华安宝利配置证券投资基金 2018年半年度报告摘要

基金管理人:华安基金管理有限公司
基金托管人:交通银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一八年八月二十四日

1 重要提示

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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定, 于2018年8月22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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文, 投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年1月1日起至6月30日止。

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	华安宝利配置混合	
基金主代码	040004	
交易代码	040004(前端)	041004(后端)
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2004年8月24日	
基金管理人	华安基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,265,736,722.76份	
基金合同存续期	不定期	

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过挖掘存在于各相关证券子市场以及不同金融工具之间的投资机会,灵活配置资产,并充分提高基金资产的使用效率,在实现基金资产保值的基础上获取更高的投资收益。
投资策略	基金管理人将通过对中国证券市场进行定量和定性的分析,采用积极的投资组合策略,保留可控制的风险,规避或降低无法控制的风险,发现和捕捉市场机会以实现基金的投资目标。
业绩比较基准	35%×天相转债指数收益率+30%×天相280 指数收益率+30%×天相国债全价指数收益率+5%×金融同业存款利率
风险收益特征	本基金面临与其他开放式基金相同的风险(例如市场风险、流动性风险、管理风险、技术风险等),但上述风险在本基金中存在一定的特殊性。本基金主要面临的风险为:利率风险、政策风险,经济周期风险,信用风险,再投资风险,上市公司经营风险,新产品创新带来的风险,购买力风险,流动性风险,现金管理风险,技术风险,管理风险,巨额赎回风险等。

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		华安基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	钱鲲	陆志俊
	联系电话	021-38969999	021-32169999
	电子邮箱	qiankun@huaan.com.cn	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		4008850099	95559
传真		021-68863414	021-62701216

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告摘要的管理人互联网网址	www.huaan.com.cn
基金半年度报告备置地点	上海市世纪大道8号上海国金中心二期31、32层

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

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2018年1月1日至2018年6月30日)
本期已实现收益	-17,087,863.16
本期利润	-134,749,028.76
加权平均基金份额本期利润	-0.1046
本期基金份额净值增长率	-8.87%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.0888
期末基金资产净值	1,378,073,595.40
期末基金份额净值	1.089

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(例如:封闭式基金交易佣金、开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等),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、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的孰低数(为期末余额,不是当期发生数)。

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

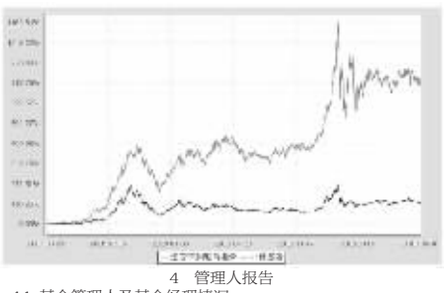
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-2.51%	1.12%	-3.13%	0.58%	0.62%	0.54%
过去三个月	-6.44%	0.98%	-4.21%	0.51%	-2.23%	0.47%
过去六个月	-8.87%	1.09%	-3.65%	0.55%	-5.22%	0.54%
过去一年	-3.29%	0.99%	-1.21%	0.46%	-2.08%	0.53%
过去三年	-11.21%	1.68%	-12.67%	0.86%	1.46%	0.82%
自基金合同生效起至今	791.66%	1.33%	114.96%	0.87%	676.70%	0.46%

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

华安宝利配置证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2004年8月24日至2018年6月30日)



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

华安基金管理有限公司经中国证监会证监基金字 [1998]20号文批准于1998年6月设立,是国内首批基金管理公司之一,注册资本1.5亿元人民币,公司总部设在上海陆家嘴金融贸易区。目前的股东为国泰君安投资管理股份有限公司、上海国际信托有限公司、上海工业投资(集团)有限公司、上海锦江国际投资管理有限公司和国泰君安创新投资有限公司。公司在北京、上海、沈阳、成都、广州等地设有分公司,在香港和上海设有子公司—华安(香港)资产管理有限公司、华安未来资产管理有限公司。截至2018年6月30日,公司旗下共管理华安创新混合、华安MSCI中国A、华安现金富利货币、华安稳定收益债券、华安黄金易ETF、华安沪港深外延增长混合、华安全球美元收益债券等103只开放式基金,管理资产规模达到2,460.80亿元人民币。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
刘伟亭	本基金的基金经理	2015-09-25	2018-05-14	12年	硕士研究生,12年证券、基金从业经验。曾任长江巴黎百富勤证券有限公司助理经理、国海富兰克林基金基金经理。2015年6月加入华安基金管理有限公司,2015年9月至2018年5月担任本基金及华安生态优先混合型证券投资基金的基金经理。2016年9月至2018年6月,担任华安智增精选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018年2月至2018年5月,同时担任华安慧增优选定期开放灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。
王嘉	本基金的基金经理	2018-02-26	-	14年	硕士,14年金融、证券行业从业经验。曾任上海市恩佳企业咨询有限公司研究员、上海市新理益投资管理有限公司研究员、莫尼塔投资咨询有限公司研究员、元大京华证券上海代表处研究员、兴业证券研究发展中心研究员。2010年5月加入华安基金,现任基金投资部基金经理。2015年7月起担任华安国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016年2月至2018年1月,担任华安乐惠保本混合型证券投资基金的基金经理,2016年2月起,同时担任华安安康保本混合型证券投资基金的基金经理。2018年2月起,同时担任本基金的基金经理。2018年6月起,同时担任华安新机遇灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。

注:此处的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日,即以公告日为准。证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

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《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、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,在控制风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大利益,不存在违法违规或未履行基金合同承诺的情形。

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

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,公司制定了《华安基金管理有限公司公平交易管理制度》,将封闭式基金、开放式基金、特定客户资产管理组合及其他投资组合资产在研究分析、投资决策、交易执行等方面全部纳入公平交易管理中。控制措施包括:在研究环节,研究员在为公司管理的各类投资组合提供研究信息、投资建议过程中,使用晨会发言、邮件发送、登录在研究报告管理系统中等方式来确保各类投资组合经理可以公平享有信息获取机会。在投资环节,公司各投资组合经理根据投资组合的风格和投资策略,制定并严格执行交易决策规则,以保证各投资组合交易决策的客观性和独立性。同时严格执行投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体授权机制,投资组合经理在授权范围内自主决策,超过授权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易环节,公司实行强制公平交易机制,确保各投资组合享有公平的交易执行机会。(1) 交易所二级市场业务,遵循价格优先、时间优先、比例分配、综合平衡的控制原则,实现同一时间下达指令的投资组合在交易时机上的公平性。(2) 交易所一级市场业务,投资组合经理按意愿独立进行业务申报,集中交易部以投资组合名义对外进行申报。若该业务以公司名义进行申报与中签,则按实际中签情况以价格优先、比例分配原则进行分配。若中签量过小无法合理进行比例分配,且以公司名义获得,则投资部门在合规监察员监督参与下,进行公平协商分配。(3) 银行间市场业务遵循指令时间优先原则,先到先询价的控制原则。通过内部共同的iwind群,发布询价需求和结果,做到信息公开。若是多个投资组合进行一级市场投标,则各投资组合经理须以各投资组合名义向集中交易部下达投资意向, 交易员以此进行投标,以确保中签结果与投资组合投标意向一一对应。若中签量过小无法合理进行比例分配,且以公司名义获得,则投资部门在风险管理部投资监督参与下,进行公平协商分配。交易监控、分析与评估环节,公司风险管理部对公司旗下的各投资组合投资境内证券市场上市交易的投资品种、进行场外的非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购、不同投资组合同日和临近交易日的反向交易以及可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控,根据市场公认的第三方信息(如:中债登的债券估值),定期对各投资组合与交易对手之间议价交易的交易价格公允性进行审查,对不同投资组合临近交易日的同向交易的交易时机和交易价差进行分析。

本报告期内,公司公平交易制度总体执行情况良好。

本基金管理人通过统计检验的方法对管理的不同投资组合,在不同时间窗下(日内、3日内、5日内)的本年度同向交易价差进行了专项分析,未发现违反公平交易原则的异常情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,公司合规监察稽核部会同基金投资、交易部门讨论制定了公募基金、专户针对股票、债券、回购等投资品种在交易所及银行间的同日反向交易控制规则,并在投资系统中进行了设置,实现了完全的系统控制。同时加强了对基金、专户间的同日反向交易的监控与隔日反向交易的检查;风险管理部开发了同向交易分析系统,对相关同向交易指标进行持续监控,并定期对组合间的同向交易行为进行了重点分析。

本报告期内,因组合流动性管理或投资策略调整需要,除指数基金以外的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的次数为3次,未出现异常交易。

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

截止2018年6月30日,本基金份额净值为1.089元。报告期的净值下跌主要受到成长股调整幅度较大, 本基金在报告期适当降低了仓位,且结构转向防御。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2018年06月30日,本基金份额净值为1.089元,本报告期份额净值增长率为-8.87%,同期业绩比较基准增长率为-3.65%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

对经济判断:今年以来的中国经济数据,宏观数据和预期一直在和中观数据对抗,投资、信贷等数据偏弱,但地产、周期和消费中观数据,尤其是龙头公司数据超出预期。个人理解是去杠杆现阶段还主要停留在挤出金融系统空转的资金,以及资金的价格上升还不足以明显抑制经济活动。个人认为如果去杠杆和贸易战持续,则更大的概率是中观数据向宏观预期靠拢,直至去杠杆阶段性目标达成或者是货币或财政政策明显转向。积极的信号是,货币政策态度出现了一定的转变,流动性预期有所改善。

股市展望:虽然货币政策有所转向,但去杠杆的过程还未彻底结束,也不会出现大水漫灌式的松动,股市的结构性的问题依然存在,且难有系统性机会。当前位置相对看好前期涨幅较低的必须消费品、前期跌幅较但基本面较强的地产和部分周期品,以及基本面扎实、跟宏观关联较小的成长股。

操作思路:整体降低仓位,以中性仓位应对波动,同时结构上加大对消费和成长股的配置。适度把握地产和部分周期性行业的波段性机会。

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,负责在证券发行机构发生了严重影响证券价格的重大事件时, 评估重大事件对投资品种价值的影响程度、评估对基金估值的影响程度、确定采用的估值方法、确定该证券的公允价值;同时将采用的估值方法以及采用该方法对相关证券的估值与基金的托管银行进行沟通。估值委员会成员由投资总监、研究总监、固定收益部总监、指数投资部总监、基金运营部总经理、风险管理部总监等人员组成,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

本报告期不进行收益分配。

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

本基金报告期内不存在基金持有人数低于200人或基金资产净值低于5000万元的情形。

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

2018半年度, 基金托管人在华安宝利配置证券投资基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议,尽职尽责地履行了托管人应尽的义务,不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

2018半年度, 华安基金管理有限公司在华安宝利配置证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上,托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配,符合基金合同的规定。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

2018半年度, 由华安基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关华安宝利配置证券投资基金的半年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、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:华安宝利配置证券投资基金

报告截止日:2018年6月30日

单位:人民币元

资产	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
资产:	-	-
银行存款	25,726,424.07	10,691.13
结算备付金	228,634,618.82	115,168,626.87
存出保证金	1,496,107.41	1,074,725.51
交易性金融资产	1,126,534,044.67	1,478,575,851.96
其中:股票投资	851,663,571.11	1,259,421,126.68
基金投资	-	-
债券投资	274,870,473.56	219,154,725.28
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	16,894,709.72	6,764,146.81
应收利息	7,362,099.22	5,117,023.03
应收股利	-	-
应收申购款	794,796.08	793,180.19
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,407,442,799.99	1,607,504,245.50
负债和所有者权益	**本期末 2018年6月30日**	**上年度末 2017年12月31日**
负债:	-	-
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	17,029,621.12	48,844.26
应付赎回款	2,285,934.80	1,796,442.91
应付管理人报酬	1,399,335.59	1,627,025.83
应付托管费	291,528.26	338,963.70
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	7,904,700.66	4,121,582.77
应交税费	5,059.03	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	453,025.13	654,900.00
负债合计	29,369,204.59	8,587,759.47
所有者权益:	-	-
实收基金	1,265,736,722.76	1,337,834,944.54
未分配利润	112,336,872.64	261,081,541.49
所有者权益合计	1,378,073,595.40	1,598,916,486.03
负债和所有者权益总计	1,407,442,799.99	1,607,504,245.50

注:报告截止日2018年6月30日,基金份额净值1.089元,基金份额总额1,265,736,722.76份。

6.2 利润表

会计主体:华安宝利配置证券投资基金

本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
一、收入	-110,729,996.33	20,688,174.31
1.利息收入	6,397,209.20	4,859,326.62
其中:存款利息收入	1,477,048.28	1,088,838.82
债券利息收入	4,920,160.92	3,766,935.71
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	3,552.09
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	396,552.78	-5,225,661.26
其中:股票投资收益	-7,466,383.91	-13,153,140.54
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-2,524,160.90	128,600.00
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	10,387,097.59	7,798,879.28
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-117,661,165.60	20,609,653.76
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	137,407.29	444,855.19
减:二、费用	24,019,032.43	22,881,324.14
1. 管理人报酬	8,895,836.62	10,259,943.53
2. 托管费	1,853,299.32	2,137,488.18
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	13,049,013.57	10,265,171.06
5. 利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6.税金及附加	2,939.79	-
7. 其他费用	217,943.13	218,721.37
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	-134,749,028.76	-2,193,149.83
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	-134,749,028.76	-2,193,149.83

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:华安宝利配置证券投资基金

本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018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)	1,337,834,944.54	261,081,541.49	1,598,916,486.03
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-134,749,028.76	-134,749,028.76
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)	-72,098,221.78	-13,995,640.09	-86,093,861.87
其中:1.基金申购款	75,742,851.87	11,995,308.66	87,738,160.53
2.基金赎回款	-147,841,073.65	-25,990,948.75	-173,832,022.40
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)	1,265,736,722.76	112,336,872.64	1,378,073,595.40

注:报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2018半年度,基金托管人在华安宝利配置证券投资基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议,尽职尽责地履行了托管人应尽的义务,不存在任何损害基金持有人利益的行为。

注:报告期内托管人遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2018半年度,华安基金管理有限公司在华安宝利配置证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上,托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

注:报告期内本基金未进行收益分配,符合基金合同的规定。

注:报告期内托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

2018半年度,由华安基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关华安宝利配置证券投资基金的半年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华安宝利配置证券投资基金(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")证监基金字[2004]第97 号《关于同意华安宝利配置证券投资基金设立的批复》核准,由华安基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安宝利配置证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定, 首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币1,130,461,912.15 元, 业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2004)第161 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华安宝利配置证券投资基金基金合同》于2004 年8 月24 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,130,480,770.08 份基金份额,其中认购资金利息折合18,857.93 份基金份额。本基金的基金管理人为华安基金管理有限公司,基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《华安宝利配置证券投资基金基金合同》和最新发布的《华安宝利配置证券投资基金更新的招募说明书》的有关规定,本基金的投资范围为国内依法公开发行、上市的股票、债券及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。本基金所持有的可转换债券及其对应的基础股票市值占基金资产净值的目标比例为45%,最低比例为10%,最高比例为70%(其中所对应的基础股票的投资比例不超过基金资产净值的20%); 除可转换债券外的其它债券市值占基金资产净值的目标比例为30%,最低比例为10%,最高比例为65%;除可转换债券所对应基础股票外的其它股票市值占基金资产净值的目标比例为20%,最低比例为10%,最高比例为65%。本基金的业绩比较基准为:天相转债指数收益率×35%+天相280 指数收益率×30%+天相国债全价指数收益率×30%+金融同业存款利率×5%。

本财务报表由本基金的基金管理人华安基金管理有限公司于2018年8月23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 日颁布的《企业会计准则-基本准则》和38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称"企业会计准则")、中国证监会公告[2010]5 号《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)》、中国证券业协会于2007 年5 月15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华安宝利配置证券投资基金基金合同》 和在财务报表附注所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2018年上半年度财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2018年6月30日的财务状况以及2018年上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 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的说明

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

本会计期间不存在会计政策变更。

6.4.5.2会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3差错更正的说明

本会计期间不存在差错更正。

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[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[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补充政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 于2016年5月1日前,以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自2016年5月1日起,金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。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,对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(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,股权的股息、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, 于2015年9月8日前暂减按25%计入应纳税所得额,自2015年9月8日起,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。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 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
华安基金管理有限公司("华安基金公司")	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
交通银行股份有限公司("交通银行")	基金托管人、基金代销机构

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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

无。

6.4.8.1.2 权证交易

无。

6.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

无。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	8,895,836.62	10,259,943.53
其中:支付销售机构的客户维护费	1,926,305.98	2,138,288.25

注:支付基金管理人华安基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值1.2%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。

其计算公式为: 日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 1.2% / 当年天数。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,853,299.32	2,137,488.18

注: 支付基金托管人交通银行的托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。

其计算公式为:日托管费=前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

基金管理公司主要股东及其控制的机构本报告期末和上年度末均无投资本基金的情况。

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017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
交通银行	25,726,424.07	181,592.53	10,238,192.50	79,955.89

注:1. 本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管,按银行同业利率计息。

2.本基金用于证券交易结算的资金通过"交通银行基金托管结算资金专用存款账户"转存于中国证券登记结算有限责任公司,按银行同业利率计息。于2018年6 月30日的相关余额在资产负债表中的结算备付金"科目中单独列示(2017年6月30日:同)。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

6.4.8.7.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.9 期末(2018年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 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

6.4.9.1.1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
603105	芯能科技	2018-06-29	2018-07-09	网下中签	4.83	4.83	3,410.00	16,470.30	16,470.30	-
603693	江苏新能	2018-06-25	2018-07-03	网下中签	9.00	9.00	5,384.00	48,456.00	48,456.00	-
603706	东方环宇	2018-06-29	2018-07-09	网下中签	13.09	13.09	1,765.00	23,103.85	23,103.85	-
6.4.9.1.2受限证券类别:债券										
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:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113511	千禾转债	2018-06-20	2018-07-10	老股东配债	100.00	100.00	4,620.00	462,000.00	462,000.00	-

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金截至2018年6月30日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票,该类股票将在所公布事项的重大影响消除后,经交易所批准复牌。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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	851,663,571.11	60.51
	其中:股票	851,663,571.11	60.51
2	固定收益投资	274,870,473.56	19.53
	其中:债券	274,870,473.56	19.53
	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	254,361,042.89	18.07
7	其他各项资产	26,547,712.43	1.89
8	合计	1,407,442,799.99	100.00

7.2 报告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

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	97,364,843.17	7.07
C	制造业	467,221,271.54	33.90
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	71,559.85	0.01
E	建筑业	91,409,184.00	6.63
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	41,491,606.00	3.01
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	37,966,815.60	2.76
J	金融业	98,539,581.53	7.15
K	房地产业	16,736,931.28	1.21
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	861,778.14	0.06
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	851,663,571.11	61.80

7.3 期末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

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	000961	中南建设	14,486,400	91,409,184.00	6.63
2	600309	万华化学	1,276,892	57,996,434.64	4.21
3	300285	国瓷材料	2,492,457	49,699,592.58	3.61
4	600711	盛屯矿业	5,314,819	47,992,815.57	3.48
5	601398	工商银行	8,756,700	46,585,644.00	3.38