

# 汇安丰利灵活配置混合型证券投资基金

## 2017 年年度报告 摘要

2017 年 12 月 31 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：2018 年 3 月 27 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 2018 年 3 月 26 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。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

## § 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      | 528,233,165.61 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 | 355,897,236.50 份 | 172,335,929.11 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。<br>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   | 孙运英                | 曾麓燕                 |
|         | 联系电话 | 01056711605        | 021-52629999-212040 |
|         | 电子邮箱 | sunyy@huianfund.cn | 015292@cib.com.cn   |
| 客户服务电话  |      | 01056711690        | 95561               |
| 传真      |      | 01056711640        | 021-62535823        |

## 2.4 信息披露方式

|                     |                  |
|---------------------|------------------|
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | www.huianfund.cn |
| 基金年度报告备置地点          | 基金管理人及基金托管人办公地点  |

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 2017 年         |                | 2016 年 12 月 19 日(基金合同生效日)-2016 年 12 月 31 日 |              |
|---------------|----------------|----------------|--------------------------------------------|--------------|
|               | 汇安丰利混合 A       | 汇安丰利混合 C       | 汇安丰利混合 A                                   | 汇安丰利混合 C     |
| 本期已实现收益       | 38,758,286.62  | 3,467,076.11   | 252,845.85                                 | 4,136.23     |
| 本期利润          | 37,410,481.88  | 3,607,775.02   | 1,103,086.60                               | 18,595.48    |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.1719         | 0.1147         | 0.0038                                     | 0.0037       |
| 本期基金份额净值增长率   | 31.60%         | 27.72%         | 0.38%                                      | 0.37%        |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2017 年末        |                | 2016 年末                                    |              |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.1928         | 0.1566         | 0.0009                                     | 0.0008       |
| 期末基金资产净值      | 424,509,555.64 | 199,323,720.66 | 295,116,383.64                             | 5,018,820.48 |
| 期末基金份额净值      | 1.1928         | 1.1566         | 1.0038                                     | 1.0037       |

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

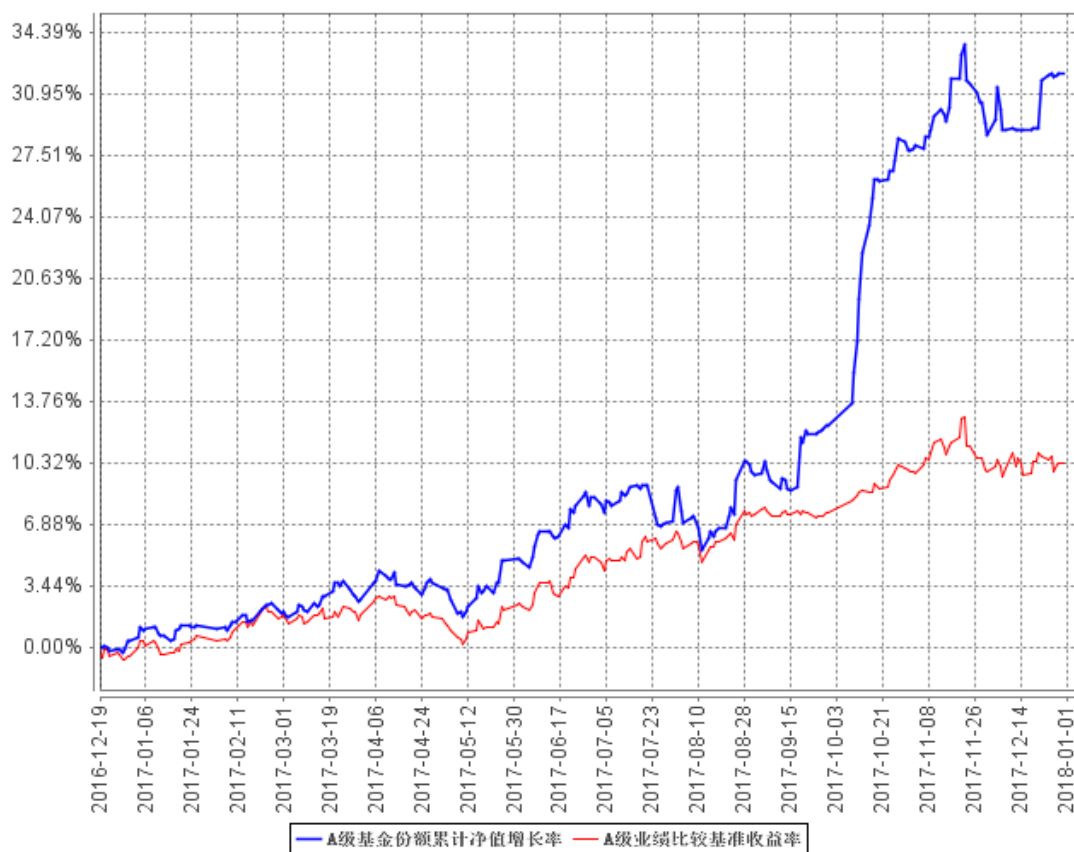
| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③    | ②—④   |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月      | 17.58%   | 0.73%       | 2.60%      | 0.40%         | 14.98% | 0.33% |
| 过去六个月      | 21.87%   | 0.67%       | 5.07%      | 0.35%         | 16.80% | 0.32% |
| 过去一年       | 31.60%   | 0.54%       | 10.86%     | 0.32%         | 20.74% | 0.22% |
| 自基金合同生效起至今 | 32.10%   | 0.53%       | 10.33%     | 0.32%         | 21.77% | 0.21% |

汇安丰利混合 C

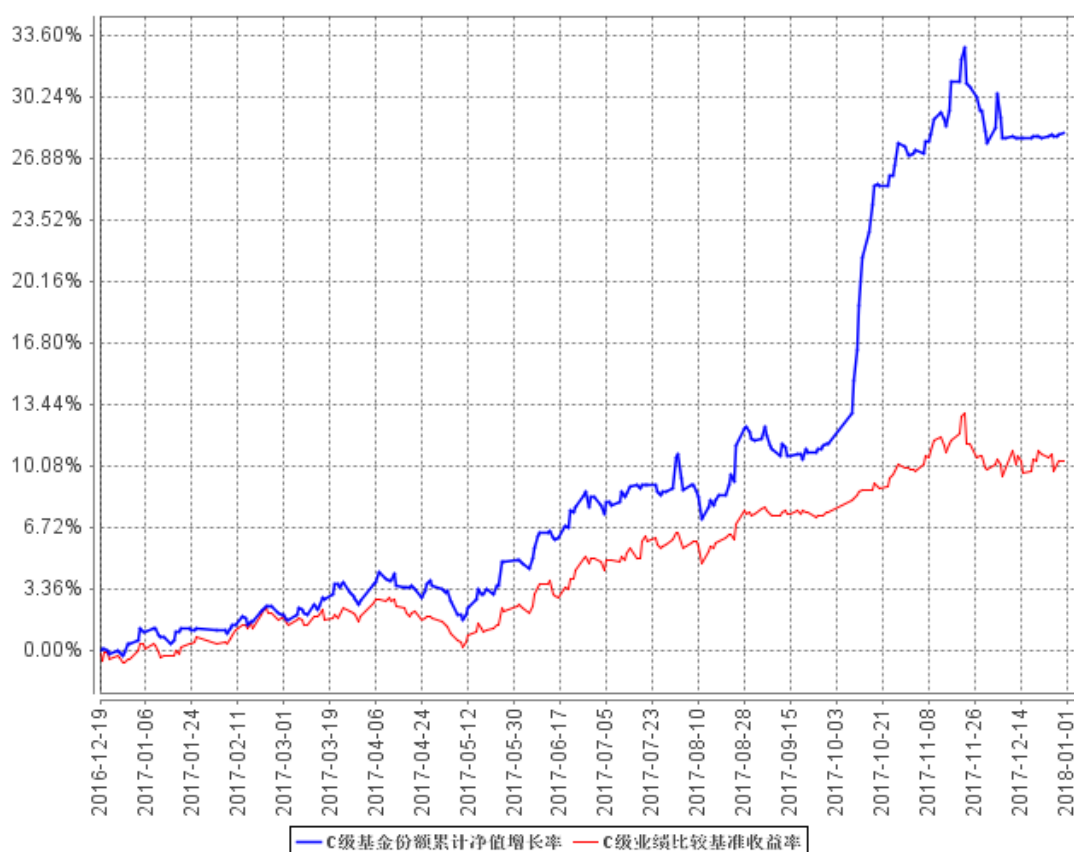
| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③    | ②—④   |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月      | 15.24%   | 0.70%       | 2.60%      | 0.40%         | 12.64% | 0.30% |
| 过去六个月      | 18.33%   | 0.60%       | 5.07%      | 0.35%         | 13.26% | 0.25% |
| 过去一年       | 27.72%   | 0.49%       | 10.86%     | 0.32%         | 16.86% | 0.17% |
| 自基金合同生效起至今 | 28.19%   | 0.48%       | 10.33%     | 0.32%         | 17.86% | 0.16% |

### 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

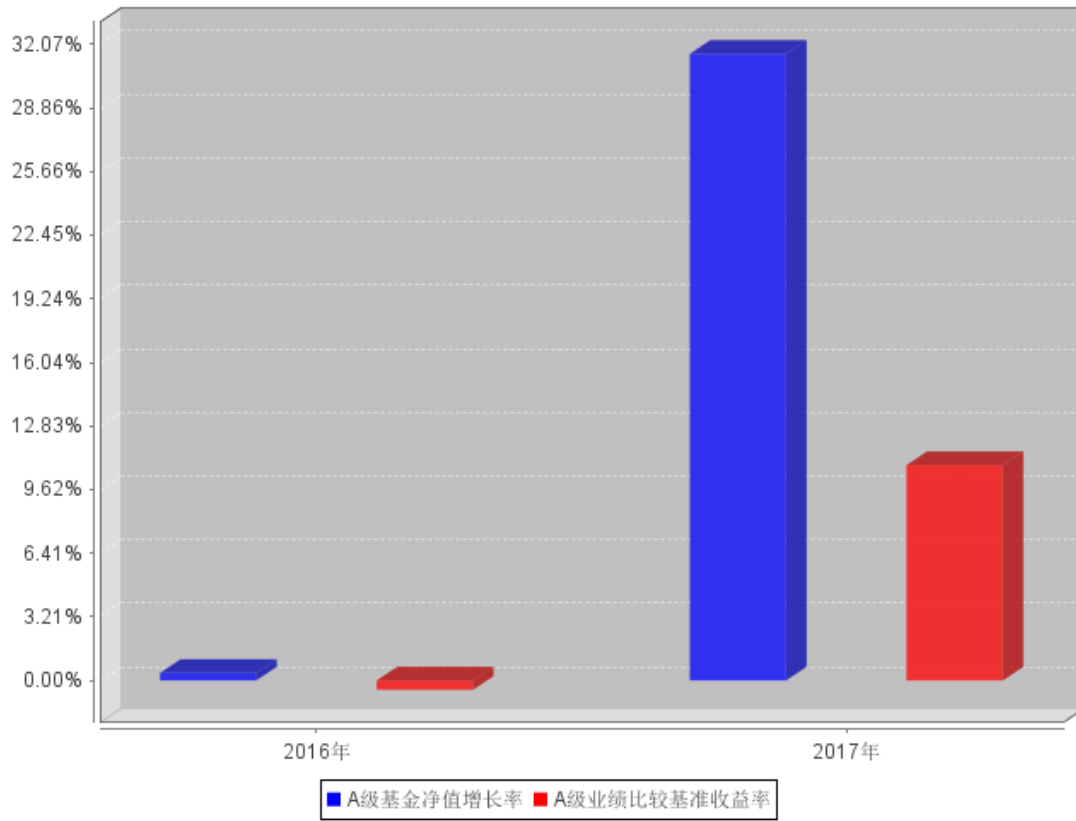


注：①本基金合同生效日为2016年12月19日，至本报告期末，本基金合同生效已满一年。

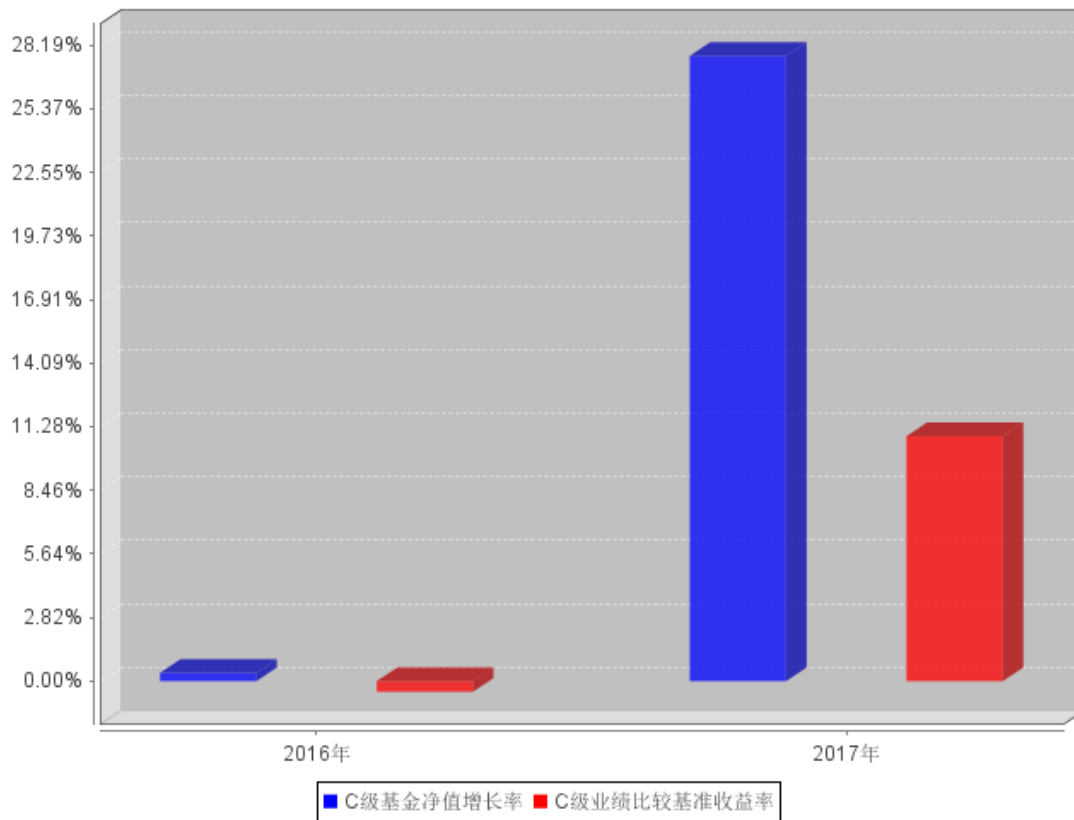
②根据《汇安丰利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、可转换债券、中小企业私募债等）、债券回购、同业存单、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金的投资组合比例为：本基金股票资产投资比例为基金资产的0-95%；每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不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；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2016年12月19日至2017年6月18日，建仓结束时各项资产比例符合合同约定。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

**A级自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图**



C级自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

| 汇安丰利混合 A |             |                |               |                |    |
|----------|-------------|----------------|---------------|----------------|----|
| 年度       | 每10份基金份额分红数 | 现金形式发放总额       | 再投资形式发放总额     | 年度利润分配合计       | 备注 |
| 2017     | 1.2510      | 151,743,220.62 | 14,091,779.71 | 165,835,000.33 | -  |
| 2016     | -           | -              | -             | -              | -  |
| 合计       | 1.2510      | 151,743,220.62 | 14,091,779.71 | 165,835,000.33 | -  |

| 汇安丰利混合 C |             |               |           |               |    |
|----------|-------------|---------------|-----------|---------------|----|
| 年度       | 每10份基金份额分红数 | 现金形式发放总额      | 再投资形式发放总额 | 年度利润分配合计      | 备注 |
| 2017     | 1.2510      | 21,559,224.73 | -         | 21,559,224.73 | -  |
| 2016     | -           | -             | -         | -             | -  |
| 合计       | 1.2510      | 21,559,224.73 | -         | 21,559,224.73 | -  |

## § 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 2017 年 12 月 31 日，公司旗下管理 13 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、汇安丰泰灵活配置混合型证券投资基金、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。

#### 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 |        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
| 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  | -    | 4 年    | 戴杰，复旦大学数学本科、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 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 3 月 22 日至今，任汇安丰恒灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2017 年 3 月 23 日至今，任汇安丰华灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2017 年 7 月 19 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；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 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。 |
| 仇秉则 | 固定收益投资部副总经理、          | 2016 年 12 月 19 日 | -    | 12 年   | 仇秉则，CFA，CPA，中山大学经济学学士，12 年证券、基金行业从业经历，曾任职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                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |

|  |              |  |  |  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
|--|--------------|--|--|--|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  | 本基金的<br>基金经理 |  |  |  | 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 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 19 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；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 1 月 10 日至今，任汇安丰华灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2017 年 1 月 13 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 1 月 25 日至今，任汇安丰泰灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2017 年 3 月 13 日至今，任汇安丰恒灵活配置混合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。 |
|--|--------------|--|--|--|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

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 公平交易制度和控制方法

公司严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善了公司公平交易制度，制度的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等所有投资管理活动，同时包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、监控等投资管理活动相关的各个环节，形成了有效的公平交易执行体系。

对于场内交易，公司启用了交易系统内的公平交易程序，在指令分发及指令执行阶段，均由系统强制执行公平委托；此外，公司严格控制不同投资组合之间的同日反向交易。对于场外交易，

公司完善银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易的交易分配制度，保证各投资组合获得公平的交易机会。对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易，各投资组合经理在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量，公司按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配。

#### 4.3.2 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。

#### 4.3.3 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

2017 年中国宏观经济展现出较强韧性，经济增速稳中有降。本年又是金融监管大年，各项监管政策持续推进，债券收益率大幅上行，信用息差走扩而期限利差维持在历史低位。但股票市场震荡回调，走出罕见分化行情。

2017 年主导债券市场的核心因素是金融监管政策不断出台，过去数年内各类金融机构资产负债表高速扩张并形成复杂的交易链条，在其调整过程中，债券市场遭遇了需求减少同时因债券流动性好于非标资产而被抛售的局面。经过此番调整后，国债收益率继续大幅上行的概率较低，低等级信用债则还有上行空间，需关注金融机构缩中可能引发的信用风险。因此保持组合流动性、审慎甄别信用风险仍是债券获利的主要手段，同时重视顺应政策而灵活调整业务方向。

伴随宏观经济企稳回升，2017 年股票市场出现罕见分化，估值偏低的价值龙头和基本面确定性高的成长龙头均有较大涨幅，走出独立行情，相反缺乏业绩支撑的大部分小股票仍然在不断探底。我们对股票市场标的选择更多考量基本面指标，遵循业绩为王的投资理念，谨慎看待题材炒作。

#### 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 1.1928 元，本报告期基金份额净值增长率为

31.60%；截至本报告期末汇安丰利混合 C 基金份额净值为 1.1566 元，本报告期基金份额净值增长率为 27.72%；同期业绩比较基准收益率为 10.86%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望来看，2018 年基建投资与地产投资面临资金来源受限的约束，消费对经济增长驱动力增强但居民部门杠杆率高企可能会对消费增速形成一定的制约，全球经济向好尤其是发达经济体基本面向好和一带一路战略的推进都将对外需形成提振，预计明年出口增速仍然能维持较高增长。预期通胀处于较温和水平，变数在于油价和供给侧改革传导效应。货币政策在“管住货币供给总闸门”基调下回归中性，大概率保持不松不紧的状态。同时防范和化解重大风险位列三大攻坚战之首，监管政策依然仍需重点关注。

我们认为 A 股市场在 IPO 常态化、再融资审核趋严的背景下，中小市值公司估值继续下移是大概率事件，股票市场结构性分化可能会持续。2018 年，资金有望持续流入股票市场，整体来看，市场下行的空间并不大：目前 A 股大部分传统行业的公司估值修复基本完成，部分公司有泡沫化的趋势，但总体来看并未明显高估，得益于宏观经济增速换挡、行业集中度提升等因素，龙头公司的基本面向好确定性很高，未来盈利持续增长有望继续打开收益空间。与此同时，部分具有长期逻辑支撑的新兴行业估值已经合理，具备中长期投资价值。我们将继续秉承价值投资的理念，寻找估值合理、相对低估的股票进行投资，精选标的、精确化管理组合的风险，实现基金资产中长期的稳定增值。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人依照法律法规和公司内部控制的整体要求，致力于内控机制的完善，积极推动主动合规管理；全面加强风险控制，不断提高风险控制水平；有计划地开展监察稽核工作，推动公司内控体系和制度措施的落实，强化对基金投资运作和公司经营管理的合规性管理。

本报告期内，本基金管理人结合新法规的实施、新的监管要求和公司业务发展情况，坚持从保障基金持有人利益出发，由督察长领导独立于各业务部门的监察稽核部不断推动完善相关制度流程的建立、健全，及时贯彻落实新的监管要求，并通过实时监控、定期检查、专项检查等方式深入开展监察稽核工作，包括对基金投资运作、基金投资交易、基金销售与宣传、投资者适当性管理、客户服务、产品开发、信息披露、反洗钱工作、信息系统与信息安全、基金运营等方面进行监察稽核，及时发现上述业务开展中的相关问题，提出改进建议并跟踪改进落实情况。

本基金管理人承诺将坚持诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，积极健全内部管

理制度，不断提高监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，切实保护基金份额持有人的利益。

#### 4.7 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、风险管理部、监察稽核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。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内收益分配情况如下：

汇安丰利混合 A 以截至 2017 年 12 月 8 日基金可分配收益 236,541,650.65 元为基准，以 2017 年 12 月 18 日为权益登记日、除息日，于 2017 年 12 月 19 日向本基金的基金持有人派发第一次分红，每 1 份基金份额派发红利 0.1251 元。

汇安丰利混合 C 以截至 2017 年 12 月 8 日基金可分配收益 4,493,820.95 元为基准，以 2017 年 12 月 18 日为权益登记日、除息日，于 2017 年 12 月 19 日向本基金的基金持有人派发第一次分红，每 1 份基金份额派发红利 0.1251 元。

#### 4.9 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合规守信、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 审计报告

## 6.1 审计报告基本信息

|            |                         |
|------------|-------------------------|
| 财务报表是否经过审计 | 是                       |
| 审计意见类型     | 标准无保留意见                 |
| 审计报告编号     | 普华永道中天审字(2018)第 20985 号 |

## 6.2 审计报告的基本内容

|           |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |
|-----------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 审计报告标题    | 审计报告                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| 审计报告收件人   | 汇安丰利灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
| 审计意见      | 我们审计了汇安丰利灵活配置混合型证券投资基金以下简称“汇安丰利混合基金”)的财务报表，包括 2017 年 12 月 31 日和 2016 年 12 月 31 日的资产负债表，2017 年度和 2016 年 12 月 19 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止期间的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注<br>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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，公允反映了汇安丰利混合基金 2017 年 12 月 31 日和 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年度和 2016 年 12 月 19 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。 |
| 形成审计意见的基础 | 我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |

|                        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |
|------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|                        | <p>意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于汇安丰利混合基金，并履行了职业道德方面的其他责任。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
| <p>管理层和治理层对财务报表的责任</p> | <p>汇安丰利混合基金的基金管理人汇安基金管理有限责任公司管理层(以下简称“基金管理人”)负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估汇安丰利混合基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非管理层计划清算汇安丰利混合基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>汇安丰利混合基金的基金管理人汇安基金管理有限责任公司治理层负责监督汇安丰利混合基金的财务报告过程。</p>                                                                                                                                                                              |
| <p>注册会计师对财务报表审计的责任</p> | <p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> |

|           |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |    |
|-----------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----|
|           | <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对汇安丰利混合基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而未来的事项或情况可能导致汇安丰利混合基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露)，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与汇安丰利混合基金的基金管理人汇安基金管理有限责任公司治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p> |    |
| 会计师事务所的名称 | 普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |    |
| 注册会计师的姓名  | 薛竞                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   | 赵钰 |
| 会计师事务所的地址 | 中国 · 上海市                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |    |
| 审计报告日期    | 2018 年 3 月 26 日                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |    |

## § 7 年度财务报表

### 7.1 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：2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资 产      | 本期末<br>2017 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2016 年 12 月 31 日 |
|----------|-------------------------|--------------------------|
| 资 产：     |                         |                          |
| 银行存款     | 15,882,799.65           | 193,107,024.95           |
| 结算备付金    | 270,482.95              | -                        |
| 存出保证金    | 137,584.95              | -                        |
| 交易性金融资产  | 270,381,908.21          | 106,827,800.00           |
| 其中：股票投资  | 41,565,634.21           | 106,827,800.00           |
| 基金投资     | -                       | -                        |
| 债券投资     | 228,816,274.00          | -                        |
| 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        | 334,508,837.11                  | -                                |
| 应收证券清算款         | -                               | -                                |
| 应收利息            | 3,717,538.60                    | 352,068.51                       |
| 应收股利            | -                               | -                                |
| 应收申购款           | -                               | -                                |
| 递延所得税资产         | -                               | -                                |
| 其他资产            | -                               | -                                |
| 资产总计            | 624,899,151.47                  | 300,286,893.46                   |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>本期末<br/>2017 年 12 月 31 日</b> | <b>上年度末<br/>2016 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          | -                               | -                                |
| 卖出回购金融资产款       | -                               | -                                |
| 应付证券清算款         | -                               | -                                |
| 应付赎回款           | -                               | -                                |
| 应付管理人报酬         | 474,449.37                      | 58,780.15                        |
| 应付托管费           | 79,074.91                       | 9,796.70                         |
| 应付销售服务费         | 10,572.10                       | 163.81                           |
| 应付交易费用          | 341,778.79                      | 77,239.73                        |
| 应交税费            | -                               | -                                |
| 应付利息            | -                               | -                                |
| 应付利润            | -                               | -                                |
| 递延所得税负债         | -                               | -                                |
| 其他负债            | 160,000.00                      | 5,708.95                         |
| 负债合计            | 1,065,875.17                    | 151,689.34                       |
| <b>所有者权益:</b>   |                                 |                                  |
| 实收基金            | 528,233,165.61                  | 299,013,522.04                   |
| 未分配利润           | 95,600,110.69                   | 1,121,682.08                     |
| 所有者权益合计         | 623,833,276.30                  | 300,135,204.12                   |
| 负债和所有者权益总计      | 624,899,151.47                  | 300,286,893.46                   |

注：1. 报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额总额 528,233,165.61 份，其中 A 类基金份额总额为 355,897,236.50 份，基金份额净值 1.1928 元；C 类基金份额总额为 172,335,929.11 份，基金份额净值 1.1566 元。（于 2016 年 12 月 31 日，基金份额总额 299,013,522.04 份，其中 A 类基金份额总额为 294,013,297.04 份，基金份额净值 1.0038 元；C 类基金份额总额为 5,000,225.00 份，基金份额净值 1.0037 元）。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2017 年度和 2016 年 12 月 19 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日止期间。

## 7.2 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：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项 目                        | 本期<br>2017 年 1 月 1 日至<br>2017 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2016 年 12 月 19 日(基金合同生<br>效日)至 2016 年 12 月 31 日 |
|----------------------------|-------------------------------------------|------------------------------------------------------------|
| <b>一、收入</b>                | 44,880,008.79                             | 1,281,302.16                                               |
| 1.利息收入                     | 7,905,608.44                              | 416,602.16                                                 |
| 其中：存款利息收入                  | 1,115,397.29                              | 416,602.16                                                 |
| 债券利息收入                     | 3,444,925.08                              | -                                                          |
| 资产支持证券利息收入                 | -                                         | -                                                          |
| 买入返售金融资产收入                 | 3,345,286.07                              | -                                                          |
| 其他利息收入                     | -                                         | -                                                          |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）           | 27,372,564.72                             | -                                                          |
| 其中：股票投资收益                  | 25,144,774.89                             | -                                                          |
| 基金投资收益                     | -                                         | -                                                          |
| 债券投资收益                     | 157,898.32                                | -                                                          |
| 资产支持证券投资收益                 | -                                         | -                                                          |
| 贵金属投资收益                    | -                                         | -                                                          |
| 衍生工具收益                     | -                                         | -                                                          |
| 股利收益                       | 2,069,891.51                              | -                                                          |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）      | -1,207,105.83                             | 864,700.00                                                 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）          | -                                         | -                                                          |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）          | 10,808,941.46                             | -                                                          |
| <b>减：二、费用</b>              | 3,861,751.89                              | 159,620.08                                                 |
| 1. 管理人报酬                   | 1,637,509.07                              | 58,780.15                                                  |
| 2. 托管费                     | 272,918.19                                | 9,796.70                                                   |
| 3. 销售服务费                   | 35,178.26                                 | 163.81                                                     |
| 4. 交易费用                    | 1,253,141.51                              | 84,770.47                                                  |
| 5. 利息支出                    | 475,270.33                                | -                                                          |
| 其中：卖出回购金融资产支出              | 475,270.33                                | -                                                          |
| 6. 其他费用                    | 187,734.53                                | 6,108.95                                                   |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> | 41,018,256.90                             | 1,121,682.08                                               |
| 减：所得税费用                    | -                                         | -                                                          |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   | 41,018,256.90                             | 1,121,682.08                                               |

### 7.3 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：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 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）                        | 299,013,522.04                                         | 1,121,682.08    | 300,135,204.12    |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）              | -                                                      | 41,018,256.90   | 41,018,256.90     |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数<br>（净值减少以“-”号填列）  | 229,219,643.57                                         | 240,854,396.77  | 470,074,040.34    |
| 其中：1. 基金申购款                            | 1,867,880,315.65                                       | 486,449,581.21  | 2,354,329,896.86  |
| 2. 基金赎回款                               | -1,638,660,672.08                                      | -245,595,184.44 | -1,884,255,856.52 |
| 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） | -                                                      | -187,394,225.06 | -187,394,225.06   |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 528,233,165.61                                         | 95,600,110.69   | 623,833,276.30    |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2016 年 12 月 19 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 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）                        | 299,013,522.04                                         | -               | 299,013,522.04    |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）              | -                                                      | 1,121,682.08    | 1,121,682.08      |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数<br>（净值减少以“-”号填列）  | -                                                      | -               | -                 |
| 其中：1. 基金申购款                            | -                                                      | -               | -                 |
| 2. 基金赎回款                               | -                                                      | -               | -                 |
| 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）                        | 299,013,522.04                                         | 1,121,682.08    | 300,135,204.12    |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

|           |            |            |
|-----------|------------|------------|
| <u>秦军</u> | <u>杜海岚</u> | <u>杜海岚</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    |

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 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；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： $\text{沪深 300 指数收益率} \times 50\% + \text{上证国债指数收益率} \times 50\%$ 。

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 2018 年 3 月 26 日批准报出。

## 7.4.2 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 7.4.4 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。

## 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2017 年度和 2016 年 12 月 19 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日止期间的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 2017 年 12 月 31 日和 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年度和 2016 年 12 月 19 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

## 7.4.4 重要会计政策和会计估计

## 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 7.4.5.1 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。

### 7.4.5.2 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。

### 7.4.5.3 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。

## 7.4.6 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》、及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。

(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。

#### 7.4.7 关联方关系

| 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           |
| 赵毅                   | 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           |

#### 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

##### 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 7.4.8.1.1 股票交易

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。

#### 7.4.8.2 关联方报酬

##### 7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2017年1月1日至2017<br>年12月31日 | 上年度可比期间<br>2016年12月19日(基金合同生效<br>日)至2016年12月31日 |
|-----------------|---------------------------------|-------------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 1,637,509.07                    | 58,780.15                                       |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | -                               | -                                               |

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 × 0.60% / 当年天数。

##### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2017年1月1日至2017<br>年12月31日 | 上年度可比期间<br>2016年12月19日(基金合同生<br>效日)至2016年12月31日 |
|----------------|---------------------------------|-------------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 272,918.19                      | 9,796.70                                        |

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 × 0.10% / 当年天数。

##### 7.4.8.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的<br>各关联方名称 | 本期<br>2017年1月1日至2017年12月31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        |
| 汇安基金管理有限责任公司       | -                                               | 35,178.26 | 35,178.26 |
| 兴业银行股份有限公司         | -                                               | -         | -         |
| 合计                 | -                                               | 35,178.26 | 35,178.26 |
| 获得销售服务费的<br>各关联方名称 | 上年度可比期间<br>2016年12月19日(基金合同生效日)至2016年12月31<br>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     |
|--------------|----------|----------|--------|
| 汇安基金管理有限责任公司 | -        | 163.81   | 163.81 |
| 兴业银行股份有限公司   | -        | -        | -      |
| 合计           | -        | 163.81   | 163.81 |

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值 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。

#### 7.4.8.3 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。

#### 7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

报告期内，基金管理人未运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的基金份额。

##### 7.4.8.4.2 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

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方没有投资本基金的情况。

#### 7.4.8.5 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<br>2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日 |            | 上年度可比期间<br>2016 年 12 月 19 日(基金合同生效日)<br>至 2016 年 12 月 31 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  | 15,882,799.65                          | 644,373.40 | 13,107,024.95                                              | 86,185.45 |

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。

#### 7.4.8.6 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。

#### 7.4.8.7 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。

#### 7.4.9 期末（2017 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.10.1.1 受限证券类别：股票

| 证券代码   | 证券名称 | 成功认购日            | 可流通日           | 流通受限类型 | 认购价格  | 期末估值单价 | 数量<br>(单位: 股) | 期末成本总额    | 期末估值总额    | 备注 |
|--------|------|------------------|----------------|--------|-------|--------|---------------|-----------|-----------|----|
| 603161 | 科华控股 | 2017 年 12 月 28 日 | 2018 年 1 月 5 日 | 新股流通受限 | 16.75 | 16.75  | 1,239         | 20,753.25 | 20,753.25 | -  |
| 603080 | 新疆火炬 | 2017 年 12 月 25 日 | 2018 年 1 月 3 日 | 新股流通受限 | 13.60 | 13.60  | 1,187         | 16,143.20 | 16,143.20 | -  |

#### 7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.9.3.1 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。

##### 7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2017 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 41,528,737.76 元，属于第二层次的余额为 228,853,170.45 元，无属于第三层次的余额(2016 年 12 月 31 日：第一层次 106,827,800.00 元，无属于第二层次以及第三层次的余额)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输

入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2017 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2016 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 增值税

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[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》的规定：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。

根据财政部、国家税务总局于 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，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。

此外，财政部、国家税务总局于 2017 年 12 月 25 日颁布的财税[2017]90 号《关于租入固定资产进行税额抵扣等增值税政策的通知》对资管产品管理人自 2018 年 1 月 1 日起运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务的销售额确定做出规定。

上述税收政策对本基金截至 2017 年 12 月 31 日止的财务状况和经营成果无影响。

(3) 除公允价值和增值税外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 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  | 41,565,634.21 | 6.65         |
|    | 其中：股票 | 41,565,634.21 | 6.65         |

|   |                   |                |        |
|---|-------------------|----------------|--------|
| 2 | 基金投资              | -              | -      |
| 3 | 固定收益投资            | 228,816,274.00 | 36.62  |
|   | 其中：债券             | 228,816,274.00 | 36.62  |
|   | 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          | 334,508,837.11 | 53.53  |
|   | 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      | 16,153,282.60  | 2.58   |
| 8 | 其他各项资产            | 3,855,123.55   | 0.62   |
| 9 | 合计                | 624,899,151.47 | 100.00 |

## 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 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          | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------------------|---------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | -             | -            |
| B  | 采矿业              | 1,365,535.36  | 0.22         |
| C  | 制造业              | 9,657,860.71  | 1.55         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 287,358.20    | 0.05         |
| E  | 建筑业              | 2,720,183.00  | 0.44         |
| F  | 批发和零售业           | -             | -            |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 808,275.94    | 0.13         |
| H  | 住宿和餐饮业           | -             | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 450,696.00    | 0.07         |
| J  | 金融业              | 24,975,189.00 | 4.00         |
| K  | 房地产业             | 1,300,536.00  | 0.21         |
| 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        | -             | -            |

|   |    |               |      |
|---|----|---------------|------|
| S | 综合 | -             | -    |
|   | 合计 | 41,565,634.21 | 6.66 |

## 8.2.2 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。

## 8.3 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

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 | 60,000  | 4,198,800.00 | 0.67         |
| 2  | 600519 | 贵州茅台 | 4,000   | 2,789,960.00 | 0.45         |
| 3  | 600036 | 招商银行 | 87,500  | 2,539,250.00 | 0.41         |
| 4  | 601989 | 中国重工 | 411,800 | 2,483,154.00 | 0.40         |
| 5  | 600016 | 民生银行 | 206,700 | 1,734,213.00 | 0.28         |
| 6  | 601336 | 新华保险 | 23,400  | 1,642,680.00 | 0.26         |
| 7  | 600887 | 伊利股份 | 48,000  | 1,545,120.00 | 0.25         |
| 8  | 601328 | 交通银行 | 245,300 | 1,523,313.00 | 0.24         |
| 9  | 601601 | 中国太保 | 34,500  | 1,428,990.00 | 0.23         |
| 10 | 601288 | 农业银行 | 343,800 | 1,316,754.00 | 0.21         |

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于管理人网站的年度报告正文。

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 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 | 62,360,106.60 | 20.78          |
| 2  | 600519 | 贵州茅台 | 22,140,811.98 | 7.38           |
| 3  | 600036 | 招商银行 | 21,602,278.59 | 7.20           |
| 4  | 300002 | 神州泰岳 | 20,038,000.00 | 6.68           |
| 5  | 601288 | 农业银行 | 17,843,420.00 | 5.95           |
| 6  | 601328 | 交通银行 | 15,700,256.25 | 5.23           |
| 7  | 600016 | 民生银行 | 15,614,142.82 | 5.20           |
| 8  | 600837 | 海通证券 | 13,915,569.00 | 4.64           |
| 9  | 600000 | 浦发银行 | 13,337,362.55 | 4.44           |

|    |        |      |               |      |
|----|--------|------|---------------|------|
| 10 | 600887 | 伊利股份 | 12,367,493.51 | 4.12 |
| 11 | 601601 | 中国太保 | 12,251,447.00 | 4.08 |
| 12 | 601766 | 中国中车 | 11,884,044.00 | 3.96 |
| 13 | 601668 | 中国建筑 | 11,081,141.00 | 3.69 |
| 14 | 600030 | 中信证券 | 10,736,979.66 | 3.58 |
| 15 | 600820 | 隧道股份 | 9,970,500.00  | 3.32 |
| 16 | 601398 | 工商银行 | 9,877,369.29  | 3.29 |
| 17 | 601169 | 北京银行 | 8,571,794.71  | 2.86 |
| 18 | 600104 | 上汽集团 | 8,231,627.18  | 2.74 |
| 19 | 002736 | 国信证券 | 6,996,762.00  | 2.33 |
| 20 | 000776 | 广发证券 | 6,937,680.00  | 2.31 |
| 21 | 601211 | 国泰君安 | 6,894,967.00  | 2.30 |
| 22 | 601988 | 中国银行 | 6,577,337.00  | 2.19 |
| 23 | 000333 | 美的集团 | 6,414,628.00  | 2.14 |
| 24 | 600048 | 保利地产 | 6,128,079.86  | 2.04 |
| 25 | 601857 | 中国石油 | 6,124,172.00  | 2.04 |

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。

#### 8.4.2 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  | 601318 | 中国平安 | 63,453,653.10 | 21.14          |
| 2  | 600519 | 贵州茅台 | 52,567,494.49 | 17.51          |
| 3  | 000826 | 启迪桑德 | 31,167,180.00 | 10.38          |
| 4  | 000783 | 长江证券 | 28,334,100.00 | 9.44           |
| 5  | 600887 | 伊利股份 | 26,808,756.00 | 8.93           |
| 6  | 600036 | 招商银行 | 19,462,893.10 | 6.48           |
| 7  | 300002 | 神州泰岳 | 17,909,500.00 | 5.97           |
| 8  | 600674 | 川投能源 | 17,484,000.00 | 5.83           |
| 9  | 601288 | 农业银行 | 16,898,498.00 | 5.63           |
| 10 | 601328 | 交通银行 | 14,033,916.00 | 4.68           |
| 11 | 600016 | 民生银行 | 13,818,269.60 | 4.60           |
| 12 | 600837 | 海通证券 | 13,077,056.69 | 4.36           |
| 13 | 600000 | 浦发银行 | 11,715,672.66 | 3.90           |
| 14 | 601766 | 中国中车 | 11,158,730.63 | 3.72           |

|    |        |      |               |      |
|----|--------|------|---------------|------|
| 15 | 601601 | 中国太保 | 11,133,500.28 | 3.71 |
| 16 | 600030 | 中信证券 | 9,677,560.00  | 3.22 |
| 17 | 601668 | 中国建筑 | 9,667,895.00  | 3.22 |
| 18 | 600820 | 隧道股份 | 8,772,000.00  | 2.92 |
| 19 | 601398 | 工商银行 | 8,733,854.00  | 2.91 |
| 20 | 000333 | 美的集团 | 7,915,600.00  | 2.64 |
| 21 | 601169 | 北京银行 | 7,419,307.00  | 2.47 |
| 22 | 000776 | 广发证券 | 7,300,980.00  | 2.43 |
| 23 | 600104 | 上汽集团 | 7,168,980.50  | 2.39 |
| 24 | 002736 | 国信证券 | 7,027,680.00  | 2.34 |
| 25 | 601211 | 国泰君安 | 6,112,219.00  | 2.04 |

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。

#### 8.4.3 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 | 444,199,230.60 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 533,889,684.46 |

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。

#### 8.5 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      | 19,968,000.00  | 3.20         |
|    | 其中：政策性金融债 | 19,968,000.00  | 3.20         |
| 4  | 企业债券      | 149,501,274.00 | 23.96        |
| 5  | 企业短期融资券   | -              | -            |
| 6  | 中期票据      | 9,957,000.00   | 1.60         |
| 7  | 可转债（可交换债） | -              | -            |
| 8  | 同业存单      | 49,390,000.00  | 7.92         |
| 9  | 其他        | -              | -            |
| 10 | 合计        | 228,816,274.00 | 36.68        |

#### 8.6 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  | 111719333 | 17 恒丰银行 CD333  | 500,000 | 49,390,000.00 | 7.92         |
| 2  | 1480549   | 14 首创集团永续期债 01 | 500,000 | 49,015,000.00 | 7.86         |
| 3  | 136586    | 16 中合 01       | 300,000 | 29,043,000.00 | 4.66         |
| 4  | 150309    | 15 进出 09       | 200,000 | 19,968,000.00 | 3.20         |
| 5  | 143283    | 17 江海 G1       | 200,000 | 19,722,000.00 | 3.16         |

## 8.7 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。

## 8.8 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。

## 8.9 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。

## 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 8.10.1 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。

### 8.10.2 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。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 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。

### 8.11.2 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投资国债期货。

### 8.11.3 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。

## 8.12 投资组合报告附注

**8.12.1** 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。

**8.12.2** 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。

### 8.12.3 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   | 137,584.95   |
| 2  | 应收证券清算款 | —            |
| 3  | 应收股利    | —            |
| 4  | 应收利息    | 3,717,538.60 |
| 5  | 应收申购款   | —            |
| 6  | 其他应收款   | —            |
| 7  | 待摊费用    | —            |
| 8  | 其他      | —            |
| 9  | 合计      | 3,855,123.55 |

### 8.12.4 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。

### 8.12.5 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。

### 8.12.6 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。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 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<br>(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 | 222          | 1,603,140.70  | 355,544,053.06 | 99.900763%  | 353,183.44 | 0.099237% |
| 汇安丰利混合 C | 3            | 57,445,309.70 | 172,335,929.11 | 100.000000% | 0.00       | 0.000000% |
| 合计       | 225          | 2,347,702.96  | 527,879,982.17 | 99.933139%  | 353,183.44 | 0.066861% |

### 9.3 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<br>从业人员持有本<br>基金 | 汇安丰利混合 A | 133.38 | 0.00010000% |
|                          | 汇安丰利混合 C | 0.00   | 0.00000000% |
|                          | 合计       | 133.38 | 0.00010000% |

#### 9.4 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<br>投资和研究部门负责人持<br>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<br>放式基金                    | 汇安丰利混合 A | 0~10              |
|                                        | 汇安丰利混合 C | 0                 |
|                                        | 合计       | 0~10              |

### § 10 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                    | 294,013,297.04   | 5,000,225.00   |
| 本报告期基金总申购份额                     | 1,602,586,425.73 | 265,293,889.92 |
| 减:本报告期基金总赎回份额                   | 1,540,702,486.27 | 97,958,185.81  |
| 本报告期期末基金份额总额                    | 355,897,236.50   | 172,335,929.11 |

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。

### § 11 重大事件揭示

#### 11.1 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。

#### 11.2 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

2017 年 1 月 4 日本基金管理人发布公告，孙运英女士不再担任公司首席风控官职务，转任公司督察长职务。

2017 年 8 月 22 日本基金管理人发布公告，袁明女士因工作变动不再担任公司副总经理。

2017 年 8 月 28 日本基金管理人发布公告，窦星华先生、王俊波先生自 2017 年 8 月 25 日起

担任公司副总经理。

上述人事变动已按相关规定备案、公告。

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。

### 11.3 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。

### 11.4 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。

### 11.5 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 16 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。本基金自基金成立日至 2017 年 12 月 31 日应支付审计费用陆万元整。

### 11.6 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。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 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 |      |
| 东方证券 | 2      | -              | -            | -          | -          | 本期新增 |
| 国金证券 | 2      | 540,370,349.47 | 55.44%       | 384,360.74 | 60.88%     | 本期新增 |
| 银河证券 | 2      | 111,279,061.00 | 11.42%       | 80,778.61  | 12.79%     | -    |
| 山西证券 | 2      | 210,496,391.93 | 21.59%       | 153,679.39 | 24.34%     | 本期新增 |
| 中泰证券 | 2      | 112,587,728.36 | 11.15%       | 12,531.79  | 1.98%      | 本期新增 |

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，基金管理人留存监察稽核部备案。

## 11.7.2 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 |
| 东方证券 | -              | -            | -                | -              | -    | -            |
| 国金证券 | 15,151.89      | 0.01%        | 5,541,000,000.00 | 84.49%         | -    | -            |
| 银河证券 | 100,892,907.12 | 97.61%       | 241,000,000.00   | 3.67%          | -    | -            |
| 山西证券 | 1,372,468.80   | 1.33%        | 758,000,000.00   | 11.56%         | -    | -            |
| 中泰证券 | 1,083,658.65   | 1.05%        | 18,000,000.00    | 0.27%          | -    | -            |

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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              | 20170920-20171207       | 0.00 | 32,502,652.25 | 16,451,144.83 | 16,051,507.42 | 3.0000% |

|                                                                                                                                                                                   |                   |                |                |                |                |          |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------|
| 2                                                                                                                                                                                 | 20171213-20171221 | 0.00           | 387,866,728.73 | 387,866,728.73 | 0.00           | -        |
| 3                                                                                                                                                                                 | 20171208-20171221 | 0.00           | 387,926,914.42 | 387,926,914.42 | 0.00           | -        |
| 4                                                                                                                                                                                 | 20171208-20171221 | 0.00           | 387,926,914.42 | 387,926,914.42 | 0.00           | -        |
| 5                                                                                                                                                                                 | 20171222-20171231 | 0.00           | 156,274,421.69 | 0.00           | 156,274,421.69 | 30.0000% |
| 6                                                                                                                                                                                 | 20170103-20170721 | 299,012,455.00 | 0.00           | 299,012,455.00 | 0.00           | -        |
| 7                                                                                                                                                                                 | 20171222-20171231 | 0.00           | 214,591,416.31 | 0.00           | 214,591,416.31 | 41.0000% |
| 8                                                                                                                                                                                 | 20170727-20171018 | 0.00           | 89,239,620.41  | 60,861,152.93  | 28,378,450.92  | 5.0000%  |
| 9                                                                                                                                                                                 | 20170926-20170929 | 0.00           | 18,072,906.28  | 18,072,906.28  | 0.00           | -        |
| 10                                                                                                                                                                                | 20170926-20170929 | 0.00           | 18,025,316.22  | 18,025,316.22  | 0.00           | -        |
| 11                                                                                                                                                                                | 20170926-20170929 | 0.00           | 18,025,316.22  | 18,025,316.22  | 0.00           | -        |
| 12                                                                                                                                                                                | 20171019-20171207 | 0.00           | 31,657,417.54  | 0.00           | 31,657,417.54  | 6.0000%  |
| 个<br>人                                                                                                                                                                            | -                 | -              | -              | -              | -              | -        |
| 产品特有风险                                                                                                                                                                            |                   |                |                |                |                |          |
| 本基金本报告期末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。 |                   |                |                |                |                |          |

## 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

根据《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》（财税[2016]36 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[2016]140 号）、《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》（财税[2017]2 号）、《关于资管产品增值税有关问题的通知》（财税[2017]56 号）、《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》（财税[2017]90 号）等有关规定，自 2018 年 1 月 1 日起，我司旗下所有证券投资基金发生的增值税应税行为，将适用简易计税方法，按照适用法规缴纳增值税以及相关附加，相应税费需由各基金财产承担。上述新的税费可能对基金财产收益水平有所影响。

汇安基金管理有限责任公司  
 2018 年 3 月 27 日