汇安量化优选灵活配置混合型证券投资基金
2018年年度报告

2018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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2019年3月30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 3 月 29 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 2018 年 7 月 26 日起至 2018 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录 2
1.1 重要提示 2
1.2 目录 3
§2 基金简介 5
2.1 基金基本情况 5
2.2 基金产品说明 5
2.3 基金管理人和基金托管人 5
2.4 信息披露方式 6
2.5 其他相关资料 6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况 7
3.1 主要会计数据和财务指标 7
3.2 基金净值表现 7
3.3 过去三年基金的利润分配情况 11
§4 管理人报告 12
4.1 基金管理人及基金经理情况 12
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 16
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 16
§5 托管人报告 17
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 17
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 17
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 17
§6 审计报告 18
6.1 审计报告基本信息 18
6.2 审计报告的基本内容 18
§7 年度财务报表 21
7.1 资产负债表 21
7.2 利润表 22
7.3 所有者权益（基金净值）变动表 23
7.4 报表附注 24
§8 投资组合报告 45
8.1 期末基金资产组合情况 45
8.2 期末按行业分类的股票投资组合 45
8.3 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 46
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 53
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 56
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 56
8.7 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细 56

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 56
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 57
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 57
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 57
8.12 投资组合报告附注 57
§9 基金份额持有人信息 59
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 59
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 59
9.3 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 59
§10 开放式基金份额变动 60
§11 重大事件揭示 61
11.1 基金份额持有人大会决议 61
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 61
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 61
11.4 基金投资策略的改变 61
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 61
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 61
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 61
11.8 其他重大事件 62
§12 影响投资者决策的其他重要信息 64
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 64
§13 备查文件目录 65
13.1 备查文件目录 65
13.2 存放地点 65
13.3 查阅方式 65

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	汇安量化优选灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	汇安量化优选	
基金主代码	005599	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 7 月 26 日	
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	43,024,889.23 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称：	汇安量化优选 A	汇安量化优选 C
下属分级基金的交易代码：	005599	005600
报告期末下属分级基金的份额总额	38,542,311.00 份	4,482,578.23 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过数量化方法进行投资组合管理，在严格控制风险并保持资产流动性的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金通过合理稳健的资产配置策略，将基金资产在股票类资产和债券类资产之间灵活配置，以精确化的数学优化方式控制各个维度的风险暴露。在个股选择方面，本基金在基金管理人成熟的量化选股框架下挖掘具有超额收益的股票组合，把握中国经济增长和资本市场发展机遇，严格控制下行风险，力争实现基金份额净值的长期平稳增长。 本基金投资策略主要包括资产配置策略、股票投资策略、债券类资产投资策略、股指期货和国债期货投资策略、权证投资策略等。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×55%+上证国债指数收益率×45%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其风险收益水平高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。

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	秦军	郭明
	联系电话	01056711688	010-66105798
	电子邮箱	qinjun@huianfund.cn	custoday@icbc.com.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	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	100007	100140
法定代表人	秦军	易会满

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼
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、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	2018 年 7 月 26 日(基金合同生效日)-2018 年 12 月 31 日	
	汇安量化优选 A	汇安量化优选 C
本期已实现收益	-5,125,032.91	-792,727.00
本期利润	-5,282,789.72	-866,659.51
加权平均基金份额本期利润	-0.1313	-0.0193
本期加权平均净值利润率	-13.82%	-1.94%
本期基金份额净值增长率	-13.24%	-13.60%
3.1.2 期末数据和指标	2018 年末	
期末可供分配利润	-5,102,110.18	-609,810.15
期末可供分配基金份额利润	-0.1324	-0.1360
期末基金资产净值	33,440,200.82	3,872,768.08
期末基金份额净值	0.8676	0.8640
3.1.3 累计期末指标	2018 年末	
基金份额累计净值增长率	-13.24%	-13.60%

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。

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

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

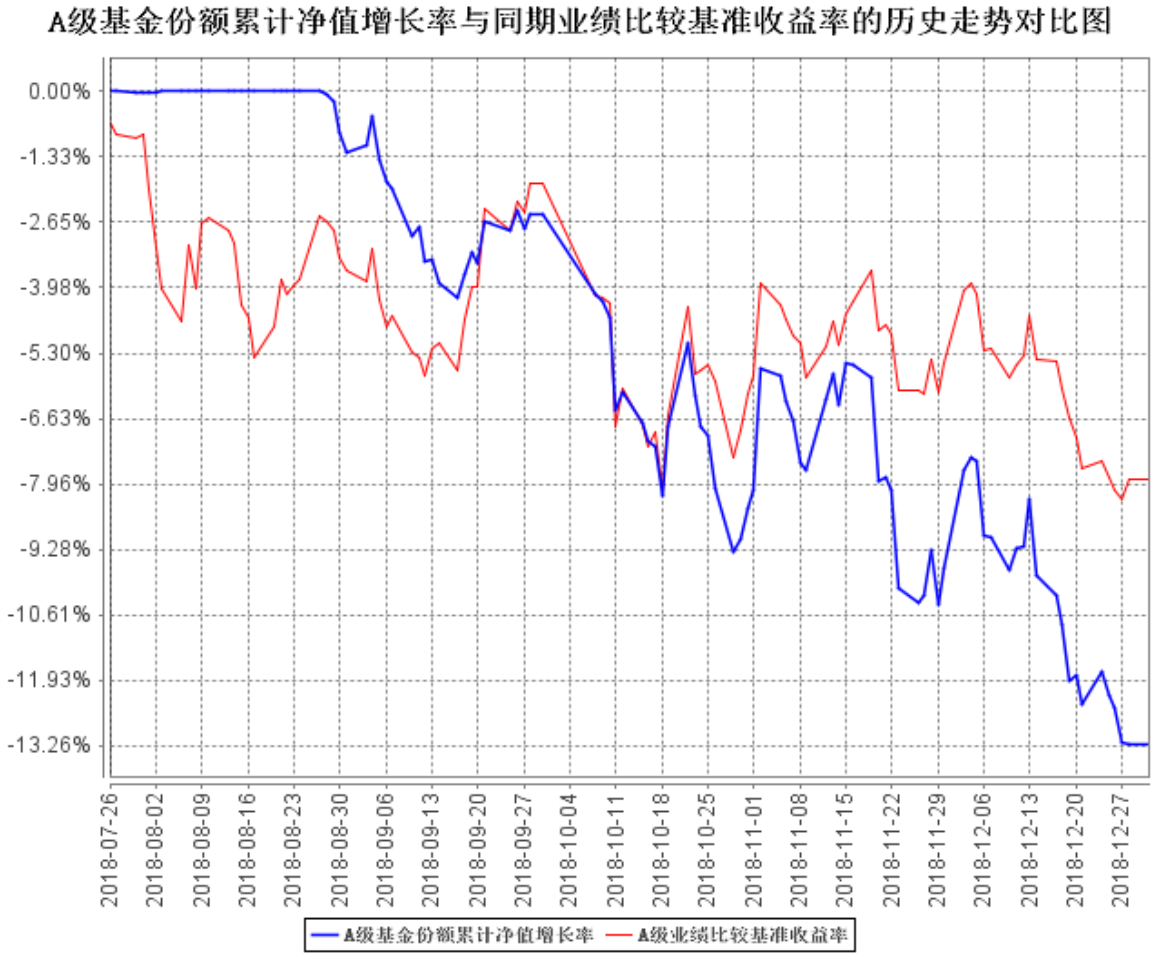
汇安量化优选 A

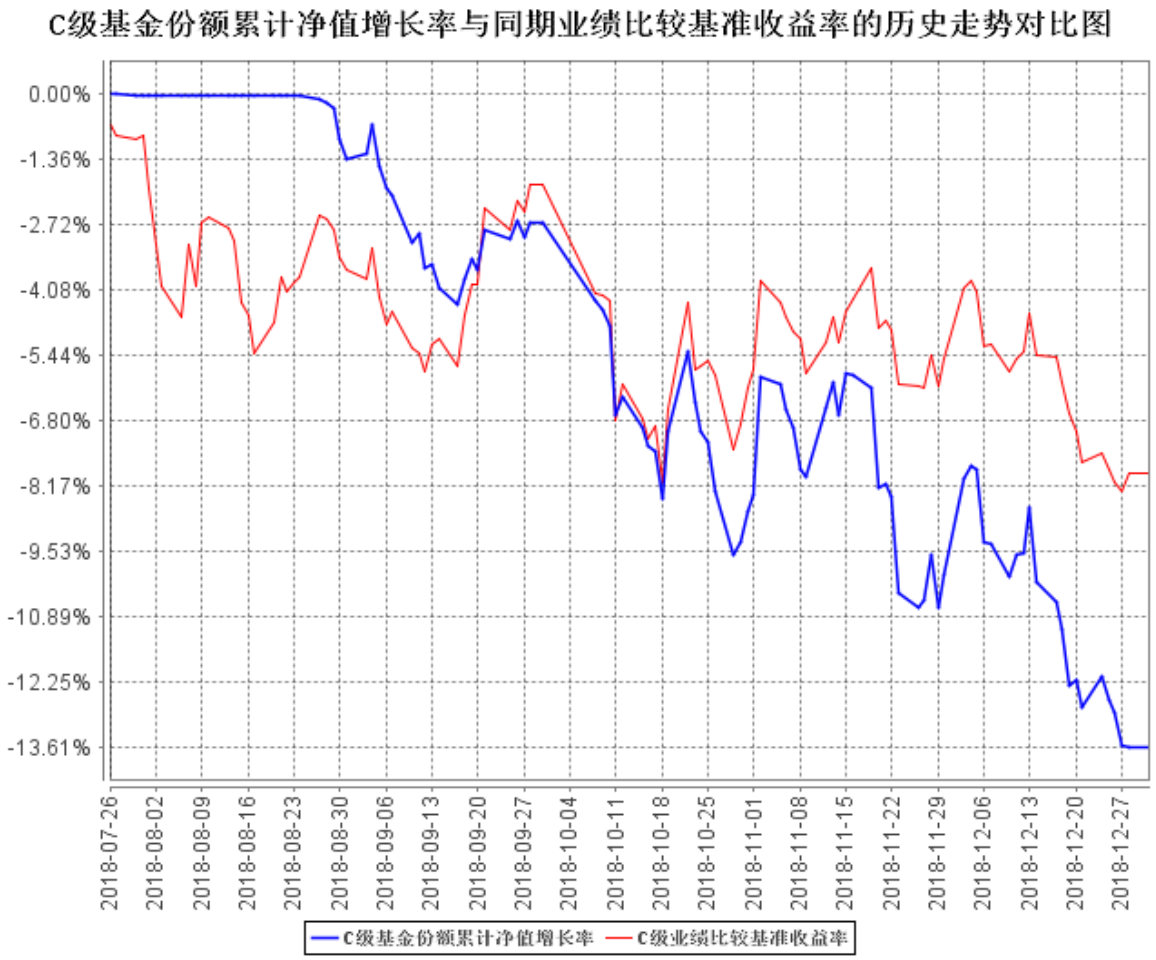
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	-11.03%	1.00%	-6.12%	0.90%	-4.91%	0.10%
自基金合同生效起至今	-13.24%	0.79%	-7.88%	0.83%	-5.36%	-0.04%

汇安量化优选 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	-11.22%	1.00%	-6.12%	0.90%	-5.10%	0.10%
自基金合同生效起至今	-13.60%	0.79%	-7.88%	0.83%	-5.72%	-0.04%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



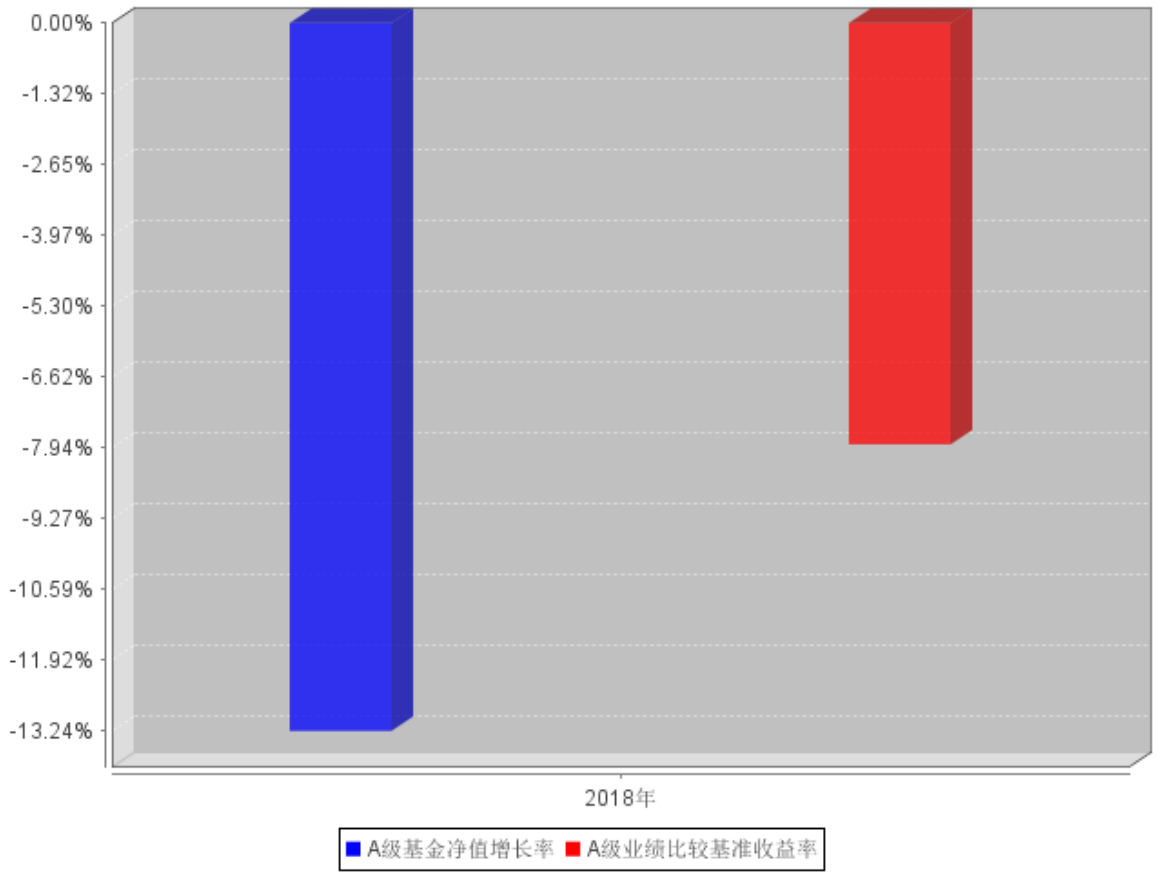


注：①本基金合同生效日为 2018 年 7 月 26 日，至本报告期末，本基金合同生效未满一年。

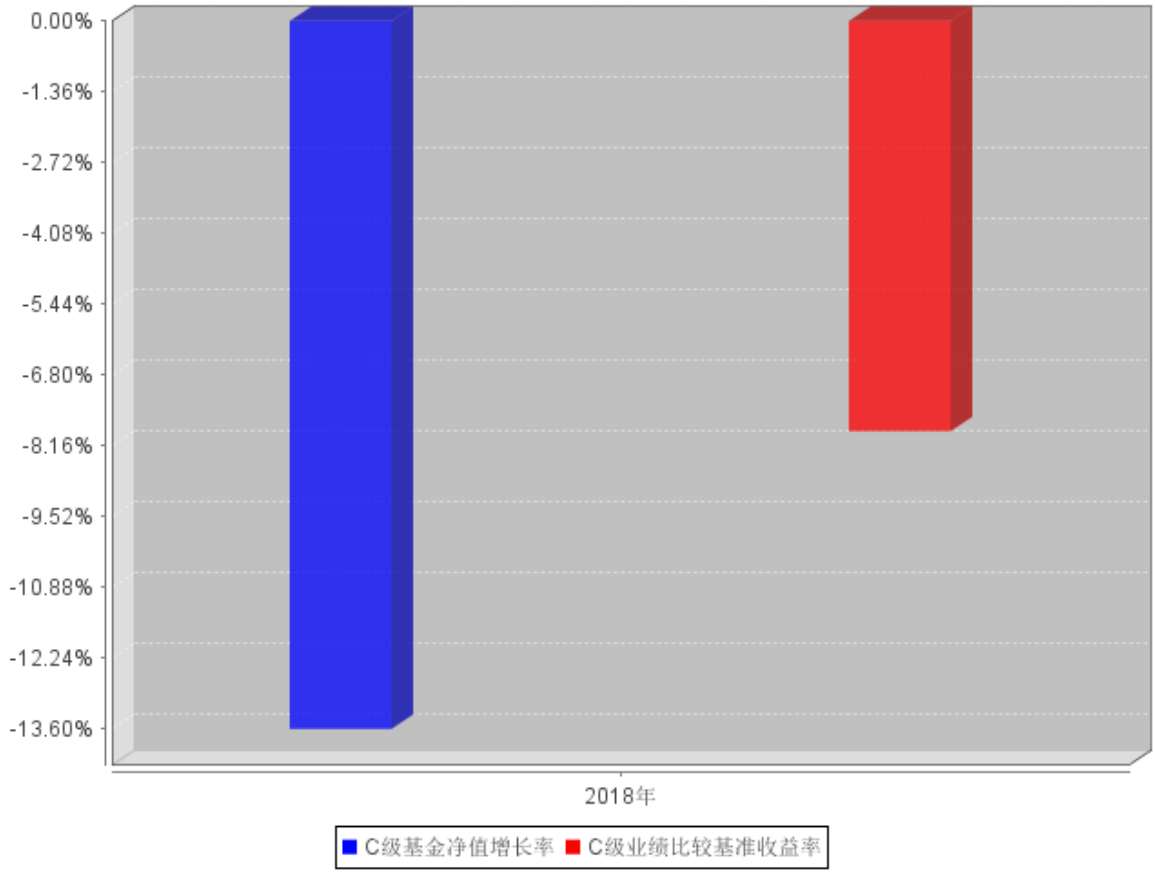
②根据《汇安量化优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、可转换债券、分离交易的可转换债券、中小企业私募债等）、债券回购、同业存单、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。基金的投资组合比例为：本基金股票资产投资比例为基金资产的 0-95%；每个交易日日终在扣除股指期货合约、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。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，本基金仍处于建仓期。

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



注：本基金合同生效日为 2018 年 7 月 26 日。合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自成立至本报告期末未进行利润分配。

§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 2018 年 12 月 31 日，公司旗下管理 22 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、汇安成长优选灵活配置混合型证券投资基金、汇安量化优选灵活配置混合型证券投资基金、汇安趋势动力股票型证券投资基金、汇安裕华纯债定期开放债券型发起式证券投资基金、汇安稳裕债券型证券投资基金、汇安短债债券型证券投资基金、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。

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	2018 年 7 月 26 日	-	5 年	戴杰，复旦大学数学本科、硕士，5 年证券、基金行业从业经历，曾任华安基金管理有限公司指数与量化投资部先后担任数量分析师和投资经理。2016 年 10 月 24 日加入汇安基金管理有限责任公司，担任指数与量化投资部高级经理一职。2017 年 7 月 27 日至 2018 年 8 月 9 日，任汇安丰裕灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2017 年 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 11 月 22 日至今，任汇安多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2018 年 2 月 13 日至今，任汇安成长优选灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2018 年 7 月 26 日至今，任汇安量化优选灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
朱晨歌	指数与量化投资部高级经理、本基金的基金经理	2018 年 8 月 9 日	-	4 年	朱晨歌，复旦大学理论物理硕士，4 年证券、基金行业从业经历，曾任华安基金管理有限公司指数与量化投资事业部数量分析师、投资经理，从事量化投资研究工作。2017 年 12 月 29 日加入汇安基金管理有限责任公司，担任指数与量化投资部高级经理一职。2018 年 2 月 8 日至今，任汇安丰利灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2018 年 2 月 8 日至今，任汇安多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2018 年 4 月 26 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；2018 年 8 月 9 日至今，任汇安量化优选灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2018 年 8 月 22 日至今，任汇安沪深 300 指数增强型证券投资基金基金经理。

注：1、“任职日期”和“离职日期”分别指根据公司对外披露的聘任日期和解聘日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

3、本基金无基金经理助理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求利益，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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中的公平交易程序，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

报告期内，国内宏观经济超预期下行，市场也整体呈震荡下行趋势，主要反映了投资者对于经济和中美贸易摩擦的担忧。在大的环境下，风险偏好持续下降，出口和消费的疲软也影响了企业盈利水平，尤其是中小企业。本基金策略以量化选择成长股为主，受到一定市场风格影响。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末汇安量化优选 A 基金份额净值为 0.8676 元，本报告期基金份额净值增长率为-13.24%；截至本报告期末汇安量化优选 C 基金份额净值为 0.8640 元，本报告期基金份额净值增长率为-13.60%；同期业绩比较基准收益率为-7.88%。

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 2019 年，虽然不确定性仍然较高，但已经有了一些积极信号：政府稳增长的首要任务，深化改革开放的明确方向，减税降费的加速推动，以及对民营经济的高度肯定和切实纾困等一系列表态和举措，都有助于解决问题，提振实体经济参与者和投资者的信心。中美贸易战虽有反复，但随着两国元首在年底会晤，双方达成了相向而行的共同目标，并有望在 2019 年一季度达成协议。另外，美国经济在 2019 年同样有下行压力，且美国股市已开始调整，加息步伐可能放缓。总体来看，国内外环境边际改善的迹象比较明显，但相关政策传导到企业盈利和居民收入仍需时间，贸易战不确定性仍然存在，需持续关注相关情况的变化。作为汇安量化优选基金的管理人，我们将继续使用量化选股的方法，自下而上优选标的，勤勉尽责，力争为投资者获得长期稳定的回报。

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合规风控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、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。

4.8 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。

4.9 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量化优选灵活配置混合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，量化优选灵活配置混合型证券投资基金的管理人——汇安基金管理有限责任公司在量化优选灵活配置混合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量化优选灵活配置混合型证券投资基金 2018 年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 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(2019)第 21257 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	汇安量化优选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	(一)我们审计的内容 我们审计了汇安量化优选灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“汇安量化优选混合基金”)的财务报表，包括 2018 年 12 月 31 日的资产负债表，2018 年 7 月 26 日(基金合同生效日)至 2018 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。 (二)我们的意见 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，公允反映了汇安量化优选混合基金 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年 7 月 26 日(基金合同生效日)至 2018 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，为发表审计意见提供了基础。 按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于汇安量化优选混合基金，并履行了职业道德方面的其他责任。
管理层和治理层对财务报表的责任	汇安量化优选混合基金的基金管理人汇安基金管理有限责任公司(以下简称“基金管理人”)管理层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。 在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估汇安量化优选混合

	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，除非基金管理人管理层计划清算汇安量化优选混合基金、终止运营或别无其他现实的选择。 基金管理人治理层负责监督汇安量化优选混合基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	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。 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： (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。 (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。 (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。 (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，就可能导致对汇安量化优选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量化优选混合基金不能持续经营。

	（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。 我们与基金管理人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。	
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	2019 年 3 月 28 日	

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：汇安量化优选灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日： 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2018 年 12 月 31 日
资 产：		
银行存款	7.4.7.1	2,076,836.09
结算备付金		8,478,270.45
存出保证金		22,363.68
交易性金融资产	7.4.7.2	25,918,091.00
其中：股票投资		25,918,091.00
基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收证券清算款		2,345,675.31
应收利息	7.4.7.5	1,069.68
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		38,842,306.21
负债和所有者权益	**附注号**	**本期末 2018 年 12 月 31 日**
负 债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		1,213,028.25
应付赎回款		-
应付管理人报酬		49,975.84
应付托管费		8,329.30
应付销售服务费		2,794.63
应付交易费用	7.4.7.7	155,209.29
应交税费		-

应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	100,000.00
负债合计		1,529,337.31
所有者权益：		
实收基金	7.4.7.9	43,024,889.23
未分配利润	7.4.7.10	-5,711,920.33
所有者权益合计		37,312,968.90
负债和所有者权益总计		38,842,306.21

注：1.报告截止日 2018 年 12 月 31 日，基金份额总额 43,024,889.23 份，其中 A 类基金份额总额为 38,542,311.00 份，基金份额净值为 0.8676 元；C 类基金份额总额为 4,482,578.23 份，基金份额净值为 0.8640 元。

2.本财务报表的实际编制期间为2018年7月26日(基金合同生效日)至2018年12月31日止期间。

7.2 利润表

会计主体：汇安量化优选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 7 月 26 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2018 年 7 月 26 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日
一、收入		-4,954,047.63
1.利息收入		566,774.49
其中：存款利息收入	7.4.7.11	85,427.32
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		481,347.17
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-5,299,191.27
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-5,320,453.57
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.2	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-
股利收益	7.4.7.16	21,262.30
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-231,689.32
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	10,058.47

减：二、费用		1,195,401.60
1．管理人报酬	7.4.10.2.1	525,813.81
2．托管费	7.4.10.2.2	87,635.58
3．销售服务费	7.4.10.2.3	148,067.45
4．交易费用	7.4.7.19	332,439.96
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	7.4.7.20	101,444.80
三、利润总额 （亏损总额以“-”号填列）		-6,149,449.23
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-6,149,449.23

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汇安量化优选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 7 月 26 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 7 月 26 日(基金合同生效日)至 2018 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）	231,646,455.66	-	231,646,455.66
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-6,149,449.23	-6,149,449.23
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）	-188,621,566.43	437,528.90	-188,184,037.53
其中：1.基金申购款	33,678.07	-2,043.08	31,634.99
2.基金赎回款	-188,655,244.50	439,571.98	-188,215,672.52
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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	43,024,889.23	-5,711,920.33	37,312,968.90

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：

秦军　　窦星华　　江士

基金管理人负责人　　主管会计工作负责人　　会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

汇安量化优选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[2018]63 号《关于准予汇安量化优选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《汇安量化优选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，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 231,568,828.45 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 0467 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《汇安量化优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2018 年 7 月 26 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 231,646,455.66 份基金份额，其中认购资金利息折合 77,627.21 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“中国工商银行”)。

根据《汇安量化优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《汇安量化优选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/申购费用与销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用的基金份额，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，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取认购/申购费用的基金份额，并在赎回时根据持有期限收取赎回费用的，称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将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《汇安量化优选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、分离交易的可转换债券、中小企业私募债等)、债券回购、同业存单、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金的投资组合比例为：股票资产的比例为基金资产的 0-95%；每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳

的交易保证金后，保持不低于基金资产净值的 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付、存出保证应收申购款等；权证、股指期货、国债期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×55%+上证国债指数收益率×45%。

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 3 月 28 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》、《汇安量化优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 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。

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定，开放式基金在基金合同生效后，连续 60 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5,000 万元情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。于 2018 年 12 月 31 日， 本基金出现连续 60 个工作日基金资产净值低于 5,000 万元的情形，本基金的基金管理人已向中国证监会报告并在评估后续处理方案，故本财务报表仍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 2018 年 7 月 26 日(基金合同生效日)至 2018 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 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年 7 月 26 日(基金合同生效日)至 2018 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

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2018 年 7 月 26 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1)金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2)金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2)当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3)如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1）具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2）交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认

为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股

票投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

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》、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。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票的转让收入免征增值税。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，包括买卖股票的差价收入，股票的股息、红利收入及其

他收入，暂不征收企业所得税。

(3)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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日
活期存款	2,076,836.09
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：	2,076,836.09

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2018 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		26,149,780.32	25,918,091.00	-231,689.32
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-

其他	-	-	-
合计	26,149,780.32	25,918,091.00	-231,689.32

7.4.7.3 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/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 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。

7.4.7.4.2 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从买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	574.35
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	484.22
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	11.11
合计	1,069.68

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	155,209.29
银行间市场应付交易费用	-
合计	155,209.29

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	100,000.00
合计	100,000.00

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

汇安量化优选 A		
项目	本期 2018 年 7 月 26 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	41,774,356.67	41,774,356.67
本期申购	1,357.08	1,357.08
本期赎回（以“-”号填列）	-3,233,402.75	-3,233,402.75
本期末	38,542,311.00	38,542,311.00

金额单位：人民币元

汇安量化优选 C		
项目	本期 2018 年 7 月 26 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	189,872,098.99	189,872,098.99
本期申购	32,320.99	32,320.99
本期赎回（以“-”号填列）	-185,421,841.75	-185,421,841.75
本期末	4,482,578.23	4,482,578.23

注：1.本基金自 2018 年 6 月 11 日至 2018 年 7 月 20 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币 231,568,828.45 元，折合为 231,568,828.45 份基金份额(其中 A 类基金份额 41,747,228.45 份，C 类基金份额 189,821,600.00 份)。根据《汇安量化优选灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入人民币 77,627.21 元在本基金成立后，折合为 77,627.21 份基金份额(其中 A 类基金份额 27,128.22 份，C 类基金份额 50,498.99 份)，划入基金份额持有人账户。

2.根据《汇安量化优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》、《汇安量化优选灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》及《汇安量化优选灵活配置混合型证券投资基金开放日常申购、赎回及定期定额投资业务的公告》的相关规定，本基金于2018年7月26日(基金合同生效日)至2018年8月23日止期间暂不向投资人开放基金交易，申购、赎回业务自2018年8月24日起开始办理。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

汇安量化优选A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-5,125,032.91	-157,756.81	-5,282,789.72
本期基金份额交易产生的变动数	141,810.89	38,868.65	180,679.54
其中：基金申购款	-44.11	-25.28	-69.39
基金赎回款	141,855.00	38,893.93	180,748.93
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-4,983,222.02	-118,888.16	-5,102,110.18

单位：人民币元

汇安量化优选C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-792,727.00	-73,932.51	-866,659.51
本期基金份额交易产生的变动数	196,751.09	60,098.27	256,849.36
其中：基金申购款	-2,592.43	618.74	-1,973.69
基金赎回款	199,343.52	59,479.53	258,823.05
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-595,975.91	-13,834.24	-609,810.15

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年7月26日(基金合同生效日)至2018年12月31日
活期存款利息收入	75,111.45
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	10,254.91
其他	60.96

合计	85,427.32

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年7月26日(基金合同生效日)至2018年12月31日
卖出股票成交总额	118,176,442.93
减：卖出股票成本总额	123,496,896.50
买卖股票差价收入	-5,320,453.57

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期内无债券投资收益。

7.4.7.13.2 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年7月26日(基金合同生效日)至2018年12月31日
股票投资产生的股利收益	21,262.30
基金投资产生的股利收益	-
合计	21,262.30

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2018 年 7 月 26 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日
1.交易性金融资产	-231,689.32
——股票投资	-231,689.32
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-231,689.32

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 7 月 26 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	10,058.47
合计	10,058.47

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 7 月 26 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	332,439.96
银行间市场交易费用	-
合计	332,439.96

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 7 月 26 日(基金合同生效日)至

	2018 年 12 月 31 日
审计费用	50,000.00
信息披露费	50,000.00
银行划款手续费	1,044.80
证券账户开户费	400.00
合计	101,444.80

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 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。

7.4.8.2 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。

7.4.9 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、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。

7.4.10 本报告期的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期内未有通过关联方交易单元进行的交易。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 7 月 26 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	525,813.81
其中：支付销售机构的客户维护费	387,696.73

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 1.50%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 × 1.50%/ 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 7 月 26 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	87,635.58

注：支付基金托管人中国工商银行的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：

日托管费＝前一日基金资产净值 × 0.25%/ 当年天数。

7.4.10.2.3 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 2018 年 7 月 26 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	汇安量化优选 A	汇安量化优选 C	合计
汇安基金	-	3,504.38	3,504.38
中国工商银行	-	141,145.94	141,145.94
合计	-	144,650.32	144,650.32

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 0.80%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× 0.80% / 当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内未发生与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人于本基金本报告期内未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

于本基金本报告期末除基金管理人以外的其他关联方未投资本基金。

7.4.10.5 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 2018 年 7 月 26 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	2,076,836.09	75,111.45

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末（2018 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.12.2 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。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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。

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。

7.4.13.2 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中国工商银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。

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 2018 年 12 月 31 日，本基金无债券投资。

7.4.13.3 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 2018 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制)。

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 7.4.12。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 2018 年 12 月 31 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 2018 年 12 月 31 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 29,127,574.15 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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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、结算备付金和存出保证金等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2018 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	2,076,836.09	-	-	-	-	-	2,076,836.09
结算备付金	8,478,270.45	-	-	-	-	-	8,478,270.45
存出保证金	22,363.68	-	-	-	-	-	22,363.68
交易性金融资产	-	-	-	-	-	25,918,091.00	25,918,091.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	2,345,675.31	2,345,675.31
应收利息	-	-	-	-	-	1,069.68	1,069.68
资产总计	10,577,470.22	-	-	-	-	28,264,835.99	38,842,306.21
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	1,213,028.25	1,213,028.25
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	49,975.84	49,975.84
应付托管费	-	-	-	-	-	8,329.30	8,329.30
应付销售服务费	-	-	-	-	-	2,794.63	2,794.63
应付交易费用	-	-	-	-	-	155,209.29	155,209.29
其他负债	-	-	-	-	-	100,000.00	100,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	1,529,337.31	1,529,337.31
利率敏感度缺口	10,577,470.22	-	-	-	-	26,735,498.68	37,312,968.90

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2018 年 12 月 31 日，本基金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。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，通过对宏观经济情况及政策的分析，

结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票资产投资比例为基金资产的 0-95%，每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值的 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；权证、股指期货、国债期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产-股票投资	25,918,091.00	69.46
交易性金融资产－基金投资	-	-
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	25,918,091.00	69.46

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

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。

7.4.14 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 2018 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 25,918,091.00 元，无属于第二或第三层次的余额。

(ii)公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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 2018 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。

(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)除公允价值外，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	25,918,091.00	66.73
	其中：股票	25,918,091.00	66.73
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	10,555,106.54	27.17
8	其他各项资产	2,369,108.67	6.10
9	合计	38,842,306.21	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	446,298.00	1.20
B	采矿业	463,257.00	1.24
C	制造业	15,091,886.00	40.45
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,104,433.00	2.96
E	建筑业	527,290.00	1.41
F	批发和零售业	1,196,928.00	3.21
G	交通运输、仓储和邮政业	1,197,262.00	3.21
H	住宿和餐饮业	162,840.00	0.44
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,008,886.00	5.38
J	金融业	1,219,871.00	3.27

K	房地产业	1,397,314.00	3.74
L	租赁和商务服务业	837,934.00	2.25
M	科学研究和技术服务业	5,985.00	0.02
N	水利、环境和公共设施管理业	2,173.00	0.01
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	254,239.00	0.68
S	综合	1,495.00	0.00
	合计	25,918,091.00	69.46

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	000661	长春高新	2,000	350,000.00	0.94
2	300760	迈瑞医疗	3,100	338,582.00	0.91
3	000750	国海证券	76,800	334,848.00	0.90
4	601766	中国中车	35,200	317,504.00	0.85
5	300702	天宇股份	14,500	316,825.00	0.85
6	600009	上海机场	6,200	314,712.00	0.84
7	603899	晨光文具	10,400	314,600.00	0.84
8	601318	中国平安	5,600	314,160.00	0.84
9	603556	海兴电力	24,000	312,000.00	0.84
10	300065	海兰信	30,400	310,688.00	0.83
11	002129	中环股份	42,400	306,552.00	0.82
12	000581	威孚高科	17,000	300,220.00	0.80
13	600519	贵州茅台	500	295,005.00	0.79
14	600376	首开股份	40,400	290,476.00	0.78
15	600959	江苏有线	68,800	283,456.00	0.76
16	600266	北京城建	35,200	278,784.00	0.75
17	300182	捷成股份	64,400	276,276.00	0.74
18	000685	中山公用	38,600	270,200.00	0.72
19	600881	亚泰集团	81,200	268,772.00	0.72

20	600056	中国医药	21,300	267,741.00	0.72
21	600380	健康元	40,000	266,800.00	0.72
22	601880	大连港	143,200	264,920.00	0.71
23	601678	滨化股份	61,600	259,952.00	0.70
24	000718	苏宁环球	81,600	259,488.00	0.70
25	002426	胜利精密	111,400	258,448.00	0.69
26	000564	西安民生	101,600	257,048.00	0.69
27	603658	安图生物	5,200	254,228.00	0.68
28	000501	鄂武商 A	26,500	251,220.00	0.67
29	000537	广宇发展	33,500	250,915.00	0.67
30	600835	上海机电	17,200	250,260.00	0.67
31	002002	鸿达兴业	86,800	249,984.00	0.67
32	600633	浙数文化	30,400	247,760.00	0.66
33	600126	杭钢股份	54,400	245,344.00	0.66
34	603888	新华网	18,800	241,392.00	0.65
35	600338	西藏珠峰	12,400	240,932.00	0.65
36	002010	传化智联	35,200	228,800.00	0.61
37	000889	茂业通信	22,400	228,480.00	0.61
38	601788	光大证券	26,000	228,020.00	0.61
39	000560	昆百大 A	48,800	227,896.00	0.61
40	603025	大豪科技	20,400	227,460.00	0.61
41	600191	华资实业	57,600	226,944.00	0.61
42	300111	向日葵	112,400	225,924.00	0.61
43	002598	山东章鼓	33,200	225,096.00	0.60
44	600299	安迪苏	19,600	225,008.00	0.60
45	600986	科达股份	53,700	225,003.00	0.60
46	600873	梅花生物	53,300	224,926.00	0.60
47	002901	大博医疗	7,600	224,884.00	0.60
48	000591	太阳能	75,900	224,664.00	0.60
49	600093	易见股份	29,600	224,368.00	0.60
50	002456	欧菲光	24,400	224,236.00	0.60
51	000016	深康佳 A	69,200	224,208.00	0.60
52	000046	泛海控股	48,000	224,160.00	0.60
53	002600	江粉磁材	89,600	224,000.00	0.60
54	600965	福成股份	22,400	223,776.00	0.60
55	300323	华灿光电	30,900	223,407.00	0.60
56	000767	漳泽电力	90,400	223,288.00	0.60
57	600477	杭萧钢构	62,000	223,200.00	0.60
58	600219	南山铝业	105,600	222,816.00	0.60

59	002310	东方园林	32,000	222,720.00	0.60
60	600781	辅仁药业	17,600	222,640.00	0.60
61	600346	恒力股份	16,800	222,600.00	0.60
62	600317	营口港	98,400	222,384.00	0.60
63	601238	广汽集团	21,600	222,264.00	0.60
64	601908	京运通	70,500	222,075.00	0.60
65	600797	浙大网新	30,800	222,068.00	0.60
66	600233	圆通速递	22,200	222,000.00	0.59
67	000825	太钢不锈	53,600	221,904.00	0.59
68	000415	渤海金控	61,600	221,760.00	0.59
68	300434	金石东方	25,200	221,760.00	0.59
69	601139	深圳燃气	41,200	221,244.00	0.59
70	600337	美克家居	56,000	221,200.00	0.59
71	600616	金枫酒业	46,400	220,864.00	0.59
72	000959	首钢股份	59,200	220,816.00	0.59
73	600879	航天电子	40,800	220,728.00	0.59
74	300559	佳发安泰	6,400	220,480.00	0.59
75	300072	三聚环保	22,400	220,416.00	0.59
76	603368	柳药股份	8,400	220,080.00	0.59
77	601360	三六零	10,800	219,996.00	0.59
78	603429	集友股份	9,600	219,936.00	0.59
79	000050	深天马 A	22,400	219,744.00	0.59
80	002712	思美传媒	36,800	219,696.00	0.59
81	000869	张裕 A	8,400	218,400.00	0.59
82	000546	金圆股份	25,200	218,232.00	0.58
83	600372	中航电子	16,800	218,064.00	0.58
84	603707	健友股份	11,600	217,732.00	0.58
85	002294	信立泰	10,400	217,256.00	0.58
86	002068	黑猫股份	36,800	217,120.00	0.58
87	601012	隆基股份	12,400	216,256.00	0.58
88	002202	金风科技	21,600	215,784.00	0.58
89	002008	大族激光	7,100	215,556.00	0.58
90	000592	平潭发展	80,400	214,668.00	0.58
91	000938	紫光股份	6,800	212,568.00	0.57
92	601088	中国神华	11,600	208,336.00	0.56
93	600893	航发动力	9,200	199,824.00	0.54
94	002353	杰瑞股份	12,000	180,000.00	0.48
95	601211	国泰君安	11,600	177,712.00	0.48
96	300088	长信科技	42,400	175,960.00	0.47

97	601326	秦港股份	53,200	167,048.00	0.45
98	000524	岭南控股	23,600	162,840.00	0.44
99	600452	涪陵电力	10,200	161,670.00	0.43
100	000861	海印股份	63,600	159,636.00	0.43
101	002074	国轩高科	13,600	157,216.00	0.42
102	600000	浦发银行	15,600	152,880.00	0.41
103	601138	工业富联	12,800	148,352.00	0.40
104	600362	江西铜业	11,200	147,392.00	0.40
105	002327	富安娜	18,400	138,184.00	0.37
106	002493	荣盛石化	10,000	100,900.00	0.27
107	000012	南玻A	25,200	100,548.00	0.27
108	600545	卓郎智能	10,800	79,920.00	0.21
109	600839	四川长虹	34,000	78,540.00	0.21
110	600300	维维股份	27,600	77,832.00	0.21
111	002244	滨江集团	17,800	70,844.00	0.19
112	002383	合众思壮	4,800	56,784.00	0.15
113	601216	君正集团	16,000	41,920.00	0.11
114	603444	吉比特	200	29,600.00	0.08
115	002304	洋河股份	300	28,416.00	0.08
116	300523	辰安科技	300	17,850.00	0.05
117	603818	曲美家居	2,400	16,080.00	0.04
118	000858	五粮液	300	15,264.00	0.04
119	300308	中际装备	300	12,207.00	0.03
120	000568	泸州老窖	300	12,198.00	0.03
121	601888	中国国旅	200	12,040.00	0.03
122	300413	快乐购	300	11,103.00	0.03
123	300454	深信服	100	8,960.00	0.02
124	603260	合盛硅业	200	8,760.00	0.02
125	603387	基蛋生物	300	7,971.00	0.02
126	300498	温氏股份	300	7,854.00	0.02
127	600782	新钢股份	1,500	7,635.00	0.02
128	002833	弘亚数控	200	6,800.00	0.02
129	300212	易华录	300	6,216.00	0.02
130	600547	山东黄金	200	6,050.00	0.02
131	603357	设计总院	300	5,985.00	0.02
132	600104	上汽集团	200	5,334.00	0.01
133	001979	招商蛇口	300	5,205.00	0.01
134	002415	海康威视	200	5,152.00	0.01
135	601877	正泰电器	200	4,848.00	0.01

136	000002	万科A	200	4,764.00	0.01
137	300467	迅游科技	200	4,586.00	0.01
138	300571	平治信息	100	4,398.00	0.01
139	002462	嘉事堂	300	4,335.00	0.01
140	600977	中国电影	300	4,296.00	0.01
141	300068	南都电源	300	4,266.00	0.01
142	300365	恒华科技	200	4,180.00	0.01
143	600848	上海临港	200	4,136.00	0.01
144	300439	美康生物	300	4,008.00	0.01
145	300458	全志科技	200	4,000.00	0.01
146	601100	恒立液压	200	3,962.00	0.01
147	000063	中兴通讯	200	3,918.00	0.01
148	300418	昆仑万维	300	3,858.00	0.01
149	600426	华鲁恒升	300	3,621.00	0.01
150	000651	格力电器	100	3,569.00	0.01
151	600048	保利地产	300	3,537.00	0.01
152	600801	华新水泥	200	3,344.00	0.01
153	002468	申通快递	200	3,290.00	0.01
154	601688	华泰证券	200	3,240.00	0.01
155	300316	晶盛机电	300	3,006.00	0.01
156	300257	开山股份	300	2,997.00	0.01
157	600872	中炬高新	100	2,946.00	0.01
158	600585	海螺水泥	100	2,928.00	0.01
159	300149	量子高科	200	2,926.00	0.01
160	603369	今世缘	200	2,898.00	0.01
161	600352	浙江龙盛	300	2,895.00	0.01
162	603636	南威软件	300	2,880.00	0.01
163	000960	锡业股份	300	2,862.00	0.01
164	601601	中国太保	100	2,843.00	0.01
165	002440	闰土股份	300	2,700.00	0.01
166	300274	阳光电源	300	2,676.00	0.01
167	600837	海通证券	300	2,640.00	0.01
168	000401	冀东水泥	200	2,476.00	0.01
169	600559	老白干酒	200	2,472.00	0.01
170	300309	吉艾科技	300	2,418.00	0.01
171	300525	博思软件	100	2,374.00	0.01
172	600887	伊利股份	100	2,288.00	0.01
173	601633	长城汽车	400	2,240.00	0.01
174	000930	中粮生化	300	2,226.00	0.01

175	002739	万达院线	100	2,183.00	0.01
176	601997	贵阳银行	200	2,136.00	0.01
177	002541	鸿路钢构	300	2,106.00	0.01
178	600536	中国软件	100	2,093.00	0.01
179	002449	国星光电	200	2,076.00	0.01
180	600179	安通控股	300	1,995.00	0.01
181	300527	华舟应急	300	1,980.00	0.01
182	002013	中航机电	300	1,953.00	0.01
183	002111	威海广泰	200	1,948.00	0.01
184	000726	鲁泰 A	200	1,942.00	0.01
185	002555	三七互娱	200	1,888.00	0.01
186	002250	联化科技	200	1,886.00	0.01
187	000528	柳工	300	1,821.00	0.00
188	600012	皖通高速	300	1,809.00	0.00
189	601101	昊华能源	300	1,803.00	0.00
190	600267	海正药业	200	1,678.00	0.00
191	600475	华光股份	200	1,640.00	0.00
192	002146	荣盛发展	200	1,590.00	0.00
193	000759	中百集团	300	1,584.00	0.00
194	300389	艾比森	100	1,563.00	0.00
195	600895	张江高科	100	1,495.00	0.00
196	002463	沪电股份	200	1,434.00	0.00
197	000066	长城电脑	300	1,422.00	0.00
198	600390	五矿资本	200	1,392.00	0.00
199	600089	特变电工	200	1,358.00	0.00
200	300444	双杰电气	200	1,314.00	0.00
201	002228	合兴包装	300	1,284.00	0.00
202	600325	华发股份	200	1,240.00	0.00
203	601168	西部矿业	200	1,164.00	0.00
204	002033	丽江旅游	200	1,134.00	0.00
205	002635	安洁科技	100	1,133.00	0.00
206	300130	新国都	100	1,132.00	0.00
207	600256	广汇能源	300	1,128.00	0.00
207	600823	世茂股份	300	1,128.00	0.00
207	603993	洛阳钼业	300	1,128.00	0.00
208	002373	千方科技	100	1,112.00	0.00
209	600970	中材国际	200	1,094.00	0.00
210	601186	中国铁建	100	1,087.00	0.00
211	601985	中国核电	200	1,054.00	0.00

212	600708	光明地产	300	1,047.00	0.00
213	000826	启迪桑德	100	1,039.00	0.00
214	600050	中国联通	200	1,034.00	0.00
215	000426	兴业矿业	200	996.00	0.00
216	600803	新奥股份	100	994.00	0.00
217	600023	浙能电力	200	946.00	0.00
218	300038	梅泰诺	100	933.00	0.00
219	002247	帝龙文化	200	932.00	0.00
220	300026	红日药业	300	915.00	0.00
221	600711	盛屯矿业	200	914.00	0.00
222	300367	东方网力	100	887.00	0.00
223	002036	联创电子	100	860.00	0.00
224	002579	中京电子	100	859.00	0.00
225	601006	大秦铁路	100	823.00	0.00
226	002185	华天科技	200	812.00	0.00
227	600623	华谊集团	100	808.00	0.00
228	600886	国投电力	100	805.00	0.00
229	000338	潍柴动力	100	770.00	0.00
230	300219	鸿利智汇	100	766.00	0.00
231	002550	千红制药	200	760.00	0.00
232	600789	鲁抗医药	100	755.00	0.00
233	600655	豫园股份	100	740.00	0.00
234	300459	金科娱乐	100	735.00	0.00
235	603108	润达医疗	100	719.00	0.00
236	300315	掌趣科技	200	706.00	0.00
237	600180	瑞茂通	100	705.00	0.00
238	000519	江南红箭	100	629.00	0.00
239	600567	山鹰纸业	200	624.00	0.00
240	002584	西陇科学	100	603.00	0.00
241	600236	桂冠电力	100	562.00	0.00
242	601717	郑煤机	100	553.00	0.00
243	000650	仁和药业	100	548.00	0.00
244	600028	中国石化	100	505.00	0.00
245	300217	东方电热	200	466.00	0.00
246	300058	蓝色光标	100	434.00	0.00
247	002334	英威腾	100	428.00	0.00
248	300237	美晨科技	100	363.00	0.00
249	601992	金隅集团	100	350.00	0.00
250	300145	中金环境	100	325.00	0.00

251	002610	爱康科技	200	314.00	0.00
252	600569	安阳钢铁	100	303.00	0.00
253	601918	新集能源	100	301.00	0.00
254	000078	海王生物	100	298.00	0.00
255	600017	日照港	100	276.00	0.00
256	600231	凌钢股份	100	267.00	0.00
257	300303	聚飞光电	100	243.00	0.00

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	2,493,993.00	6.68
2	600009	上海机场	2,344,477.38	6.28
3	000977	浪潮信息	2,044,596.00	5.48
4	600498	烽火通信	2,026,550.00	5.43
5	002859	洁美科技	1,966,094.76	5.27
6	600036	招商银行	1,911,330.16	5.12
7	600519	贵州茅台	1,909,257.00	5.12
8	600585	海螺水泥	1,842,263.00	4.94
9	300365	恒华科技	1,761,702.00	4.72
10	002589	瑞康医药	1,676,508.00	4.49
11	600588	用友网络	1,668,029.00	4.47
12	000661	长春高新	1,606,309.00	4.30
13	001979	招商蛇口	1,568,423.00	4.20
14	000063	中兴通讯	1,402,890.00	3.76
15	300413	快乐购	1,379,730.00	3.70
16	002475	立讯精密	1,359,736.00	3.64
17	000858	五粮液	1,359,466.00	3.64
18	000963	华东医药	1,348,850.00	3.61
19	601939	建设银行	1,331,925.00	3.57
20	300253	卫宁健康	1,299,962.67	3.48
21	300065	海兰信	1,289,302.00	3.46
22	600131	岷江水电	1,260,238.00	3.38

23	300571	平治信息	1,248,361.00	3.35
24	000681	视觉中国	1,226,323.00	3.29
25	002304	洋河股份	1,224,939.00	3.28
26	002281	光迅科技	1,122,643.00	3.01
27	603019	中科曙光	1,120,825.88	3.00
28	000651	格力电器	1,105,517.00	2.96
29	300036	超图软件	1,064,296.00	2.85
30	002371	七星电子	1,057,295.00	2.83
31	000750	国海证券	1,030,800.00	2.76
32	002410	广联达	1,025,324.00	2.75
33	002353	杰瑞股份	1,006,047.00	2.70
34	002179	中航光电	953,523.00	2.56
35	002463	沪电股份	917,850.00	2.46
36	600845	宝信软件	913,146.00	2.45
37	002129	中环股份	909,038.00	2.44
38	601888	中国国旅	908,994.80	2.44
39	600536	中国软件	899,427.00	2.41
40	600760	中航沈飞	892,715.00	2.39
41	600271	航天信息	886,721.00	2.38
42	300308	中际装备	883,462.00	2.37
43	600038	中直股份	879,665.00	2.36
44	300003	乐普医疗	865,750.00	2.32
45	002202	金风科技	862,151.00	2.31
46	002044	美年健康	851,832.00	2.28
47	300559	佳发安泰	849,272.00	2.28
48	300144	宋城演艺	830,281.50	2.23
49	601766	中国中车	815,926.00	2.19
50	600048	保利地产	791,710.00	2.12
51	600967	内蒙一机	777,907.00	2.08
52	002343	慈文传媒	775,624.00	2.08
53	600028	中国石化	761,680.00	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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	2,031,943.00	5.45
2	600498	烽火通信	1,978,195.00	5.30
3	002859	洁美科技	1,841,630.28	4.94
4	600009	上海机场	1,825,521.00	4.89
5	600036	招商银行	1,806,422.98	4.84
6	600585	海螺水泥	1,774,373.00	4.76
7	000977	浪潮信息	1,702,536.00	4.56
8	300365	恒华科技	1,672,275.00	4.48
9	600588	用友网络	1,593,753.69	4.27
10	001979	招商蛇口	1,549,037.84	4.15
11	002589	瑞康医药	1,513,134.00	4.06
12	600519	贵州茅台	1,413,194.00	3.79
13	000063	中兴通讯	1,336,805.00	3.58
14	300413	快乐购	1,336,430.00	3.58
15	300253	卫宁健康	1,333,496.00	3.57
16	601939	建设银行	1,324,715.00	3.55
17	002475	立讯精密	1,322,217.00	3.54
18	000858	五粮液	1,234,942.00	3.31
19	600131	岷江水电	1,179,748.00	3.16
20	000681	视觉中国	1,170,410.00	3.14
21	002304	洋河股份	1,169,224.00	3.13
22	000963	华东医药	1,152,283.00	3.09
23	002281	光迅科技	1,143,387.00	3.06
24	603019	中科曙光	1,125,885.00	3.02
25	300571	平治信息	1,108,653.00	2.97
26	000651	格力电器	1,035,122.00	2.77
27	300036	超图软件	1,002,583.00	2.69
28	002410	广联达	991,765.00	2.66
29	002371	七星电子	984,618.00	2.64
30	000661	长春高新	979,889.50	2.63
31	002044	美年健康	953,876.00	2.56
32	600536	中国软件	913,678.00	2.45
33	002179	中航光电	908,435.00	2.43
34	600271	航天信息	888,930.00	2.38

35	002463	沪电股份	878,826.06	2.36
36	300065	海兰信	870,822.00	2.33
37	600038	中直股份	870,007.00	2.33
38	300144	宋城演艺	868,109.00	2.33
39	601888	中国国旅	849,430.00	2.28
40	600845	宝信软件	821,411.00	2.20
41	600760	中航沈飞	812,723.90	2.18
42	300003	乐普医疗	801,269.00	2.15
43	002343	慈文传媒	794,144.00	2.13
44	002353	杰瑞股份	786,817.00	2.11
45	600872	中炬高新	761,772.00	2.04
46	600757	长江传媒	753,078.26	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。

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	149,646,676.82
卖出股票收入（成交）总额	118,176,442.93

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

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

本基金本报告期未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.12.2 基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

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	22,363.68
2	应收证券清算款	2,345,675.31
3	应收股利	-
4	应收利息	1,069.68
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,369,108.67

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（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
汇安量化优选A	221	174,399.60	0.00	0.00%	38,542,311.00	100.00%
汇安量化优选C	62	72,299.65	0.00	0.00%	4,482,578.23	100.00%
合计	283	152,031.41	0.00	0.00%	43,024,889.23	100.00%

9.2 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	汇安量化优选A	0.00	0.0000%
	汇安量化优选C	0.00	0.0000%
	合计	0.00	0.0000%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	汇安量化优选A	0
	汇安量化优选C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	汇安量化优选A	0
	汇安量化优选C	0
	合计	0

§10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	汇安量化优选 A	汇安量化优选 C
基金合同生效日（2018 年 7 月 26 日）基金份额总额	41,774,356.67	189,872,098.99
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	1,357.08	32,320.99
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	3,233,402.75	185,421,841.75
本报告期期末基金份额总额	38,542,311.00	4,482,578.23

§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

本基金管理人 2018 年 11 月 18 日发布公告，孙运英女士不再担任公司督察长职务，在公司新任督察长任职前由总经理秦军代为履行督察长职务。

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。

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(2018 年 7 月 26 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。本基金本报告期应支付给普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计费用伍万元整。

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	

国金证券	2	200,802,231.52	74.98%	142,829.70	74.98%	-
东北证券	2	67,020,888.23	25.02%	47,671.32	25.02%	-

注：选择专用席位的标准和程序：

（1）选择标准

券商经纪人财务状况良好、经营行为规范、风险管理先进、投资风格与基金管理人有互补性、在最近一年内无重大违规行为。

券商经纪人具有较强的研究能力：能及时、全面、定期向基金管理人提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析的报告及丰富全面的信息咨询服务；有很强的行业分析能力，能根据基金管理人所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力。

券商经纪人能提供最优惠合理的佣金率：与其他券商经纪人相比，该券商经纪人能够提供最优惠、最合理的佣金率。

（2） 选择程序

基金管理人根据以上标准对不同券商经纪人进行考察、选择和确定，选定的经纪人名单需经风险管理小组审批同意。基金管理人与被选择的证券经营机构签订委托协议。基金管理人与被选择的券商经纪人在签订委托代理协议时，要明确签定协议双方的公司名称、委托代理期限、佣金率、双方的权利义务等，经签章有效。委托代理协议一式三份，协议双方及证券主管机关各留存一份，基金管理人留存合规风控部备案。

（3）交易单元变更情况

以上交易单元均为本基金本报告期内新增交易单元。

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
国金证券	-	-	1,361,500,000.00	98.87%	-	-
东北证券	-	-	15,500,000.00	1.13%	-	-

11.8 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	汇安量化优选灵活配置混合型证券	中国证券报及公司官网	2018 年 7 月 6 日

	投资基金-延期结束募集的公告		
2	关于汇安基金管理公司旗下基金增加销售机构公告	中国证券报及公司官网	2018 年 7 月 26 日
3	汇安量化优选灵活配置混合型证券投资基金-基金合同生效公告	中国证券报及公司官网	2018 年 7 月 27 日
4	汇安量化优选灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告（增聘朱晨歌）	中国证券报及公司官网	2018 年 8 月 10 日
5	汇安量化优选灵活配置混合型证券投资基金开放申购、赎回及定期定额投资计划的公告	中国证券报及公司官网	2018 年 8 月 21 日
6	关于汇安基金管理有限公司旗下基金增加销售机构的公告-基煜	中国证券报及公司官网	2018 年 9 月 21 日
7	关于汇安基金管理有限公司旗下基金增加销售机构的公告-中泰	中国证券报及公司官网	2018 年 11 月 2 日
8	关于汇安基金管理有限公司旗下基金增加销售机构的公告-好买	中国证券报及公司官网	2018 年 12 月 20 日

§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

本基金本报告期内未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。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

（1） 中国证监会批准汇安量化优选灵活配置混合型证券投资基金募集的文件；

（2）《汇安量化优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；

（3）《汇安量化优选灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》；

（4）《汇安量化优选灵活配置混合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；

13.2 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

13.3 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 3 月 30 日