理体系：第一道防线由各个业务部门构成，各业务部门总监作为风险责任人；第二道监控防线由合规风控部构成，对公司运营过程中产生的或潜在的各项风险进行有效管理，并就内部控制及风险管理制度的执行情况独立地履行检查、评价、报告、建议职能；第三道防线是由总经理及其下设的风险管理委员会构成，总经理负责公司日常经营管理中的风险管理工作。总经理下设风险管理委员会，负责对公司经营及基金运作中的风险进行研究、评估和防控；第四道监控防线由董事会及其下设公司风险控制委员会构成。董事会负责公司整体风险的预防和控制，审核、监督公司风险管理制度的有效执行。董事会下设公司风险控制委员会，协助董事会确立公司风险取向，风险总量、风险限额，制定和调整公司风险管理战略、原则、政策和指导方针，并确保其得到有效执行。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人浦发银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2019 年 6 月 30 日，本基金无债券投资(2018 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严

密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于 2019 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的合规风控部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2019 年 6 月 30 日，本基金未持有流动性受限资产。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于 2019 年 6 月 30 日，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值为 68,059,141.54 元，超过经确认的当日净赎回金额。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购

交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	4,377,372.82	-	-	-	4,377,372.82
结算备付金	3,864,687.68	-	-	-	3,864,687.68
存出保证金	15,699.83	-	-	592,722.00	608,421.83
交易性金融资产	-	-	-	63,805,578.99	63,805,578.99
应收利息	-	-	-	2,798.69	2,798.69
应收申购款	-	-	-	360,040.78	360,040.78
资产总计	8,257,760.33	-	-	64,761,140.46	73,018,900.79
负债					
应付证券清算款	-	-	-	96,456.00	96,456.00
应付赎回款	-	-	-	27,354.27	27,354.27
应付管理人报酬	-	-	-	41,194.38	41,194.38
应付托管费	-	-	-	4,119.43	4,119.43
应付销售服务费	-	-	-	715.98	715.98

应付交易费用	-	-	-	47,787.08	47,787.08
应交税费	-	-	-	4,693.17	4,693.17
其他负债	-	-	-	128,386.78	128,386.78
负债总计	-	-	-	350,707.09	350,707.09
利率敏感度缺口	8,257,760.33	-	-	-64,410,433.37	72,668,193.70
上年度末 2018 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,140,607.84	-	-	-	1,140,607.84
结算备付金	107,345.87	-	-	-	107,345.87
存出保证金	8,318.89	-	-	-	8,318.89
交易性金融资产	-	-	-	11,224,405.00	11,224,405.00
应收利息	-	-	-	780.23	780.23
应收申购款	-	-	-	21,805.19	21,805.19
资产总计	1,256,272.60	-	-	-11,246,990.42	12,503,263.02
负债					
应付赎回款	-	-	-	28,097.31	28,097.31
应付管理人报酬	-	-	-	10,503.97	10,503.97
应付托管费	-	-	-	1,050.41	1,050.41
应付销售服务费	-	-	-	61.72	61.72
应付交易费用	-	-	-	41,282.12	41,282.12
其他负债	-	-	-	273,948.91	273,948.91
负债总计	-	-	-	354,944.44	354,944.44
利率敏感度缺口	1,256,272.60	-	-	-10,892,045.98	12,148,318.58

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2019 年 6 月 30 日，本基金未持有债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2018 年 12 月 31 日：同）。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的

影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中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。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日		上年度末 2018 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	63,805,578.99	87.80	11,224,405.00	92.39
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	63,805,578.99	87.80	11,224,405.00	92.39

注：本基金本期末持有股指期货，请参见附注 6.4.7.3。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2019 年 6 月 30 日）	上年度末（2018 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上升 5%	3,436,631.00	524,721.50
	沪深 300 指数下降 5%	-3,436,631.00	-524,721.50

§ 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	63,805,578.99	87.38
	其中：股票	63,805,578.99	87.38
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	8,242,060.50	11.29
8	其他各项资产	971,261.30	1.33
9	合计	73,018,900.79	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末指数投资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	671,238.00	0.92
B	采矿业	762,334.00	1.05
C	制造业	23,360,932.90	32.15
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	892,549.00	1.23
E	建筑业	2,418,209.00	3.33
F	批发和零售业	1,169,362.00	1.61
G	交通运输、仓储和邮政业	2,426,202.00	3.34
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	97,560.00	0.13
J	金融业	18,951,065.00	26.08
K	房地产业	3,009,299.00	4.14

L	租赁和商务服务业	748,475.00	1.03
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	207,214.00	0.29
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,022,010.00	1.41
R	文化、体育和娱乐业	410,500.00	0.56
S	综合	-	-
	合计	56,146,949.90	77.26

7.2.2 期末积极投资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	120,750.00	0.17
B	采矿业	26,696.00	0.04
C	制造业	5,617,159.81	7.73
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	197,280.00	0.27
G	交通运输、仓储和邮政业	282,387.00	0.39
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	451,077.28	0.62
J	金融业	50,300.00	0.07
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	27,690.00	0.04
N	水利、环境和公共设施管理业	885,289.00	1.22
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	7,658,629.09	10.54

7.2.3 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所有股票投资明细

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	601318	中国平安	57,400	5,086,214.00	7.00
2	600519	贵州茅台	2,700	2,656,800.00	3.66
3	601398	工商银行	343,800	2,024,982.00	2.79
4	600036	招商银行	38,700	1,392,426.00	1.92
5	000858	五粮液	9,300	1,096,935.00	1.51
6	000651	格力电器	19,500	1,072,500.00	1.48
7	300015	爱尔眼科	33,000	1,022,010.00	1.41
8	000661	长春高新	3,000	1,014,000.00	1.40
9	600009	上海机场	12,000	1,005,360.00	1.38
10	000333	美的集团	18,100	938,666.00	1.29
11	600030	中信证券	39,400	938,114.00	1.29
12	601166	兴业银行	49,400	903,526.00	1.24
13	601668	中国建筑	152,000	874,000.00	1.20
14	600031	三一重工	55,100	720,708.00	0.99
15	601169	北京银行	120,000	709,200.00	0.98
16	002304	洋河股份	5,600	680,736.00	0.94
17	600585	海螺水泥	15,800	655,700.00	0.90
18	000063	中兴通讯	20,000	650,600.00	0.90
19	601336	新华保险	11,700	643,851.00	0.89
20	600104	上汽集团	24,600	627,300.00	0.86
21	601818	光大银行	162,200	617,982.00	0.85
22	601006	大秦铁路	70,200	567,918.00	0.78
23	000776	广发证券	41,100	564,714.00	0.78
24	000001	平安银行	40,300	555,334.00	0.76
25	000157	中联重科	92,100	553,521.00	0.76
26	600015	华夏银行	71,000	546,700.00	0.75
27	000338	潍柴动力	44,300	544,447.00	0.75
28	000568	泸州老窖	6,200	501,146.00	0.69
29	300498	温氏股份	13,800	494,868.00	0.68
30	000100	TCL 集团	147,300	490,509.00	0.67
31	600606	绿地控股	71,700	489,711.00	0.67
32	000425	徐工机械	107,500	479,450.00	0.66
33	000069	华侨城 A	67,200	467,040.00	0.64

34	600741	华域汽车	21,500	464,400.00	0.64
35	000895	双汇发展	18,400	457,976.00	0.63
36	600153	建发股份	50,300	446,664.00	0.61
37	000703	恒逸石化	32,600	445,316.00	0.61
38	002146	荣盛发展	47,400	445,086.00	0.61
39	000166	申万宏源	88,700	444,387.00	0.61
40	002236	大华股份	30,000	435,600.00	0.60
41	600188	兖州煤业	39,500	429,365.00	0.59
42	601877	正泰电器	18,000	415,620.00	0.57
43	000402	金融街	52,700	413,168.00	0.57
44	300413	快乐购	10,000	410,500.00	0.56
45	601828	美凯龙	33,700	409,455.00	0.56
46	601601	中国太保	11,200	408,912.00	0.56
47	600068	葛洲坝	62,200	387,506.00	0.53
48	600522	中天科技	41,800	383,306.00	0.53
49	002475	立讯精密	15,200	376,808.00	0.52
50	300296	利亚德	47,900	375,057.00	0.52
51	601992	金隅集团	96,500	362,840.00	0.50
52	601009	南京银行	43,200	356,832.00	0.49
53	002202	金风科技	28,200	350,526.00	0.48
54	600029	南方航空	44,400	342,768.00	0.47
55	002601	龙鳞佰利	23,000	341,090.00	0.47
56	600887	伊利股份	10,200	340,782.00	0.47
57	002415	海康威视	11,900	328,202.00	0.45
58	601390	中国中铁	50,100	326,652.00	0.45
59	601186	中国铁建	32,400	322,380.00	0.44
60	601555	东吴证券	31,400	321,850.00	0.44
61	300136	信维通信	12,800	312,960.00	0.43
62	002456	欧菲光	39,600	310,464.00	0.43
63	002142	宁波银行	12,000	290,880.00	0.40
64	601288	农业银行	80,300	289,080.00	0.40
65	000671	阳光城	44,400	287,712.00	0.40
66	000002	万科 A	10,300	286,443.00	0.39
67	601211	国泰君安	15,200	278,920.00	0.38
68	600115	东方航空	44,400	278,388.00	0.38
69	601229	上海银行	22,800	270,180.00	0.37
70	601838	成都银行	30,400	268,432.00	0.37
71	600276	恒瑞医药	4,020	265,320.00	0.37
72	300122	智飞生物	6,100	262,910.00	0.36

73	600028	中国石化	45,500	248,885.00	0.34
74	600023	浙能电力	55,800	246,636.00	0.34
75	600340	华夏幸福	7,300	237,761.00	0.33
76	600309	万华化学	5,500	235,345.00	0.32
77	601238	广汽集团	21,300	232,809.00	0.32
78	000423	东阿阿胶	5,800	230,956.00	0.32
79	600346	恒力石化	18,960	230,553.60	0.32
80	600690	青岛海尔	13,000	224,770.00	0.31
81	601688	华泰证券	10,000	223,200.00	0.31
82	600027	华电国际	58,100	219,037.00	0.30
83	002673	西部证券	21,000	211,680.00	0.29
84	002024	苏宁云商	18,100	207,788.00	0.29
85	002081	金螳螂	20,100	207,231.00	0.29
86	300070	碧水源	26,600	207,214.00	0.29
87	600066	宇通客车	15,900	207,018.00	0.28
88	000938	紫光股份	7,540	205,465.00	0.28
89	002050	三花智控	19,000	200,450.00	0.28
90	002736	国信证券	15,200	200,032.00	0.28
91	002508	老板电器	7,200	195,408.00	0.27
92	002001	新和成	10,000	192,900.00	0.27
93	000786	北新建材	10,500	190,365.00	0.26
94	002294	信立泰	8,200	183,516.00	0.25
95	600016	民生银行	28,800	182,880.00	0.25
96	000415	渤海金控	46,000	180,320.00	0.25
97	002714	牧原股份	3,000	176,370.00	0.24
98	600795	国电电力	69,400	176,276.00	0.24
99	000961	中南建设	20,000	173,200.00	0.24
100	601988	中国银行	46,000	172,040.00	0.24
101	600383	金地集团	14,400	171,792.00	0.24
102	601998	中信银行	28,400	169,548.00	0.23
103	603260	合盛硅业	3,600	169,416.00	0.23
104	600705	中航资本	30,900	167,478.00	0.23
105	300408	三环集团	8,500	165,325.00	0.23
106	002310	东方园林	27,200	163,200.00	0.22
107	603156	养元饮品	4,400	163,152.00	0.22
108	600487	亨通光电	9,600	160,896.00	0.22
109	600297	广汇汽车	35,900	160,114.00	0.22
110	002027	分众传媒	30,000	158,700.00	0.22
111	002468	申通快递	6,300	157,122.00	0.22

112	000963	华东医药	5,800	150,568.00	0.21
113	002602	世纪华通	13,000	141,960.00	0.20
114	601607	上海医药	7,400	134,310.00	0.18
115	601766	中国中车	14,500	117,305.00	0.16
116	000783	长江证券	14,500	113,245.00	0.16
117	601377	兴业证券	16,200	109,188.00	0.15
118	600886	国投电力	13,400	104,118.00	0.14
119	600089	特变电工	13,700	99,325.00	0.14
120	600362	江西铜业	6,300	99,162.00	0.14
121	002555	三七互娱	7,200	97,560.00	0.13
122	601788	光大证券	8,400	95,928.00	0.13
123	600703	三安光电	8,500	95,880.00	0.13
124	600999	招商证券	5,300	90,577.00	0.12
125	600398	海澜之家	9,900	89,793.00	0.12
126	600219	南山铝业	39,200	88,592.00	0.12
127	601800	中国交建	7,800	88,296.00	0.12
128	601225	陕西煤业	9,100	84,084.00	0.12
129	000630	铜陵有色	30,800	75,768.00	0.10
130	601328	交通银行	12,300	75,276.00	0.10
131	601997	贵阳银行	8,700	75,255.00	0.10
132	601138	工业富联	6,200	74,710.00	0.10
133	601111	中国国航	7,800	74,646.00	0.10
134	601985	中国核电	13,200	73,392.00	0.10
135	600704	物产中大	12,900	69,918.00	0.10
136	002179	中航光电	2,000	66,920.00	0.09
137	601162	天风证券	6,000	65,040.00	0.09
138	600688	上海石化	11,700	60,372.00	0.08
139	000538	云南白药	700	58,394.00	0.08
140	603160	汇顶科技	400	55,520.00	0.08
141	600674	川投能源	6,000	53,400.00	0.07
142	601618	中国中冶	16,100	48,944.00	0.07
143	601319	中国人保	5,000	47,450.00	0.07
144	002007	华兰生物	1,500	45,735.00	0.06
145	600271	航天信息	1,900	43,795.00	0.06
146	600837	海通证券	2,800	39,732.00	0.05
147	000656	金科股份	6,200	37,386.00	0.05
148	000898	鞍钢股份	6,370	24,142.30	0.03
149	300003	乐普医疗	1,000	23,020.00	0.03
150	600900	长江电力	1,100	19,690.00	0.03

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	300388	国祯环保	70,000	660,100.00	0.91
2	600273	嘉化能源	50,000	578,000.00	0.80
3	300630	普利制药	10,000	576,200.00	0.79
4	600216	浙江医药	50,000	512,000.00	0.70
5	000860	顺鑫农业	10,000	466,500.00	0.64
6	300747	锐科激光	3,000	420,030.00	0.58
7	300702	天宇股份	10,000	360,400.00	0.50
8	000977	浪潮信息	15,000	357,900.00	0.49
9	603068	博通集成	6,000	347,880.00	0.48
10	300760	迈瑞医疗	2,000	326,400.00	0.45
11	300365	恒华科技	20,000	324,200.00	0.45
12	603083	剑桥科技	10,000	310,800.00	0.43
13	001965	招商公路	33,900	282,387.00	0.39
14	002157	正邦科技	15,000	249,900.00	0.34
15	000826	启迪桑德	19,100	225,189.00	0.31
16	603368	柳药股份	6,000	197,280.00	0.27
17	002085	万丰奥威	26,400	192,192.00	0.26
18	300573	兴齐眼药	3,000	151,350.00	0.21
19	002371	七星电子	2,000	138,500.00	0.19
20	000708	大冶特钢	10,000	127,000.00	0.17
21	300511	雪榕生物	15,000	120,750.00	0.17
22	300065	海兰信	10,000	120,200.00	0.17
23	600536	中国软件	2,000	107,340.00	0.15
24	000066	长城电脑	10,000	102,800.00	0.14
25	000951	中国重汽	6,000	96,300.00	0.13
26	002191	劲嘉股份	6,000	74,460.00	0.10
27	603517	绝味食品	1,400	54,474.00	0.07
28	000750	国海证券	10,000	50,300.00	0.07
29	600460	士兰微	2,000	33,200.00	0.05
30	300284	苏交科	3,000	27,690.00	0.04
31	600968	海油发展	7,520	26,696.00	0.04
32	603867	新化股份	801	20,673.81	0.03
33	601698	中国卫通	4,984	19,537.28	0.03

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	601318	中国平安	3,924,311.00	32.30
2	600519	贵州茅台	2,409,642.00	19.84
3	601398	工商银行	2,329,594.00	19.18
4	000651	格力电器	1,728,148.00	14.23
5	600036	招商银行	1,306,779.00	10.76
6	601166	兴业银行	1,223,680.00	10.07
7	000333	美的集团	1,119,449.00	9.21
8	300015	爱尔眼科	1,089,149.00	8.97
9	600016	民生银行	1,072,463.00	8.83
10	600009	上海机场	1,005,638.00	8.28
11	600030	中信证券	962,319.00	7.92
12	000661	长春高新	961,538.19	7.91
13	601668	中国建筑	942,268.20	7.76
14	000858	五粮液	927,083.00	7.63
15	600104	上汽集团	870,770.00	7.17
16	601169	北京银行	817,376.00	6.73
17	601328	交通银行	796,292.00	6.55
18	601336	新华保险	750,423.00	6.18
19	000001	平安银行	739,181.00	6.08
20	000776	广发证券	700,543.00	5.77
21	300388	国祯环保	684,778.00	5.64
22	600031	三一重工	684,182.00	5.63
23	002304	洋河股份	677,473.00	5.58
24	002475	立讯精密	666,581.08	5.49
25	601009	南京银行	661,833.00	5.45
26	600585	海螺水泥	648,053.00	5.33
27	000069	华侨城 A	639,628.00	5.27
28	601818	光大银行	634,093.00	5.22
29	000063	中兴通讯	620,204.00	5.11

30	601006	大秦铁路	614,368.00	5.06
31	601601	中国太保	611,792.97	5.04
32	000568	泸州老窖	601,699.00	4.95
33	300498	温氏股份	599,767.00	4.94
34	600741	华域汽车	592,456.00	4.88
35	300296	利亚德	575,735.00	4.74
36	000703	恒逸石化	573,967.00	4.72
37	600015	华夏银行	571,968.00	4.71
38	601555	东吴证券	570,742.00	4.70
39	600273	嘉化能源	564,853.00	4.65
40	600216	浙江医药	551,850.00	4.54
41	601390	中国中铁	535,458.00	4.41
42	601186	中国铁建	533,679.66	4.39
43	600188	兖州煤业	532,914.00	4.39
44	300630	普利制药	532,061.00	4.38
45	000157	中联重科	527,719.00	4.34
46	000338	潍柴动力	520,082.00	4.28
47	600606	绿地控股	519,437.00	4.28
48	002146	荣盛发展	519,368.00	4.28
49	600068	葛洲坝	516,828.00	4.25
50	000002	万科 A	511,494.00	4.21
51	002415	海康威视	507,875.00	4.18
52	000425	徐工机械	499,353.00	4.11
53	000100	TCL 集团	489,651.00	4.03
54	002601	龙蟠佰利	477,506.00	3.93
55	600153	建发股份	466,825.00	3.84
56	601992	金隅集团	460,618.00	3.79
57	000895	双汇发展	460,501.67	3.79
58	600029	南方航空	460,040.00	3.79
59	300136	信维通信	454,490.00	3.74
60	000860	顺鑫农业	447,120.00	3.68
61	002456	欧菲光	446,755.00	3.68
62	601211	国泰君安	446,090.00	3.67
63	601877	正泰电器	442,294.00	3.64
64	600887	伊利股份	441,957.00	3.64
65	000166	申万宏源	424,555.00	3.49

66	601229	上海银行	421,822.00	3.47
67	000977	浪潮信息	418,000.00	3.44
68	300413	芒果超媒	413,320.00	3.40
69	300747	锐科激光	408,709.00	3.36
70	601828	美凯龙	408,603.00	3.36
71	002294	信立泰	408,138.09	3.36
72	000671	阳光城	402,851.00	3.32
73	600522	中天科技	401,951.00	3.31
74	000402	金融街	397,653.00	3.27
75	002142	宁波银行	393,046.00	3.24
76	600309	万华化学	385,971.00	3.18
77	002236	大华股份	385,738.00	3.18
78	002202	金风科技	381,863.20	3.14
79	300122	智飞生物	376,902.00	3.10
80	600690	海尔智家	376,201.00	3.10
81	603156	养元饮品	352,206.54	2.90
82	600027	华电国际	350,049.00	2.88
83	600000	浦发银行	347,813.00	2.86
84	601238	广汽集团	341,872.00	2.81
85	002508	老板电器	340,257.91	2.80
86	300702	天宇股份	336,749.00	2.77
87	300070	碧水源	333,952.00	2.75
88	600795	国电电力	323,462.00	2.66
89	600276	恒瑞医药	322,971.00	2.66
90	600535	天士力	321,913.00	2.65
91	002050	三花智控	319,238.00	2.63
92	002736	国信证券	317,281.00	2.61
93	000938	紫光股份	316,276.32	2.60
94	300760	迈瑞医疗	313,548.00	2.58
95	601288	农业银行	311,018.00	2.56
96	300365	恒华科技	309,826.00	2.55
97	002027	分众传媒	306,931.00	2.53
98	002179	中航光电	306,415.10	2.52
99	603083	剑桥科技	304,956.00	2.51
100	600383	金地集团	303,989.00	2.50
101	000826	启迪桑德	299,255.00	2.46

102	601998	中信银行	298,831.00	2.46
103	603068	博通集成	297,746.00	2.45
104	603368	柳药股份	297,458.00	2.45
105	600705	中航资本	295,751.00	2.43
106	600704	物产中大	295,704.00	2.43
107	000961	中南建设	293,946.00	2.42
108	600028	中国石化	290,848.00	2.39
109	002157	正邦科技	289,301.00	2.38
110	300408	三环集团	286,231.00	2.36
111	000415	渤海租赁	285,979.00	2.35
112	600011	华能国际	285,370.00	2.35
113	601669	中国电建	282,264.00	2.32
114	600048	保利地产	278,564.00	2.29
115	603993	洛阳钼业	273,734.00	2.25
116	001965	招商公路	272,054.00	2.24
117	600487	亨通光电	270,548.40	2.23
118	600115	东方航空	269,339.00	2.22
119	002008	大族激光	266,124.00	2.19
120	000423	东阿阿胶	265,949.00	2.19
121	002602	世纪华通	263,971.00	2.17
122	601838	成都银行	261,240.00	2.15
123	000963	华东医药	256,187.00	2.11
124	600023	浙能电力	253,472.00	2.09
125	000898	鞍钢股份	253,354.00	2.09
126	600837	海通证券	250,744.00	2.06
127	601607	上海医药	248,526.00	2.05
128	600739	辽宁成大	243,796.00	2.01

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	600016	民生银行	1,187,512.00	9.78

2	000651	格力电器	837,496.00	6.89
3	601328	交通银行	826,586.00	6.80
4	601166	兴业银行	672,881.00	5.54
5	002475	立讯精密	502,564.95	4.14
6	600887	伊利股份	453,965.00	3.74
7	600000	浦发银行	387,891.57	3.19
8	601398	工商银行	359,537.00	2.96
9	000333	美的集团	353,042.00	2.91
10	600009	上海机场	350,919.00	2.89
11	601336	新华保险	341,781.00	2.81
12	600519	贵州茅台	341,510.00	2.81
13	601668	中国建筑	321,760.00	2.65
14	603993	洛阳钼业	314,575.00	2.59
15	601669	中国电建	311,160.00	2.56
16	002142	宁波银行	310,259.00	2.55
17	601009	南京银行	309,293.00	2.55
18	601555	东吴证券	302,647.00	2.49
19	600048	保利地产	301,926.00	2.49
20	600795	国电电力	295,597.00	2.43
21	600535	天士力	295,330.00	2.43
22	600011	华能国际	284,881.00	2.35
23	600036	招商银行	283,767.00	2.34
24	600061	国投资本	279,604.00	2.30
25	000725	京东方 A	276,290.00	2.27
26	600741	华域汽车	276,189.00	2.27
27	600085	同仁堂	275,438.00	2.27
28	601155	新城控股	275,160.00	2.27
29	601618	中国中冶	273,288.00	2.25
30	002797	第一创业	271,655.00	2.24
31	601601	中国太保	271,415.00	2.23
32	600436	片仔癀	270,379.00	2.23
33	000839	中信国安	267,384.17	2.20
34	002179	中航光电	265,490.00	2.19
35	601788	光大证券	259,079.00	2.13
36	000002	万科 A	258,747.00	2.13
37	600977	中国电影	258,354.72	2.13
38	000959	首钢股份	253,588.00	2.09
39	002773	康弘药业	253,108.00	2.08

40	603833	欧派家居	252,073.00	2.07
41	000001	平安银行	248,153.00	2.04
42	600104	上汽集团	246,073.00	2.03
43	002120	韵达股份	244,150.00	2.01

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	89,433,491.63
卖出股票收入（成交）总额	41,556,912.52

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所有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

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
IF1907	IF1907	2	2,283,000.00	85,296.00	-
IF1908	IF1908	1	1,138,860.00	9,840.00	-
IF1909	IF1909	1	1,137,540.00	1,320.00	-
公允价值变动总额合计（元）					96,456.00
股指期货投资本期收益（元）					140,935.92
股指期货投资本期公允价值变动（元）					96,456.00

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

因股指期货合约有较大贴水，本基金本报告期内择机做多了沪深 300 股指期货，用以获取基差收敛的确定性收益，同时代替部分股票仓位，留出更多灵活现金。相关投资对本基金总体风险影响可控，符合产品既定投资政策和投资目标。

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

本基金本报告期内未投资国债期货。

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

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 五粮液（000858）因公司监事涉嫌违纪违法，被四川省纪委监委立案调查，于 2018 年 8 月 28 日公告；因公司董事接受四川省纪委监委的纪律审查和监察调查，于 2018 年 7 月 14 日公告。上述情况对公司经营无重大影响。

7.12.2 基金投资的前十名股票未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	608,421.83
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,798.69
5	应收申购款	360,040.78
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	971,261.30

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

7.12.5.1 期末指数投资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。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五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
汇安沪深 300 增强 A	650	92,548.72	4,671,089.52	7.764874%	55,485,579.55	92.235126%
汇安沪深 300 增强 C	68	78,852.03	704,367.08	13.136427%	4,657,571.10	86.863573%
合计	718	91,251.54	5,375,456.60	8.204473%	60,143,150.65	91.795527%

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	汇安沪深 300 增强 A	994.96	0.00165395%
	汇安沪深 300 增强 C	0.00	0.00000000%
	合计	994.96	0.00151859%

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	汇安沪深 300 增强 A	0
	汇安沪深 300 增强 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	汇安沪深 300 增强 A	0
	汇安沪深 300 增强 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	汇安沪深 300 增 强 A	汇安沪深 300 增 强 C
基金合同生效日（2018 年 7 月 3 日）基金份额总额	453,804.07	2,522,567.55
本报告期期初基金份额总额	12,749,148.20	602,058.41
本报告期期间基金总申购份额	55,831,199.09	6,245,891.70
减：本报告期期间基金总赎回份额	8,423,678.22	1,486,011.93
本报告期末基金份额总额	60,156,669.07	5,361,938.18

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（2018 年 7 月 3 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	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
中信建投证 券	2	130,948,458.58	100.00%	93,143.65	100.00%	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	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

本基金本报告期内新增万联证券交易单元 1 个。

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
中信建投证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于汇安基金管理有限责任公司旗下基金增加销售机构的公告	中国证券报, 公司官网	2019 年 1 月 16 日
2	关于汇安基金管理有限责任公司旗下基金增加销售机构的公告	中国证券报, 公司官网	2019 年 3 月 8 日
3	关于汇安基金管理有限责任公司旗下基金增加销售机构的公告	中国证券报, 公司官网	2019 年 3 月 22 日
4	关于汇安基金管理有限责任公司旗下基金增加销售机构的公告	中国证券报, 公司官网	2019 年 3 月 30 日
5	关于汇安基金管理有限责任公司旗下基金增加销售机构的公告	中国证券报, 公司官网	2019 年 4 月 26 日
6	关于汇安基金管理有限责任公司旗下基金增加销售机构的公告	中国证券报, 公司官网	2019 年 6 月 1 日
7	关于汇安基金管理有限责任公司旗下基金增加销售机构的公告	中国证券报, 公司官网	2019 年 6 月 6 日
8	汇安基金管理有限责任公司关于旗下部分基金可投资与科创板股票的公告	中国证券报, 公司官网	2019 年 6 月 22 日

§ 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	-	-	-	-	-	-	-
个人	1	20190523-20190630	-	23,663,649.29	-	23,663,649.29	36.1174%
产品特有风险							
<p>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。</p>							

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会批准汇安丰泰灵活配置混合型证券投资基金募集的文件
- (2) 关于准予汇安丰泰灵活配置混合型证券投资基金变更注册的批复
- (3) 《汇安沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》
- (4) 《汇安沪深 300 指数增强型证券投资基金招募说明书》
- (5) 《汇安沪深 300 指数增强型证券投资基金托管协议》
- (6) 基金管理人业务资格批件、营业执照
- (6) 报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告

12.2 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

12.3 查阅方式

投资者可到基金管理人的办公场所及网站免费查阅备查文件，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。

投资者对本报告如有疑问，可咨询本基金管理人汇安基金管理有限责任公司，客户服务中心电话 010-56711690。

公司网站：<http://www.huianfund.cn>

汇安基金管理有限责任公司

2019 年 8 月 29 日