华安安禧灵活配置混合型证券投资基金 2018年年度报告摘要

（原华安安禧保本混合型证券投资基金转型）

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
送出日期：二〇一九年三月三十日

§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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年3月26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。

原华安安禧保本混合型证券投资基金本报告期自2018年1月1日起至10月22日止，华安安禧灵活配置混合型证券投资基金本报告期自2018年10月23日（基金合同生效日）起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

2.1.1 华安安禧灵活配置混合型证券投资基金

基金名称	华安安禧灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	华安安禧灵活配置混合	
基金主代码	002398	
交易代码	002398	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018年10月23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	
报告期末基金份额总额	193,238,948.61份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华安安禧灵活配置混合A	华安安禧灵活配置混合C
下属分级基金的交易代码	002398	002399
报告期末下属分级基金的份额总额	171,801,295.80份	21,437,652.81份

2.1.2 华安安禧保本混合型证券投资基金

基金名称	华安安禧保本混合型证券投资基金	
基金简称	华安安禧保本混合	
基金主代码	002398	
交易代码	002398	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016年4月13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	
报告期末基金份额总额	351,809,640.81份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华安安禧保本混合A	华安安禧保本混合C
下属分级基金的交易代码	002398	002399
报告期末下属分级基金的份额总额	315,003,529.20份	36,806,111.61份

2.2 基金产品说明

2.2.1 华安安禧灵活配置混合型证券投资基金

投资目标	通过对权益类资产和固定收益类资产的灵活配置充分捕捉各证券子市场的绝对收益机会，在合理控制风险、保障基金资产流动性的前提下，力求持续高效地获取稳健回报。
投资策略	本基金为混合型基金，在投资中将通过对宏观经济、国家政策等可能影响证券市场的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，确定基金资产在权益类资产和固定收益类资产之间的配置比例；当市场环境发生变化时，本基金将依托仓位弹性优势并借助股指期货等金融工具快速灵活地作出反应，对大类资产配置比例进行及时调整。 此外，本基金还将广泛运用各种定量和定性分析模型研究和比较不同证券子市场和不同金融工具的收益及风险特征，积极寻找各种可能的套利和价值增长的机会，以确定基金资产在各类具体券种间的配置比例。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×60%＋中国债券总指数收益率×40%
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金，其预期收益和风险高于货币市场基金、债券型基金，而低于股票型基金。

2.2.2 华安安禧保本混合型证券投资基金

投资目标	通过运用投资组合保险技术，有效控制本金损失的风险，在本金安全的基础上力争实现基金资产的稳定增值。
投资策略	本基金采用基于VaR的风险乘数全程可变的CPPI策略（恒定比例组合保险策略）。基金管理人主要通过数量分析，根据市场的波动来调整和修正安全垫放大倍数（即风险乘数），动态调整保本资产与风险资产的投资比例，以确保基金在一段时间以后其价值不低于事先设定的基一目标价值，从而实现投资组合的保本增值目标。同时，本基金将通过对宏观经济、国家政策等可能影响证券市场的重要因素的研究和预测，分析和比较不同证券子市场和不同金融工具的收益及风险特征，确定具体的投资券种选择，积极寻找各种可能的套利和价值增长机会。
业绩比较基准	三年期银行定期存款收益率（税后）
风险收益特征	本基金为保本混合型基金，属于证券投资基金中的低风险品种。投资者投资于保本基金并不等于将资金作为存款放在银行或存款类金融机构，保本基金在极端情况下仍然存在本金损失的风险。

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陆璎	田青
	联系电话	021-38969999	010-67595096
	电子邮箱	luying@huaan.com.cn	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		40088850099	010-67595096
传真		021-68863414	010-66275853

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告摘要的管理人互联网网址	www.huaan.com.cn
基金年度报告备置地点	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、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

3.1.1 华安安禧灵活配置混合型证券投资基金

金额单位：人民币元

3.1.1.1期间数据和指标	报告期 2018年10月23日至2018年12月31日	
	华安安禧灵活配置混合A	华安安禧灵活配置混合C
本期已实现收益	181,055.53	-7,138.03
本期利润	-16,538.85	-31,023.74
加权平均基金份额本期利润	-0.0001	-0.0012
本期加权平均净值利润率	-0.01%	-0.12%
本期基金份额净值增长率	0.04%	-0.08%
3.1.1.2期末数据和指标	2018年末	
	华安安禧灵活配置混合A	华安安禧灵活配置混合C
期末可供分配利润	8,320,017.68	711,661.73
期末可供分配基金份额利润	0.0484	0.0332
期末基金资产净值	180,121,313.48	22,149,314.54
期末基金份额净值	1.0484	1.0332
3.1.1.3累计期末指标	2018年末	
	华安安禧灵活配置混合A	华安安禧灵活配置混合C
基金份额累计净值增长率	0.04%	-0.08%

3.1.2 华安安禧保本混合型证券投资基金

金额单位：人民币元

3.1.2.1期间数据和指标	报告期 2018年1月1日至2018年10月22日		2017年		2016年	
	华安安禧保本混合A	华安安禧保本混合C	华安安禧保本混合A	华安安禧保本混合C	华安安禧保本混合A	华安安禧保本混合C
本期已实现收益	52,151,072.34	2,572,232.30	136,856,553.25	7,559,844.61	34,976,245.38	1,888,147.72
本期利润	56,014,518.01	2,770,236.39	158,836,907.84	8,795,619.65	10,410,023.49	176,790.22
加权平均基金份额本期利润	0.0291	0.0248	0.0577	0.0507	0.0031	0.0007
本期加权平均净值利润率	2.73%	2.36%	5.61%	4.96%	0.31%	0.07%
本期基金份额净值增长率	2.66%	2.20%	5.68%	5.21%	0.30%	-0.10%
3.1.2.2 期末数据和指标	报告期末(2018年10月22日)		2017年末		2016年末	
	华安安禧保本混合A	华安安禧保本混合C	华安安禧保本混合A	华安安禧保本混合C	华安安禧保本混合A	华安安禧保本混合C
期末可供分配利润	15,200,844.35	1,258,259.26	130,893,921.96	7,042,341.91	8,848,686.79	-130,602.50
期末可供分配基金份额利润	0.0483	0.0342	0.0602	0.0509	0.0028	-0.0006
期末基金资产净值	330,204,373.55	38,064,370.87	2,305,425,593.29	145,334,983.30	3,179,131,524.33	226,752,712.69
期末基金份额净值	1.0480	1.0340	1.0600	1.0510	1.0030	0.9990
3.1.2.3 累计期末指标	报告期末(2018年10月22日)		2017年末		2016年末	
	华安安禧保本混合A	华安安禧保本混合C	华安安禧保本混合A	华安安禧保本混合C	华安安禧保本混合A	华安安禧保本混合C
基金份额累计净值增长率	8.82%	7.41%	6.00%	5.10%	0.30%	-0.10%

3.2 基金净值表现

3.2.1 华安安禧灵活配置混合型证券投资基金

3.2.1.1 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
过去三个月	0.38%	0.02%	0.71%	0.01%	-0.33%	0.01%
过去六个月	1.23%	0.03%	1.39%	0.01%	-0.16%	0.02%
过去一年	3.34%	0.08%	2.77%	0.01%	0.57%	0.07%
自基金成立起至今	8.82%	0.08%	6.95%	0.01%	1.87%	0.07%

华安安禧保本混合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
过去三个月	0.29%	0.02%	0.71%	0.01%	-0.42%	0.01%
过去六个月	0.95%	0.03%	1.39%	0.01%	-0.44%	0.02%
过去一年	2.79%	0.08%	2.77%	0.01%	0.02%	0.07%
自基金成立起至今	7.41%	0.08%	6.95%	0.01%	0.46%	0.07%

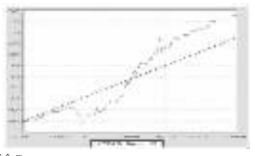
3.2.3自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华安安禧保本混合型证券投资基金

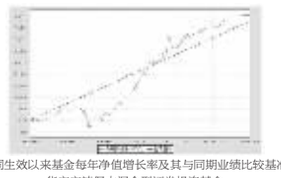
自基金合同生效以来份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2016年4月13日至2018年10月22日)

1、华安安禧保本混合A



2、华安安禧保本混合C

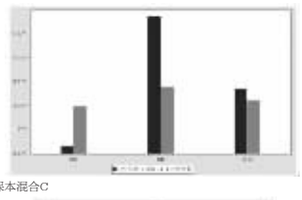


3.2.4 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

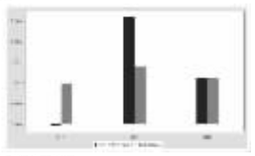
华安安禧保本混合型证券投资基金

自基金合同生效以来净值增长率与业绩比较基准收益率的柱形对比图

1、华安安禧保本混合A



2、华安安禧保本混合C



3.3过去三年基金的利润分配情况

3.3.1 华安安禧灵活配置混合型证券投资基金

无

3.3.2 华安安禧保本混合型证券投资基金

1、华安安禧保本混合A：

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2018	0.400	73,215,537.70	-	73,215,537.70	-
2017	-	-	-	-	-
2016	-	-	-	-	-
合计	0.400	73,215,537.70	-	73,215,537.70	-

2、华安安禧保本混合C：

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2018	0.400	4,109,612.25	-	4,109,612.25	-
2017	-	-	-	-	-
2016	-	-	-	-	-
合计	0.400	4,109,612.25	-	4,109,612.25	-

§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15亿元人民币，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证券股份有限公司、上海上国投资产管理有限公司、上海锦江国际投资管理有限公司、上海工业投资（集团）有限公司和国泰君安投资管理股份有限公司。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12月31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108只开放式基金，管理资产规模达到2756.06亿元人民币。

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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
杨明	本基金的基金经理、投资研究部高级总监	2018-10-23	-	18年	中央财经大学硕士研究生，18年银行、基金从业经历，曾在上海银行从事信贷员、交易员及风险管理，2004年10月加入华安基金管理有限公司，任研究发展部研究员，现任投资研究部总监。2013年6月起担任华安策略优选混合型证券投资基金的基金经理。2014年6月起担任投资研究部高级总监。2015年6月至2016年9月同时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3月至2018年3月同时担任华安沪港深外延增长灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016年5月至2018年10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。2018年10月起，同时担任本基金的基金经理。2018年1月起，同时担任华安红利精选混合型证券投资基金的基金经理。2018年4月起，同时担任华安睿明两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018年12月起，同时担任华安创新证券投资基金的基金经理。
朱才敏	本基金的基金经理	2018-10-23	-	11年	金融工程硕士，具有基金从业资格证书，11年基金行业从业经历。2007年7月应届生毕业进入华安基金，历任金融工程部风险管理员、产品经理、固定收益部研究员、基金经理助理等职务，2014年11月至2017年7月，同时担任华安月月鑫短期理财债券型证券投资基金、华安季季鑫短期理财债券型证券投资基金、华安季鑫短期理财债券型证券投资基金的基金经理。2014年11月起，同时担任华安红财通货币市场基金、华安双债添利债券型证券投资基金的基金经理。2015年5月起同时担任华安新回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016年4月至2018年10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。2018年10月起，同时担任本基金的基金经理。2016年9月至2018年1月，同时担任华安新财富灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016年11月至2017年12月，同时担任华安新希望灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2016年12月起，同时担任华安新泰利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017年3月起，同时担任华安睿安定期开放混合型证券投资基金的基金经理。
陆秋渊	本基金的基金经理	2018-10-23	-	11年	复旦大学经济学硕士研究生，11年基金行业从业经验。2007年7月应届毕业进入华安基金，任全球投资部研究员。2017年6月起，担任华安护港深机会灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018年9月至2018年10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。2018年10月起，同时担任本基金的基金经理。2018年10月起，同时担任华安核心优选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公平交易制度和控制方法

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wind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。

4.3.2公平交易制度的执行情况

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。

4.3.3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4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

2018年，美国经济平稳增长，减税刺激经济，失业率维持低位，通胀在目标水平徘徊，联储在3、6、9、12月4次调高联邦基准利率，加息对经济和资本市场的影响逐渐显现，4季度经济出现放缓迹象，PMI指数明显走低，美股出现大幅调整，美债收益率也大幅走低。国内经济继续下行：在中美贸易摩擦的影响下，外贸呈现较为明显的抢跑效应，进出口呈现前高后低；固定资产投资持续下滑，4季度小幅企稳，基建投资在18年出现断崖式下滑，制造业投资持续回升，房地产投资小幅下滑；消费增速继续小幅下行。通胀方面，CPI先上后下，全年在2.1%左右；PPI从2季度后持续下降，全年在3.5%附近，较17年明显下行。在严监管、去杠杆取得实效且经济下行压力渐增的背景下，货币政策逐步转向宽松，通过（定向）降准、公开市场、MLF等操作对市场流动性进行调节；去杠杆政策转向稳杠杆政策，推出TMLF鼓励银行向小微企业放贷，鼓励设立纾困基金、CRMW等帮助民营和小微企业融资，引导金融支持实体经济。货币市场持续宽松，银行间7天回购利率均值3.02%（较17年下降33bps），3个月Shibor均值3.75%（较17年下降62bps），1年期国债、国开债收益率较上年末分别下行119bps、193bps，NCD发行利率和二级利率较上年末大幅走低130bps以上。在资金面宽松、经济下行以及融资需求疲弱的带动下，债券市场呈牛市行情，10年国债、国开债收益率较上年末分别走低65bps、118bps；高等级信用债收益率跟随利率债大幅走低；中低等级信用债则受信用爆雷频发影响，交投清淡，4季度后受政策扶持影响，有所回暖。2018年股市全年呈现大幅震荡下行的态势。沪深300指数下跌25.3%，而创业板指下跌28.65%。全年我们保持了极低的股票仓位，选择品种主要是估值在历史底部、业绩稳定性较强且宏观经济相关性较低的个股。债券方面，我们保持对利率债和高等级信用债的基本配置，维持基金中短久期。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金于2018年10月23日转型，转型后截至2018年12月31日华安安禧灵活配置混合A份额净值为1.0484元，C份额净值为1.0332元；华安安禧灵活配置混合A份额净值增长率为0.04%，C份额净值增长率为-0.08%，同期业绩比较基准增长率为-3.78%。

转型前截至2018年10月22日，华安安禧保本A份额净值为1.048，C份额净值为1.034；华安安禧保本A份额净值增长率为2.66%。C份额净值增长率为2.20%，同期业绩比较基准增长率为2.22%。

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2019年，美国经济增长趋缓，减税刺激作用逐步消退，美联储加息空间大幅下降。国内经济仍面临下行压力，近期中美贸易摩擦缓和、但全球需求放缓决定出口大概率走弱，随着工业企业利润的走弱、制造业投资预计将见顶回落，房地产投资也将有明显回落，消费增速受可支配收入下降带动或将延续回落。政策层面陆续出台逆周期政策对冲经济下行压力，基建投资仍将肩负托底经济的重任，减税降费政策的出台对消费会有一定的支撑，货币政策预计将是定向政策和总量政策相结合引导货币流向实体经济。预计资金面在上半年仍将维持宽松，随着实体经济融资需求的增加，资金面会逐步走向平衡；人民币在中美贸易谈判走向积极的背景下，预计将保持稳中走升的态势，若谈判出现不确定影响则可能走贬。随着逆周期政策的逐步落地，利率债将逐步承压，因此预计长久期利率在2019年受基本面变化和政策影响将以震荡为主，中长期高等级信用债预计将跟随利率债变化，短期限利率债、信用债收益率预计受流动性的带动在上半年低位波动、而后走高，信用风险仍需特别关注。伴随着比较宽松的财政与货币政策，2019年经济有望在下半年见底；股票市场一般会提前经济基本面反应，因此，总体我们对2019年股票市场的走势比较具有信心。考虑到产品的属性，我们仍将保持谨慎的策略，在获得一定的安全垫的情况下，逐步提高仓位，主要配置方向包括先进制造、医疗、地产等板块。债券方面，我们将保持高信用等级策略，维持基金中短久期。本基金将秉承稳健、专业的投资理念，勤勉尽责地维护持有人利益。

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，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

本报告期内实施了2018年度第一次分红，分红方案为：0.400元/10份（原华安安禧保本混合A）、0.400元/10份（原华安安禧保本混合C）。权益登记日及除息日：2018年7月17日；现金红利发放日：2018年7月18日。

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

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

本基金于2018年7月17日（转型前）进行分红，每10份派发红利0.40元，其中华安安禧保本A分红金额为73,215,537.70元，华安安禧保本C分红金额为4,109,612.25元。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

§6 审计报告

6.1 华安安禧灵活配置混合型证券投资基金

安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)审计了2018年12月31日的资产负债表、2018年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表和财务报表附注，并出具了标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

6.2 华安安禧保本混合型证券投资基金

安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)审计了2018年10月22日的资产负债表、2018年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表和财务报表附注，并出具了标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7年度财务报表

7.1 华安安禧灵活配置混合型证券投资基金

7.1.1资产负债表

会计主体：华安安禧灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2018年12月31日

单位：人民币元

资产	本期末 2018年12月31日
资产：	-
银行存款	4,235,517.13
结算备付金	418,500.45
存出保证金	10,456.60
交易性金融资产	197,922,000.00
其中：股票投资	3,641,000.00
基金投资	-
债券投资	194,281,000.00
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	-
应收利息	2,200,788.91
应收股利	-
应收申购款	700.08
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	204,787,963.17
负债和所有者权益	本期末 2018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	-
应付赎回款	1,762,661.66
应付管理人报酬	275,428.02
应付托管费	45,904.67
应付销售服务费	11,691.46
应付交易费用	10,818.42
应交税费	10,830.92
应付利息	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	400,000.00
负债合计	2,517,335.15
所有者权益：	-
实收基金	193,238,948.61
未分配利润	9,031,679.41
所有者权益合计	202,270,628.02
负债和所有者权益总计	204,787,963.17

注：(1)报告截止日2018年12月31日，基金份额净值1.0467元，基金份额总额193,238,948.61份。其中A类基金份额净值1.0484元，基金份额总额171,801,295.80份；C类基金份额净值1.0332元，基金份额总额21,437,652.81份。

(2)本基金由华安安禧保本混合型证券投资基金转型而成，转型日为2018年10月23日。

7.1.2 利润表

会计主体：华安安禧灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2018年10月23日至2018年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2018年10月23日至2018年12月31日
一、收入	847,450.46
1.利息收入	1,038,451.88
其中：存款利息收入	218,982.01
债券利息收入	774,498.72
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	44,971.15
其他利息收入	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	28,356.67
其中：股票投资收益	14,666.67
基金投资收益	-
债券投资收益	13,690.00
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	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-221,480.09
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	2,122.00
减：二、费用	895,013.05
1. 管理人报酬	661,581.04
2. 托管费	110,263.51
3. 销售服务费	29,241.34
4. 交易费用	7,338.84
5. 利息支出	4,995.31
其中：卖出回购金融资产支出	4,995.31
6. 税金及附加	1,565.39
7. 其他费用	80,027.62
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-47,562.59
减：所得税费用	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-47,562.59

7.1.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安安禧灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2018年10月23日至2018年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2018年10月23日至2018年12月31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）	351,809,640.81	16,459,103.61	368,268,744.42
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-47,562.59	-47,562.59
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）	-158,570,692.20	-7,379,861.61	-165,950,553.81
其中：1.基金申购款	230,669.45	8,480.97	239,150.42
2.基金赎回款	-158,801,361.65	-7,388,342.58	-166,189,704.23
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）	193,238,948.61	9,031,679.41	202,270,628.02

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：朱学华，主管会计工作负责人：赵敏，会计机构负责人：陈林

7.1.4 报表附注

7.1.4.1 基金基本情况

华安安禧灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)，由华安安禧保本混合型证券投资基金转型而成，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]143号《关于准予华安安禧保本混合型证券投资基金注册的批复》的核准，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2016年4月13日生效，首次设立募集规模为3,657,725,249.27份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人及注册登记机构为华安基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《华安安禧保本混合型证券投资基金基金合同》以及《华安安禧保本混合型证券投资基金保本期到期安排及转型为华安安禧灵活配置混合型证券投资基金相关业务规则的公告》的约定，本基金自2018年10月23日起转型为非保本的混合型证券投资基金并更名为华安安禧灵活配置混合型证券投资基金。

本基金根据申购费用收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人申购时收取申购费用的，称为A类基金份额；在投资人申购时不收取申购费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为C类基金份额。

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（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证、股指期货等权益类金融工具，债券等固定收益类金融工具（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、中小企业私募债、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、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的相关规定）。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：股票占基金资产的比例为0-95%；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的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；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。

本基金整体业绩比较基准：沪深300指数收益率×60%＋中国债券总指数收益率×40%。

7.1.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《证券投资基金信息披露管