华安年年盈定期开放债券型证券投资基金

2018年第三季度报告

2018年9月30日

基金管理人:华安基金管理有限公司

基金托管人:中国银行股份有限公司

报告送出日期:二〇一八年十月二十六日

§1 重要提示

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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年10月24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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华安年年盈定期开放债券	
基金主代码	000239	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015年2月3日	
报告期末基金份额总额	72,483,565.78份	
投资目标	在合理控制风险的前提下,通过主动管理充分捕捉债券市场投资机会,力争实现基金资产的长期稳定增值。	
投资策略	本基金将充分发挥基金管理人的研究优势,将规范的宏观研究、严谨的个券分析与积极主动的投资风格相结合,在分析和判断宏观经济运行状况和金融市场运行趋势的基础上,动态调整固定收益类资产配置比例,自上而下决定债券组合久期及债券类属配置;在严谨深入的基本面分析和信用分析基础上,综合考量各类债券的流动性、供求关系、风险及收益率水平等,自下而上地精选个券。	
业绩比较基准	一年期定期存款利率(税后)+1.2%	
风险收益特征	本基金为债券型基金,其预期的风险水平和预期收益都要低于股票基金、混合基金,高于货币市场基金,属于证券投资基金中的中等风险和中等收益的品种	
基金管理人	华安基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	华安年年盈定期开放债券A	华安年年盈定期开放债券C
下属分级基金的交易代码	000239	000240
报告期末下属分级基金的份额总额	64,627,758.31份	7,855,807.47份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2018年7月1日-2018年9月30日)	
	华安年年盈定期开放债券A	华安年年盈定期开放债券C
1.本期已实现收益	1,436,293.99	167,259.09
2.本期利润	2,109,240.92	248,399.36
3.加权平均基金份额本期利润	0.0326	0.0316
4.期末基金资产净值	65,724,825.86	7,920,876.29
5.期末基金份额净值	1.017	1.008

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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

1、华安年年盈定期开放债券A:

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
过去三个月	3.35%	0.08%	0.68%	0.20%	2.67%	-0.12%

2、华安年年盈定期开放债券C:

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
过去三个月	3.17%	0.08%	0.68%	0.20%	2.49%	-0.12%

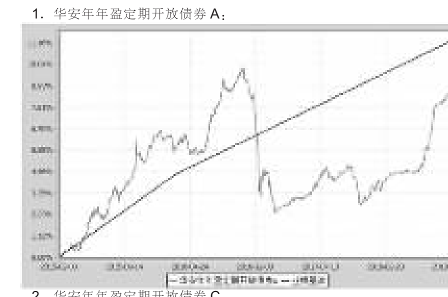
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华安年年盈定期开放债券型证券投资基金

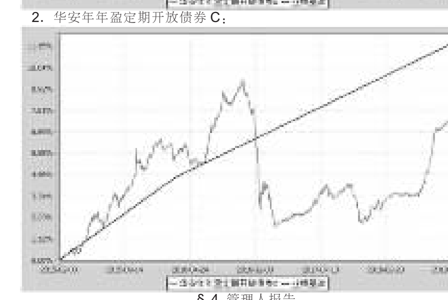
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2015年2月3日至2018年9月30日)

1. 华安年年盈定期开放债券A:



2. 华安年年盈定期开放债券C:



§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
孙丽娜	本基金的基金经理	2015-02-17	-	8年	硕士研究生,8年债券、基金行业从业经验。曾任上海国际货币经纪公司债券经纪人。2010年8月加入华安基金管理有限公司,先后担任债券交易员、基金经理助理。2014年8月至2017年7月担任华安日日鑫货币市场基金及华安汇财通货币市场基金的基金经理,2014年8月至2015年1月,同时担任华安七日鑫短期理财债券型证券投资基金的基金经理。2014年10月起同时担任华安现金富利投资基金的基金经理。2015年2月起担任华本基金的基金经理。2015年6月起同时担任华安添颐养老混合型发起式证券投资基金的基金经理。2016年10月至2018年1月,同时担任华安安润灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016年12月起,同时担任华安新丰利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017年3月起,同时担任华安现金宝货币市场基金的基金经理。2018年5月起,同时担任华安日日鑫货币市场基金的基金经理。2018年9月起,同时担任华安安浦债券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 公平交易专项说明

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、发送邮件、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,超过投资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,则投资部门在风控部门的监督参与下,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;风险管理部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。

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,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,出现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0次,未出现异常交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

三季度,全球金融市场基本面和政策周期进一步分化。美国经济延续强劲,美联储9月如期加息;欧洲复苏进程有所放缓,欧央行9月议息保持中性;国内宏观经济稳中略降,投资和消费数据有所回落,货币政策进一步宽松,央行通过降准和增量投放MLF支持信用扩张。受中美贸易争端影响,外储结束连增,人民币汇率有所承压。受益于流动性大幅改善,三季度货币市场收益率大幅回落,债市各期限收益率也明显下行。

本基金保持了较高的债券仓位和适中的久期,同时对利率债积极波段操作,努力赚钱收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2018年9月30日,华安年年盈A份额净值为1.017元,C份额净值为1.008元;华安年年盈A份额净值增长率为3.35%,C份额净值增长率为3.17%,同期业绩比较基准增长率为0.68%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望四季度,美国或将迎来本轮经济增长峰值,欧元区经济有望企稳,主要经济体货币政策仍走在回归正常化道路上。对中国而言,外有贸易战和全球需求的不确定性,内有融资环境恶化带来的经济潜在风险,宏观经济具有一定的下行压力。央行年内第四次降准,流动性整体较为宽裕。中短久期利率债和高等级信用债有望进一步走牛,但仍需警惕信用风险,尤其是对于信用资质较差的民企。

本基金将保持适中的债券仓位和久期,积极参与利率债波动操作。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

5.1 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	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	96,515,721.20	97.52
	其中:债券	96,515,721.20	97.52
	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	481,432.81	0.49
7	其他各项资产	1,969,242.85	1.99
8	合计	98,966,396.86	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

5.3 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股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票投资。

5.4 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	39,977,421.20	54.28
5	企业短期融资券	42,301,000.00	57.44
6	中期票据	14,237,300.00	19.33
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	96,515,721.20	131.05

5.5 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	101800559	18徐庄高新MTN001	70,000	7,166,600.00	9.73
2	101800745	18中交三航MTN001	70,000	7,070,700.00	9.60
3	011801017	18恒信租赁SCP002	70,000	7,058,800.00	9.58
4	011801047	18中储发展SCP001	70,000	7,055,300.00	9.58
5	011800819	18均瑶SCP001	70,000	7,050,400.00	9.57

5.6 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。

5.7 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。

5.8 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。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期没有投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

无。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期没有投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	5,671.66
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,963,571.19
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,969,242.85

5.11.4 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。

5.11.5 报告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不存在流通受限的情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	华安年年盈定期开放债券A	华安年年盈定期开放债券C
本报告期期初基金份额总额	64,627,758.31	7,855,807.47
报告期基金总申购份额	-	-
减:报告期基金总赎回份额	-	-
报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	64,627,758.31	7,855,807.47

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、《华安年年盈定期开放债券型证券投资基金基金合同》

2、《华安年年盈定期开放债券型证券投资基金招募说明书》

3、《华安年年盈定期开放债券型证券投资基金托管协议》

8.2 存放地点

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

8.3 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。

华安基金管理有限公司

二〇一八年十月二十六日

华安年年红定期开放债券型证券投资基金

2018年第三季度报告

2018年9月30日

基金管理人:华安基金管理有限公司

基金托管人:中国工商银行股份有限公司

报告送出日期:二〇一八年十月二十六日

§1 重要提示

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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年10月24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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华安年年红债券	
基金主代码	000227	
基金运作方式	契约性开放式	
基金合同生效日	2013年11月14日	
报告期末基金份额总额	211,165,808.72份	
投资目标	本基金主要投资于固定收益品种,在合理控制风险的基础上谨慎投资,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、国家政策等可能影响债券市场的重要因素的研究和预测,并利用公司研究开发的各种数量模型工具,分析和比较不同债券品种和具体债券的收益及风险特征,积极寻找各种可能的价值增长和套利的机会,以确定基金资产在利率类固定收益品种(国债、央行票据等)和信用类固定收益品种之间的配置比例。同时结合基金的封闭运作期限和现金流预测调整债券组合的平均久期,决定投资品种。	
业绩比较基准	同期一年期定期存款收益率(税后)+1.2%	
风险收益特征	本基金为债券型基金,其预期的风险水平和预期收益都要低于股票基金、混合基金,高于货币市场基金,属于证券投资基金中的中等风险和中等收益的品种。	
基金管理人	华安基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	华安年年红债券A	华安年年红债券C
下属分级基金的交易代码	000227	001994
报告期末下属分级基金的份额总额	166,170,920.21份	44,994,888.51份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2018年7月1日-2018年9月30日)	
	华安年年红债券A	华安年年红债券C
1.本期已实现收益	4,082,005.80	1,041,535.63
2.本期利润	5,278,657.59	1,364,540.65
3.加权平均基金份额本期利润	0.0318	0.0303
4.期末基金资产净值	178,140,913.82	48,064,890.17
5.期末基金份额净值	1.072	1.068

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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

1、华安年年红债券A:

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
过去三个月	3.07%	0.11%	0.68%	0.01%	2.39%	0.10%

2、华安年年红债券C:

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
过去三个月	2.88%	0.10%	0.68%	0.01%	2.20%	0.09%

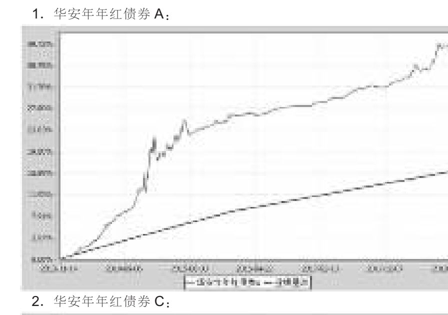
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华安年年红定期开放债券型证券投资基金

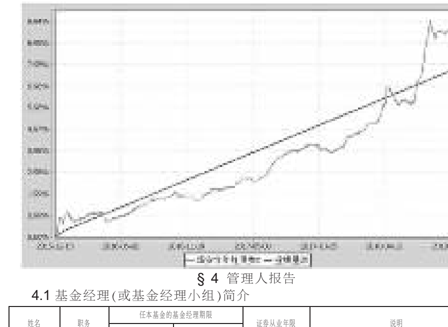
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2013年11月14日至2018年9月30日)

1. 华安年年红债券A:



2. 华安年年红债券C:



§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
郑可成	本基金的基金经理,固定收益部助理总监	2014-08-30	-	17年	硕士研究生,17年证券基金从业经历。2001年7月至2004年12月在闽发证券有限责任公司担任研究员,从事债券研究及投资,2005年1月至2005年9月在福建儒林投资顾问有限公司任研究员,2005年10月至2009年7月在益民基金管理有限公司任基金经理,2009年8月至今任职于华安基金管理有限公司固定收益部。2010年12月起担任华安稳固收益债券型证券投资基金的基金经理。2012年9月起同时担任华安安心收益债券型证券投资基金的基金经理。2012年11月至2017年7月同时担任华安日日鑫货币市场基金的基金经理。2012年12月起同时担任华安信用增强债券型证券投资基金的基金经理。2013年5月起同时担任华安保本混合型证券投资基金的基金经理。2014年8月至2015年1月,同时担任华安七日鑫短期理财债券型证券投资基金的基金经理,2014年8月起,同时担任本基金的基金经理。2015年3月起担任华安新动力灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2015年5月起同时担任华安新机遇灵活配置混合型证券投资基金、华安新优选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2015年6月起同时担任华安添颐混合型发起式证券投资基金的基金经理;2015年11月起,同时担任华安安益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理;2015年12月至2018年1月,同时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月至2017年7月,同时担任华安安康保本混合型证券投资基金的基金经理。2016年4月至2017年7月,同时担任华安安禧保本混合型证券投资基金的基金经理。2016年10月至2018年1月,同时担任华安安润灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017年2月起,同时担任华安安享灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017年3月起,同时担任华安现金宝货币市场基金的基金经理。
周益鸣	本基金的基金经理	2018-06-08	-	10年	硕士,10年金融、基金行业从业经验。曾任太平资产管理有限公司交易员。2010年6月加入华安基金,历任集中交易部交易员、固定收益部基金经理助理。2018年6月起,担任本基金的基金经理。

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 公平交易专项说明

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、发送邮件、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,超过投资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,则投资部门在风控部门的监督参与下,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;风险管理部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。

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,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,出现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0次,未出现异常交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2018年三季度宏观经济下行压力开始显现。基建投资由于地方政府债务问题出现断崖式下滑,尽管房地产和制造业投资相对稳定,但整体投资仍然受到拖累。消费层面由于可支配收入增速相对较低且居民杠杆水平较高,因此同样表现不佳。进出口贸易由于未来存在贸易战的影响,企业有抢进出口的冲动,增速尚可。

货币政策在三季度有些许变化,在汇率方面启用了逆周期,扭转了市场的贬值预期,其次大幅提高了离岸人民币利率,并有启动央票的可能。国内货币市场融资利率也回归合理水平,略高于央行公开市场操作利率。

债券市场以震荡为主,在人民币和美元挂钩后,中美利差开始趋于稳定,导致中国市场利率更容易受美债收益率的影响。同时地方债的大量发行也对债券市场形成一定负面影响。权益市场则在经济基本面走弱,贸易摩擦升温的背景下出现持续下跌。

本基金在2018年三季度适当降低了债券平均久期和杠杆水平,兑现了部分收益。可转债进行小仓位波段操作,对基金净值影响有限。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2018年9月30日,华安年年红债券A份额净值为1.072元,C份额净值为1.068元;华安年年红债券A份额净值增长率为3.07%,C份额净值增长率为2.88%,同期A级业绩比较基准增长率为0.68%,同期C级业绩比较基准增长率为0.68%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

进入四季度,虽然经济基本面仍有下滑动力,但随着央行降准和宽信用政策的落地,我们倾向于认为"社会融资规模增速"这一先行指标会出现企稳反弹,且和M2增速之间的差额会进一步扩大,即"信用投放比货币投放更宽松",对债券市场会形成一定的负面影响,但会有利于权益市场的阶段性企稳。外部因素方面,美国经济数据依然强劲,支持美联储持续缓慢加息,10年美债收益率有进一步上行的动力。结合人民币汇率和美元挂钩的判断,国内利率也会有被迫上行的压力。

基于以上判断,本基金将维持高杠杆和中短久期的配置策略,适当增加转债配置力度。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

5.1 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	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	328,464,119.15	97.00
	其中:债券	328,464,119.15	97.00
	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	5,016,061.67	1.48
7	其他各项资产	5,129,254.14	1.51
8	合计	338,609,434.96	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.3 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股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票投资。

5.4 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	136,692,003.30	60.43
5	企业短期融资券	90,812,000.00	40.15
6	中期票据	81,140,000.00	35.87
7	可转债(可交换债)	19,820,115.85	8.76
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	328,464,119.15	145.21

5.5 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	101800211	18新国贸MTN001	200,000	20,618,000.00	9.11
2	041800122	18六合经开CP001	200,000	20,206,000.00	8.93
3	101761036	17南山集MTN001	200,000	20,202,000.00	8.93
4	041800117	18盐城交通CP001	200,000	20,194,000.00	8.93
5	011801040	18恒逸SCP003	200,000	20,142,000.00	8.90

5.6 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。

5.7 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。

5.8 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。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期没有投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

无。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期没有投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	14,625.82
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	5,114,628.32
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,129,254.14

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	128036	金农转债	2,550,550.00	1.13
2	128034	江银转债	1,313,650.00	0.58
3	128015	久其转债	1,191,840.00	0.53
4	110042	航电转债	1,112,000.00	0.49
5	113505	杭电转债	895,000.00	0.40
6	127006	敖东转债	680,820.00	0.30
7	128022	众信转债	602,400.00	0.27
8	128027	崇达转债	597,150.00	0.26
9	128026	众兴转债	514,140.00	0.23
10	110043	无锡转债	490,950.00	0.22
11	127005	长证转债	478,100.00	0.21
12	128030	天康转债	449,700.00	0.20
13	128023	亚太转债	433,650.00	0.19
14	128037	岩土转债	348,480.00	0.15
15	123009	星源转债	222,140.00	0.10

5.11.5 报告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不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	华安年年红债券A	华安年年红债券C
本报告期期初基金份额总额	165,952,761.41	44,973,079.40
报告期基金总申购份额	218,158.80	21,809.11
减:报告期基金总赎回份额	-	-
报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	166,170,920.21	44,994,888.51

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20180701-20180930	47,754,536.77	0.00	0.00	47,754,536.77	22.61%
产品特有风险							
本基金报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过20%的情形,如该单一投资者大额赎回将可能导致基金份额净值波动风险,基金流动性风险等特定风险。							

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、《华安年年红定期开放债券型证券投资基金基金合同》

2、《华安年年红定期开放债券型证券投资基金招募说明书》

3、《华安年年红定期开放债券型证券投资基金托管协议》

9.2 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。

9.3 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。

华安基金管理有限公司

二〇一八年十月二十六日

华安纳斯达克100指数证券投资基金

2018年第三季度报告

2018年9月30日

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

报告送出日期:二〇一八年十月二十六日

§1 重要提示

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10月24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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华安纳斯达克100指数
基金主代码	040046
交易代码	040046
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年8月2日
报告期末基金份额总额	121,695,915.23份
投资目标	本基金为股票指数基金,通过严格的指数化投资策略与风险控制,紧密跟踪标的指数,力争实现跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金采用完全复制法,跟踪标的指数,以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则,进行被动式指数化投资。为更好地实现本基金的投资目标,本基金还将在条件允许的情况下投资于股指期货等金融衍生品,以期降低跟踪误差水平。本基金的风险控制目标是追求年跟踪误差不超过4%(以美元计价计算)。
业绩比较基准	纳斯达克100价格指数(Nasdaq 100 Price Index)收益率。
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。
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
境外资产托管人英文名称	State Street Bank and Trust Company
境外资产托管人中文名称	美国道富银行

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2018年7月1日-2018年9月30日)
1.本期已实现收益	-392,512.57
2.本期利润	17,654,097.33
3.加权平均基金份额本期利润	0.1994
4.期末基金资产净值	283,992,160.39
5.期末基金份额净值	2.334

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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

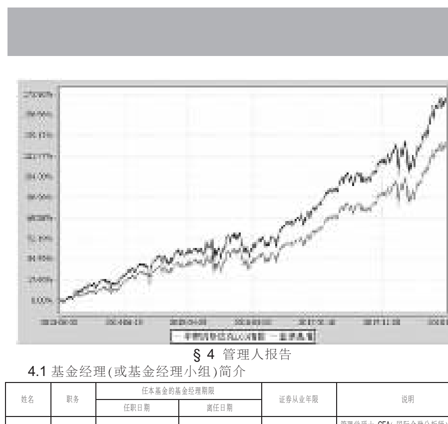
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	10.98%	0.71%	12.63%	0.80%	-1.65%	-0.09%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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

华安纳斯达克100指数证券投资基金

累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2013年8月2日至2018年9月30日)



§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
徐宜宜	本基金的基金经理,指数与量化投资部助理总监	2013-08-02	2018-09-28	12年	管理学硕士,CFA(国际金融分析师),FRM(金融风险管理师),12年证券、基金行业从业经历,具有基金从业资格。曾在美国道富全球投资管理公司担任对冲基金助理、量化分析师和风险管理师等职。2011年1月加入华安基金管理有限公司被动投资部从事海外被动投资的研究工作。2011年5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职务。2012年3月至2018年9月同时担任华安标普全球石油指数证券投资基金(LOF)的基金经理。2013年7月至2018年9月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月至2018年9月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及本基金的基金经理。2013年12月至2016年9月同时担任华安中证细分地产交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2014年8月至2018年9月同时担任华安国际龙头(DAX)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。2017年4月至2018年9月,同时担任华安中证定向增发事件指数证券投资基金(LOF)的基金经理。2018年4月至2018年9月,同时担任华安CES港股通精选100交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2018年5月至2018年9月,同时担任华安CES港股通精选100交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。
倪斌	本基金的基金经理	2018-09-10	-	8年	硕士研究生,8年基金行业从业经历。曾任毕马威华振会计师事务所审计员。2010年7月加入华安基金,历任基金运营部基金会计、指数与量化投资部分析师、基金经理助理。2018年9月起,同时担任华安标普全球石油指数证券投资基金(LOF)、本基金、华安国际龙头(DAX)交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金、华安CES港股通精选100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。

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 公平交易专项说明

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、发送邮件、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,超过投资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,则投资部门在风控部门的监督参与下,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;风险管理部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。

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,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,出现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0次,未出现异常交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

纳斯达克100指数报告期内出现震荡上行,从开盘6979.54点上涨至7627.65点,三季度上涨8.33%,而该季度的振幅为10.25%,盈利持续提升支撑指数上涨。我们认为影响纳斯达克100指数走势的因素有以下几点:1)美国经济表现依然强劲,就业市场强劲,失业率维持在4%以内,核心通胀稳步提升;2)美联储9月份议息会议加息25bps,鲍威尔讲话偏鹰派;3)中美贸易战阴霾笼罩全球贸易市场,企业盈利不确定性增加;4)二季度科技股业绩多数超预期,苹果,微软,亚马逊等公司股价继续提升。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2018年9月30日,本基金份额净值为2.334元,本报告期份额净值增长率为10.98%,同期业绩比较基准增长率为12.63%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

经过金融危机以来的调整,美国经济已处于全面复苏阶段,失业率回落至历史低位,企业盈利抬升带来资产价格显著回升。同时,美国经济的结构性变革愈加显著,在信息技术、半导体、生物医药等领域的领先优势继续扩大。2018年我们预计以高科技和高成长为代表的纳斯达克100指数走势依然会有较好的相对表现。全球仍然处在新一轮科技创新的浪潮之中,以人工智能为代表的科技创新将深刻影响世界并带来新的投资机会,而纳斯达克100指数的成分股是科技股中的翘楚,相对于成长性估值并不存在显著泡沫,未来表现依然偏乐观。

作为纳斯达克100指数基金的管理人,我们继续坚持积极将基金回报与指数相拟合的原则,降低跟踪偏离和跟踪误差,勤勉尽责,为投资者获得长期稳定的回报。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	264,921,200.86	89.18
	其中:普通股	260,235,482.61	87.61
	存托凭证	4,685,718.25	1.58
	优先股	-	-
	房地产信托	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中:远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
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	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	27,543,906.31	9.27
8	其他各项资产	4,589,627.43	1.55
9	合计	297,054,734.60	100.00

5.2 报告期末在各个国家(地区)证券市场的股票及存托凭证投资分布

国家(地区)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
美国	264,921,200.86	93.28
合计	264,921,200.86	93.28

5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

5.3.1 期末指数投资按行业分类的股票及存托凭证投资组合

金额单位:人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
信息技术	115,457,440.91	40.66
通讯服务	59,364,745.00	20.90
非必须消费品	45,078,021.74	15.87
保健	24,829,701.96	8.74
必须消费品	15,052,226.17	5.30
工业	5,139,065.08	1.81
合计	264,921,200.86	93.28

注:以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

5.3.2 期末积极投资按行业分类的股票及存托凭证投资组合

无。

5.4 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股票及存托凭证投资明细

5.4.1 指数投资期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权益投资明细

金额单位:人民币元

序号	公司名称(英文)	公司名称(中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家(地区)	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	APPLE INC	苹果公司	AAPL US	纳斯达克市场	美国	21,480	33,356,519.86	11.75
2	AMAZON.COM INC	亚马逊公司	AMZN US	纳斯达克市场	美国	2,200	30,313,882.72	10.67
3	MICROSOFT CORP	微软	MSFT US	纳斯达克市场	美国	33,900	26,671,642.13	9.39
4	GOOGLE INC-CL C	Alphabet公司	GOOG US	纳斯达克市场	美国	1,500	12,315,178.24	4.34
5	FACEBOOK INC	Facebook公司	FB US	纳斯达克市场	美国	10,700	12,105,479.58	4.26
6	GOOGLE INC-CL A	Alphabet公司	GOOGL US	纳斯达克市场	美国	1,300	10,794,868.16	3.80
7	CISCO SYSTEMS INC	思科	CSCO US	纳斯达克市场	美国	20,800	6,961,200.06	2.45
8	INTEL CORP	英特尔公司	INTC US	纳斯达克市场	美国	20,400	6,636,474.31	2.34
9	NVIDIA CORP	英伟达	NVDA US	纳斯达克市场	美国	2,700	5,219,620.52	1.84
10	COMCAST CORP-CLASS A	康卡斯特	CMCSA US	纳斯达克市场	美国	20,200	4,920,567.93	1.73

5.4.2 积极投资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益投资明细

无。

5.5 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

5.8 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金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

5.9 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基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	35,357.37
4	应收利息	6,235.18
5	应收申购款	4,548,034.88
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,589,627.43

5.10.4 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。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.10.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

5.10.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

无。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	52,264,523.45
报告期基金总申购份额	104,902,911.09
减:报告期基金总赎回份额	35,471,519.31
报告期基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	121,695,915.23

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、《华安纳斯达克100指数证券投资基金基金合同》

2、《华安纳斯达克100指数证券投资基金招募说明书》

3、《华安纳斯达克100指数证券投资基金托管协议》

8.2 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。

8.3 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。

华安基金管理有限公司

二〇一八年十月二十六日