

# 汇安趋势动力股票型证券投资基金 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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>6</b>
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
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>12</b>
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.....	13
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.....	14
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
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>16</b>
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
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>17</b>
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
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>39</b>
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.....	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	44
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.....	45
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.....	45
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.....	45
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.....	45
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	45
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	46
7.12 投资组合报告附注.....	46
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>48</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	48
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	48
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.....	48
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>49</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>50</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	50
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.....	50
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	50
10.4 基金投资策略的改变.....	50
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	50
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.....	50
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	50
10.8 其他重大事件.....	52
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>53</b>
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.....	53

<b>§12 备查文件目录</b> .....	<b>54</b>
12.1 备查文件目录.....	54
12.2 存放地点.....	54
12.3 查阅方式.....	54

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	汇安趋势动力股票型证券投资基金	
基金简称	汇安趋势动力股票	
基金主代码	005628	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 4 月 25 日	
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	
报告期末基金份额总额	22,463,571.80 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	汇安趋势动力股票 A	汇安趋势动力股票 C
下属分级基金的交易代码:	005628	005629
报告期末下属分级基金的份额总额	18,743,884.51 份	3,719,687.29 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于在现行趋势下具有持续增长潜力的优质上市公司，在有效控制投资组合风险的前提下，通过积极主动的资产配置，力争获得超越业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金投资策略主要包括资产配置策略、行业配置策略、股票配置策略、债券投资组合策略、流通受限证券投资策略、权证投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略等。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率*80%+中证综合债券指数收益率*20%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。

### 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	中国工商银行股份有限公司
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	-
传真	01056711640	010-66105799
注册地址	上海市虹口区欧阳路 218 弄 1 号 2 楼 215 室	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址	北京市东城区东直门南大	北京市西城区复兴门内大街 55

	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	号
邮政编码	100007	100140
法定代表人	秦军	陈四清

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
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	汇安趋势动力股票 A	汇安趋势动力股票 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	7,595,737.99	1,897,084.55
本期利润	8,160,737.20	2,400,276.45
加权平均基金份额本期利润	0.2757	0.3612
本期加权平均净值利润率	26.65%	35.54%
本期基金份额净值增长率	17.28%	16.94%
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	1,214,168.33	207,149.98
期末可供分配基金份额利润	0.0648	0.0557
期末基金资产净值	19,958,052.84	3,926,837.27
期末基金份额净值	1.0648	1.0557
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	6.48%	5.57%

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

汇安趋势动力股票 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	0.68%	0.93%	3.55%	0.95%	-2.87%	-0.02%



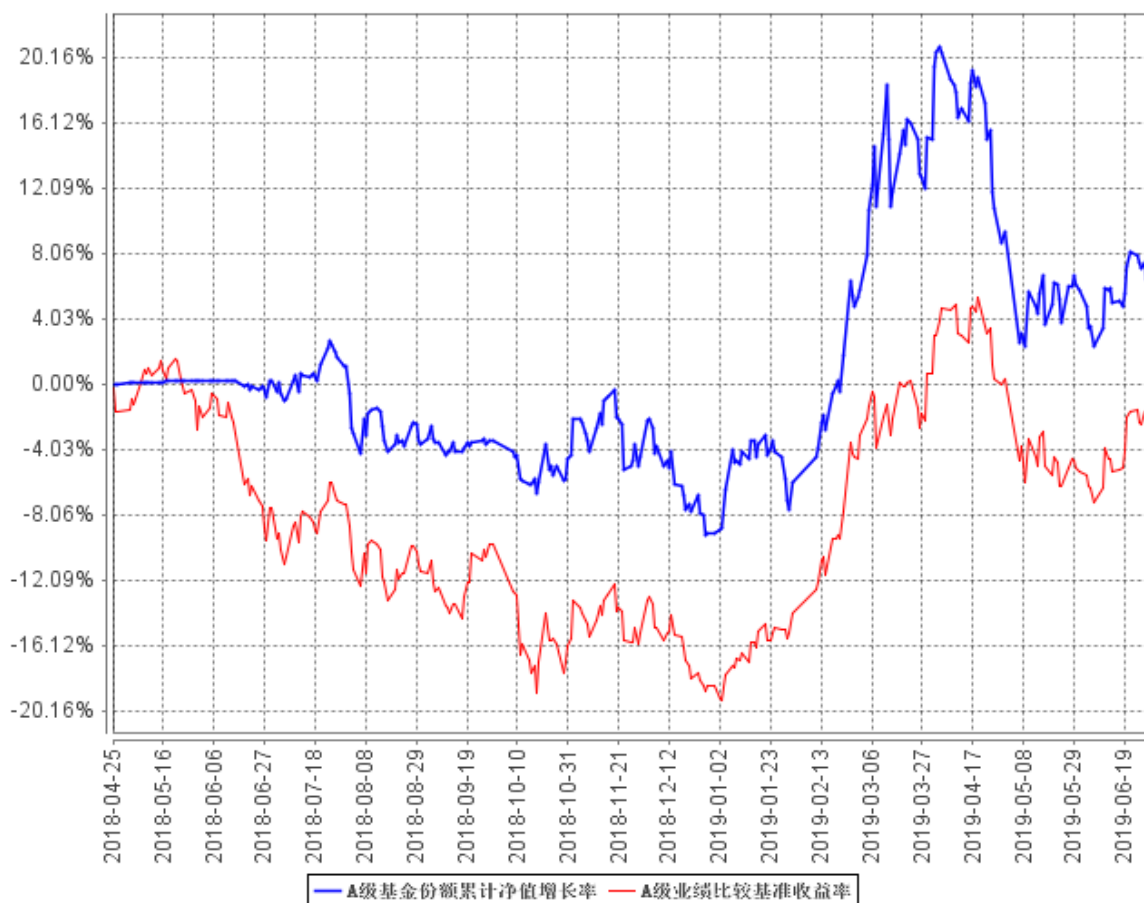
过去三个月	-7.51%	1.50%	-2.64%	1.25%	-4.87%	0.25%
过去六个月	17.28%	1.58%	20.34%	1.25%	-3.06%	0.33%
过去一年	6.27%	1.28%	6.02%	1.23%	0.25%	0.05%
自基金合同生效起至今	6.48%	1.17%	-2.05%	1.19%	8.53%	-0.02%

汇安趋势动力股票 C

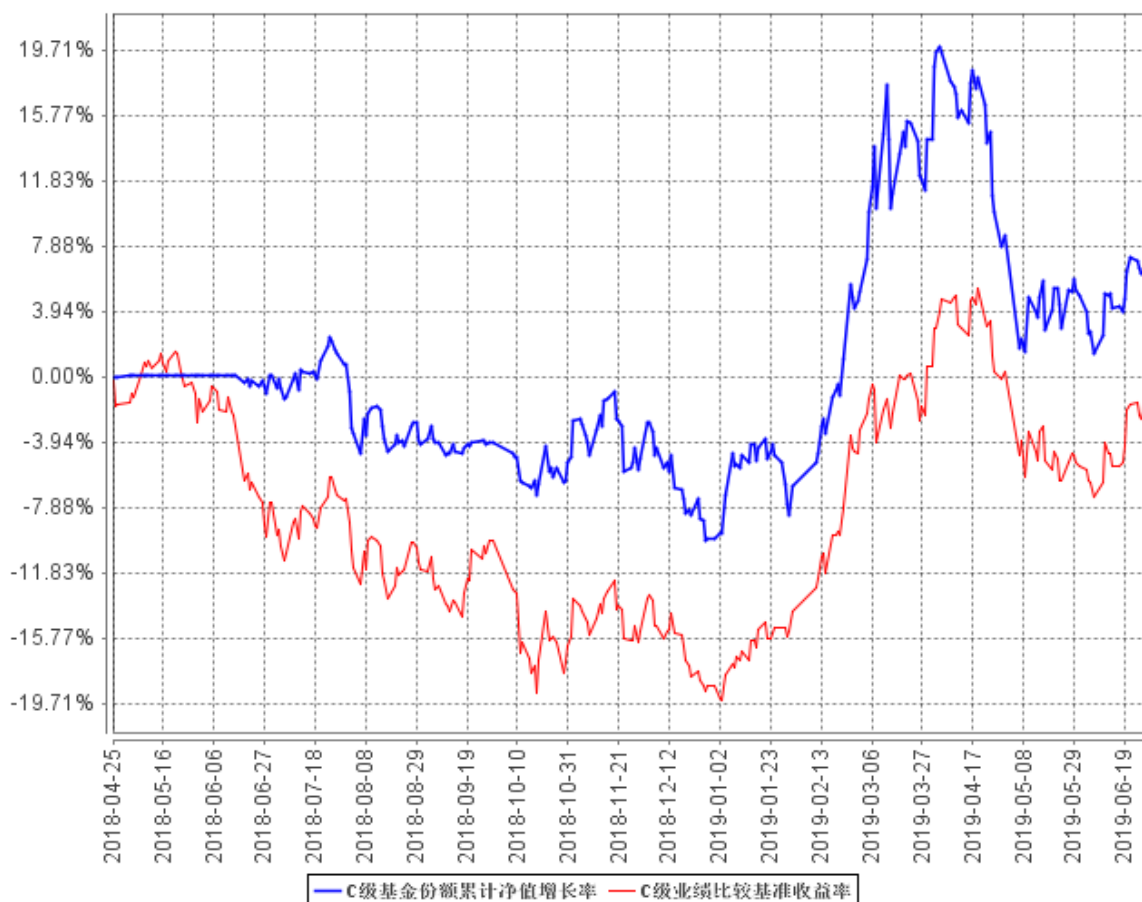
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.64%	0.93%	3.55%	0.95%	-2.91%	-0.02%
过去三个月	-7.61%	1.50%	-2.64%	1.25%	-4.97%	0.25%
过去六个月	16.94%	1.58%	20.34%	1.25%	-3.40%	0.33%
过去一年	5.52%	1.28%	6.02%	1.23%	-0.50%	0.05%
自基金合同生效起至今	5.57%	1.17%	-2.05%	1.19%	7.62%	-0.02%

### 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

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本基金合同生效日为 2018 年 4 月 25 日，至本报告期末，本基金合同生效已满一年。

②根据《汇安趋势动力股票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（包括中小板、创业板和其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、债券回购、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：本基金投资于股票的比例占基金资产的 80%-95%；本基金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，应当保持不低于基金资产净值 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。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 4 月 25 日至 2018 年 10 月 24 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		
邹唯	首席投资官、本基金的基金经理	2018 年 4 月 26 日	-	19 年	邹唯，理科硕士，19 年证券、基金行业从业经历，曾任长城证券有限公司研究部行业分析师，嘉实基金管理有限公司行业分析师、基金经理、主题策略组组长，中信产业基金金融投资部董事总经理，嘉

					实基金管理有限公司基金经理、主题策略组组长、董事总经理。2017 年 12 月 1 日加入汇安基金管理有限责任公司，担任首席投资官，董事总经理。2018 年 4 月 27 日至今，任汇安趋势动力股票型证券投资基金基金经理；2018 年 9 月 27 日至今，任汇安裕阳三年定期开放混合型证券投资基金基金经理；2019 年 1 月 25 日至今，任汇安核心成长混合型证券投资基金基金经理。
张媛	研究部 副总监、 本基金的 基金经理 助理	2018 年 4 月 25 日	-	11 年	张媛，中国科学技术大学管理科学与工程硕士，伦敦商学院金融硕士，11 年证券、基金行业从业经历，曾任国泰君安证券任机构客户销售，新宝集投资任主题研究总监。2017 年 11 月 1 日加入汇安基金管理有限责任公司研究部，任研究部副总监一职。2018 年 4 月 25 日至今，任汇安趋势动力股票型证券投资基金基金经理助理。

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。

#### 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

一季度市场在中美贸易冲突放缓，国内逆周期政策推动下，反弹力度超预期。本产品把握科技、周期等领域机会，提升仓位，积极参与反弹。进入二季度后，中美在贸易谈判出现反复，国内经济面临的下行压力明显，市场在短暂冲高后进入调整阶段。在众多不确定因素影响下，避险情绪使得资金更多向大消费、大金融行业配置。

本产品在一季度的季报中已经看到市场的调整压力，但强调不惧调整。因为主题方法注重的是较长期的趋势方向，并愿意忍受一定程度上的短期市场波动。在评判市场可能的风险后，本产品在下阶段仓位上保持 80% 左右的最低仓位要求，但在配置上坚持了军工、自主可控、信息安全、高品质资源、年轻消费等方向，仅在市场流动性收缩期间加配了核心银行、保险分散风险。偏成长的配置导致组合整体受市场回调影响阶段性回撤较大，同期跑输业绩基准。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末汇安趋势动力股票 A 基金份额净值为 1.0648 元，本报告期基金份额净值增长率为 17.28%；截至本报告期末汇安趋势动力股票 C 基金份额净值为 1.0557 元，本报告期基金份额净值增长率为 16.94%；同期业绩比较基准收益率为 20.34%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

三季度，中美贸易谈判在双方领导人推动下重新开启，并且流动性持续宽松的情况下，市场风险偏好得到提振。但考虑谈判重启或意味人民币贬值告一段落，同时国内对冲增长下行的政策

押后，未来不会出现大水漫灌式的投资拉动，结构性调整是主基调，科技创新、先进制造、新兴消费、环保和高品质资源获得经济转型需求和更多政策支持。虽然国内宏观经济仍有下行压力，但结构性调整带来的机会有望在三季度重新发力。

本产品仍将聚焦核心科技、年轻消费、军工和网络安全、环保和高品质资源领域的成长性机会。

#### 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

本基金已连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元，本基金管理人已按法规要求向证监会报送解决方案。

## § 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，本基金托管人在对汇安趋势动力股票型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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，汇安趋势动力股票型证券投资基金的管理人——汇安基金管理有限责任公司在汇安趋势动力股票型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，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

本托管人依法对汇安基金管理有限责任公司编制和披露的汇安趋势动力股票型证券投资基金 2019 年半年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。



## § 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：汇安趋势动力股票型证券投资基金

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
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	4,386,955.13	7,748,640.52
结算备付金		107,108.37	58,395.75
存出保证金		28,465.87	51,780.81
交易性金融资产	6.4.7.2	19,581,007.48	50,286,752.60
其中：股票投资		19,556,306.68	50,286,752.60
基金投资		-	-
债券投资		24,700.80	-
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		-	1,344,934.20
应收利息	6.4.7.5	946.31	1,763.77
应收股利		-	-
应收申购款		1,100.67	499.25
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		24,105,583.83	59,492,766.90
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2019 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2018 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
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		2,763.02	53,747.28
应付管理人报酬		29,161.10	78,039.18
应付托管费		4,860.18	13,006.52
应付销售服务费		1,559.59	4,938.79
应付交易费用	6.4.7.7	51,882.71	166,992.84

应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	130,467.12	116,103.88
负债合计		220,693.72	432,828.49
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	22,463,571.80	65,120,443.52
未分配利润	6.4.7.10	1,421,318.31	-6,060,505.11
所有者权益合计		23,884,890.11	59,059,938.41
负债和所有者权益总计		24,105,583.83	59,492,766.90

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，汇安趋势动力 A 基金份额净值 1.0648 元，基金份额总额 18,743,884.51 份；汇安趋势动力 C 基金份额净值 1.0557 元，基金份额总额 3,719,687.29 份。汇安趋势动力股票份额总额合计为 22,463,571.80 份。

## 6.2 利润表

会计主体：汇安趋势动力股票型证券投资基金

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	上年度可比期间 2018 年 4 月 25 日(基金 合同生效日)至 2018 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		11,300,020.45	1,166,439.16
1.利息收入		23,739.69	1,139,129.48
其中：存款利息收入	6.4.7.11	23,730.86	264,586.07
债券利息收入		8.83	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	874,543.41
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		10,180,387.17	20,401.00
其中：股票投资收益	6.4.7.12	10,010,140.30	-
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	-	-
股利收益	6.4.7.16	170,246.87	20,401.00
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	1,068,191.11	-36,800.39

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	27,702.48	43,709.07
<b>减：二、费用</b>		739,006.80	736,058.00
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	281,172.61	512,600.74
2. 托管费	6.4.10.2.2	46,862.07	85,433.44
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	16,963.87	70,564.95
4. 交易费用	6.4.7.19	327,578.66	32,459.54
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.20	66,429.59	34,999.33
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		10,561,013.65	430,381.16
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		10,561,013.65	430,381.16

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汇安趋势动力股票型证券投资基金

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）	65,120,443.52	-6,060,505.11	59,059,938.41
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	10,561,013.65	10,561,013.65
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）	-42,656,871.72	-3,079,190.23	-45,736,061.95
其中：1. 基金申购款	3,092,173.79	141,658.10	3,233,831.89
2. 基金赎回款	-45,749,045.51	-3,220,848.33	-48,969,893.84

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）	22,463,571.80	1,421,318.31	23,884,890.11
项目	上年度可比期间 2018 年 4 月 25 日(基金合同生效日)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）	269,413,274.01	-	269,413,274.01
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	430,381.16	430,381.16
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）	-149,431,326.65	-215,022.16	-149,646,348.81
其中：1.基金申购款	726,630.90	-3,772.41	722,858.49
2.基金赎回款	-150,157,957.55	-211,249.75	-150,369,207.30
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）	119,981,947.36	215,359.00	120,197,306.36

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

基金管理人负责人

\_\_\_\_\_  
窦星华

主管会计工作负责人

\_\_\_\_\_  
江士

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

汇安趋势动力股票型证券投资基金(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[2018]135号《关于准予汇安趋势动力股票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《汇安趋势动力股票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 269,363,866.94 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(2018)第 0259 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《汇安趋势动力股票型证券投资基金基金合同》于 2018 年 4 月 25 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 269,413,274.01 份基金份额，其中认购资金利息折合 49,407.07 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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司（以下简称“工商银行”）。

根据《汇安趋势动力股票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《汇安趋势动力股票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、创业板和其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、债券回购、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）。本基金投资于股票的比例占基金资产的 80%-95%；本基金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，应当保持不低于基金资产净值 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。本基金的业绩比较基准为：中证 800 指数收益率\*80%+中证综合债券指数收益率\*20%。

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》、《汇安趋势动力股票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 重要会计政策和会计估计

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

本基金本报告期末发生会计政策变更。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末发生会计估计变更。

#### 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	4,386,955.13
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:	4,386,955.13

#### 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	20,048,379.57	19,556,306.68	-492,072.89
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	24,700.80	700.80
	银行间市场	-	-
	合计	24,700.80	700.80
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	20,072,379.57	19,581,007.48	-491,372.09

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产或衍生金融负债。

#### 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	876.37
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	48.20
应收债券利息	8.84
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	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	12.90
合计	946.31

#### 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	51,882.71
银行间市场应付交易费用	-
合计	51,882.71

#### 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	0.35
预提费用	130,466.77
合计	130,467.12

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

汇安趋势动力股票 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	52,679,730.33	52,679,730.33
本期申购	1,036,982.16	1,036,982.16

本期赎回(以“-”号填列)	-34,972,827.98	-34,972,827.98
本期末	18,743,884.51	18,743,884.51

金额单位：人民币元

汇安趋势动力股票 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	12,440,713.19	12,440,713.19
本期申购	2,055,191.63	2,055,191.63
本期赎回(以“-”号填列)	-10,776,217.53	-10,776,217.53
本期末	3,719,687.29	3,719,687.29

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

汇安趋势动力股票 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-3,277,253.08	-1,573,586.07	-4,850,839.15
本期利润	7,595,737.99	564,999.21	8,160,737.20
本期基金份额交易产生的变动数	-913,847.31	-1,181,882.41	-2,095,729.72
其中：基金申购款	83,263.53	-19,578.37	63,685.16
基金赎回款	-997,110.84	-1,162,304.04	-2,159,414.88
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,404,637.60	-2,190,469.27	1,214,168.33

单位：人民币元

汇安趋势动力股票 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-839,935.08	-369,730.88	-1,209,665.96
本期利润	1,897,084.55	503,191.90	2,400,276.45
本期基金份额交易产生的变动数	-418,581.10	-564,879.41	-983,460.51
其中：基金申购款	326,722.50	-248,749.56	77,972.94
基金赎回款	-745,303.60	-316,129.85	-1,061,433.45
本期已分配利润	-	-	-
本期末	638,568.37	-431,418.39	207,149.98

### 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	21,577.67
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	1,798.59
其他	354.60
合计	23,730.86

### 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	138,854,629.26
减：卖出股票成本总额	128,844,488.96
买卖股票差价收入	10,010,140.30

### 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

本基金本报告期内未发生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

本基金本报告期内无衍生工具收益。

### 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	170,246.87
基金投资产生的股利收益	-
合计	170,246.87

#### 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	1,068,191.11
——股票投资	1,067,490.31
——债券投资	700.80
——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	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估 增值税	-
合计	1,068,191.11

#### 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	27,702.48
合计	27,702.48

#### 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	327,578.66
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	327,578.66

#### 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	39,671.58
银行划款手续费	1,962.82
合计	66,429.59

#### 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
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人、基金销售机构
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

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行交易，亦未发生支付给关联方的佣金。

### 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	上年度可比期间 2018年4月25日(基金合同生效日) 至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	281,172.61	512,600.74
其中：支付销售机构的客户维护费	136,518.15	265,635.47

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 1.5% 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 × 1.5% / 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	上年度可比期间 2018年4月25日(基金合同生效日) 至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	46,862.07	85,433.44

注：支付基金托管人中国工商银行股份有限公司的基金托管费按前一日基金资产净值 0.25% 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：日基金托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 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		
	汇安趋势动力股票 A	汇安趋势动力股票 C	合计
汇安基金	-	-	-
中国工商银行	-	16,088.96	16,088.96
合计	-	16,088.96	16,088.96
获得销售服务费的 各关联方名称	上年度可比期间 2018 年 4 月 25 日(基金合同生效日)至 2018 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	汇安趋势动力股票 A	汇安趋势动力股票 C	合计
	汇安基金	-	21,391.40
中国工商银行	-	49,130.72	49,130.72
合计	-	70,522.12	70,522.12

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 0.50% 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 × 0.50% / 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

本基金本报告期末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及上年度可比期间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

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。

#### 6.4.10.5 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		上年度可比期间 2018 年 4 月 25 日(基金合同生效日)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
工商银行	4,386,955.13	21,577.67	31,080,277.14	258,801.41

注：本基金的银行存款由基金托管人工商银行保管，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**

本基金本报告期未参与关联方承销证券的买卖。

#### **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的说明。

#### **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银行间市场债券正回购余额，因此没有作为抵押的债券。

###### **6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购余额，因此没有作为抵押的债券。

#### **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，其长期平均风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。

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**

信用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工商银行，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，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.10%(2018 年 12 月 31 日：无债券投资)。

#### **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同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综合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期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发行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 23,965,199.59 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、存出保证金及债券投资等。

##### 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	4,386,955.13	-	-	-	4,386,955.13
结算备付金	107,108.37	-	-	-	107,108.37
存出保证金	28,465.87	-	-	-	28,465.87
交易性金融资产	24,700.80	-	-	19,556,306.68	19,581,007.48
应收利息	-	-	-	946.31	946.31
应收申购款	-	-	-	1,100.67	1,100.67
其他资产	-	-	-	-	-

资产总计	4,547,230.17	-	-	19,558,353.66	24,105,583.83
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,763.02	2,763.02
应付管理人报酬	-	-	-	29,161.10	29,161.10
应付托管费	-	-	-	4,860.18	4,860.18
应付销售服务费	-	-	-	1,559.59	1,559.59
应付交易费用	-	-	-	51,882.71	51,882.71
其他负债	-	-	-	130,467.12	130,467.12
负债总计	-	-	-	220,693.72	220,693.72
利率敏感度缺口	4,547,230.17	-	-	19,337,659.94	23,884,890.11
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	7,748,640.52	-	-	-	7,748,640.52
结算备付金	58,395.75	-	-	-	58,395.75
存出保证金	51,780.81	-	-	-	51,780.81
交易性金融资产	-	-	-	50,286,752.60	50,286,752.60
应收证券清算款	-	-	-	1,344,934.20	1,344,934.20
应收利息	-	-	-	1,763.77	1,763.77
应收申购款	-	-	-	499.25	499.25
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	7,858,817.08	-	-	51,633,949.82	59,492,766.90
负债					
应付赎回款	-	-	-	53,747.28	53,747.28
应付管理人报酬	-	-	-	78,039.18	78,039.18
应付托管费	-	-	-	13,006.52	13,006.52
应付销售服务费	-	-	-	4,938.79	4,938.79
应付交易费用	-	-	-	166,992.84	166,992.84
其他负债	-	-	-	116,103.88	116,103.88
负债总计	-	-	-	432,828.49	432,828.49
利率敏感度缺口	7,858,817.08	-	-	51,201,121.33	59,059,938.41

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约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，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.10%（2018 年 12 月 31 日：未持有交易性债券投资），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。基金的投资组合比例为：本基金投资于股票的比例占基金资产的 80%-95%；本基金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，应当保持不低于基金资产净值 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。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	19,556,306.68	81.88	50,286,752.60	85.15
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	19,556,306.68	81.88	50,286,752.60	85.15

**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%	1,123,271.47	-
	沪深 300 指数下降 5%	-1,123,271.47	-

注：于 2018 年 12 月 31 日，本基金成立尚未满一年，无足够历史经验数据计算其他价格风险对基金资产净值的影响。

## § 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	19,556,306.68	81.13
	其中：股票	19,556,306.68	81.13
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	24,700.80	0.10
	其中：债券	24,700.80	0.10
	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	4,494,063.50	18.64
8	其他各项资产	30,512.85	0.13
9	合计	24,105,583.83	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

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	-	-
B	采矿业	2,808,222.00	11.76
C	制造业	12,022,636.00	50.34
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	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,502,888.68	14.67
J	金融业	535,942.00	2.24
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	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	686,618.00	2.87
S	综合	-	-
	合计	19,556,306.68	81.88

### 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	601857	中国石油	86,800	597,184.00	2.50
2	601988	中国银行	143,300	535,942.00	2.24
3	601958	金钼股份	51,000	341,700.00	1.43
4	000878	云南铜业	32,000	340,160.00	1.42
5	000831	*ST 五稀	20,500	332,715.00	1.39
6	600392	盛和资源	29,700	328,482.00	1.38
7	300571	平治信息	7,900	328,245.00	1.37
8	300533	冰川网络	9,000	326,520.00	1.37
9	600259	广晟有色	8,100	326,430.00	1.37
10	600373	中文传媒	25,800	324,048.00	1.36
11	600111	北方稀土	25,100	322,284.00	1.35
12	002425	凯撒文化	49,800	322,206.00	1.35
13	601088	中国神华	15,800	322,004.00	1.35
14	603444	吉比特	1,500	314,940.00	1.32
15	600893	航发动力	12,700	288,417.00	1.21
16	000733	振华科技	17,300	285,104.00	1.19
17	002371	七星电子	4,100	283,925.00	1.19
18	601600	中国铝业	71,600	280,672.00	1.18
19	300726	宏达电子	11,500	271,400.00	1.14
20	600760	中航沈飞	9,300	269,979.00	1.13



21	002405	四维图新	16,650	268,065.00	1.12
22	002013	中航机电	38,800	266,944.00	1.12
23	300045	华力创通	29,400	262,836.00	1.10
24	000547	航天发展	27,300	260,988.00	1.09
25	000066	长城电脑	25,200	259,056.00	1.08
26	300183	东软载波	16,000	250,880.00	1.05
27	600875	东方电气	23,200	246,384.00	1.03
28	600406	国电南瑞	13,200	246,048.00	1.03
29	601727	上海电气	45,100	242,638.00	1.02
30	002339	积成电子	37,100	242,263.00	1.01
31	600590	泰豪科技	37,200	240,684.00	1.01
32	600268	国电南自	40,500	240,570.00	1.01
33	601616	广电电气	67,500	240,300.00	1.01
34	600489	中金黄金	21,200	217,724.00	0.91
35	600988	赤峰黄金	35,100	214,812.00	0.90
36	600764	中国海防	7,600	211,888.00	0.89
37	601989	中国重工	37,800	210,168.00	0.88
38	600547	山东黄金	5,000	205,850.00	0.86
39	002155	湖南黄金	20,200	203,414.00	0.85
40	600372	中航电子	13,700	203,308.00	0.85
41	000768	中航飞机	12,900	203,175.00	0.85
42	603232	格尔软件	7,391	203,104.68	0.85
43	300447	全信股份	18,300	202,032.00	0.85
44	601069	西部黄金	13,100	201,740.00	0.84
45	002829	星网宇达	9,700	201,275.00	0.84
46	300474	景嘉微	5,100	201,246.00	0.84
47	002935	天奥电子	5,650	201,027.00	0.84
48	600118	中国卫星	8,900	200,695.00	0.84
49	002268	卫士通	8,200	200,490.00	0.84
50	000738	中航动控	14,900	199,660.00	0.84
51	600879	航天电子	32,300	198,968.00	0.83
52	002933	新兴装备	4,600	198,720.00	0.83
53	600536	中国软件	3,700	198,579.00	0.83
54	002574	明牌珠宝	33,600	197,232.00	0.83
55	002368	太极股份	6,500	196,950.00	0.82
56	600435	北方导航	21,900	196,881.00	0.82
57	601858	中国科传	15,000	196,650.00	0.82
58	300581	晨曦航空	13,300	193,648.00	0.81
59	603607	京华激光	9,500	193,610.00	0.81

60	300659	中孚信息	5,300	192,655.00	0.81
61	601168	西部矿业	27,800	177,364.00	0.74
62	600549	厦门钨业	11,900	170,289.00	0.71
63	600459	贵研铂业	9,400	169,858.00	0.71
64	000807	云铝股份	35,800	167,902.00	0.70
65	300251	光线传媒	24,400	165,920.00	0.69
66	000650	仁和药业	22,900	165,109.00	0.69
67	603609	禾丰牧业	13,800	163,392.00	0.68
68	002168	深圳惠程	18,400	162,840.00	0.68
69	600633	浙数文化	17,300	161,755.00	0.68
70	300288	朗玛信息	12,100	161,051.00	0.67
71	000990	诚志股份	9,800	160,818.00	0.67
72	002224	三力士	27,100	160,432.00	0.67
73	600668	尖峰集团	10,600	135,680.00	0.57
74	002149	西部材料	13,800	132,756.00	0.56
75	002262	恩华药业	12,300	132,717.00	0.56
76	300682	朗新科技	7,300	131,400.00	0.55
77	000788	北大医药	19,500	129,285.00	0.54
78	600312	平高电气	16,200	124,578.00	0.52
79	601028	玉龙股份	24,700	123,994.00	0.52
80	601179	中国西电	33,500	123,950.00	0.52
81	601126	四方股份	20,700	123,786.00	0.52
82	002266	浙富控股	26,000	123,500.00	0.52
83	002318	久立特材	16,600	121,346.00	0.51
84	000777	中核科技	8,800	121,000.00	0.51
85	601877	正泰电器	5,200	120,068.00	0.50
86	002130	沃尔核材	22,700	118,267.00	0.50
87	002255	海陆重工	26,500	117,925.00	0.49
88	002182	云海金属	15,400	117,194.00	0.49
89	000629	攀钢钒钛	34,400	116,616.00	0.49

## 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	601988	中国银行	1,988,398.00	3.37
2	601288	农业银行	1,988,311.00	3.37

3	601939	建设银行	1,987,713.00	3.37
4	601328	交通银行	1,987,682.00	3.37
5	600036	招商银行	1,434,867.00	2.43
6	601628	中国人寿	1,264,390.96	2.14
7	601336	新华保险	1,263,743.74	2.14
8	601601	中国太保	1,261,968.00	2.14
9	601818	光大银行	1,151,385.00	1.95
10	601166	兴业银行	1,150,460.93	1.95
11	002628	成都路桥	1,045,605.00	1.77
12	601369	陕鼓动力	1,017,355.00	1.72
13	600039	四川路桥	990,689.00	1.68
14	600939	重庆建工	990,570.00	1.68
15	300732	设研院	987,516.00	1.67
16	601388	怡球资源	904,875.00	1.53
17	600259	广晟有色	825,358.00	1.40
18	300659	中孚信息	812,172.00	1.38
19	002225	濮耐股份	782,453.00	1.32
20	000547	航天发展	779,234.00	1.32

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。

#### 7.4.2 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	002439	启明星辰	2,430,367.00	4.12
2	601858	中国科传	2,069,778.00	3.50
3	601328	交通银行	2,067,116.90	3.50
4	601939	建设银行	2,038,954.00	3.45
5	002230	科大讯飞	2,035,412.76	3.45
6	601288	农业银行	2,003,154.00	3.39
7	300017	网宿科技	1,938,694.21	3.28
8	300045	华力创通	1,875,155.00	3.18
9	300579	数字认证	1,697,431.00	2.87
10	300183	东软载波	1,696,623.00	2.87
11	601616	广电电气	1,633,823.00	2.77

12	002465	海格通信	1,580,841.00	2.68
13	600590	泰豪科技	1,579,155.20	2.67
14	300124	汇川技术	1,554,372.00	2.63
15	000878	云南铜业	1,553,354.00	2.63
16	600036	招商银行	1,549,763.00	2.62
17	603466	风语筑	1,540,253.00	2.61
18	300400	劲拓股份	1,533,208.00	2.60
19	601857	中国石油	1,496,500.00	2.53
20	600452	涪陵电力	1,488,919.20	2.52
21	601988	中国银行	1,488,754.00	2.52
22	600406	国电南瑞	1,459,404.00	2.47
23	002167	东方锆业	1,374,389.20	2.33
24	002747	埃斯顿	1,305,749.00	2.21
25	601166	兴业银行	1,293,426.00	2.19
26	000807	云铝股份	1,280,576.00	2.17
27	000066	长城电脑	1,229,984.00	2.08
28	601818	光大银行	1,229,924.00	2.08
29	601601	中国太保	1,225,765.00	2.08
30	603607	京华激光	1,219,655.00	2.07
31	601628	中国人寿	1,214,453.00	2.06
32	603656	泰禾光电	1,214,380.40	2.06
33	002253	川大智胜	1,196,728.00	2.03
34	601336	新华保险	1,194,893.00	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。

#### 7.4.3 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	97,046,552.73
卖出股票收入（成交）总额	138,854,629.26

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
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）	24,700.80	0.10
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	24,700.80	0.10

## 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	113024	核建转债	240	24,700.80	0.10

注：本基金本报告期末仅持有一只债券。

## 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

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

报告期内，本基金未参与股指期货交易。

### 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

报告期内，本基金未参与国债期货交易。

### 7.12 投资组合报告附注

**7.12.1** 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责、处罚。

**7.12.2** 本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

#### 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	28,465.87
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	946.31
5	应收申购款	1,100.67
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	30,512.85

#### 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
汇安趋势动力股票 A	233	80,445.86	12,000,000.00	64.0209%	6,743,884.51	35.9791%
汇安趋势动力股票 C	92	40,431.38	0.00	0.0000%	3,719,687.29	100.0000%
合计	325	69,118.68	12,000,000.00	53.4198%	10,463,571.80	46.5802%

### 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	汇安趋势动力股票 A	53,968.21	0.287924%
	汇安趋势动力股票 C	10,477.79	0.281685%
	合计	64,446.00	0.286891%

### 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、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金	汇安趋势动力股票 A	0
	汇安趋势动力股票 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	汇安趋势动力股票 A	0
	汇安趋势动力股票 C	0
	合计	0



## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	汇安趋势动力股票 A	汇安趋势动力股票 C
基金合同生效日（2018 年 4 月 25 日）基金份额总额	116,888,719.53	152,524,554.48
本报告期期初基金份额总额	52,679,730.33	12,440,713.19
本报告期间基金总申购份额	1,036,982.16	2,055,191.63
减：本报告期间基金总赎回份额	34,972,827.98	10,776,217.53
本报告期末基金份额总额	18,743,884.51	3,719,687.29

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 4 月 25 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	
东北证券	2	235,901,181.99	100.00%	167,797.94	100.00%	-
国金证券	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
东北证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-

**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	证券时报, 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	证券时报, 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	证券时报, 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	证券时报, 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	证券时报, 公司官网	2019 年 4 月 3 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	证券时报, 公司官网	2019 年 6 月 6 日
7	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	证券时报, 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	1	20190221-20190630	15,000,000.00	-	3,000,000.00	12,000,000.00	53.42%
个人	-	-	-	-	-	-	-
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趋势动力股票型证券投资基金募集的文件
- (2) 《汇安趋势动力股票型证券投资基金基金合同》
- (3) 《汇安趋势动力股票型证券投资基金招募说明书》
- (4) 《汇安趋势动力股票型证券投资基金托管协议》
- (5) 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