汇安嘉汇纯债债券型证券投资基金
2020年中期报告

2020年6月30日

基金管理人：汇安基金管理有限责任公司

基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司

送出日期：2020年8月29日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录 2

1.1 重要提示 2

1.2 目录 3

§2 基金简介 6

2.1 基金基本情况 6

2.2 基金产品说明 6

2.3 基金管理人和基金托管人 6

2.4 信息披露方式 7

2.5 其他相关资料 7

§3 主要财务指标和基金净值表现 8

3.1 主要会计数据和财务指标 8

3.2 基金净值表现 8

§4 管理人报告 11

4.1 基金管理人及基金经理情况 11

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 12

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 12

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 13

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 13

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 14

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 14

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 14

§5 托管人报告 15

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 15

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 15

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 15

§6 半年度财务会计报告（未经审计） 16

6.1 资产负债表 16

6.2 利润表 17

6.3 所有者权益（基金净值）变动表 18

6.4 报表附注.....19
§7 投资组合报告.....40
7.1 期末基金资产组合情况.....40
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....40
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....40
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....41
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....41
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....41
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....41
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....41
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....41
7.11 投资组合报告附注.....42
§8 基金份额持有人信息.....43
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....43
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....43
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....43
§9 开放式基金份额变动.....44
§10 重大事件揭示.....45
10.1 基金份额持有人大会决议.....45
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....45
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....45
10.4 基金投资策略的改变.....45
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....45
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....45
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....45
10.8 其他重大事件.....47
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....48
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....48
§12 备查文件目录.....48

12.1 备查文件目录.....48
12.2 存放地点.....48
12.3 查阅方式.....48

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	汇安嘉汇纯债债券型证券投资基金	
基金简称	汇安嘉汇纯债债券	
基金主代码	003742	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 12 月 2 日	
基金管理人	汇安基金管理有限责任公司	
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	746,113,293.96 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称：	汇安嘉汇纯债债券 A	汇安嘉汇纯债债券 C
下属分级基金的交易代码：	003742	009771
报告期末下属分级基金的份额总额	746,113,196.90 份	97.06 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制投资组合风险的前提下，力争长期内实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金采用的投资策略包括大类资产配置策略和债券组合管理策略，其中债券组合管理策略包括利率策略、类属配置策略、信用策略、相对价值策略、债券选择策略、中小企业私募债投资策略、资产支持证券等品种投资策略、国债期货投资策略。
业绩比较基准	中债新综合财富（总值）指数收益率*95%+金融机构人民币活期存款利率（税后）*5%。
风险收益特征	本基金为债券型基金，属证券投资基金中的较低风险品种，其长期平均预期风险和预期收益率低于股票型基金和混合型基金，高于货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		汇安基金管理有限责任公司	上海浦东发展银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	郭冬青	胡波
	联系电话	01056711600	021-61618888
	电子邮箱	guodq@huianfund.cn	hub5@spdb.com.cn
客户服务电话		01056711690	95528
传真		01056711640	021-63602540
注册地址		上海市虹口区欧阳路 218 弄 1 号 2 楼 215 室	上海市中山东一路 12 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；	上海市北京东路 689 号

	上海市虹口区东大名路 501 号白玉兰大厦 36 层	
邮政编码	100007	200001
法定代表人	何斌（代行职务）	郑杨

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

2.5 其他相关资料

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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

基金级别	汇安嘉汇纯债债券 A	汇安嘉汇纯债债券 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2020 年 1 月 1 日 - 2020 年 6 月 30 日)	报告期(2020 年 1 月 1 日 - 2020 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	41,113,066.58	0.01
本期利润	18,963,634.91	0.01
加权平均基金份额本期利润	0.0208	0.0001
本期加权平均净值利润率	2.02%	0.01%
本期基金份额净值增长率	1.83%	0.01%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	20,516,828.97	2.67
期末可供分配基金份额利润	0.0275	0.0275
期末基金资产净值	768,748,423.12	100.01
期末基金份额净值	1.0303	1.0304
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	18.46%	0.01%

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

汇安嘉汇纯债债券 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	-0.27%	0.06%	-0.65%	0.12%	0.38%	-0.06%
过去三个月	0.34%	0.05%	-0.21%	0.11%	0.55%	-0.06%
过去六个月	1.83%	0.04%	2.23%	0.11%	-0.40%	-0.07%
过去一年	3.99%	0.04%	4.87%	0.08%	-0.88%	-0.04%
过去三年	16.07%	0.05%	15.43%	0.07%	0.64%	-0.02%

自基金合同生效起至今	18.46%	0.05%	14.40%	0.08%	4.06%	-0.03%

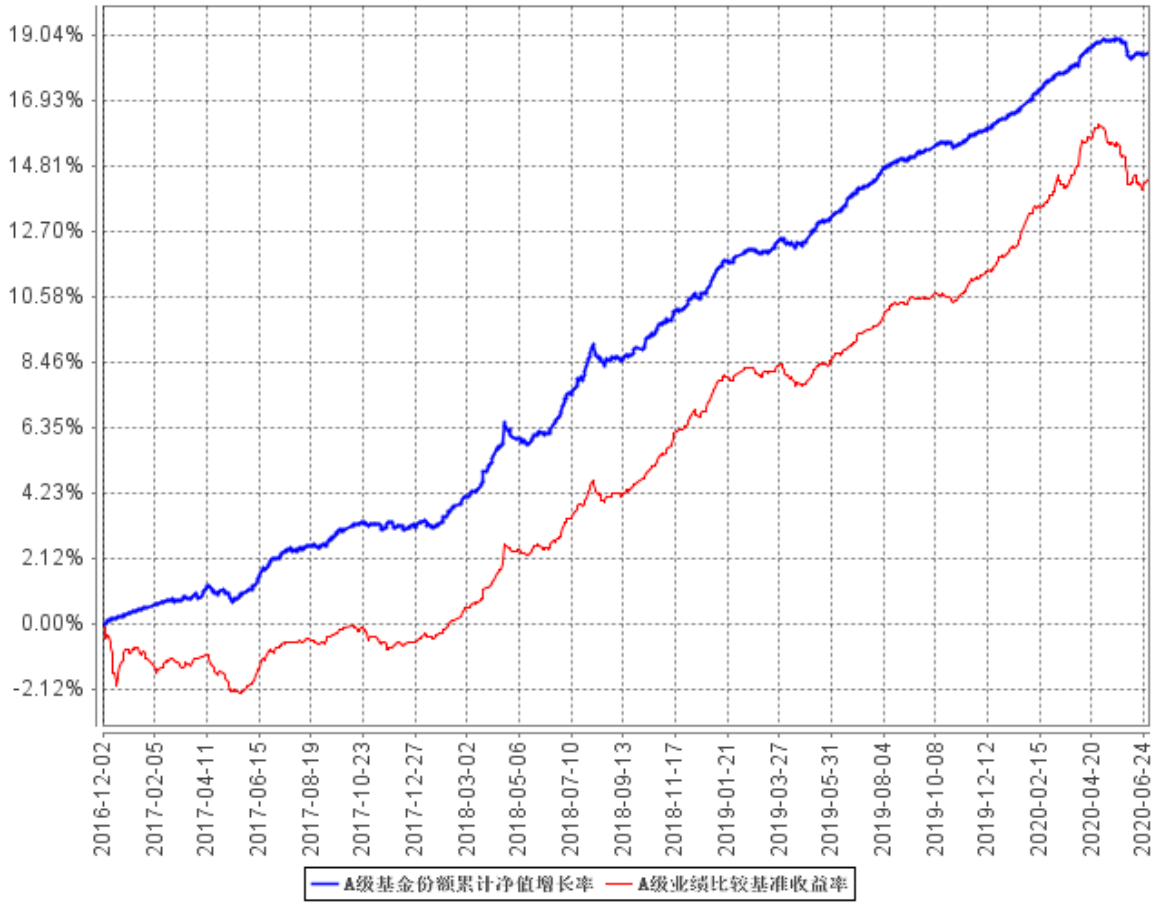
汇安嘉汇纯债债券 C

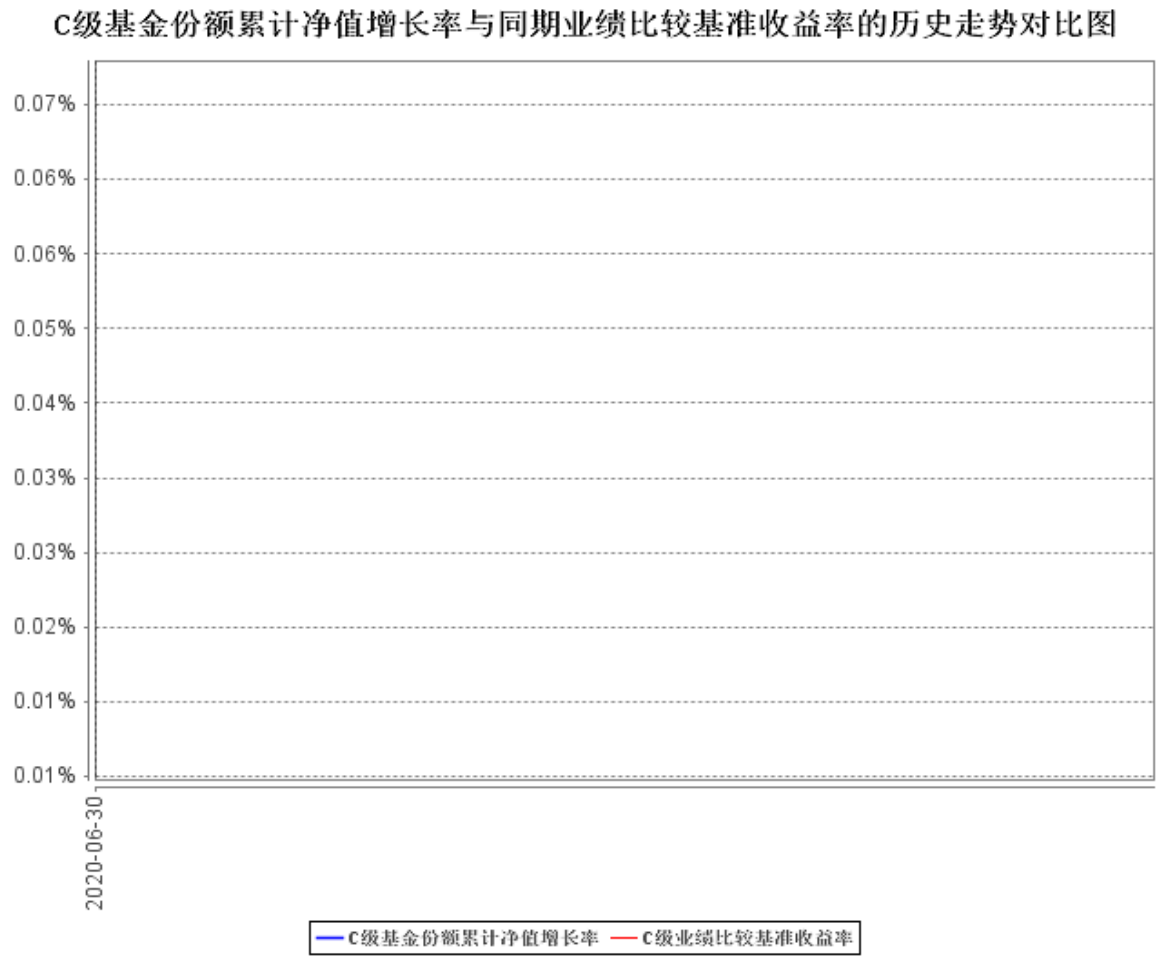
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
自基金合同生效起至今	0.01%	0.00%	0.07%	0.00%	-0.06%	0.00%

注：本基金自 2020 年 6 月 29 日起新增 C 类份额。

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





注：本报告期，本基金投资比例符合基金合同要求。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为汇安基金管理有限责任公司，于 2016 年 4 月 19 日获中国证监会批复，2016 年 4 月 25 日正式成立，是业内首家全自然人、由内部核心专业人士控股的公募基金管理公司，注册资本 1 亿元人民币，注册地为上海市，设北京、上海双总部。公司目前具有公开募集证券投资基金管理、基金销售、特定客户资产管理的资格。

截至 2020 年 6 月 30 日，公司旗下管理 37 只公募基金——汇安嘉汇纯债债券型证券投资基金、汇安嘉裕纯债债券型证券投资基金、汇安丰利灵活配置混合型证券投资基金、汇安丰融灵活配置混合型证券投资基金、汇安嘉源纯债债券型证券投资基金、汇安丰华灵活配置混合型证券投资基金、汇安丰泽灵活配置混合型证券投资基金、汇安沪深 300 指数增强型证券投资基金、汇安丰恒灵活配置混合型证券投资基金、汇安丰裕灵活配置混合型证券投资基金、汇安丰益灵活配置混合型证券投资基金、汇安多策略灵活配置混合型证券投资基金、汇安资产轮动灵活配置混合型证券投资基金、汇安裕华纯债定期开放债券型发起式证券投资基金、汇安成长优选灵活配置混合型证券投资基金、汇安稳裕债券型证券投资基金、汇安趋势动力股票型证券投资基金、汇安量化优选灵活配置混合型证券投资基金、汇安裕阳三年定期开放混合型证券投资基金、汇安短债债券型证券投资基金、汇安嘉鑫纯债债券型证券投资基金、富时中国 A50 交易型开放式指数证券投资基金、汇安核心成长混合型证券投资基金、汇安鼎利纯债债券型证券投资基金、汇安多因子混合型证券投资基金、汇安嘉诚一年封闭运作债券型证券投资基金、汇安行业龙头混合型证券投资基金、汇安中短债债券型证券投资基金、汇安量化先锋混合型证券投资基金、汇安宜创量化精选混合型证券投资基金、汇安中债-广西壮族自治区公司信用类债券指数证券投资基金、汇安嘉盛纯债债券型证券投资基金、汇安信利债券型证券投资基金、汇安裕和纯债债券型证券投资基金、汇安上证证券交易型开放式指数证券投资基金、汇安嘉利一年封闭运作混合型证券投资基金、汇安核心资产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		
张再奇	固定收益投资部高级经理、本	2019 年 2 月 28 日	-	5 年	张再奇，中国人民大学金融学学士、数学与应用数学学士，美国福 特汉姆大学金融学硕士，5 年证券、

	基金的基金经理				基金行业从业经历，曾任东兴证券固定收益部交易员、投资助理。2017 年 11 月加入汇安基金管理有限责任公司固定收益投资部。2019 年 2 月 28 日至今，任汇安嘉汇纯债债券型证券投资基金基金经理；2019 年 4 月 17 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；2019 年 11 月 19 日至今，任汇安丰融灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2019 年 12 月 27 日至今，任汇安中债-广西壮族自治区公司信用类债券指数证券投资基金基金经理。

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

3、本基金无基金经理助理。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，完善相应制度及流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行，确保公平交易原则的实现。基金管理人公平对待旗下管理的所有投资组合，报告期内公平交易制度得到良好的贯彻执行，未发现存在违反公平交易原则的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

基金管理人严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。本报告期内，本基金未发现可能的异常交易情况，不存在所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边成交量超过该证券当日成交量的 5%的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

新冠疫情已演变为全球大流行传染病，欧洲和美国成为疫情新震中，局面全面受控尚需一段时间。严峻的疫情下，各国先后采取了隔离与暂停非必需经济活动的措施，全球经济全面急速冻结。包括股票、债券、货币、短期资金市场在内的国际金融市场前期均爆发史诗级波动，各国迅速采取了多种超常规措施，规模普遍超过了 2008 年国际金融危机时期的市场与经济救助计划，金融市场方才摆脱极端恐慌。疫情进程尚有较大不确定性，造成的严重失业、供应链阻塞、有效需求不足、经济部门去杠杆的连锁反应开始逐步体现，海外经济在 2020 年步入严重衰退已无悬念。

中国以果决的手段控制住了疫情的蔓延，复工复产已步入正轨，但居民日常生活与服务业的全面复原则仍需等待。海外需求的锐减对国内出口的影响已显现，并对国内产业链造成强烈扰动。国内推出一系列针对性政策，在保持流动性整体充裕下，着力扶持受疫情冲击严重的中小企业，开启新基建的同时严格执行房住不炒的政策。相比其他国家，中国在疫情防控上已占据主动，拥有较充分的政策空间与强大执行力，依托中国经济韧性，中国经济可率先步入复苏进程。

债券收益率曲线陡峭化下移，和国外主要经济体相比，长端国债利率仍有下行空间。预计短端利率维持低位，杠杆操作有一定获利空间。在经济下行期，信用风险加大，对信用品种的选择需更为谨慎。权益市场预期以结构性行情为主，立足国内需求、财务稳健和高分红率的公司相对受益。

报告期内，组合在债券投资方面主要以利率债和高评级信用债为主，适度使用杠杆以增加收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末汇安嘉汇纯债债券 A 基金份额净值为 1.0303 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.34%；截至本报告期末汇安嘉汇纯债债券 C 基金份额净值为 1.0304 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.35%；同期业绩比较基准收益率为-0.21%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2020 年的后半年是我国的后疫情时代，由于疫情已被较为平稳的控制，各行业均稳步的进入复苏阶段，此时应兼顾衡量疫情对各行业的短期冲击、长期影响以及政策面相应的应对。此外，

全球经济和国际局势仍受疫情和中美关系等因素影响存在较大不确定性，是为后续投资决策中需要密切关注的方向。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照《企业会计准则》、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，公司运营总监担任估值委员会主席，投资部门、合规风控部和运营部指定人员担任委员。估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备行业研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供银行间同业市场及交易所交易的债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内收益分配情况如下：

本基金以截至 2020 年 1 月 16 日基金可分配收益 17,728,263.53 元为基准，以 2020 年 1 月 20 日为权益登记日、除息日，于 2020 年 1 月 21 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 0.013 元。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对汇安嘉汇纯债债券型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对汇安嘉汇纯债债券型证券投资基金的投资运作进行了监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金实施利润分配的金额为 17,272,762.27 元。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由汇安基金管理有限责任公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：汇安嘉汇纯债债券型证券投资基金

报告截止日： 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	1,492,250.48	199,170.07
结算备付金		60,751,128.97	62,131,599.78
存出保证金		7,292.32	17,153.21
交易性金融资产	6.4.7.2	637,182,798.70	1,561,993,394.70
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		637,182,798.70	1,476,978,394.70
资产支持证券投资		-	85,015,000.00
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	60,000,210.00	-
应收证券清算款		-	25,596,012.07
应收利息	6.4.7.5	11,983,190.92	34,010,522.94
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		771,416,871.39	1,683,947,852.77
负债和所有者权益	**附注号**	**本期末 2020 年 6 月 30 日**	**上年度末 2019 年 12 月 31 日**
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		2,000,000.00	16,000,000.00
应付证券清算款		-	11,007,317.00
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		189,244.52	439,979.80
应付托管费		63,081.50	146,659.93
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	5,438.01	12,878.80
应交税费		84,745.18	102,797.16

应付利息		1,412.91	-1,401.53
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	324,426.14	292,000.00
负债合计		2,668,348.26	28,000,231.16
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	746,113,293.96	1,615,887,799.80
未分配利润	6.4.7.10	22,635,229.17	40,059,821.81
所有者权益合计		768,748,523.13	1,655,947,621.61
负债和所有者权益总计		771,416,871.39	1,683,947,852.77

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，汇安嘉汇纯债债券 A 基金份额净值 1.0303 元，基金份额总额 746,113,196.90 份；汇安嘉汇纯债债券 C 基金份额净值 1.0304 元，基金份额总额 97.06 份。汇安嘉汇纯债债券份额总额合计为 746,113,293.96 份。

6.2 利润表

会计主体：汇安嘉汇纯债债券型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
一、收入		21,519,224.17	25,011,634.83
1.利息收入		23,525,244.01	21,269,218.78
其中：存款利息收入	6.4.7.11	336,366.31	39,643.87
债券利息收入		21,872,559.61	20,381,948.81
资产支持证券利息收入		1,150,264.00	376,717.62
买入返售金融资产收入		165,945.09	470,877.97
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		109.00	30.51
2.投资收益（损失以“-”填列）		20,143,409.33	5,292,335.07
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	19,996,929.19	5,292,335.07
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	146,480.14	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-22,149,431.67	-1,549,919.02
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-

5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	2.50	-
减：二、费用		2,555,589.25	1,930,878.17
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	1,419,188.98	1,295,000.51
2．托管费	6.4.10.2.2	473,062.95	431,666.85
3．销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4．交易费用	6.4.7.19	14,097.29	3,372.30
5．利息支出		448,412.44	46,335.10
其中：卖出回购金融资产支出		448,412.44	46,335.10
6．税金及附加		68,357.68	41,159.99
7．其他费用	6.4.7.20	132,469.91	113,343.42
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		18,963,634.92	23,080,756.66
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		18,963,634.92	23,080,756.66

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汇安嘉汇纯债债券型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,615,887,799.80	40,059,821.81	1,655,947,621.61
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	18,963,634.92	18,963,634.92
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）	-869,774,505.84	-19,115,465.29	-888,889,971.13
其中：1.基金申购款	21,673.36	533.43	22,206.79
2.基金赎回款	-869,796,179.20	-19,115,998.72	-888,912,177.92
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的	-	-17,272,762.27	-17,272,762.27

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）	746,113,293.96	22,635,229.17	768,748,523.13
项目	**上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日**		
	实收基金	**未分配利润**	**所有者权益合计**
一、期初所有者权益（基金净值）	796,021,086.36	63,220,204.51	859,241,290.87
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	23,080,756.66	23,080,756.66
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）	-	-	-
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）	796,021,086.36	86,300,961.17	882,322,047.53

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

何斌	王嘉浩	江士
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

汇安嘉汇纯债债券型证券投资基金(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]2462 号《关于准予汇安嘉汇纯债债券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《汇安嘉汇纯债债券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 200,001,134.19 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 1530 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《汇安嘉汇纯债债券型证券投资基金基金合同》于 2016 年 12 月 2 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 200,010,134.28 份基金份额，其中认购资金利息折合 9,000.09 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，基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“浦发银行”）。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《汇安嘉汇纯债债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围包括国内依法发行上市的国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、地方政府债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、同业存单、资产支持证券、次级债、可分离交易可转债的纯债部分、中小企业私募债、债券回购、银行存款、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的相关规定)。本基金不投资于股票、权证等资产，可转债仅投资可分离交易可转债的纯债部分。本基金对债券的投资比例不低于基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：中债新综合财富（总值）指数收益率×95%+金融机构人民币活期存款利率（税后）×5%。

本财务报表由本基金的基金管理人汇安基金管理有限责任公司于 2018 年 8 月 24 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则－基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《汇安成长优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2)对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%

计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

(4)基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
活期存款	1,492,250.48
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：	1,492,250.48

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2020 年 6 月 30 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	296,297,566.46	296,935,798.70	638,232.24
	银行间市场	342,422,235.89	340,247,000.00	-2,175,235.89
	合计	638,719,802.35	637,182,798.70	-1,537,003.65
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		638,719,802.35	637,182,798.70	-1,537,003.65

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	60,000,210.00	-
合计	60,000,210.00	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	11,284.71
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	17,572.10
应收债券利息	11,949,100.54
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	5,230.27
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	3.30
合计	11,983,190.92

6.4.7.6 其他资产

无。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	5,438.01
合计	5,438.01

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
预提费用	324,426.14
合计	324,426.14

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

汇安嘉汇纯债债券 A		
项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,615,887,799.80	1,615,887,799.80
本期申购	21,576.30	21,576.30
本期赎回(以"-"号填列)	-869,796,179.20	-869,796,179.20
本期末	746,113,196.90	746,113,196.90

金额单位：人民币元

汇安嘉汇纯债债券 C		
项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	-	-
本期申购	97.06	97.06
本期赎回(以"-"号填列)	-	-

本期末	97.06	97.06

注：本期申购包含红利再投、转换入份额；本期赎回包含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

汇安嘉汇纯债债券 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,392,054.97	37,667,766.84	40,059,821.81
本期利润	41,113,066.58	-22,149,431.67	18,963,634.91
本期基金份额交易产生的变动数	-5,715,530.31	-13,399,937.92	-19,115,468.23
其中：基金申购款	265.02	265.47	530.49
基金赎回款	-5,715,795.33	-13,400,203.39	-19,115,998.72
本期已分配利润	-17,272,762.27	-	-17,272,762.27
本期末	20,516,828.97	2,118,397.25	22,635,226.22

单位：人民币元

汇安嘉汇纯债债券 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	0.01	-	0.01
本期基金份额交易产生的变动数	2.66	0.28	2.94
其中：基金申购款	2.66	0.28	2.94
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2.67	0.28	2.95

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	223,124.92
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	113,241.39
其他	-
合计	336,366.31

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

无。

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

无。

6.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	19,996,929.19
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	19,996,929.19

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	1,810,776,527.18
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	1,749,775,460.53
减：应收利息总额	41,004,137.46
买卖债券差价收入	19,996,929.19

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出资产支持证券成交总额	146,270,200.69
减：卖出资产支持证券成本总额	145,000,000.00
减：应收利息总额	1,123,720.55
资产支持证券投资收益	146,480.14

注：无。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.16 股利收益

无。

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	-22,149,431.67
——股票投资	-
——债券投资	-22,134,431.67
——资产支持证券投资	-15,000.00
——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	-22,149,431.67

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	2.50
合计	2.50

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	1,212.29
银行间市场交易费用	12,885.00
合计	14,097.29

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
审计费用	44,753.80
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行划款手续费	9,443.77

上清所证书使用费	600.00
账户维护费	18,000.00
合计	132,469.91

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

无

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
汇安基金管理有限责任公司（“汇安基金”）	基金管理人、登记机构、基金销售机构
上海浦东发展银行股份有限公司（“浦发银行”）	基金托管人
何斌	基金管理人股东
秦军	基金管理人股东
郭小峰	基金管理人股东
戴新华	基金管理人股东
刘强	基金管理人股东
郭兆强	基金管理人股东
尹喜杰	基金管理人股东
王福德	基金管理人股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 权证交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,419,188.98	1,295,000.51
其中：支付销售机构的客户维护费	1,050.59	-

注：支付基金管理人汇安基金管理有限责任公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 0.3%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日基金管理人报酬＝前一日基金资产净值 × 0.3% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	473,062.95	431,666.85

注：支付基金托管人浦发银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费＝前一日基金资产净值×0.10% / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	汇安嘉汇纯债债券 A	汇安嘉汇纯债债券 C	合计
汇安基金	-	-	-
合计	-	-	-
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	汇安嘉汇纯债债券 A	汇安嘉汇纯债债券 C	合计
合计	-	-	-

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 0.20%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 类基金份额的基金资产净值× 0.20% / 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.5.2 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

无。

6.4.10.6 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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
浦发银行	1,492,250.48	223,124.92	6,079,255.67	37,942.83

注：本基金的银行存款由基金托管人浦发银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

汇安嘉汇纯债债券 A

金额单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		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	本期利润分配合计	备注
		场内	场外					
1	2020 年 1 月 20 日	-	2020 年 1 月 20 日	0.1300	17,266,607.86	6,154.41	17,272,762.27	
合计	-	-		0.1300	17,266,607.86	6,154.41	17,272,762.27	

6.4.12 期末（2020 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为债券型基金，其长期平均风险和预期收益率低于股票基金、混合基金，高于货币市场基金。

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

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

公司致力于实行全面、系统的风险管理，通过制定系统化的风险管理程序，对风险管理的整个流程进行评估和改进。公司奉行分工明确、相互协作、彼此牵制的风险管理组织结构，构建由四大防线共同筑成的风险管理体系：第一道防线由各个业务部门构成，各业务部门总监作为风险责任人；第二道监控防线由合规风控部构成，对公司运营过程中产生的或潜在的各项风险进行有效管理，并就内部控制及风险管理制度的执行情况独立地履行检查、评价、报告、建议职能；第三道防线是由总经理及其下设的风险管理委员会构成，总经理负责公司日常经营管理中的风险管理工作。总经理下设风险管理委员会，负责对公司经营及基金运作中的风险进行研究、评估和防控；第四道监控防线由董事会及其下设公司风险控制委员会构成。董事会负责公司整体风险的预防和控制，审核、监督公司风险管理制度的有效执行。董事会下设公司风险控制委员会，协助董事会确立公司风险取向，风险总量、风险限额，制定和调整公司风险管理战略、原则、政策和指导方针，并确保其得到有效执行。

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

将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

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

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

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

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
A-1	-	160,529,000.00
A-1 以下	-	-
未评级	119,478,000.00	233,316,500.00
合计	119,478,000.00	393,845,500.00

注：未评级部分为政策性金融债和短期融资券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	-	39,685,000.00
合计	-	39,685,000.00

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
AAA	116,507,798.70	393,857,087.20
AAA 以下	350,850,000.00	257,412,650.00
未评级	50,347,000.00	392,178,157.50
合计	517,704,798.70	1,043,447,894.70

注：未评级部分为政策性金融债。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
AAA	-	85,015,000.00
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	-	85,015,000.00

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

于 2020 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额中有 2,000,000.00 元将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他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，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

6.4.13.3.2 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》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理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%(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上述比例限制)。

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 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2020 年 6 月 30 日，本基金无流动性受限资产。

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 2020 年 6 月 30 日，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值为 698,675,259.18 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。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,492,250.48	-	-	-	1,492,250.48
结算备付金	60,751,128.97	-	-	-	60,751,128.97
存出保证金	7,292.32	-	-	-	7,292.32
交易性金融资产	430,658,400.00	206,524,398.70	-	-	637,182,798.70
买入返售金融资产	60,000,210.00	-	-	-	60,000,210.00
应收利息	-	-	-	11,983,190.92	11,983,190.92
资产总计	552,909,281.77	206,524,398.70	-	11,983,190.92	771,416,871.39
负债					
卖出回购金融资产款	2,000,000.00	-	-	-	2,000,000.00
应付管理人报酬	-	-	-	189,244.52	189,244.52
应付托管费	-	-	-	63,081.50	63,081.50
应付交易费用	-	-	-	5,438.01	5,438.01
应付利息	-	-	-	1,412.91	1,412.91
应交税费	-	-	-	84,745.18	84,745.18
其他负债	-	-	-	324,426.14	324,426.14
负债总计	2,000,000.00	-	-	668,348.26	2,668,348.26
利率敏感度缺口	550,909,281.77	206,524,398.70	-	11,314,842.66	768,748,523.13
上年度末 2019 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	199,170.07	-	-	-	199,170.07

结算备付金	62,131,599.78	-	-	-	62,131,599.78
存出保证金	17,153.21	-	-	-	17,153.21
交易性金融资产	826,501,207.50	684,352,187.20	51,140,000.00	-	1,561,993,394.70
应收证券清算款	-	-	-	25,596,012.07	25,596,012.07
应收利息	-	-	-	34,010,522.94	34,010,522.94
资产总计	888,849,130.56	684,352,187.20	51,140,000.00	59,606,535.01	1,683,947,852.77
负债					
卖出回购金融资产款	16,000,000.00	-	-	-	16,000,000.00
应付证券清算款	-	-	-	11,007,317.00	11,007,317.00
应付管理人报酬	-	-	-	439,979.80	439,979.80
应付托管费	-	-	-	146,659.93	146,659.93
应付交易费用	-	-	-	12,878.80	12,878.80
应付利息	-	-	-	-1,401.53	-1,401.53
应交税费	-	-	-	102,797.16	102,797.16
其他负债	-	-	-	292,000.00	292,000.00
负债总计	16,000,000.00	-	-	12,000,231.16	28,000,231.16
利率敏感度缺口	872,849,130.56	684,352,187.20	51,140,000.00	47,606,303.85	1,655,947,621.61

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（ 2020 年 6 月 30 日 ）	上年度末（ 2019 年 12 月 31 日 ）
	市场利率下降 25 个基点	1,704,266.12	3,942,667.12
	市场利率上升 25 个基点	-1,693,464.71	-3,911,844.79

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场

交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

无

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

无

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	637,182,798.70	82.60
	其中：债券	637,182,798.70	82.60
	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	60,000,210.00	7.78
	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	62,243,379.45	8.07
8	其他各项资产	11,990,483.24	1.55
9	合计	771,416,871.39	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期末未持有股票。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期末未持有股票。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期未买入及卖出股票。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	229,500,000.00	29.85
	其中：政策性金融债	159,815,000.00	20.79
4	企业债券	316,846,798.70	41.22
5	企业短期融资券	10,010,000.00	1.30
6	中期票据	80,826,000.00	10.51
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	637,182,798.70	82.89

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	2020015	20 柳州银行小微债 01	700,000	69,685,000.00	9.06
2	200206	20 国开 06	700,000	69,412,000.00	9.03
3	112585	17 桂建 01	636,590	66,160,798.70	8.61
4	101900091	19 恒逸 MTN001	500,000	50,405,000.00	6.56
5	143315	17 广汇 G2	489,000	48,704,400.00	6.34

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期未投资国债期货。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 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。

7.11.2 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。

7.11.3 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	7,292.32
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	11,983,190.92
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,990,483.24

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有流通受限股票。

7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
汇安嘉汇纯债债券A	219	3,406,909.57	746,110,885.47	99.999690%	2,311.43	0.000310%
汇安嘉汇纯债债券C	1	97.06	0.00	0.000000%	97.06	100.000000%
合计	220	3,391,424.06	746,110,885.47	99.999677%	2,408.49	0.000323%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	汇安嘉汇纯债债券A	92.91	0.00001200%
	汇安嘉汇纯债债券C	97.06	100.00000000%
	合计	189.97	0.00002500%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	汇安嘉汇纯债债券 A	汇安嘉汇纯债债券 C
基金合同生效日（2016 年 12 月 2 日）基金份额总额	200,010,134.28	-
本报告期期初基金份额总额	1,615,887,799.80	-
本报告期基金总申购份额	21,576.30	97.06
减:本报告期基金总赎回份额	869,796,179.20	-
本报告期期末基金份额总额	746,113,196.90	97.06

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人无重大人事变动

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金在报告期内基金投资策略没有改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

自本基金成立日（2016 年 12 月 22 日）起至今聘任普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金提供审计服务，本报告期内未发生变动。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信建投证券	2	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
湘财证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-

注：选择专用席位的标准和程序：

（1）选择标准

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

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

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

（2） 选择程序

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

（3）交易单元变更情况

本基金本报告期内无交易单元变更。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中信建投证券	360,397,916.89	87.54%	679,000,000.00	77.51%	-	-
川财证券	51,319,639.51	12.46%	197,000,000.00	22.49%	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-

华泰证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	汇安基金管理有限责任公司关于董事会成员换届变更的公告	指定报刊和/或公司网站	2020 年 1 月 4 日
2	汇安嘉汇纯债债券型证券投资基金分红公告	指定报刊和/或公司网站	2020 年 1 月 18 日
3	汇安嘉汇纯债债券型证券投资基金暂停及恢复大额申购（含转换转入）业务的公告	指定报刊和/或公司网站	2020 年 1 月 18 日
4	汇安嘉汇纯债债券型证券投资基金（2020 年第 1 号）招募说明书（更新）	指定报刊和/或公司网站	2020 年 4 月 18 日
5	关于汇安嘉汇纯债债券型证券投资基金增加 C 类份额并修改基金合同的公告	指定报刊和/或公司网站	2020 年 6 月 29 日
6	汇安嘉汇纯债债券型证券投资基金基金合同	指定报刊和/或公司网站	2020 年 6 月 29 日
7	汇安嘉汇纯债债券型证券投资基金托管协议	指定报刊和/或公司网站	2020 年 6 月 29 日
8	汇安嘉汇纯债债券型证券投资基金招募说明书（更新）	指定报刊和/或公司网站	2020 年 6 月 29 日
9	汇安嘉汇纯债债券型证券投资基金招募说明书（更新）摘要	指定报刊和/或公司网站	2020 年 6 月 29 日

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20200101-20200630	746,110,885.47	0.00	0.00	746,110,885.47	99.9997%
	2	20200120-20200210	266,712,304.41	0.00	266,712,304.41	0.00	0.0000%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
本基金本报告期内存在单一基金份额持有人持有基金份额比例超过 20%的情况，投资人在投资本基金时，可能面临本基金因持有人集中度较高而产生的相应风险，具体包括：巨额赎回风险、流动性风险、基金资产净值持续低于 5000 万元的风险、基金份额净值大幅波动风险以及基金收益水平波动风险。本基金管理人将在基金运作中对以上风险进行严格的监控和管理，保护中小投资者利益。							

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

（1） 中国证监会批准汇安嘉汇纯债债券型证券投资基金募集的文件

（2）《汇安嘉汇纯债债券型证券投资基金基金合同》

（3）《汇安嘉汇纯债债券型证券投资基金招募说明书》

（4）《汇安嘉汇纯债债券型证券投资基金托管协议》

（5）基金管理人业务资格批件、营业执照

（6）报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告

12.2 存放地点

北京市东城区东直门南大街 5 号中青旅大厦 13 层

上海市虹口区东大名路 501 白玉兰大厦 36 层

12.3 查阅方式

投资者可到基金管理人的办公场所及网站免费查阅备查文件，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

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

公司网站：http://www.huianfund.cn

汇安基金管理有限责任公司

2020 年 8 月 29 日