(上接B056版)

注册地址：北京市西城区民丰胡同31号中水大厦215A
办公地址：北京市西城区民丰胡同31号中水大厦215A
法定代表人：梁蓉
联系电话：010-66154828
传真号码：010-88067526
89）北京汇成基金销售有限公司
注册地址:北京市海淀区中关村大街11号11层1108
办公地址:北京市海淀区中关村大街11号11层1108
法定代表人：王伟刚
联系电话:010-56282140
传真号码:010-62680827
90）浙江同花顺基金销售有限公司
注册地址:浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦903室
办公地址:浙江省杭州市翠柏路7号杭州电子商务产业园2楼
法定代表人:易峥
电话:0571-88920879
传真:0571-86800423
电话:0571-88920897 4008-773-772
网址：www.5ifund.com
91）宁波银行股份有限公司
地址:宁波市鄞州区宁南南路700号
法定代表人:陆华裕
客户服务电话:95574
网址:www.nbcb.com.cn
92）上海云湾投资管理有限公司
注册地址:中国（上海）自由贸易试验区新金桥路27号13号楼2层
办公地址:中国（上海）自由贸易试验区新金桥路27号13号楼2层
法定代表人：戴新装
联系电话：021-20538888
传真号码:021-20538999
93）乾道金融信息服务（北京）有限公司
注册地址:北京市海淀区东北旺村南1号楼7层7117室
办公地址：北京市西城区德外大街合生财富广场1302室
法定代表人：王兴吉
联系电话:010-62062880
传真号码:010-82057741
94）东海期货有限责任公司
注册地址:江苏省常州市延陵西路23、25、27、29号
办公地址：上海市浦东新区东方路1928号东海证券大厦8楼
法定代表人：陈太康
联系电话：021-68757102
传真号码:021-68757102
95）济安财富(北京) 基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区东三环中路7号4号楼40层4601室
办公地址：北京市朝阳区东三环中路7号 财富中心A座46层 济安财富
法定代表人:杨健
联系人:李海燕
电话:010-65309516
传真:010-65330699
客户服务电话:400-075-6663（济安财富官网） 400-071-6766（腾讯财经）
公司网站:www.jianfortune.com
96）泰诚财富基金销售（大连）有限公司
法定代表人:林卓
地址:辽宁省大连市沙河口区星海中龙园 3 号
办公地址:辽宁省大连市沙河口区星海中龙园 3 号
电话：400-6411-999
网址：www.taichengcaifu.com
97）北京肯特瑞财富投资管理有限公司
注册地址:北京市海淀区中关村东路66号1号楼22层2603-06
法定代表人:江卉
电 话：4000988511/ 4000888816
传 真：010-89188000
98）上海华夏财富投资管理有限公司
注册地址:上海市虹口区东大名路687号1幢2楼268室
办公地址:北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层
法定代表人:李一梅
联系人:仲秋玥
电话:010-88066632
传真:010-88066552
客户服务电话:400-817-5666
网址:www.amcfortune.com
99）武汉市伯嘉基金销售有限公司
注册地址：武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际SOHO城（一期）第七幢23层1号4号
办公地址： 武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际SOHO城（一期）第七幢23层1号4号
法定代表人：陶捷
联系电话:（027）87006009
传真号码:（027）87006010
100）中民财富管理（上海）有限公司
注册地址:上海市黄浦区中山南路100号7层05单元
办公地址:上海市黄浦区中山南路100号7层05单元
法定代表人：弭洪军
联系电话：021-33355333
传真号码:021-33355288
基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其他符合要求的机构为本基金的场外发售机构，并及时公告。
(101)深圳市新兰德证券投资咨询有限公司
注册地址:深圳市福田区福田街道民田路178号华融大厦27层2704
办公地址:深圳市福田区福田街道民田路178号华融大厦27层2704
法定代表人:马勇
客服电话:4001161188
公司网站:https://8.jrj.com/
(102)平安银行股份有限公司
注册地址:中国深圳市深南中路5047号
法定代表人:谢永林
联系电话:（0755）82080387
传真号码:（0755）82080386
客户服务电话:95511
网址:bank.pingan.com
(103) 中信期货有限公司
地址:深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座13层1301-1305室、14层
法定代表人:张皓
客户服务电话:400-990-8826
网址:www.citicsf.com
(104) 江苏江南农村商业银行
住所:常州市和平中路413号
法定代表人:陆向阳
联系电话:（0519）96005
网址:http://www.jnbank.com.cn/index.html
(105) 宜信普泽投资顾问（北京）有限公司
注册地址:北京市朝阳区建国路88号9号楼15层1809
办公地址:北京市朝阳区建国路88号SOHO现代城C1809
法定代表人:戎兵
联系电话:010-52413385
传真号码:010-85894285
网址:http://www.yixinfund.com/
(106) 上海通华财富基金销售有限公司
注册地址:上海市虹口区同丰路667弄107号201室
办公地址:上海市浦东新区杨高南路799号9楼
法定代表人:马刚
客户服务电话:021-61766900
网址：www.tonghuafund.cn
(107) 上海万得基金销售有限公司
注册地址:中国（上海）自由贸易试验区福山路33号11楼B座
办公地址:上海市浦东新区浦明路1500号万得大厦11楼
法定代表人：王廷富
联系电话:021-51327185
传真号码:021-5071 0161
客户服务电话:400-821-0203
(108) 泛华普益基金销售有限公司
注册地址:成都市成华区建设路9号高地中心1101室
法定代表人:于海锋
客户服务电话:4008-588-588
网址:www.puyifund.com/
(109) 中国民族证券有限责任公司
法人代表:何亚刚
注册地址:北京市朝阳区北四环中路27号盘古大观A座40层-43层
办公地址： 北京市朝阳区北四环中路27号盘古大观A座40层-43层
客服电话:400-889-5618
网址:http://e5618.com
(110) 北京电盈基金销售有限公司
法定代表人:程刚
住所:北京市朝阳区呼家楼(京广中心)1号楼36层3603室
电话:400-100-3391
网址:http://www.dianyingfund.com/
(111) 国金证券股份有限公司
注册地址:成都市东城根上街95号
办公地址:成都市东城根上街95号
法定代表人:冉云
电话:（028）86690125
传真:（028）86690126
客户服务电话:4006-600109
网址:www.gjzq.com.cn
(112) 上海有鱼基金销售有限公司
住所:中国（上海）自由贸易试验区浦东大道2123号3层3E-2655室
客服电话:400-098-4800
网址:http://www.youyufund.com/
(113) 上海基煜基金销售有限公司
注册地址： 上海市崇明县长兴镇路潘园公路1800号2号楼6153室（上海泰和经济发展区）
法定代表人：王翔
联系电话:021-65370077
公司网站:www.jiyufund.com.cn/
客户服务电话:400-820-5369
(114) 厦门市鑫鼎盛控股有限公司
注册地址： 厦门市思明区鹭江道2号厦门第一广场西座1501-1504室
办公地址： 厦门市思明区鹭江道2号厦门第一广场西座1501-1504室
法定代表人：陈洪生
联系电话:0592-3122673
传真号码:0592-312270
客服热线:400-918-0808
公司网址:www.xds.com.cn
(115) 北京唐鼎耀华投资咨询有限公司
注册地址:北京市延庆县延庆经济开发区百泉街10号2栋236室
办公地址:北京市朝阳区建国门外大街19号A座1504/1505室
法定代表人：张冠宇
联系电话：86-10-85870662
传真号码:86-10-85932880
客服电话:400-819-9868
网址:http://www.tdyhfund.com/
2、场内发售机构
本基金的场内发售机构为具有基金代销资格的深圳证券交易所会员单位（具体名单可在深圳证券交易所网站查询）。
本基金募集结束前获得基金代销资格的深圳证券交易所会员单位可新增为本基金的场内发售机构。
（二）注册登记机构
名称:中国证券登记结算有限责任公司
住所:北京西城区太平桥大街17号
办公地址:北京西城区太平桥大街17号
法定代表人:金颖
电话:（010）59378835
传真:（010）59378839
联系人:朱立元
（三）律师事务所和经办律师
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
负责人:韩炯
电话:（021）31358666
传真:（021）31358600
联系人:王利民
经办律师:秦悦民、王利民
（四）会计师事务所和经办注册会计师
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

五、基金的类型

股票型基金。

六、基金的运作方式

契约型开放式。

七、基金的投资目标

本基金通过被动的指数化投资管理，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

八、基金的投资范围

本基金资产投资于具有良好流动性的金融工具，包括标的指数成份股及其备选成份股(包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票)、新股(一级市场初次发行或增发)、债券、债券回购、权证、股指期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

本基金投资于标的指数成份股及其备选成份股的市值加上买入、卖出股指期货合约的轧差合计值不低于基金资产的90%，其中投资于标的指数成份股及其备选成份股的市值不低于基金资产的85%；每个交易日日终在扣除股指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5%的现金或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；投资于权证的比例不得超过基金资产净值的3%；其他金融工具的投资比例符合法律法规和中国证监会的规定。

如法律法规或监管机构在基金合同生效以后允许基金投资其他品种或变更投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以相应调整本基金的投资范围、投资比例规定。

九、基金的投资策略

本基金为被动式股票指数基金，采用完全复制标的指数的方法跟踪标的指数，即按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。若因特殊情况（如市场流动性不足、个别成份股被限制投资、法律法规禁止或限制投资等）导致无法获得足够数量的股票时，基金可能不能按照成份股权重持有成份股，基金管理人将采用合理方法替代等指数投资技术适当调整基金投资组合，并可在条件允许的情况下，辅以金融衍生工具进行投资管理，以有效控制基金的跟踪误差，追求尽可能贴近标的指数的表现。

为有效控制指数的跟踪误差，本基金在注重风险管理的前提下，将适度运用股指期货。本基金利用股指期货流动性好、交易成本低和杠杆操作等特点，通过股指期货对本基金投资组合的跟踪效果进行及时、有效地调整和优化，并提高投资组合的运作效率等。例如在本基金的建仓期或发生大额净申购时，可运用股指期货有效减少基金组合资产配置与跟踪标的之间的差距；在本基金发生大额净赎回时，可运用股指期货控制基金较大幅度减仓时可能存在的冲击成本，从而确保投资组合对指数跟踪的效果。

正常情况下，本基金力求日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%，年跟踪误差不超过4%。

十、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为95%×沪深300指数收益率+5%×同期银行活期存款利率（税后）。

由于本基金投资标的指数为沪深300指数，且投资于现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值5%，因此，本基金将业绩比较基准定为95%×沪深300指数收益率+5%×同期银行活期存款利率（税后）。

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时，本基金经基金管理人和基金托管人协商一致，可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

十一、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。从本基金所分离的两类基金份额来看，华安沪深300A份额具有低风险、收益相对稳定的特征；华安沪深300B份额具有高风险、高预期收益的特征。

十二、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4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2018年3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	261,463,601.40	93.98
	其中:股票	261,463,601.40	93.98
2	固定收益投资	143,916.40	0.05
	其中:债券	143,916.40	0.05
	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	16,516,150.81	5.94
7	其他各项资产	101,895.74	0.04
8	合计	278,225,564.35	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	32,102.99	0.01
C	制造业	469,880.84	0.17
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	26,402.87	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	36,659.62	0.01
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	34,203.96	0.01
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	–	–
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	599,250.28	0.22

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	546,389.32	0.20
B	采矿业	8,365,216.33	3.01
C	制造业	102,469,409.34	36.92
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,158,332.31	2.58
E	建筑业	9,813,867.79	3.54
F	批发和零售业	5,558,833.25	2.00
G	交通运输、仓储和邮政业	8,168,400.18	2.94
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,832,785.58	3.90
J	金融业	86,197,319.47	31.06
K	房地产业	13,868,877.66	5.00
L	租赁和商务服务业	3,226,991.80	1.16
M	科学研究和技术服务业	–	–
N	水利、环境和公共设施管理业	1,123,142.20	0.40
O	居民服务、修理和其他服务业	–	–
P	教育	–	–
Q	卫生和社会工作	1,228,600.00	0.44
R	文化、体育和娱乐业	2,065,072.89	0.74
S	综合	241,113.00	0.09
	合计	260,864,351.12	93.99

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	601318	中国平安	248,731	16,244,621.61	5.85
2	600519	贵州茅台	11,633	7,952,551.46	2.87
3	600036	招商银行	238,003	6,923,507.27	2.49
4	000333	美的集团	104,853	5,717,634.09	2.06
5	000651	格力电器	111,052	5,208,338.80	1.88
6	601166	兴业银行	287,624	4,800,444.56	1.73
7	600016	民生银行	545,506	4,358,592.94	1.57
8	600887	伊利股份	140,221	3,994,896.29	1.44
9	601328	交通银行	634,048	3,918,416.64	1.41
10	000002	万 科A	112,195	3,734,971.55	1.35

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	600666	奥瑞德	18,880	328,512.00	0.12
2	300504	天邑股份	3,062	57,596.22	0.02
3	600929	湖南盐业	5,696	44,542.72	0.02
4	002930	宏川智慧	2,467	36,659.62	0.01
5	300634	彩讯股份	2,058	34,203.96	0.01

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）	143,916.40	0.05
8	同业存单	–	–
9	其他	–	–
10	合计	143,916.40	0.05

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	127005	长证转债	807	80,700.00	0.03
2	127006	敖东转债	445	44,500.00	0.02
3	113019	玲珑转债	180	18,716.40	0.01

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。

8报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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

本基金本报告期末投资股指期货。

9.2 本基金投资股指期货的投资政策

为有效控制指数的跟踪误差，本基金在注重风险管理的前提下，将适度运用股指期货。本基金利用股指期货流动性好、交易成本低和杠杆操作等特点，通过股指期货对本基金投资组合的跟踪效果进行及时、有效地调整和优化，并提高投资组合的运作效率等。

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

本基金本报告期末投资国债期货。

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	12,082.37
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	3,301.01
5	应收申购款	86,512.36
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	101,895.74

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

本基金本报告期末指数投资前十名股票不存在流通受限的情况。

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

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	600666	奥瑞德	328,512.00	0.12	重大事项停牌

十三、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2012年6月25日（合同生效日）起至2012年12月31日	4.90%	1.09%	0.42%	1.17%	4.48%	-0.08%
自2013年1月1日起至2013年12月31日止	-7.45%	1.34%	-7.25%	1.32%	-0.20%	0.02%
自2014年1月1日起至2014年12月31日止	46.08%	1.12%	49.09%	1.15%	-3.01%	-0.03%
自2015年1月1日起至2015年12月31日止	3.85%	2.37%	5.32%	2.36%	-1.47%	0.01%
自2016年1月1日起至2016年12月31日止	-12.42%	1.40%	-10.70%	1.33%	-1.72%	0.07%
自2017年1月1日起至2017年12月31日止	24.60%	0.60%	20.70%	0.60%	3.90%	0.00%

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

十四、费用概览

（一）与基金运作有关的费用

1、基金管理人的管理费

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的1%年费率计提。计算方法如下：

H＝E×年管理费率÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

2、基金托管人的基金托管费

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的0.22%年费率计提。计算方法如下：

H＝E×年托管费率÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

（二）与基金销售有关的费用

1、申购费率

（1）场外申购费率

本基金场外申购费率随申购金额的增加而递减。投资人在一天之内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。

本基金对通过直销中心申购的养老金客户与除此之外的其他投资人实施差别的申购费率。

养老金客户指基本养老基金与依法成立的养老计划筹集的资金及其投资运营收益形成的补充养老基金，包括全国社会保障基金、可以投资基金的地方社会保障基金、企业年金单一计划以及集合计划。如将来出现经养老基金监管部门认可的新的养老基金类型，基金管理人可在招募说明书更新时或发布临时公告将其纳入养老金客户范围，并按规定向中国证监会备案。非养老金客户指除养老金客户外的其他投资人。

通过基金管理人的直销中心申购本基金份额的养老金客户申购费率为每笔500元。

其他投资人申购本基金基金份额申购费率如下所示：

申购金额（M）	申购费率
M＜100万	1.2%
100万≤M＜300万	0.8%
300万≤M＜500万	0.4%
M≥500万	每笔1000元

（2）场内申购费率

本基金场内申购采用金额申购方法，场内申购不收取申购费。

（3）本基金的申购费用由基金申购人承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

2、赎回费率

（1）场外赎回费率

本基金的场外赎回费率按持有期递减，具体费率如下：

持有期限（Y）	赎回费率
Y＜7天	1.50%
7天≤Y＜1年	0.5%
1年≤Y＜2年	0.25%
Y≥2年	0

注：一年指365天，两年为730天

（2）场内赎回费率

本基金的场内赎回费率固定为0.5%，但对于持续持有期少于7日的投资者收取的1.5%的赎回费。

（3）本基金的赎回费用在投资人赎回本基金份额时收取。本基金的赎回费用由赎回申请人承担，不低于赎回费总额的25%应归基金财产，其中，对于持续持有期少于7日的投资者收取的赎回费全额计入基金财产，其余用于支付注册登记费和其他必要的手续费。

（三）其他费用

1、基金财产拨划支付的银行费用；
2、基金合同生效后的基金信息披露费用；
3、基金份额持有人大会费用；
4、基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；
5、基金的证券交易费用；
6、基金的开户费用、账户维护费用；
7、基金上市费用；
8、基金合同生效以后的标的指数使用许可费；
9、在中国证监会规定允许的前提下，本基金可以从基金财产中计提销售服务费，具体计提方法、计提标准在招募说明书或相关公告中载明；
10、依法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。

(四)不列入基金费用的项目

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，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。

(五)基金税收

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定，履行纳税义务。

十五、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
重要提示	更新了重要提示的相关内容。
一、绪言	更新了绪言的相关信息。
二、释义	更新了释义的相关信息。
三、基金管理人	更新了基金管理人相关信息。
四、基金托管人	更新基金托管人相关信息。
五、相关服务机构	1.更新了部分销售机构的信息； 2.更新了会计师事务所的相关信息。
十、基金份额的申购与赎回	更新了基金份额的申购与赎回的相关信息。
十三、基金的投资	更新了最新一期的基金投资组合报告等相关信息。
十四、基金的业绩	披露了基金合同生效以来的基金业绩，详见招募说明书。
十六、基金资产的估值	更新了基金资产估值的相关信息。
二十二、基金的信息披露	更新了基金信息披露的相关信息。
二十三、风险揭示	更新了风险揭示的相关信息。
二十八、其他应披露事项	披露了自2017年12月25日至2018年6月25日期间本基金的公告信息。

华安基金管理有限公司
二〇一八年八月九日

华安基金管理有限公司关于华安信用四季红债券基金C类增加肯特瑞为销售机构的公告

根据华安基金管理有限公司（以下简称“本公司”）与北京肯特瑞财富投资管理有限公司(以下简称“北京肯特瑞”)签署的销售协议，自2018年8月13日起北京肯特瑞开始销售华安信用四季红债券型证券投资基金C类（以下简称“本基金”，基金代码：006015），投资者可在本基金的申购期内到北京肯特瑞网站办理本基金申购及其他相关业务。具体的业务流程、办理时间和办理方式以北京肯特瑞的规定为准。

详情请咨询：

1、北京肯特瑞财富投资管理有限公司
客服电话：个人业务：95118 企业业务：400-088-8816
公司网址：http://fund.jd.com/
2、华安基金管理有限公司
客户服务电话：40088-50099
网址：www.huaan.com.cn

华安基金管理有限公司
二〇一八年八月九日

华安丰利18个月定期开放债券型证券投资基金清算报告

基金管理人：华安基金管理有限公司
基金托管人：渤海银行股份有限公司
报告送出日期：二〇一八年八月九日

§1 重要提示

华安丰利18个月定期开放债券型证券投资基金（以下简称“本基金”），系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] 1190号《关于准予华安丰利18个月定期开放债券型证券投资基金注册的批复》及机构部函[2017] 1165号《关于同意华安丰利18个月定期开放债券型证券投资基金延期募集备案的回函》准予注册，由基金管理人华安基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于2018年2月9日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的规模为232,072,417.50份基金份额。本基金的基金管理人及登记机构为华安基金管理有限公司，基金托管人为渤海银行股份有限公司。

根据《华安丰利18个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）第二十部分“基金合同的变更、终止与基金财产的清算”中“二、《基金合同》的终止事由”的约定：“有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：1、基金份额持有人大会决定终止的；2、基金管理人、基金托管人职责终止，在6个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；3、《基金合同》生效后，在每个开放期届满时，基金规模低于2亿元的；4、《基金合同》约定的其他情形；5、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。”根据基金管理人2018年6月12日发布的《关于华安丰利18个月定期开放债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，本基金基金份额持有人大会于2018年6月11日表决通过了《关于终止华安丰利18个月定期开放债券型证券投资基金基金合同有关事项的议案》，大会决议自该日起生效，本基金自2018年6月23日起进入清算程序。

由基金管理人华安基金管理有限公司、基金托管人渤海银行股份有限公司、安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）和上海源泰律师事务所于2018年6月25日组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序，并由安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）对清算报告进行审计，上海源泰律师事务所对清算报告出具法律意见。

§2 基金产品概况

基金简称	华安丰利18个月定开债
基金主代码	002950
基金运作方式	契约开放式
基金合同生效日	2018年2月9日
报告期末(2018年6月22日)基金份额总额	40,892.55份
投资目标	在合理控制风险的前提下，通过积极主动的投资管理把握债券市场投资机会，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金将通过对宏观经济运行情况、国家货币及财政政策、资本市场资金环境等重要因素的研究和预测，结合投资时钟理论并利用公司研究开发的多因子模型等数量工具，优化基金资产在利率债、信用债以及货币市场工具等各类固定收益类金融工具之间的配置比例。开放期内，本基金为保持较高的组合流动性，方便投资人安排投资，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，将主要投资于高流动性的投资品种，减小基金净值的波动。
业绩比较基准	中债综合全价指数
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期的风险和收益水平低于股票型基金和混合型基金，高于货币市场基金，属于证券投资基金中的中等风险投资品种。
基金管理人	华安基金管理有限公司
基金托管人	渤海银行股份有限公司

§3 基金运作情况概述

本基金系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] 1190号《关于准予华安丰利18个月定期开放债券型证券投资基金注册的批复》及机构部函[2017] 1165号《关于同意华安丰利18个月定期开放债券型证券投资基金延期募集备案的回函》准予注册，由基金管理人华安基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于2018年2月9日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的规模为232,072,417.50份基金份额。

根据《基金合同》的约定以及基金管理人2018年6月12日发布的《关于华安丰利18个月定期开放债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，本基金基金份额持有人大会于2018年6月11日表决通过了《关于终止华安丰利18个月定期开放债券型证券投资基金基金合同有关事项的议案》，大会决议自该日起生效。根据决议生效公告，本基金最后运作日为2018年6月22日，自2018年6月23日起进入清算程序。自本基金基金合同生效日至最后运作日期间，本基金正常运作。

§4财务报告

4.1资产负债表

会计主体：华安丰利18个月定期开放债券型证券投资基金

报告截止日：2018年6月22日

单位：人民币元

资 产	最后运作日2018年6月22日
资 产：	
银行存款	28,483,368.51
结算备付金	–
存出保证金	–
交易性金融资产	–
其中：股票投资	–
应收利息	2,886.96
资产总计	28,486,255.47
负债和所有者权益	最后运作日2018年6月22日
负 债：	
应付赎回款	28,387,986.57
应付管理人报酬	37,994.71
应付托管费	12,664.91
应付销售服务费	0.66
应付交易费用	–
其他负债	–
负债合计	28,438,646.85
所有者权益：	
实收基金	40,892.55
未分配利润	6,716.07
所有者权益合计	47,608.62
负债和所有者权益总计	28,486,255.47

注：本财务报告已经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师蒋燕华、骆文慧签字出具了安永华明（2018）专字第60971571_B10号标准无保留意见的审计报告。

§5基金财产分配

自2018年6月23日至2018年6月29日止清算期间，基金财产清算小组对本基金的资产、负债进行清算，全部清算工作按清算原则和清算手续进行。具体清算情况如下：

5.1资产处置情况

5.1.1本基金最后运作日应收银行存款利息为人民币2,886.96元，该款项由基金管理人华安基金管理有限公司以自有资金垫付，并已于2018年6月21日划入托管账户。基金管理人垫付资金到账日起孳生的利息归基金管理人所有。

5.2负债清偿情况

5.2.1 本基金最后运作日应付赎回款为人民币28,387,986.57元，该款项已于2018年6月25日支付。

5.2.2 本基金最后运作日应付管理人报酬为人民币37,994.71元，该款项已于2018年6月25日支付。

5.2.3 本基金最后运作日应付托管费为人民币12,664.91元，该款项已于2018年6月25日支付。

5.2.4 本基金最后运作日应付销售服务费为人民币0.66元，该款项已于2018年6月25日支付。

5.3清算期间的清算损益情况

项目	自2018年6月23日至2018年6月29日止清算期间
一、清算损益	
1、利息收入（注1）	1,902.84
清算损益小计	1,902.84
二、清算费用	
清算费用小计（注2）	–
三、清算净损益	1,902.84

注1：利息收入系计提的自2018年6月23日至2018年6月29日止清算期间的银行存款利息。该款项由基金管理人华安基金管理有限公司以自有资金垫付，并已于2018年6月21日划入托管账户。基金管理人垫付资金到账日起孳生的利息归基金管理人所有。

注2：根据《关于华安丰利18个月定期开放债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，本次清算期间产生的清算费用由本基金管理人代为支付。

5.4资产处置及负债清偿后的剩余资产分配情况

单位：人民币元

项目	金额
一、最后运作日2018年6月22日基金净资产	47,608.62
加：清算期间净损益	1,902.84
减：基金净赎回转出金额	–
二、2018年6月29日基金净资产	49,511.46

根据本基金的《基金合同》及《关于华安丰利18个月定期开放债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，将基金财产清算后的全部剩余资产交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

资产处置及负债清偿后，本基金截至2018年6月29日止的剩余财产为人民币49,511.46元。

截至2018年6月29日止，经基金管理人以及基金托管人确认，本基金托管账户银行存款余额共人民币94,721.66元，其中人民币50,000.00元系基金管理人代垫的足以清偿以当前适用的利率预估的银行存款利息的款项。

若本基金后续清算，出现账面剩余资产不足以支付相关负债的，基金管理人有义务于收到基金托管人通知后当日内将款项补足。

5.5 基金财产清算报告的告知安排

本清算报告已经基金托管人复核，在经会计师事务所审计、律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案并向基金份额持有人公告。

§6 备查文件

6.1 备查文件目录

1、华安丰利18个月定期开放债券型证券投资基金2018年6月22日资产负债表及审计报告

2、《华安丰利18个月定期开放债券型证券投资基金清算报告》的法律意见

6.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的办公场所，并登载于基金管理人互联网站http://www.huaan.com.cn。

6.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站查阅，或在营业时间内至基金管理人或基金托管人的办公场所免费查阅。

华安丰利18个月定期开放债券型证券投资基金
基金财产清算小组
二〇一八年六月二十九日（清算报告出具日）

华安基金管理有限公司关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的公告

根据《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》（中国证券监督管理委员会公告[2017]13号）等有关规定，为使持有长期停牌股票的基金估值更加公平、合理，更好的维护持有人利益，经与托管银行协商一致，本公司决定自2018年8月7日起对旗下基金（ETF基金除外）所持有的鹏欣资源（股票代码：600490）采用“指数收益法”予以估值。在该股票复牌且其交易体现了活跃市场交易特征后，按市场价格进行估值，届时不再另行公告。敬请投资者予以关注。

特此公告。

华安基金管理有限公司
2018年8月9日

华安中证全指证券公司指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告

根据《华安中证全指证券公司指数分级证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）中关于不定期份额折算的相关规定，当华安中证全指证券公司指数分级证券投资基金之B份额的基金份额参考净值小于或等于0.2500元时，华安中证证券份额（场内简称：证券股基）、华安中证证券A份额（场内简称：证券股A）、华安中证证券B份额（场内简称：证券股B）将进行不定期份额折算。

由于近期A股市场波动较大，截至2018年8月8日，华安中证证券B份额的基金份额参考净值接近基金合同规定的不定期份额折算条件，因此本基金管理人敬请投资者密切关注华安中证证券份额近期的参考净值波动情况，并警惕可能出现的风险。

针对不定期折算所带来的风险，本基金管理人特别提示如下：

一、由于华安中证证券A份额、华安中证证券B份额折算前可能存在折溢价交易情形，不定期份额折算后，华安中证证券A份额、华安中证证券B份额的折溢价率可能发生较大变化。特提请参与二级市场交易的投资者注意高溢价所带来的风险。

二、本基金华安中证证券B份额表现为高风险、高预期收益的特征，不定期份额折算后其杠杆倍数将大幅降低，将恢复到初始杠杆水平，相应地，华安中证证券B份额净值随市场涨跌而增长或者下降的幅度也会大幅减小。

三、由于触发折算阀值当日，华安中证证券B份额的基金份额参考净值可能已低于阀值，而折算基准日在触发阀值日后才能确定，此折算基准日华安中证证券B份额的基金份额参考净值可能与折算阀值0.2500元有一定差异。

四、华安中证证券A份额表现为低风险、收益相对稳定的特征，但在不定期份额折算后华安中证证券A份额持有人的风险收益特征将发生较大变化，由持有单一的较低风险收益特征华安中证证券A份额变为同时持有较低风险收益特征华安中证证券A份额与较高风险收益特征华安中证证券份额的情况，因此华安中证证券A份额持有人预期收益实现的不确定性将会增加。

本基金管理人的其他重要提示：

一、根据深圳证券交易所的相关业务规则，场内份额数将取整计算（最小单位为1份），舍去部分计入基金资产，持有极小数量华安中证证券份额、华安中证证券A份额、华安中证证券B份额的持有人存在折算后份额因为不足1份而被强制归入基金资产的风险。

二、为保证折算期间本基金的平稳运作，基金管理人可根据深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定暂停证券股A与证券股B的上市交易和华安中证证券份额的申购及赎回等相关业务。届时本基金管理人将会对相关事项进行公告，敬请投资者予以关注。

投资者若希望了解基金不定期份额折算业务详情，请登录本公司网站（www.huaan.com.cn）查询或阅读本基金的基金合同及《华安中证全指证券公司指数分级证券投资基金招募说明书》（以下简称“招募说明书”）或者拨打本公司客服电话：40088-50099。

三、本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，也不保证最低收益。

本基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在做出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行承担。投资有风险，选择须谨慎。敬请投资者于投资前认真阅读本基金的基金合同和招募说明书等相关法律文件。

特此公告。

华安基金管理有限公司
二〇一八年八月九日

华安中证全指证券公司指数分级证券投资基金之证券股B交易价格波动提示公告

近期，华安基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”）旗下华安中证全指证券公司指数分级证券投资基金之华安中证证券B份额（场内简称：证券股B；交易代码：150302）二级市场交易价格波动较大，2018年8月7日，证券股B二级市场收盘价为0.418元，相对于当日0.3692元的基金份额参考净值，溢价幅度达到13.22%。截止2018年8月8日，证券股B二级市场收盘价为0.409元，明显高于基金份额参考净值。投资者如果盲目投资，可能遭受重大损失。

为此，本基金管理人提示如下：

1、华安中证证券B份额表现为高风险、高收益的特征。由于华安中证证券B份额内含杠杆机制的设计，华安中证证券B份额参考净值的变动幅度将大于华安中证证券份额（场内简称：证券股基，场内代码：160419）净值和华安中证证券A份额（场内简称：证券股A，场内代码：150301）参考净值的变动幅度，即华安中证证券B份额的波动性要高于其他两类份额，其承担的风险也较高。华安中证证券B份额的持有人会因杠杆倍数的变化而承担不同程度的投资风险。

2、华安中证证券B份额的交易价格，除了有份额参考净值变化的风险外，还会受到市场的系统性风险、流动性风险等其他风险影响，可能使投资人面临损失。

3、截至2018年8月8日，华安中证证券B份额的基金份额参考净值接近基金合同约定的不定期份额折算阀值。不定期份额折算后，华安中证证券B份额的溢价率可能发生较大变化。特此提示请参与证券股B二级市场交易的投资者注意高溢价所带来的风险。

4、截至本公告披露日，华安中证全指证券公司指数分级证券投资基金运作正常。本基金管理人仍将严格按照法律法规及基金合同进行投资运作。

5、截至本公告披露日，华安中证全指证券公司指数分级证券投资基金无其他应披露而未披露的重大信息。本基金管理人仍将严格按照有关规定和要求，及时做好信息披露工作。

6、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，也不保证最低收益。投资者投资于本基金前应认真阅读本基金的基金合同和招募说明书等相关法律文件。

敬请投资者注意投资风险。

特此公告。

华安基金管理有限公司
2018年8月9日