华安创业板50交易型开放式指数证券投资基金更新的招募说明书摘要

（2018年第1号）

基金管理人：华安基金管理有限公司
基金托管人：中国建设银行股份有限公司
二〇一八年二月

重要提示

本基金于2016年4月20日经中国证券监督管理委员会证监许可[2016]867号文注册，进行募集。本基金的基金合同自2016年6月30日正式生效。

本基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。

本招募说明书经中国证监会注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的投资价值和市场前景作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者在投资本基金前，应全面了解本基金的产品特性，理性判断市场，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：市场风险、管理风险、流动性风险、合规性风险、操作和技术风险、本基金的特定风险等等。本基金是股票型基金，风险和预期收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金；本基金在股票型基金中属于指数型基金，主要采用完全复制法紧密跟踪标的指数的表现，本基金的业绩表现与标的指数的表现密切相关。

本基金初始募集净值1元。在市场波动因素影响下，本基金净值可能低于初始面值，本基金投资者有可能出现亏损。因折算、分红等行为导致基金份额净值变化，不会改变基金的风险收益特征，不会降低基金投资风险或提高基金投资收益。

投资者应当认真阅读《基金合同》、《招募说明书》等基金法律文件，了解基金的风险收益特征，并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和投资者的风险承受能力相适应。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

基金管理人管理的其它基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负担。

本招募说明书摘要中涉及与基金托管人相关的基金信息已经与基金托管人复核。除特别说明外，本招募说明书摘要所载内容截止日为2017年12月30日，有关财务数据和净值表现的截止日为2017年12月31日。

一、基金管理人

一、基金管理人概况
1、名称：华安基金管理有限公司
2、住所：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道8号上海国金中心二期31－32层
3、法定代表人：朱学华
4、设立日期：1998年6月4日
5、批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基字[1998]20号
6、注册资本：1.5亿元人民币
7、组织形式：有限责任公司
8、经营范围：从事基金管理业务、发起设立基金以及从事中国证监会批准的其他业务
9、存续期间：持续经营
10、联系电话：（021）38969999
11、客户服务电话：40088-50099
12、联系人：王艳
13、网址：www.huaan.com.cn
二、注册资本和股权结构
1、注册资本：1.5亿元人民币
2、股权结构

持股单位	持股占总股本比例
上海国际信托有限公司	20%
国泰君安创新投资有限公司	20%
上海锦江国际投资管理有限公司	20%
上海工业投资（集团）有限公司	20%
国泰君安投资管理股份有限公司	20%

三、主要人员情况
1、基金管理人董事、监事、经理及其他高级管理人员
（1）董事会

朱学华先生，本科学历。历任武警上海警卫局首长处副团职参谋，上海财政证券有限公司党总支副书记，上海证券有限责任公司党委书记、副董事长、副总经理、工会主席，兼任海际大和证券有限责任公司董事长。现任华安基金管理有限公司党总支书记、董事长、法定代表人。

童威先生，博士研究生学历。历任上海证券有限责任公司研究发展中心总经理，上海国际集团有限公司研究发展总部副总经理（主持工作），上投摩根基金管理有限责任公司副总经理，上海国际集团有限公司战略发展总部总经理兼董事会办公室主任，华安基金管理有限公司副总经理。现任华安基金管理有限公司总经理。

邱平先生，本科学历，高级政工师职称。历任上海红星轴承总厂党委书记，上海东风机械（集团）公司总裁助理、副总裁，上海全光网络科技股份公司总经理，上海赛事商务有限公司总经理，上海东浩工艺品股份有限公司董事长，上海国盛集团科教投资有限公司党委副书记、总裁、董事，上海建筑材料（集团）总公司党委书记、董事长（法定代表人）、总裁。现任上海工业投资（集团）有限公司党委副书记、执行董事（法定代表人）、总裁。

马名驹先生，工商管理硕士，高级会计师。历任凤凰股份有限公司副董事长、总经理，上海东方上市企业博览中心副总经理。现任锦江国际（集团）有限公司副总裁兼计划财务部经理及金融事业部总经理、上海锦江国际投资管理有限公司董事长兼总经理、锦江麦德龙现购自运有限公司董事、华安基金管理有限公司董事、长江养老保险股份有限公司董事、上海景域文化传播有限公司董事、Crystal Bright Developments Limited董事、史带财产保险股份有限公司监事、上海上国投资产管理有限公司监事。

董鑑华先生，大学学历，高级经济师。历任上海市审计局基建处科员、副主任科员、处长助理、副处长，固定资产投资审计处副处长（主持工作）、处长，上海市审计局财政审计处处长，上海电气（集团）总公司财务总监，上海电气（集团）总公司副总裁、财务总监。现任上海电气（集团）总公司监事长，上海海立（集团）股份有限公司监事长，上海临港控股股份有限公司董事。

聂小刚先生，经济学博士。历任国泰君安证券股份有限公司投资银行三部助理业务董事、企业融资总部助理业务董事、总裁办公室主管、总裁办公室副经理、营销管理总部副经理、董事会秘书处主任助理、董事会秘书处副主任、董事会秘书处主任、上市办公室主任、国泰君安创新投资有限公司总裁等职务。现任国泰君安证券股份有限公司战略管理部总经理。

独立董事：

吴伯庆先生，大学学历，一级律师，曾被评为上海市优秀律师与上海市十佳法律顾问。历任上海市城市建设局秘书科长、上海市第一律师事务所副主任、上海市金茂律师事务所主任、上海市律师协会副会长。现任上海市金茂律师事务所高级合伙人。

夏大慰先生，研究生学历，教授。现任上海国家会计学院学术委员会主任、教授、博士生导师，中国工业经济学会副会长，财政部会计准则委员会咨询专家，财政部企业内部控制标准委员会委员，香港中文大学名誉教授，复旦大学管理学院兼职教授，上海证券交易所上市委员会委员。享受国务院政府津贴。

（2）监事会

张志红女士，经济学博士。历任中国证监会上海监管局(原上海证管办)机构处副处长、机构监管处副处长、机构监管处处长、机构监管一处处长、上市公司监管一处处长等职务，长城证券有限责任公司党委委员、纪委书记、预算管理委员会委员、合规总监、副总经理、投资决策委员会委员，中小企业融资部总经理，国泰君安证券股份有限公司总裁助理、投行业务委员会副总裁等职务。现任国泰君安证券股份有限公司业务总监兼投行业务委员会副总裁，华安基金管理有限公司监事长。

许诺先生，研究生学历。曾任怡安翰威特咨询业务总监，麦理根（McLagan）公司中国区负责人。现任华安基金管理有限公司人力资源部高级总监，华安资产管理（香港）有限公司董事。

诸慧女士，研究生学历，经济师。历任华安基金管理有限公司监察稽核部高级监察员，集中交易部总监助理。现任华安基金管理有限公司集中交易部总监。

（3）高级管理人员

朱学华先生，本科学历，18年证券、基金从业经验。历任武警上海警卫局首长处副团职参谋，上海财政证券有限公司党总支副书记，上海证券有限责任公司党委书记、副董事长、副总经理、工会主席，兼任海际大和证券有限责任公司董事长。现任华安基金管理有限公司党总支书记、董事长、法定代表人。

童威先生，博士研究生学历，16年证券、基金从业经验。历任上海证券有限责任公司研究发展中心总经理，上海国际集团有限公司研究发展总部副总经理（主持工作），上投摩根基金管理有限责任公司副总经理，上海国际集团有限公司战略发展总部总经理兼董事会办公室主任，华安基金管理有限公司副总经理。现任华安基金管理有限公司总经理。

薛珍女士，硕士研究生学历，17年证券、基金从业经验。曾任华东政法大学副教授，中国证监会上海证管办机构处副处长，中国证监会上海监管局法制工作处处长。现任华安基金管理有限公司督察长。

翁启森先生，硕士研究生学历，23年金融、证券、基金行业从业经验。历任台湾富邦银行资深领组，台湾JP摩根证券投资经理，台湾摩根投信基金经理，台湾中信证券自营部协理，台湾保德信投信基金经理，华安基金管理有限公司全球投资部总监、基金投资部兼全球投资部高级总监、公司总经理助理。现任华安基金管理有限公司副总经理、首席投资官。

姚国平先生，硕士研究生学历，13年金融、基金行业从业经验。历任香港恒生银行上海分行交易员，华夏基金管理有限公司上海分公司区域销售经理，华安基金管理有限公司上海业务部助理总监、机构业务总部高级董事总经理、公司总经理助理。现任华安基金管理有限公司副总经理。

谷媛媛女士，硕士研究生学历，18年金融、基金行业从业经验。历任广发银行客户经理，京华山一国际（香港）有限公司高级经理，华安基金管理有限公司市场业务二部大区经理、产品部高级董事总经理、公司总经理助理。现任华安基金管理有限公司副总经理。

2、本基金基金经理

许之彦先生，理学博士，14年证券、基金从业经验，CQF(国际数量金融工程师)。曾在广发证券和中山大学经济管理学院博士后流动站从事金融工程工作，2005年加入华安基金管理有限公司，曾任研究发展部数量策略分析师，2008年4月至2012年12月担任华安MSCI中国A股指数增强型证券投资基金的基金经理，2009年9月起同时担任本基金及其联接基金的基金经理。2010年11月至2012年12月担任上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理。2011年9月起同时担任华安深证300指数证券投资基金（LOF）的基金经理。2013年6月起担任指数投资部高级总监。2013年7月起同时担任华安易富黄金交易型开放式证券投资基金的基金经理。2013年8月起同时担任华安易富黄金交易型开放式证券投资基金联接基金的基金经理。2014年11月至2015年12月担任华安中证高分红指数增强型证券投资基金的基金经理。2015年6月起同时担任华安中证全指证券公司指数分级证券投资基金、华安中证银行指数分级证券投资基金的基金经理。2015年7月起担任华安创业板50指数分级证券投资基金的基金经理。2016年6月起担任本基金的基金经理。

历任基金经理：

计伟先生，自2016年6月30日至2016年8月12日担任华安创业板50交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。

钱晶先生，自2016年8月15日至2017年10月27日担任华安创业板50交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。

3、基金管理人采取集体投资决策制度，公司投资决策委员会成员的姓名和职务如下：

童　威先生，总经理
翁启森先生，副总经理、首席投资官
杨　明先生，投资研究部高级总监
许之彦先生，指数与量化投资总部高级总监
贺　涛先生，固定收益部总监
苏圻涵先生，全球投资部助理总监
万建军先生，投资研究部联席总监

上述人员之间不存在近亲属关系。

4、业务人员的准备情况：

截至2017年12月31日，公司目前共有员工346人（不含香港公司），其中56%具有硕士及以上学位，89%以上具有三年证券业或五年金融业从业经历，具有丰富的实际操作经验。所有上述人员在最近三年内均未受到所在单位及有关管理部门的处罚。公司业务由投资与研究、营销、后台支持等三个业务板块组成。

二、基金托管人

（一）基金托管人基本情况
名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)
住所：北京市西城区金融大街25号
办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
法定代表人：田国立
成立时间：2004年09月17日
组织形式：股份有限公司
注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整
存续期间：持续经营
基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12号
联系人：田　青
联系电话：(010)6759 5096

中国建设银行成立于1954年10月，是一家国内领先、国际知名的大型股份制商业银行，总部设在北京。本行于2005年10月在香港联合交易所挂牌上市(股票代码939)，于2007年9月在上海证券交易所挂牌上市(股票代码601939)。

2017年6月末，本集团资产总额216,920.67亿元，较上年末增加7,283.62亿元，增幅3.47%。上半年，本集团实现利润总额1,720.93亿元，较上年同期增长1.30%；净利润较上年同期增长3.81%至1,390.09亿元，盈利水平实现平稳增长。

2016年，本集团先后获得国内外知名机构授予的100余项重要奖项。荣获《欧洲货币》“2016中国最佳银行”，《环球金融》“2016中国最佳消费者银行”、“2016亚太区最佳流动性管理银行”，《机构投资者》“人民币国际化服务钻石奖”，《亚洲银行家》“中国最佳大型零售银行奖”及中国银行业协会“年度最具社会责任金融机构奖”。本集团在英国《银行家》2016年“世界银行1000强排名”中，以一级资本总额继续位列全球第2；在美国《财富》2016年世界500强排名第22位。

中国建设银行总行设资产托管业务部，下设综合处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、QFII托管处、养老金托管处、清算处、核算处、跨境托管运营处、监督稽核处等10个职能处室，在上海设有投资托管服务上海备份中心，共有员工220余人。自2007年起，托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计，并已经成为常规化的内控工作手段。

（二）主要人员情况

纪伟，资产托管业务部总经理，曾先后在中国建设银行南通分行、总行计划财务部、信贷经营部任职，并在总行公司业务部、投资托管业务部、授信审批部担任领导职务。其拥有八年托管从业经历，熟悉各项托管业务，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

龚毅，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行北京市分行国际部、营业部并担任副行长，长期从事信贷业务和集团客户业务等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

郑绍平，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行投资部、委托代理部、战略客户部，长期从事客户服务、信贷业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

黄秀莲，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行会计部，长期从事托管业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

原玎，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行国际业务部，长期从事海外机构及海外业务管理、境内外汇业务管理、国外金融机构客户营销拓展等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

（三）基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、(R)QFII、(R)QDII、企业年金等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至2017年二季度末，中国建设银行已托管759只证券投资基金。中国建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。中国建设银行连续11年获得《全球托管人》、《财资》、《环球金融》“中国最佳托管银行”、“中国最佳次托管银行”、“最佳托管专家——QFII”等奖项，并在2016年被《环球金融》评为中国市场唯一一家“最佳托管银行”。

三、相关服务机构

一、基金销售机构
1、网上现金发售代理机构
详见基金份额发售公告。
2、申购赎回代办证券公司（简称：一级交易商）：
华泰证券、信达证券、广发证券、方正证券、光大证券、中国银河证券、国泰君安证券、申万宏源证券、申万宏源西部证券、招商证券、中泰证券、海通证券、东兴证券、国信证券、中信建投证券、长城证券。
3、二级市场交易代办证券公司
包括具有经纪业务资格及深圳证券交易所会员资格的所有证券公司。
4、基金管理人可根据有关法律法规，选择其他符合要求的机构代理发售本基金，并及时公告。
二、登记机构
名称：中国证券登记结算有限责任公司
住所：北京市西城区太平桥大街17号
办公地址：北京市西城区太平桥大街17号
负责人：周明
联系人：严峰
电话：（0755）25946013
传真：（0755）25987122
三、出具法律意见书的律师事务所
名称：通力律师事务所
住所：上海市银城中路68号时代金融中心19楼
办公地址：上海市银城中路68号时代金融中心19楼
负责人：俞卫锋
电话：（021）31358666
传真：（021）31358600
联系人：孙睿
经办律师：安冬、孙睿
四、审计基金资产的会计师事务所
名称：普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
住所：上海市浦东新区陆家嘴环路1318 号星展银行大厦5楼
办公地址：中国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
首席合伙人：李丹
联系电话：（021）23238888
传真：（021）23238800
联系人：魏佳亮
经办会计师：单峰、魏佳亮

四、基金名称

华安创业板50交易型开放式指数证券投资基金

五、基金类型

本基金为股票型证券投资基金。运作方式为交易型开放式，存续期限不定期。

六、基金的投资目标

紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

七、基金的投资方向

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括创业板50指数的成份股及其备选成份股、其他股票（包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票）、权证、股指期货、固定收益资产（国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债券、中期票据、可转换债券（含分离交易可转债）、短期融资券、资产支持证券、中小企业私募债、债券回购、银行存款等）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）。

本基金将根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：投资于股票资产的比例不低于基金资产的90%，投资于创业板50指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的80%。权证、股指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。

如果法律法规对该比例要求有变更的，以变更后的比例为准，本基金的投资范围会做相应调整。

八、基金的投资策略

本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。当指数编制方法变更、成份股发生变更、成份股权重由于自由流通量调整而发生变化、成份股派发现金股息、配股及增发、股票长期停牌、市场流动性不足等情况发生时，基金管理人将对投资组合进行优化，尽量降低跟踪误差。

一、组合复制策略

本基金主要采取复制法，即按照标的指数成份股及其权重构建基金的股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动对股票投资组合进行相应地调整。

二、替代性策略

对于出现市场流动性不足、因法律法规原因个别成份股被限制投资等情况，导致本基金无法获得足够数量的股票时，基金管理人将通过投资成份股、非成份股、成份股个股衍生品等进行替代。

三、股指期货投资策略

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，以降低股票仓位调整的交易成本，提高投资效率，从而更好地跟踪标的指数，实现投资目标。

本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%，年跟踪误差不超过2%。

未来，随着证券市场投资工具的发展和丰富，本基金可相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书更新中公告。

九、基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准：创业板50指数收益率。

本基金为交易型开放式指数基金，将紧密跟踪标的指数创业板50指数，努力追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。因此，选择本基金业绩比较基准为：创业板50指数收益率。

如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的指数时，基金管理人可以根据本基金的投资范围和投资策略，确定变更基金的比较基准或其权重构成。若业绩比较基准的变更对基金投资无实质性影响(包括但不限于编制机构变更、指数更名等)，经基金管理人与基金托管人协商一致报按照监管部门要求履行适当程序后在指定媒介上及时公告，并在更新的招募说明书中列示，无需召开基金份额持有人大会。

十、风险收益特征

本基金为股票型基金，属于较高风险、较高预期收益的基金品种，其风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。

十一、基金投资组合报告

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年1月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本投资组合报告所载数据截至2017年12月31日。

1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	197,472,590.46	97.54
	其中：股票	197,472,590.46	97.54
2	固定收益投资	1,766,300.00	0.87
	其中：债券	1,766,300.00	0.87
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	3,173,506.19	1.57
7	其他各项资产	49,261.60	0.02
8	合计	202,461,658.25	100.00

2 报告期末按行业分类的股票投资组合

2.1积极投资按行业分类的股票投资组合

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	-	-
C	制造业	10,017,221.00	4.97
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	2,912,000.00	1.44
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	12,929,221.00	6.41

2.2指数投资按行业分类的股票投资组合

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	-	-
C	制造业	82,605,329.24	40.97
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	7,638,612.00	3.79
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	69,520,024.01	34.48
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	12,930,938.16	6.41
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	11,848,466.05	5.88
S	综合	-	-
	合计	184,543,369.46	91.54

2.3报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合
无。
3报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细
3.1期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300136	信维通信	249,800	12,664,860.00	6.28
2	300104	乐视网	800,992	12,279,207.36	6.09
3	300059	东方财富	932,431	12,074,981.45	5.99
4	300072	三聚环保	279,927	9,833,835.51	4.88
5	300124	汇川技术	330,435	9,589,223.70	4.76
6	300070	碧水源	481,368	8,361,362.16	4.15
7	300024	机器人	389,056	7,322,033.92	3.63
8	300408	三环集团	341,800	6,890,688.00	3.42
9	300017	网宿科技	495,447	5,271,556.08	2.61
10	300088	长信科技	632,700	4,954,041.00	2.46

3.2期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300146	汤臣倍健	241,700	3,630,334.00	1.80
2	300676	华大基因	14,000	2,912,000.00	1.44
3	300618	寒锐钴业	10,400	2,452,008.00	1.22
4	300053	欧比特	149,500	2,131,870.00	1.06
5	300078	思创医惠	167,100	1,803,009.00	0.89

4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	1,766,300.00	0.88
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,766,300.00	0.88

5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	123006	东财转债	10,428	1,042,800.00	0.52
2	123003	蓝思转债	3,029	302,900.00	0.15
3	123005	万信转债	2,125	212,500.00	0.11
4	123004	铁汉转债	2,081	208,100.00	0.10

6报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有资产支持类证券。
7 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投资。
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权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证投资。
9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
9.1 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。
9.2 本基金投资股指期货的投资政策
本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，以降低股票仓位调整的交易成本，提高投资效率，从而更好地跟踪标的指数，实现投资目标。
10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
10.1 本期国债期货投资政策
无。
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。
10.3 本期国债期货投资评价
无。
11投资组合报告附注
11.1本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查的，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。
11.2本基金投资的前十名股票中，不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。
11.3其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	2,099.28
2	应收证券清算款	46,345.26
3	应收股利	-
4	应收利息	817.06
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	49,261.60

11.4报告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。
11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
11.5.1期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300104	乐视网	12,279,207.36	6.09	重大事项停牌

11.5.2期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末前五名积极投资中不存在流通受限情况。
11.6投资组合报告附注的其他文字描述部分
无。

十二、基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。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。

下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。

（一）基金净值表现
历史各时间段基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较
（截止时间2017年12月31日）

阶段	净值增长率①	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
自基金合同生效日（2016年6月30日）至2016年12月31日	-17.91%	1.16%	-14.27%	1.23%	-3.64%	-0.07%
2017年1月1日至2017年12月31日	-14.81%	1.18%	-14.39%	1.19%	-0.42%	-0.01%

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

十三、费用概览

一、基金费用的种类
1、基金管理人的管理费；
2、基金托管人的托管费；
3、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费；
5、基金份额持有人大会费用；
6、基金的证券、期货交易费用；
7、基金的银行汇划费用；
8、基金的上市费及年费；
9、基金的指数使用许可费；
10、基金的开户费用、账户维护费用；
11、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内参照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。

二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式
1、与基金运作有关的费用：
（1）基金管理人的管理费
本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.50%年费率计提。管理费的计算方法如下：
H＝E×0.50%÷当年天数
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日的基金资产净值
基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月初五个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。
（2）基金托管人的托管费
本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.10%的年费率计提。托管费的计算方法如下：
H＝E×0.10%÷当年天数
H为每日应计提的基金托管费
E为前一日的基金资产净值
基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月初五个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。
（3）基金的指数使用许可费
本基金作为指数基金，需根据与深圳证券信息有限公司签署的指数使用许可协议的约定向深圳证券信息有限公司支付指数使用许可费。指数许可使用费按前一日的基金资产净值的0.03%的年费率计提。指数使用许可费每日计算，逐日累计，按季支付。计算方法如下：
H＝E×0.03%÷当年天数
H为每日应计提的指数使用许可费
E为前一日的基金资产净值
指数使用许可费收取下限为每季度5万元（基金合同生效当季按实际计提金额收取，不设下限）。指数使用许可费的支付由基金管理人向基金托管人发送划付指令，经基金托管人复核后于每年1月、4月、7月、10月的最后一个工作日前从基金财产中一次性支付给深圳证券信息有限公司。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。
上述“一、基金费用的种类中”除基金管理费、基金托管费和标的指数许可使用费之外的其他费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。
2、与基金销售有关的费用
投资者申购、赎回本基金时请参照本基金招募说明书“十、基金份额的申购与赎回”的相关规定，交纳一定的申购、赎回费用/佣金。
三、不列入基金费用的项目
下列费用不列入基金费用：
1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；
2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
3、《基金合同》生效前的相关费用；
4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。
四、基金管理费和基金托管费的调整
基金管理人和基金托管人可协商酌情降低基金管理费率和基金托管费率。降低基金管理费率和基金托管费率，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须依照《信息披露办法》的有关规定于新的费率实施前在指定媒介上刊登公告。
五、基金税收
本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

十四、对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人依据《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》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他有关法律法规的要求，结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动，对本基金的原招募说明书进行了更新，主要更新的内容如下：

章节	主要更新内容
三、基金管理人	1更新了基金管理人的相关信息。
四、基金托管人	更新了基金托管人的相关信息。
五、相关服务机构	.更新了会计师事务所的相关信息。
九、基金的投资	更新了基金投资组合报告至2017年12月31日。详见招募说明书。
十、基金的业绩	披露了基金合同生效以来至2017年12月31日的基金业绩，详见招募说明书。
二十二、其他应披露事项	披露了自2017年6月30日至2017年12月30日期间本基金的公告信息。

华安基金管理有限公司
二〇一八年二月十三日

华安基金管理有限公司关于副总经理变更的公告

公告送出日期：2018年2月13日

1.公告基本信息

基金管理人名称	华安基金管理有限公司
公告依据	《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金行业高级管理人员任职管理办法》
高管变更类型	新任基金管理人副总经理

2.新任高级管理人员的相关信息

新任高级管理人员职务	副总经理
新任高级管理人员姓名	翁启森
任职日期	2018年2月13日
过往从业经历	23年金融、证券、基金行业从业经验。历任台湾富邦银行资深领组，台湾JP摩根证券投资经理，台湾摩根投信基金经理，台湾中信证券自营部协理，台湾保德信投信基金经理，华安基金管理有限公司全球投资部总监、基金投资部兼全球投资部高级总监，现任公司总经理助理、首席投资官。
取得的相关从业资格	基金从业资格
国籍	中国台湾
学历、学位	硕士研究生

新任高级管理人员职务	副总经理
新任高级管理人员姓名	姚国平
任职日期	2018年2月13日
过往从业经历	13年金融、基金行业从业经验