

# 汇安嘉利一年封闭运作混合型证券投资基金

## 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：中国光大银行股份有限公司

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。

基金托管人中国光大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 4 月 21 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§2 基金简介</b>	<b>6</b>
2.1 基金基本情况	6
2.2 基金产品说明	6
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	8
<b>§4 管理人报告</b>	<b>12</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
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	16
<b>§5 托管人报告</b>	<b>17</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	17
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	17
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>18</b>
6.1 资产负债表	18
6.2 利润表	19
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	20

6.4 报表附注.....	21
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>47</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	47
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	47
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.....	48
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	50
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	51
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	51
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	51
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	51
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	51
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	52
7.12 投资组合报告附注.....	52
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>54</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	54
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	54
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	54
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>55</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>56</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	56
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	56
10.4 基金投资策略的改变.....	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	56
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	56
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	56
10.8 其他重大事件.....	57
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>59</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	59

<b>§12 备查文件目录</b>	<b>60</b>
12.1 备查文件目录	60
12.2 存放地点	60
12.3 查阅方式	60

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	汇安嘉利一年封闭运作混合型证券投资基金	
基金简称	汇安嘉利一年封闭混合	
基金主代码	009133	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 4 月 21 日	
基金管理人	汇安基金管理有限责任公司	
基金托管人	中国光大银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,827,879,421.63 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	汇安嘉利一年封闭混合 A	汇安嘉利一年封闭混合 C
下属分级基金的交易代码:	009133	009134
报告期末下属分级基金的份额总额	1,827,846,911.25 份	32,510.38 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险的前提下,通过优化大类资产配置和选择高安全边际的证券,力争实现基金资产的长期稳健增值。	
投资策略	本基金管理人在大类资产配置过程中,结合定量和定性分析,从宏观、中观、微观等多个角度考虑宏观经济面、政策面、市场面等多种因素,综合分析评判证券市场的特点及其演化趋势,重点分析股票、债券等资产的预期收益风险的匹配关系,在此基础上,在投资比例限制范围内,确定或调整投资组合中股票和债券的比例。	
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*15%+中债综合财富指数收益率*85%。	
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。	
	汇安嘉利一年封闭混合 A	汇安嘉利一年封闭混合 C

### 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	中国光大银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	郭冬青	石立平
	联系电话	01056711600	010-63639180
	电子邮箱	guodq@huianfund.cn	shiliping@cebbank.com
客户服务电话		01056711690	95595
传真		01056711640	010-63639132
注册地址		上海市虹口区欧阳路 218 弄 1 号 2 楼 215 室	北京市西城区太平桥大街 25 号、甲 25 号中国光大中心
办公地址		北京市东城区东直门南大	北京市西城区太平桥大街 25 号

	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	中国光大中心
邮政编码	100007	100033
法定代表人	何斌（代行职务）	李晓鹏

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金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处

## 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	汇安嘉利一年封闭混合 A	汇安嘉利一年封闭混合 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2020 年 4 月 21 日 - 2020 年 6 月 30 日)	报告期(2020 年 4 月 21 日 - 2020 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	12,119,014.58	190.92
本期利润	-6,920,935.96	-147.62
加权平均基金份额本期利润	-0.0038	-0.0045
本期加权平均净值利润率	-0.38%	-0.46%
本期基金份额净值增长率	-0.38%	-0.45%
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	-6,920,935.96	-147.62
期末可供分配基金份额利润	-0.0038	-0.0045
期末基金资产净值	1,820,925,975.29	32,362.76
期末基金份额净值	0.9962	0.9955
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	-0.38%	-0.45%

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 2020 年 4 月 21 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

汇安嘉利一年封闭混合 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
过去一个月	0.16%	0.13%	0.54%	0.16%	-0.38%	-0.03%
自基金合同生效起至今	-0.38%	0.10%	0.17%	0.14%	-0.55%	-0.04%

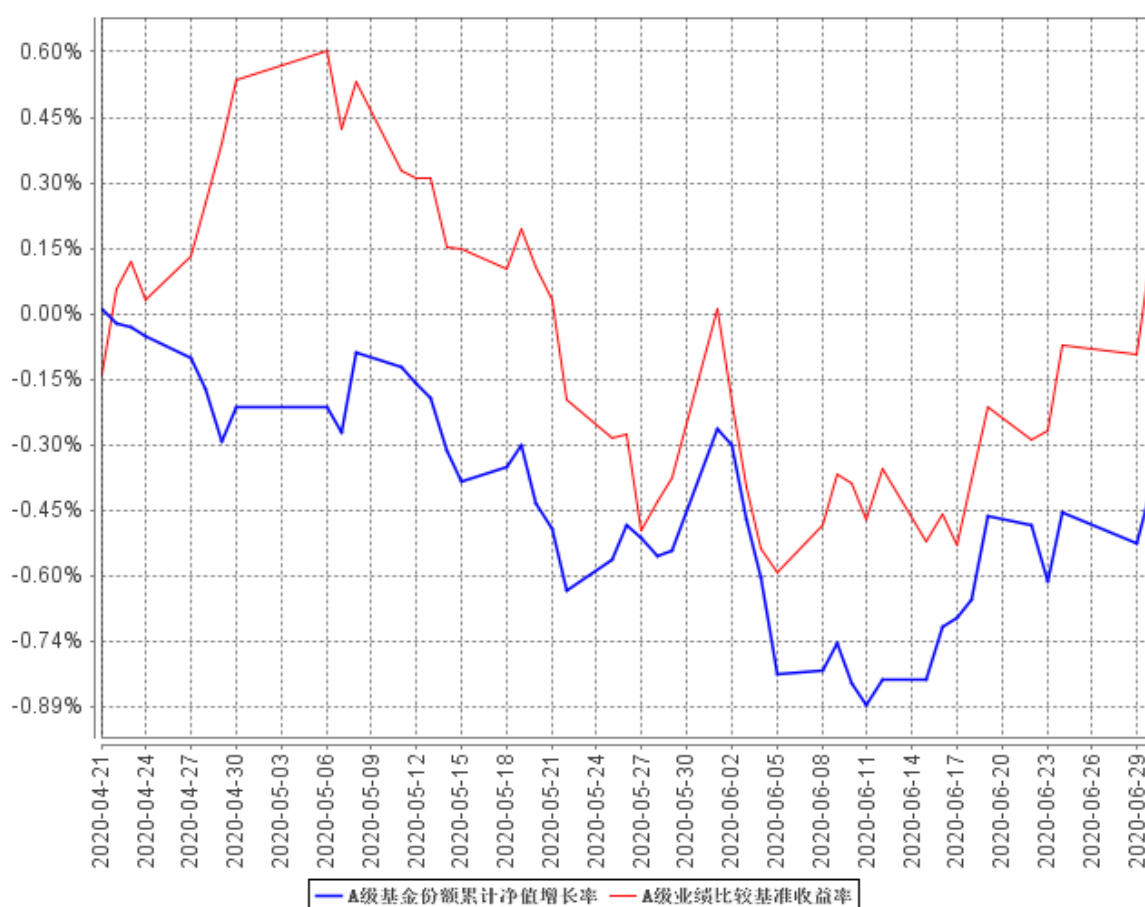


汇安嘉利一年封闭混合 C

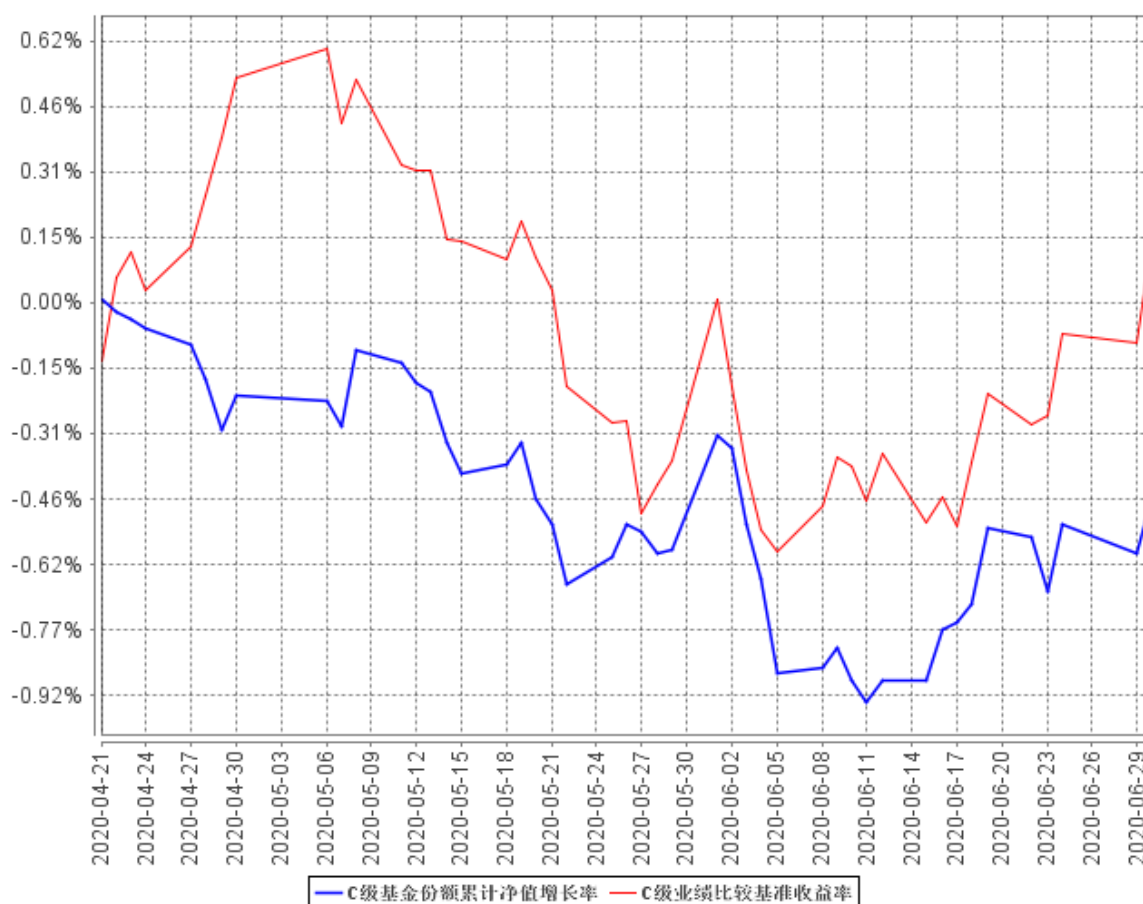
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.13%	0.13%	0.54%	0.16%	-0.41%	-0.03%
自基金合同生效起至今	-0.45%	0.10%	0.17%	0.14%	-0.62%	-0.04%

### 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

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基金合同生效日为 2020 年 4 月 21 日，至本报告期末，本基金合同生效未满一年。

②根据《汇安嘉利一年封闭运作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（包含主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、债券（包括国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券、可交换债券等）、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、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。在条件许可的情况下，基金管理人可在不改变本基金既有投资目标、策略和风险收益特征并在控制风险的前提下，根据相关法律法规，参与融资业务，不需要召开基金份额持有人大会。本基金投资于股票资产占基金资产的比例为 0%—30%；封闭期内，本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；封闭期届满转为开放式运作后，本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值的 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。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。

## § 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人，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、汇安裕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		
仇秉则	固定收益投资部副总经理、本	2020 年 4 月 21 日	-	14 年	仇秉则，CFA，CPA，中山大学经济学学士，14 年证券、基金行业从业经历，曾任普华永道中天会计师

	基金的 基金经 理				<p>事务所审计经理，嘉实基金管理有限公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责任公司，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 19 日至 2018 年 2 月 9 日，任汇安丰利灵活配置混合型证券投资基金基金经理；</p> <p>2017 年 1 月 25 日至 2018 年 2 月 9 日，任汇安丰泰灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2017 年 1 月 13 日至 2018 年 5 月 14 日，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 13 日至 2018 年 5 月 14 日，任汇安丰恒灵活配置混合型证券投资基金基金经理；</p> <p>2017 年 1 月 10 日至 2019 年 1 月 10 日，任汇安丰华灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2016 年 12 月 2 日至 2019 年 10 月 11 日，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 2019 年 10 月 11 日，任汇安嘉裕纯债债券型证券投资基金基金经理；2016 年 12 月 22 日至 2019 年 11 月 19 日，任汇安丰融灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2016 年 12 月 22 日至 2019 年 10 月 11 日任汇安嘉源纯债债券型证券投资基金基金经理；</p> <p>2017 年 7 月 27 日至 2019 年 10 月 11 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</p>
--	-----------------	--	--	--	--

					8月10日至2019年10月11日，任汇安丰益灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2019年5月10日至2020年5月11日，任汇安丰利灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2019年8月9日至今任汇安嘉诚一年封闭运作债券型证券投资基金基金经理；2019年10月14日至今任汇安裕裕债券型证券投资基金基金经理；2020年3月5日至今任汇安信利债券型证券投资基金基金经理；2020年4月21日至今任汇安嘉利一年封闭运作混合型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	---

#### 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合规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

基金管理人严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。本报告期内，本基金未发现可能的异常交易情况，不存在所有投资组合参与

的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边成交量超过该证券当日成交量的 5% 的情况。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2020 年上半年来看，一季度受新冠肺炎疫情影响，国内宏观经济生产侧、需求侧均出现明显收缩，债市收益率整体下行。进入二季度宏观经济总体快速复原，PMI 连续 3 个月处于扩张区间、工业增加值持续同比为正，地产、汽车销售近期同比已转正，基建发力确定性较高，线上消费维持高增速，国外需求下滑对出口的影响尚未充分显现。猪肉价格有所反弹，大宗商品价格基本收复了疫情造成的下跌，CPI 和 PPI 环比降幅已收窄，通缩压力有所下降。

截至 6 月的 M2 和社融存量同比增速达到 11.1% 和 12.8%，不搞大水漫灌是政策基调，前期偏宽松的货币政策已边际调整，保存货币政策空间，打击资金套利和确保资金直达实体成为重要政策考量。

债券收益率从 5 月份开始出现明显调整，十年期国债收益率已回到疫情爆发前水平，期间信用息差变动较小，信用债收益率随国债收益率相应提升。但目前经济主要以边际修复为主，且政府降低社会融资成本的要求将压制债券收益率的上升空间。二季度内，股票市场以科技成长和医药消费为代表的结构性行情表现突出，价值与成长风格的估值差波动加大，预计股票市场在本年仍将围绕核心资产演绎。

报告期内，组合在债券投资方面主要以甄选短久期信用品种为主，适度使用杠杆增加收益，并利用债券市场调整时机增加信用债配置，以提高组合的静态收益率。转债方面以业绩增长预期明确的平衡性转债为主，股票方面以价值型标的为核心持仓，同时持有部分估值相对合理的成长型标的。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末汇安嘉利一年封闭混合 A 基金份额净值为 0.9962 元，本报告期基金份额净值增长率为 -0.38%；截至本报告期末汇安嘉利一年封闭混合 C 基金份额净值为 0.9955 元，本报告期基金份额净值增长率为 -0.45%；同期业绩比较基准收益率为 0.17%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，一方面，复工复产的加快和产业链的逐步恢复，叠加财政和货币政策加大逆周期调节力度，将促进生产侧的稳步提高，近期的高炉开工率都在复苏中，但另一方面，海外疫情的不扩散和防控力度的不足，将从需求侧对外需、出口产生影响，外需的走弱会影响外向型制造业。在宏观经济波动加大的过程中，将关注收益率震荡回调的投资机会。未来一个季度，将谨慎调整股票债券比例，平衡价值与成长的配置比例，为组合创造收益。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未发生利润分配情况。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期，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合规守信情况声明

本报告期内，中国光大银行股份有限公司在汇安嘉利一年封闭运作混合型证券投资基金（以下称“本基金”）托管过程中，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，依法安全保管了基金的全部资产，对本基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督，对发现的问题及时提出了意见和建议。同时，按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告，没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为，诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

### 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

本报告期内，中国光大银行股份有限公司依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，对基金管理人的投资运作、信息披露等行为进行了复核、监督，未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金在运作中遵守了有关法律法规的要求，各重要方面由投资管理人依据基金合同及实际运作情况进行处理。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

中国光大银行股份有限公司依法对基金管理人编制的汇安嘉利一年封闭运作混合型证券投资基金 2020 年中期报告进行了复核，认为报告中相关财务指标、净值表现、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。

## § 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：汇安嘉利一年封闭运作混合型证券投资基金

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
<b>资 产：</b>		
银行存款	6.4.7.1	19,084,769.03
结算备付金		5,779,408.32
存出保证金		137,980.19
交易性金融资产	6.4.7.2	2,185,233,621.94
其中：股票投资		159,212,352.54
基金投资		-
债券投资		1,782,426,269.40
资产支持证券投资		243,595,000.00
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	-
应收证券清算款		1,977,849.58
应收利息	6.4.7.5	31,691,801.89
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		2,243,905,430.95
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2020 年 6 月 30 日</b>
<b>负 债：</b>		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		410,000,000.00
应付证券清算款		10,667,720.43
应付赎回款		-
应付管理人报酬		1,489,069.17
应付托管费		223,360.37
应付销售服务费		10.50
应付交易费用	6.4.7.7	255,837.99
应交税费		241,486.04

应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	69,608.40
负债合计		422,947,092.90
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	6.4.7.9	1,827,879,421.63
未分配利润	6.4.7.10	-6,921,083.58
所有者权益合计		1,820,958,338.05
负债和所有者权益总计		2,243,905,430.95

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，汇安嘉利一年封闭混合 A 基金份额净值 0.9962 元，基金份额总额 1,827,846,911.25 份；汇安嘉利一年封闭混合 C 基金份额净值 0.9955 元，基金份额总额 32,510.38 份。汇安嘉利一年封闭混合份额总额合计为 1,827,879,421.63 份。

## 6.2 利润表

会计主体：汇安嘉利一年封闭运作混合型证券投资基金

本报告期：2020 年 4 月 21 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2020 年 4 月 21 日(基金合同生效 日)至 2020 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		-1,557,213.03
1.利息收入		14,072,528.62
其中：存款利息收入	6.4.7.11	335,923.56
债券利息收入		11,724,305.40
资产支持证券利息收入		1,482,377.97
买入返售金融资产收入		529,921.69
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		3,410,547.43
其中：股票投资收益	6.4.7.12	1,979,919.56
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	-1,710,715.80
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-
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	3,141,343.67
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-19,040,289.08
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	-
<b>减：二、费用</b>		5,363,870.55

1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	3,481,155.53
2. 托管费	6.4.10.2.2	522,173.34
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	24.56
4. 交易费用	6.4.7.19	390,672.56
5. 利息支出		852,740.29
其中：卖出回购金融资产支出		852,740.29
6. 税金及附加		47,495.87
7. 其他费用	6.4.7.20	69,608.40
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-6,921,083.58
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-6,921,083.58

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汇安嘉利一年封闭运作混合型证券投资基金

本报告期：2020 年 4 月 21 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 4 月 21 日(基金合同生效日)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）	1,827,879,421.63	-	1,827,879,421.63
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-6,921,083.58	-6,921,083.58
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）	1,827,879,421.63	-6,921,083.58	1,820,958,338.05

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>何斌</u>	<u>王嘉浩</u>	<u>江士</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

汇安嘉利一年封闭运作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[2020]329 号《关于准予汇安嘉利一年封闭运作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《汇安嘉利一年封闭运作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 1,827,411,200.61 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(2020)第 0302 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《汇安嘉利一年封闭运作混合型证券投资基金基金合同》于 2020 年 4 月 21 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,827,879,421.63 份基金份额,其中认购资金利息折合 468,221.02 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,基金托管人为中国光大银行股份有限公司。

本基金在基金合同生效之日起一年的期间内封闭式运作。封闭期为自基金合同生效之日起至一年后对应日的前一日(含该日)止,若一年后该对应日为非工作日或不存在该对应日的,封闭期到期日相应顺延。封闭期内,基金份额保持不变,基金份额持有人不得申请申购或赎回本基金。封闭期届满后,本基金转为开放式运作,基金名称相应变更为“汇安嘉利混合型证券投资基金”。

根据《汇安嘉利一年封闭运作混合型证券投资基金基金合同》和《汇安嘉利一年封闭运作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《汇安嘉利一年封闭运作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(包含主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票)、债券(包括国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券、可交换债券等)、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、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。在条件许可的情况下,基金管理人可在不改变本基金既有投资目标、策略和风险收益特征并在控制风险的前提下,根据相关法律法规,参与融资业务,不需要召开基金份额持有人大会。本基金投资于股票资产占基金资产的比例为 0%-30%;封闭期内,本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于交易保证金一倍的现金;封闭期届满转为开放式运作后,本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值的 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。本基金的业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率 $\times$ 15%+中债综合财富指数收益率 $\times$ 85%。

#### 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》、《汇安嘉利一年封闭运作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

本基金 2020 年 4 月 21 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 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 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

##### 6.4.4.1 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 2020 年 4 月 21 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日。

#### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 6.4.4.3 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债券投资和资产支持证券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、买入返售金融资产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卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### 6.4.4.4 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；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。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。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的债券投资和资产支持证券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。

#### 6.4.4.6 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。

#### 6.4.4.7 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。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 6.4.4.8 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)。



#### 6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

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。

#### 6.4.4.10 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。

#### 6.4.4.11 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。

#### 6.4.4.12 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。

#### **6.4.4.13 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债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，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》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### **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[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、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，包括买卖债券的差价收入，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

(4) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育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	19,084,769.03
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：	19,084,769.03

##### 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	161,938,527.79	159,212,352.54	-2,726,175.25
贵金属投资-金交所	-	-	-

黄金合约				
债券	交易所市场	1,101,372,815.34	1,090,650,069.40	-10,722,745.94
	银行间市场	695,806,020.77	691,776,200.00	-4,029,820.77
	合计	1,797,178,836.11	1,782,426,269.40	-14,752,566.71
资产支持证券		245,156,547.12	243,595,000.00	-1,561,547.12
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		2,204,273,911.02	2,185,233,621.94	-19,040,289.08

#### 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

无。

##### 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	5,988.53
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	2,600.70
应收债券利息	29,696,737.41
应收资产支持证券利息	1,986,413.15
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	-
应收出借证券利息	-
其他	62.10
合计	31,691,801.89

#### 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	248,249.47
银行间市场应付交易费用	7,588.52
合计	255,837.99

### 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	69,608.40
合计	69,608.40

### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

汇安嘉利一年封闭混合 A		
项目	本期 2020 年 4 月 21 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	1,827,846,911.25	1,827,846,911.25
本期申购	—	—
本期赎回(以“-”号填列)	—	—
本期末	1,827,846,911.25	1,827,846,911.25

金额单位：人民币元

汇安嘉利一年封闭混合 C		
项目	本期 2020 年 4 月 21 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	32,510.38	32,510.38
本期申购	—	—
本期赎回(以“-”号填列)	—	—

本期末	32,510.38	32,510.38
-----	-----------	-----------

注：1. 申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

2. 本基金自 2020 年 4 月 1 日至 2020 年 4 月 15 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币 1,827,411,200.61 元，折合为 1,827,411,200.61 份基金份额（其中 A 类基金份额 1,827,378,690.61 份，C 类基金份额 32,510.00 份）。根据《汇安嘉利一年封闭运作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 468,211.02 元在本基金成立后，折合为 468,211.02 份基金份额（其中 A 类基金份额 468,220.64 份，C 类基金份额 0.38 份），划入基金份额持有人账户。

3. 根据《汇安嘉利一年封闭运作混合型证券投资基金基金合同》、《汇安嘉利一年封闭运作混合型证券投资基金招募说明书》及《汇安嘉利一年封闭运作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 2020 年 4 月 21 日（基金合同生效日）至 2021 年 4 月 20 日止期间暂不向投资人开放基金交易。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

汇安嘉利一年封闭混合 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	12,119,014.58	-19,039,950.54	-6,920,935.96
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	12,119,014.58	-19,039,950.54	-6,920,935.96

单位：人民币元

汇安嘉利一年封闭混合 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	190.92	-338.54	-147.62
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-

本期已分配利润	-	-	-
本期末	190.92	-338.54	-147.62

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 4 月 21 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	310,722.58
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	24,941.92
其他	259.06
合计	335,923.56

#### 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

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 4 月 21 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	1,979,919.56
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	1,979,919.56

##### 6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 4 月 21 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	83,061,979.96
减：卖出股票成本总额	81,082,060.40
买卖股票差价收入	1,979,919.56

#### 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4月21日(基金合同生效日)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	-1,710,715.80
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	-1,710,715.80

##### 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4月21日(基金合同生效日)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	177,591,151.86
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	175,895,317.72
减：应收利息总额	3,406,549.94
买卖债券差价收入	-1,710,715.80

##### 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

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

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 4 月 21 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	3,141,343.67
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	3,141,343.67

#### 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 4 月 21 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-19,040,289.08
——股票投资	-2,726,175.25

——债券投资	-14,752,566.71
——资产支持证券投资	-1,561,547.12
——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	-19,040,289.08

#### 6.4.7.18 其他收入

无。

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 4 月 21 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	386,272.56
银行间市场交易费用	4,400.00
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	390,672.56

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 4 月 21 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日
审计费用	27,843.36
信息披露费	41,765.04
证券出借违约金	-
合计	69,608.40

## 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、基金注册登记机构、基金销售机构
中国光大银行股份有限公司（“中国光大银行”）	基金托管人、基金销售机构
何斌	基金管理人的股东
秦军	基金管理人的股东
郭小峰	基金管理人的股东
戴新华	基金管理人的股东
刘强	基金管理人的股东
郭兆强	基金管理人的股东
尹喜杰	基金管理人的股东
王福德	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 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 4 月 21 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	3,481,155.53
其中：支付销售机构的客户维护费	1,412,839.97

注：支付基金管理人汇安基金管理有限责任公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日基金管理人报酬=前一日基金资产净值 × 1% / 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 4 月 21 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	522,173.34

注：支付基金托管人光大银行的托管费按前一日基金资产净值 0.15%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×0.15% / 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 4 月 21 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	汇安嘉利一年封闭 混合 A	汇安嘉利一年封闭 混合 C	合计
汇安基金	-	-	-
中国光大银行	-	-	-
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 0.40% 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 × 0.40% / 当年天数。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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 4 月 21 日 (基金合同生效日) 至 2020 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
中国光大银行	19,084,769.03	310,722.58

注：本基金的银行存款由基金托管人光大银行保管，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

无。

### 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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 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 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688377	迪威尔	2020 年 6 月 29 日	2020 年 7 月 8 日	新股流通受限	16.42	16.42	7,894	129,619.48	129,619.48	-
688277	天智航	2020 年 6 月 24 日	2020 年 7 月 7 日	新股流通受限	12.04	12.04	8,810	106,072.40	106,072.40	-
688027	国盾量子	2020 年 6 月 30 日	2020 年 7 月 9 日	新股流通受限	36.18	36.18	2,830	102,389.40	102,389.40	-
688528	秦川物联	2020 年 6 月 19 日	2020 年 7 月 1 日	新股流通受限	11.33	11.33	8,337	94,458.21	94,458.21	-
688600	皖仪科技	2020 年 6 月 23 日	2020 年 7 月 3 日	新股流通受限	15.50	15.50	5,468	84,754.00	84,754.00	-
300847	中船汉光	2020 年 6 月 29 日	2020 年 7 月 9 日	新股流通受限	6.94	6.94	1,420	9,854.80	9,854.80	-
300845	捷安高科	2020 年 6 月 24 日	2020 年 7 月 3 日	新股流通受限	17.63	17.63	470	8,286.10	8,286.10	-
300843	胜蓝股份	2020 年 6 月 23 日	2020 年 7 月 2 日	新股流通受限	10.01	10.01	751	7,517.51	7,517.51	-
300840	酷特智能	2020 年 6 月 30 日	2020 年 7 月 8 日	新股流通受限	5.94	5.94	1,185	7,038.90	7,038.90	-
300846	首都在线	2020 年 6 月 22 日	2020 年 7 月 1 日	新股流通受限	3.37	3.37	1,131	3,811.47	3,811.47	-

注：1、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。

2、本基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让。

#### **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。

#### **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同责任，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光大银行，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**

无。

##### **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**

无。



**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
AAA	843,804,518.00
AAA 以下	938,621,751.40
未评级	—
合计	1,782,426,269.40

**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
AAA	243,595,000.00
AAA 以下	—
未评级	—
合计	243,595,000.00

**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于约定开放日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于开放期内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 410,000,000.00 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同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额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》且于基金开放期内按照《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期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%，于开放期内，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。封闭期届满转为开放式运作后，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，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为 13.41%。

于开放期内，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。

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	19,084,769.03	-	-	-	19,084,769.03
结算备付金	5,779,408.32	-	-	-	5,779,408.32
存出保证金	137,980.19	-	-	-	137,980.19
交易性金融资产	713,670,069.40	1,157,031,000.00	155,320,200.00	159,212,352.54	2,185,233,621.94
应收证券清算款	-	-	-	1,977,849.58	1,977,849.58
应收利息	-	-	-	31,691,801.89	31,691,801.89
资产	738,672,226.94	1,157,031,000.00	155,320,200.00	192,882,004.01	2,243,905,430.95

总计					
负债					
卖出 回购 金融 资产 款	410,000,000.00	-	-	-	410,000,000.00
应付 证券 清算 款	-	-	-	10,667,720.43	10,667,720.43
应付 管理 人报 酬	-	-	-	1,489,069.17	1,489,069.17
应付 托管 费	-	-	-	223,360.37	223,360.37
应付 销售 服务 费	-	-	-	10.50	10.50
应付 交易 费用	-	-	-	255,837.99	255,837.99
应交 税费	-	-	-	241,486.04	241,486.04
其他 负债	-	-	-	69,608.40	69,608.40
负债 总计	410,000,000.00	-	-	12,947,092.90	422,947,092.90
利率 敏感 度缺 口	328,672,226.94	1,157,031,000.00	155,320,200.00	179,934,911.11	1,820,958,338.05

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）
市场利率下降 25 个基点	7,826,502.52
市场利率上升 25 个基点	-7,764,612.43

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于股票资产占基金资产的比例为 0%—30%；封闭期内，本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；封闭期届满转为开放式运作后，本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值的 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。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 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	159,212,352.54	8.74

交易性金融资产—基金投资	-	-
交易性金融资产—债券投资	95,529,369.40	5.25
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	254,741,721.94	13.99

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2020 年 6 月 30 日,本基金持有的交易性权益类投资公允价值占基金资产净值的比例为 13.99%,因此除市场利率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	159,212,352.54	7.10
	其中：股票	159,212,352.54	7.10
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	2,026,021,269.40	90.29
	其中：债券	1,782,426,269.40	79.43
	资产支持证券	243,595,000.00	10.86
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	24,864,177.35	1.11
8	其他各项资产	33,807,631.66	1.51
9	合计	2,243,905,430.95	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	7,178,578.36	0.39
C	制造业	96,666,618.51	5.31
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,766.32	0.00
E	建筑业	6,201,000.00	0.34
F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,097.57	0.00
J	金融业	—	—
K	房地产业	49,141,291.78	2.70
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	159,212,352.54	8.74

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	000002	万科 A	1,879,927	49,141,291.78	2.70
2	600887	伊利股份	949,961	29,572,285.93	1.62
3	600104	上汽集团	1,000,000	16,990,000.00	0.93
4	600176	中国巨石	1,299,912	11,894,194.80	0.65
5	002508	老板电器	345,400	10,745,394.00	0.59
6	002035	华帝股份	800,000	8,104,000.00	0.45
7	600741	华域汽车	347,034	7,214,836.86	0.40
8	601088	中国神华	499,901	7,178,578.36	0.39
9	601668	中国建筑	1,300,000	6,201,000.00	0.34
10	601137	博威合金	300,000	4,692,000.00	0.26
11	002258	利尔化学	200,000	3,566,000.00	0.20
12	000401	冀东水泥	200,000	3,208,000.00	0.18
13	688377	迪威尔	7,894	129,619.48	0.01
14	603087	甘李药业	1,076	107,922.80	0.01
15	688277	天智航	8,810	106,072.40	0.01
16	688027	国盾量子	2,830	102,389.40	0.01
17	688528	秦川物联	8,337	94,458.21	0.01
18	688600	皖仪科技	5,468	84,754.00	0.00
19	300842	帝科股份	455	18,527.60	0.00
20	600956	新天绿能	2,533	12,766.32	0.00
21	300839	博汇股份	502	11,751.82	0.00
22	300847	中船汉光	1,420	9,854.80	0.00
23	300845	捷安高科	470	8,286.10	0.00



24	300843	胜蓝股份	751	7,517.51	0.00
25	300840	酷特智能	1,185	7,038.90	0.00
26	300846	首都在线	1,131	3,811.47	0.00

## 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	000002	万科 A	49,289,357.20	2.71
2	600887	伊利股份	30,568,171.98	1.68
3	601088	中国神华	27,006,597.71	1.48
4	600104	上汽集团	19,299,158.00	1.06
5	601166	兴业银行	16,499,777.94	0.91
6	600176	中国巨石	14,009,208.34	0.77
7	002624	完美世界	12,702,274.00	0.70
8	002508	老板电器	11,129,893.00	0.61
9	601668	中国建筑	10,420,000.00	0.57
10	002035	华帝股份	8,492,195.44	0.47
11	000887	中鼎股份	7,987,500.00	0.44
12	600741	华域汽车	7,231,772.90	0.40
13	002048	宁波华翔	6,381,155.16	0.35
14	000401	冀东水泥	5,217,000.00	0.29
15	601137	博威合金	4,539,918.00	0.25
16	002367	康力电梯	3,917,224.00	0.22
17	002258	利尔化学	3,274,638.00	0.18
18	002242	九阳股份	3,169,763.00	0.17
19	688106	金宏气体	403,641.00	0.02
20	688520	神州细胞	316,679.64	0.02

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.4.2 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	601088	中国神华	18,837,955.00	1.03
2	601166	兴业银行	15,912,993.00	0.87
3	002624	完美世界	14,330,940.00	0.79
4	000887	中鼎股份	7,648,546.00	0.42
5	002048	宁波华翔	5,583,357.00	0.31
6	002367	康力电梯	3,535,687.00	0.19
7	002242	九阳股份	3,480,078.00	0.19
8	601668	中国建筑	3,346,000.00	0.18
9	600887	伊利股份	3,033,000.00	0.17
10	600176	中国巨石	1,854,000.00	0.10
11	000401	冀东水泥	1,606,013.00	0.09
12	688106	金宏气体	1,069,075.00	0.06
13	688520	神州细胞	1,066,509.04	0.06
14	688505	复旦张江	755,698.73	0.04
15	688518	联赢激光	392,255.39	0.02
16	688558	国盛智科	378,564.80	0.02
17	688555	泽达易盛	231,308.00	0.01

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	243,020,588.19
卖出股票收入（成交）总额	83,061,979.96

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	1,353,101,900.00	74.31
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	333,795,000.00	18.33
7	可转债（可交换债）	95,529,369.40	5.25

8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,782,426,269.40	97.88

## 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	163363	20 碧地 01	1,500,000	148,740,000.00	8.17
2	155269	19 新城 02	1,000,000	100,470,000.00	5.52
3	149087	20 荣盛 G1	1,000,000	99,030,000.00	5.44
4	143027	17 荣盛 01	900,000	90,891,000.00	4.99
5	102000728	20 大连万达 MTN001	800,000	79,640,000.00	4.37

## 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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	168382	逸锬优 05	850,000	84,388,000.00	4.63
2	168456	惠盈 1A	500,000	49,655,000.00	2.73
3	138612	逸锬 14A1	300,000	29,886,000.00	1.64
4	138633	海诺 2A1	300,000	29,871,000.00	1.64
5	138621	招慧 08A	300,000	29,856,000.00	1.64
6	159571	19 佳美 3A	100,000	10,000,000.00	0.55
7	168263	碧山 01 优	100,000	9,939,000.00	0.55

注：本基金本报告期末仅持有上述 7 只债券。

## 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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

7.12.2 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

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	137,980.19
2	应收证券清算款	1,977,849.58
3	应收股利	—
4	应收利息	31,691,801.89
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	33,807,631.66

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	128083	新北转债	14,411,391.36	0.79
2	110062	烽火转债	9,976,800.00	0.55
3	113019	玲珑转债	6,186,000.00	0.34
4	110042	航电转债	5,743,218.00	0.32
5	113543	欧派转债	5,721,940.00	0.31
6	128058	拓邦转债	3,931,884.60	0.22
7	110055	伊力转债	3,640,200.00	0.20

8	128046	利尔转债	759,972.60	0.04
---	--------	------	------------	------

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

#### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额 级别	持有人 户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比 例	持有份额	占总份 额比例
汇 安 嘉 利 一 年 封 闭 混 合 A	13,259	137,857.07	0.00	0.00%	1,827,846,911.25	100.00%
汇 安 嘉 利 一 年 封 闭 混 合 C	5	6,502.08	0.00	0.00%	32,510.38	100.00%
合计	13,264	137,807.56	0.00	0.00%	1,827,879,421.63	100.00%

### 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	汇安嘉利一年封闭混合 A	199,096.69	0.0109%
	汇安嘉利一年封闭混合 C	10.00	0.0308%
	合计	199,106.69	0.0109%

### 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	汇安嘉利一年封闭混合 A	0
	汇安嘉利一年封闭混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	汇安嘉利一年封闭混合 A	0
	汇安嘉利一年封闭混合 C	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	汇安嘉利一年封闭 混合 A	汇安嘉利一年封闭 混合 C
基金合同生效日（2020 年 4 月 21 日） 基金份额总额	1,827,846,911.25	32,510.38
基金合同生效日起至报告期期末基金总 申购份额	—	—
减：基金合同生效日起至报告期期末基 金总赎回份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	1,827,846,911.25	32,510.38

## § 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(2020 年 4 月 21 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	
中泰证券	2	176,451,963.83	54.43%	143,157.68	57.67%	-
银河证券	1	147,745,620.80	45.57%	105,091.79	42.33%	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-

注：选择专用席位的标准和程序：

#### (1) 选择标准

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

券商经纪人具有较强的研究能力：能及时、全面、定期向基金管理人提供高质量的关于宏观、行



业及市场走向、个股分析的报告及丰富全面的信息咨询服务；有很强的行业分析能力，能根据基金管理人所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力。

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

## （2）选择程序

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

## （3）交易单元变更情况

以上交易单元均为本报告期内新增交易单元。

### 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
中泰证券	1,256,446,121.10	84.97%	6,179,000,000.00	99.66%	—	—
银河证券	222,329,119.32	15.03%	21,000,000.00	0.34%	—	—
东兴证券	—	—	—	—	—	—

### 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	汇安嘉利一年封闭运作混合型证券投资基金基金合同	指定报刊和/或公司网站	2020 年 3 月 25 日
2	汇安嘉利一年封闭运作混合型证券投资基金托管协议	指定报刊和/或公司网站	2020 年 3 月 25 日
3	汇安嘉利一年封闭运作混合型证券投资基金招募说明书	指定报刊和/或公司网站	2020 年 3 月 25 日
4	汇安嘉利一年封闭运作混合型证券投资基金份额发售公告	指定报刊和/或公司网站	2020 年 3 月 25 日
5	汇安嘉利一年封闭运作混合	指定报刊和/或公司	2020 年 3 月 25 日

	型证券投资基金基金合同及招募说明书提示性公告	网站	
6	汇安嘉利一年封闭运作混合型证券投资基金基金合同生效公告	指定报刊和/或公司网站	2020 年 4 月 22 日
7	汇安基金管理有限责任公司关于《汇安嘉利一年封闭运作混合型证券投资基金基金合同生效公告》的更正公告	指定报刊和/或公司网站	2020 年 4 月 23 日
8	中国光大银行“投资与托管业务部”名称变更为“资产托管部”	中国证监会指定的媒介	2020 年 4 月 15 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

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。

## § 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利一年封闭运作混合型证券投资基金募集的文件
- (2) 《汇安嘉利一年封闭运作混合型证券投资基金基金合同》
- (3) 《汇安嘉利一年封闭运作混合型证券投资基金招募说明书》
- (4) 《汇安嘉利一年封闭运作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

### 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