华安CES港股通精选100交易型开放式指数证券投资基金 2018年年度报告摘要

基金管理人:华安基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期: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。

基金托管人中国农业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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告期自2018年4月27日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1基金基本情况

基金简称	华安CES港股通精选100ETF
场内简称	港股100
基金主代码	513900
交易代码	513900
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2018年4月27日
基金管理人	华安基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	77,978,000.00份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

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。
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。
业绩比较基准	中华交易服务港股通精选100指数收益率（经汇率调整）
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。本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股,具有与标的指数相似的风险收益特征。

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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陆滢	贺倩
	联系电话	021–38969999	010–66060069
	电子邮箱	luying@huaan.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4008850099	95599
传真		021–68863414	010–68121816

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层、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

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2018年4月27日（基金合同生效日）至2018年12月31日
本期已实现收益	–434,089.59
本期利润	–8,203,025.53
加权平均基金份额本期利润	–0.0779
本期基金份额净值增长率	–9.53%
3.1.2 期末数据和指标	2018年末
期末可供分配基金份额利润	–0.0953
期末基金资产净值	70,550,146.02
期末基金份额净值	0.9047

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: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）。

4、本基金于2018年4月27日成立,截止本报告期末,本基金成立不满一年。

5、合同生效日当年的主要会计数据和财务指标按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

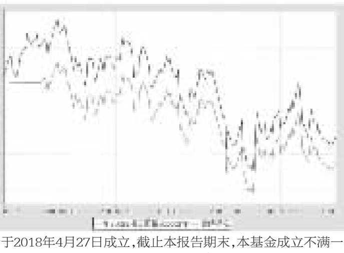
3.2 基金净值表现

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
过去三个月	–7.41%	1.52%	–7.56%	1.59%	0.15%	–0.07%
过去六个月	–8.19%	1.27%	–8.96%	1.34%	0.77%	–0.07%
过去一个月	–3.87%	1.15%	–3.80%	1.20%	–0.07%	–0.05%
自基金合同生效起至今	–9.53%	1.17%	–6.35%	1.28%	–3.18%	–0.11%

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

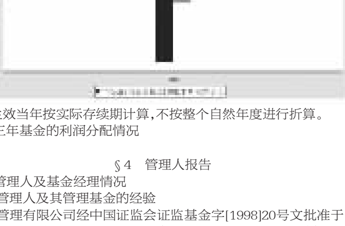
华安CES港股通精选100交易型开放式指数证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2018年4月27日至2018年12月31日)



注:本基金于2018年4月27日成立,截止本报告期末,本基金成立不满一年。基金管理人已自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。

3.2.3 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CES港股通精选100交易型开放式指数证券投资基金
自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



注:合同生效当年按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

无。

§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		
徐宜宜	本基金的基金经理,指数与量化投资部助理总监	2018–05–30	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华安纳斯达克100指数证券投资基金的基金经理。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,同时担任本基金的基金经理。
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）、华安纳斯达克100指数证券投资基金、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、本基金及其联接基金的基金经理。
苏圻涵	本基金的基金经理、全球投资部副总监	2018–10–31	–	14年	博士研究生,14年证券、基金从业经历,持有基金从业执业证书。2004年6月加入华安基金管理有限公司,曾先后于研究发展部、战略策划部工作,担任行业研究员和产品经理职务。目前任职于全球投资部,担任基金经理职务。2010年9月起担任华安香港精选股票型证券投资基金的基金经理。2011年5月起同时担任华安大中华升级股票型证券投资基金的基金经理。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3月至2018年2月同时担任华安全球美元收益债券型证券投资基金的基金经理。2016年6月至2018年2月同时担任华安全球美元票息债券型证券投资基金的基金经理。2017年2月起,同时担任华安沪港深通精选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017年5月至2018年9月,同时担任华安沪港深机会灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017年6月起,同时担任华安文体健康主题灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017年8月起,担任华安大安全主题灵活配置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 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。

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年国内经济增速放缓,全年实际GDP同比增长6.6%,较上年回落0.2个百分点。上半年,在去杠杆、严监管政策持续发力的环境下,表外融资大幅收缩,社融增速迅速回落,实体经济信用扩张受限;外部方面,中美贸易摩擦爆发,成为全年扰动全球资本市场的最大不确定因素。面对经济下行压力,下半年国内央行货币政策放松加码,各项针对民企融资难的多项政策陆续出台,但整个2018年实体信用未出现显著改善,需求仍延续疲弱态势,企业的盈利增速持续回落,尤其是商誉减值等因素对部分中小创公司业绩产生较大负面影响。受估值与业绩的双重压制,全年A股市场表现惨淡,各主要指数全线下跌,中华港股精选100指数全年下跌14.68%。

投资管理上,基金采取完全复制的管理方法跟踪指数,并利用量化工具进行精细化管理,从而控制每日跟踪误差、以及净值表现与业绩基准的偏差幅度。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截止2018年12月31日,本基金份额净值为0.9047元,本报告期份额净值增长率为–9.53%,同期业绩比较基准增长率为–6.35%。

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,尽管国内宏观经济下行的压力依然较大,出口需求及消费预计仍将维持低迷,房地产投资增速将逐步下行,而基建投资的提速将承担起经济托底的重任。但另一方面,逆周期调节的货币政策及财政政策将进一步加大,尤其在美国经济下行压力加大,美联储货币政策的面临转向的背景下,国内货币政策调节空间进一步打开。外部方面,目前来看中美间贸易领域争端达成和解的概率较高。

2019年前两月,受全球流动性边际宽松、中美贸易摩擦趋缓,国内社融数据大幅改善等影响,港股市场迎来反弹。

后续港股市场仍可能受到全球经济增长放缓的影响,而中美贸易谈判能否取得超预期进展、国内社融数据的能否从总量的宽松到结构改善、以及企业盈利的能否迎来提升仍存诸多不确定因素。但我们认为,市场经过2018年的大度下调,目前的港股估值已经充分反映经济低增长的悲观预期,在全球央行纷纷"转鸽"的背景下,港股市场的流动性有望边际改善。本基金跟踪the A+H的纯港股投资标的,对新经济行业覆盖率较高,经过前期调整,目前从估值和股息率角度都已经具备中长期投资价值。

作为基金管理人,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

在托管本基金的过程中,本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定,对本基金基金管理人—华安基金管理有限公司 2018 年 1 月 1 日至 2018年12月31日基金的投资运作,进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督,认真履行了托管人的义务,没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为,华安基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上,不存在损害基金份额持有人利益的行为;在报告期内,严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认为,华安基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定,基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整,未发现有损害基金持有人利益的行为。

§6 审计报告

本报告期的基金财务会计报告经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙)审计,注册会计师单峰 魏佳亮签字出具了普华永道中天审字(2019)第23338号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 资产负债表

会计主体:华安CES港股通精选100交易型开放式指数证券投资基金
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	3,146,275.71
结算备付金	–
存出保证金	–
交易性金融资产	67,898,903.99
其中:股票投资	67,898,903.99
基金投资	–
债券投资	–
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	627.35
应收股利	8,610.48
应收申购款	–
递延所得税资产	–
其他资产	–
资产总计	71,054,417.53
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	14.67
应付赎回款	–
应付管理人报酬	36,480.02
应付托管费	6,080.01
应付销售服务费	–
应付交易费用	28,531.97
应交税费	–
应付利息	–
应付利润	–
递延所得税负债	–
其他负债	433,164.84
负债合计	504,271.51
所有者权益:	–
实收基金	77,978,000.00
未分配利润	–7,427,853.98
所有者权益合计	70,550,146.02
负债和所有者权益总计	71,054,417.53

注:1. 报告截止日2018年12月31日,基金份额净值0.9047元,基金份额总额77,978,000.00份。

2.本财务报表的实际编制期间为2018年4月27日(基金合同生效日)至2018年12月31日止期间。

7.2 利润表

会计主体:华安CES港股通精选100交易型开放式指数证券投资基金
本报告期:2018年4月27日（基金合同生效日）至2018年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2018年4月27日（基金合同生效日）至2018年12月31日
一、收入	–6,831,705.42
1.利息收入	538,690.04
其中:存款利息收入	234,808.60
债券利息收入	–
资产支持证券利息收入	–
买入返售金融资产收入	303,881.44
其他利息收入	–
2.投资收益（损失以"–"填列）	256,051.93
其中:股票投资收益	–773,911.58
基金投资收益	–
债券投资收益	–
资产支持证券投资收益	–
贵金属投资收益	–
衍生工具收益	3,836.00
股利收益	1,026,127.51
3.公允价值变动收益（损失以"–"号填列）	–7,768,935.94
4.汇兑收益（损失以"–"号填列）	–
5.其他收入（损失以"–"号填列）	142,488.55
减:二、费用	1,371,320.11
1. 管理人报酬	418,273.03
2. 托管费	69,712.18
3. 销售服务费	–
4. 交易费用	381,894.76
5. 利息支出	–
其中:卖出回购金融资产支出	–
6. 税金及附加	12.66
7. 其他费用	501,427.48
三、利润总额（亏损总额以"–"号填列）	–8,203,025.53
减:所得税费用	–
四、净利润（净亏损以"–"号填列）	–8,203,025.53

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体:华安CES港股通精选100交易型开放式指数证券投资基金
本报告期:2018年4月27日（基金合同生效日）至2018年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2018年4月27日（基金合同生效日）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）	284,978,000.00	–	284,978,000.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	–	–8,203,025.53	–8,203,025.53
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）	–207,000,000.00	775,171.55	–206,224,828.45
其中:1.基金申购款	84,000,000.00	413,399.96	84,413,399.96
2.基金赎回款	–291,000,000.00	361,771.59	–290,638,228.41
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）	77,978,000.00	–7,427,853.98	70,550,146.02

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码（序号）从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

7.4 报表附注

7.4.1基金基本情况

华安CES港股通精选100交易型开放式指数证券投资基金(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")证监许可[2018]第369号《关于准予华安沪深300交易型开放式指数证券投资基金变更注册的批复》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CES港股通精选100交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金,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284,978,000.00元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2018)第0289号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华安CES港股通精选100交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于2018年4月27日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为284,978,000.00份基金份额,无认购资金利息折合基金份额。本基金的基金管理人为华安基金管理有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

经上海证券交易所(以下简称"上交所")自律监管决定书[2018]62号文审核同意,本基金284,978,000.00份基金份额于2018年5月25日在上交所挂牌交易。本基金上市交易后,所有的基金份额均可进行交易,不存在未上市交易的基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安CES港股通精选100交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的标的指数为中华交易服务港股通精选100指数,投资目标是紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化;本基金的主要投资范围为标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标,本基金可少量投资于非成份股(包括港股通标的股票和中国证监会核准发行的股票)、国债、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债券、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款、股指期货、权证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)。本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不低于基金资产的90%。本基金的业绩比较基准为:中华交易服务港股通精选100指数收益率(经汇率调整)。

本基金的基金管理人华安基金管理有限公司以本基金为目标ETF,于2018年5月30日募集成立了华安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(以下简称"华安CES港股通精选100ETF联接")。华安CES港股通精选100ETF联接基金为契约型开放式基金,投资目标与本基金类似,将绝大多数基金资产投资于本基金。

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2019年3月26日批准报出。

7.4.2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日及以后期间颁布的《企业会计准则–基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称"企业会计准则")、中国证监会颁布的《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〉》、中国证券投资基金业协会(以下简称"中国基金业协会")颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华安CES港股通精选100交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2018年4月27日(基金合同生效日)至2018年12月31日止期间的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12月31日的财务状况以及2018年4月27日(基金合同生效日)至2018年12月31日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4重要会计政策和会计估计

7.4.4.1会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为2018年4月27日(基金合同生效日)至2018年12月31日。

7.4.4.2记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外,以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

7.4.4.4金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时,按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,取得时发生的相关交易费用计入当期损益;对于支付的价款中包含的资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息,单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,按照公允价值进行后续计量;对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法,以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的,予以终止确认:(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止;(2) 该金融资产已转移,且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方;或者(3) 该金融资产已转移,虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬,但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时,其账面价值与收到的对价的差额,计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时,终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额,计入当期损益。

7.4.4.5金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值:

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值;估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的,按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的,应对市场交易价格进行调整,确定公允价值。与上述投资品种相同,但具有不同特征的,应以相同资产或负债的公允价值为基础,并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等,如果该限制是针对资产持有者的,那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外,基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场,采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时,优先使用可观察输入值,只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下,才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件,应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的;且2) 交易双方准备按净额结算时,金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

7.4.4.8损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列,并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益;于处置时,其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益,其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配。当基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到1%以上时,基金管理人可进行收益分配。本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。收益分配不须以弥补浮动亏损为前提,收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

以公允价值计量的外币非货币性项目,于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币,所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

7.4.4.13分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部,以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分:(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用;(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果,以决定向其配置资源、评价其业绩;(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征,并且满足一定条件的,则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作,不需要披露分部信息。

7.4.4.14其他重要的会计政策和会计估计

无。

7.4.5会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6税项

根据财政部、国家税务总局财税[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[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为,暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票的转让收入免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务,以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票的差价收入,股票的股息、红利收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

(3) 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,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。

对基金通过沪港通投资香港联交所上市H股取得的股息红利,H股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称"中国结算")提出申请,由中国结算向H股公司提供内地个人投资者名册,H股公司按照20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通投资香港联交所上市的非H股取得的股息红利,由中国结算按照20%的税率代扣个人所得税。

(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。基金通过沪港通买卖、继承、赠与联交所上市股票,按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

7.4.7关联方关系

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、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司（简称"中国农业银行"）	基金托管人、基金销售机构
国泰君安创新投资有限公司	基金管理人的股东（2018年12月5日前）
上海国际信托有限公司	基金管理人的股东（2018年12月5日前）
国泰君安证券股份有限公司("国泰君安")	基金管理人的股东(自2018年12月5日起)、基金销售机构
上海上国投资产管理有限公司	基金管理人的股东（自2018年12月5日起）
上海工业投资(集团)有限公司	基金管理人的股东
上海锦江国际投资管理有限公司	基金管理人的股东
国泰君安投资管理股份有限公司	基金管理人的股东
华安资产管理（香港）有限公司	基金管理人的全资子公司
华安未来资产管理（上海）有限公司	基金管理人的全资子公司
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("华安CES港股通精选100联接基金")	基金管理人管理的其他基金

注:1.下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

2.根据华安基金管理有限公司于2018年12月7日发布的公告,经华安基金管理有限公司股东会第五十六次会议决议、第五十九次会议决议及中国证券监督管理委员会证监许可[2018]2012号文核准,华安基金管理有限公司股东国泰君安创新投资有限公司、上海国际信托有限公司将各持有的华安基金管理有限公司20%的股权分别转让给国泰君安证券股份有限公司和上海上国投资产管理有限公司。自2018年12月5日起,华安基金管理有限公司股东变更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。

7.4.8本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1通过关联方交易单元进行的交易

无。

7.4.8.2关联方报酬

7.4.8.2.1基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2018年4月27日（基金合同生效日）至2018年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	418,273.03
其中:支付销售机构的客户维护费	–

注:支付基金管理人华安基金公司的管理人报酬按前一日基金资产净值0.60%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 × 0.60%/ 当年天数。

7.4.8.2.2基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2018年4月27日（基金合同生效日）至2018年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	69,712.18

注:支付基金托管行中国农业银行的托管费按前一日基金资产净值0.10%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 × 0.10%/ 当年天数。

7.4.8.3与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.8.4各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.8.4.2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

份额单位:份

关联方名称	本期末2018年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
华安CES港股通精选100联接基金	68,000,000.00	87.20%

7.4.8.5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4月27日（基金合同生效日）至2018年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	3,146,275.71	207,577.25

注:本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管,按银行同业利率计息。

7.4.8.6本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.8.7其他关联交易事项的说明

无。

7.4.9期末（2018年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

7.4.9.2期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.9.3期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1银行间市场债券正回购

无。

7.4.9.3.2交易所市场债券正回购

无。

7.4.10有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1)基金申购款

于2018年4月27日(基金合同生效日)至2018年12月31日止期间,本基金申购基金份额的对价总额为84,413,399.96元,其中包括以股票支付的申购款零元和以现金支付的申购款84,413,399.96元。

(2)公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次,由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定:

第一层次:相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次:除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次:相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于2018年12月31日,本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为67,898,903.99元,无属于第二或第三层次的余额。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券,若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况,本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次;并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2018年12月31日,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债,其账面价值与公允价值相差很小。

(3) 除基金申购款和公允价值外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8投资组合报告

8.1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	67,898,903.99	95.56
	其中:股票	67,898,903.99	95.56
2	固定收益投资	–	–
	其中:债券	–	–
	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	3,146,275.71	4.43
7	其他各项资产	9,237.83	0.01
8	合计	71,054,417.53	100.00

8.2报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
A 基础材料	188,930.63	0.27
B 消费者非必需品	5,688,449.87	8.06
C 消费者常用品	2,659,683.20	3.77
D 能源	2,188,659.98	3.10
E 金融	20,328,313.15	28.81
F 医疗保健	1,870,415.38	2.65
G 工业	4,307,188.91	6.11
H 信息技术	7,957,122.69	11.28
I 电信服务	5,186,933.14	7.35
J 公用事业	6,088,897.80	8.63
K 房地产	11,434,309.24	16.21
合计	67,898,903.99	96.24

8.3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

8.3.1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

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	00005	汇丰控股	122,800	6,972,308.93	9.88
2	01299	友邦保险	121,200	6,902,703.60	9.78
3	00700	腾讯控股	22,700	6,245,378.36	8.85
4	00941	中国移动	61,500	4,060,332.71	5.76
5	00388	香港交易所	12,500	2,481,836.50	3.52
6	00883	中国海洋石油	179,000	1,897,761.58	2.69
7	00001	长和	27,000	1,779,036.48	2.52
8	00002	中电控股	20,500	1,589,645.85	2.25
9	00016	新鸿基地产	14,500	1,417,866.84	2.01
10	00003	香港中华煤气	92,600	1,314,405.14	1.86

8.3.2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本基金本报告期末未持有积极投资股票。

8.4报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1累计买入金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例（%）
1	00700	腾讯控股	16,012,729.03	22.70
2	00005	汇丰控股	13,542,721.83	19.20
3	01299	友邦保险	12,068,671.87	17.11
4	00941	中国移动	6,237,939.10	8.84
5	00388	香港交易所	4,464,745.74	6.33
6	00001	长和	3,410,530.43	4.83
7	00883	中国海洋石油	3,373,261.99	4.78
8	00016	新鸿基地产	2,600,360.59	3.69
9	00027	银河娱乐	2,451,530.71	3.47
10	01113	长实集团	2,378,909.70	3.37
11	02388	中银香港	2,372,884.46	3.36
12	00002	中电控股	2,275,177.75	3.22
13	02007	碧桂园	2,225,064.27	3.15
14	00011	恒生银行	2,132,760.43	3.02
15	00003	香港中华煤气	2,021,769.27	2.87
16	01177	中国生物制药	1,758,929.58	2.49
17	00175	吉利汽车	1,734,921.28	2.46
18	02382	舜宇光学科技	1,680,354.00	2.38
19	00688	中国海外发展	1,582,097.37	2.24
20	01928	金沙中国有限公司	1,573,193.47	2.23
21	01093	石药集团	1,543,092.47	2.19
22	01997	九龙仓置业	1,474,686.43	2.09

注:本项"买入金额"均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列,不考虑相关交易费用。

8.4.2累计卖出金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例（%）
1	00700	腾讯控股	8,299,717.09	11.76
2	00005	汇丰控股	5,747,984.47	8.15
3	01299	友邦保险	5,079,907.34	7.20
4	00941	中国移动	2,655,818.78	3.76
5	00388	香港交易所	1,798,490.03	2.55
6	00001	长和	1,470,067.59	2.08
7	00883	中国海洋石油	1,407,488.69	2.00
8	00016	新鸿基地产	1,127,187.29	1.60
9	02007	碧桂园	1,044,291.20	1.48
10	00027	银河娱乐	1,006,763.94	1.43
11	02388	中银香港	989,256.98	1.40
12	01177	中国生物制药	986,243.21	1.40
13	01113	长实集团	942,278.73	1.34
14	00002	中电控股	926,887.76	1.31
15	01658	邮储银行	915,249.59	1.30
16	01997	九龙仓置业	910,822.02	1.29
17	00011	恒生银行	902,191.56	1.28
18	00003	香港中华煤气	873,338.40	1.24
19	00762	中国联通	827,188.20	1.17
20	00175	吉利汽车	675,629.99	0.96

注:本项"卖出金额"均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列,不考虑相关交易费用。

8.4.3买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位:人民币元

买入股票的成本（成交）总额	137,013,887.52
卖出股票的收入（成交）总额	60,572,136.01

8.5期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

8.6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

本基金本报告期末未持有债券投资。

8.7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。

8.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

8.9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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 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。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

若本基金投资股指期货,本基金将根据风险管理的原则,以套期保值为主要目的,有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。

本基金在进行股指期货投资时,将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究,并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。

本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征,通过资产配置、品种选择,谨慎进行投资,以降低投资组合的整体风险。

法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的,本基金将按法律法规的规定执行。

8.11报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同,本基金不能投资于国债期货。

8.11.2 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1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。

8.12.2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。

8.12.3期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	–
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	8,610.48
4	应收利息	627.35
5	应收申购款	–
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	9,237.83

8.12.4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。

8.12.5期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有存在流通受限情况的股票。

8.12.5.2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。

§9基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
241	323,560.17	69,004,500.00	88.49%	8,973,500.00	11.51%

9.2期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	招商证券股份有限公司	759,700.00	0.97%
2	肖莉	599,000.00	0.77%
3	刘昕	500,000.00	0.64%
4	刘美青	500,000.00	0.64%
5	马永强	300,000.00	0.38%
6	胡恩涛	299,000.00	0.38%
7	雷雨风	290,000.00	0.37%
8	高奉珠	270,000.00	0.35%
9	皮继良	250,000.00	0.32%
10	广发证券股份有限公司	244,800.00	0.31%
11	中国农业银行股份有限公司–华安CES港股通精选100交易型开放式指数证券投资基金	68,000,000.00	87.20%

9.3期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间为0。

本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为0。

§10 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2018年4月27日)基金份额总额	284,978,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	84,000,000.00
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	291,000,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	–
本报告期期末基金份额总额	77,978,000.00

§11重大事件揭示

11.1基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本报告期内本基金管理人重大人事变动如下:

2018年2月13日,基金管理人发布了《华安基金管理有限公司关于副总经理变更的公告》,翁启森先生、姚国平先生、谷媛媛女士新任本基金管理人的副总经理。

2、本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动如下:

本报告期内,本行总行聘任刘琳同志、李智同志为本行托管业务部高级专家。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金财产、基金托管业务的诉讼。报告期内基金管理人无涉及本基金财产的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内无基金投资策略的改变。

11.5为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘为基金审计的会计师事务所。

报告年度应支付给聘任会计师事务所的报酬为人民币58,000.00元。

目前的审计机构已提供审计服务的连续年限:自基金合同生效日起至今。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

2018年4月,针对上海证监局向公司出具的《关于对华安基金管理有限公司采取责令改正措施的决定》,公司高度重视,逐一落实各项整改要求,针对性地制定、实施整改措施,进一步提升公司内部控制和风险管理能力。2018年5月,公司已通过上海证监局的检查验收。

除上述情况外,本报告期内无管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
长江证券	1	–	–	–	–	–
中信建投	1	–	–	–	–	–
太平洋证券	1	–	–	–	–	–
安信证券	1	–	–	–	–	–
招商证券	4	111,601,348.17	56.48%	78,120.49	56.48%	–
中信证券	2	85,984,675.36	43.52%	60,191.38	43.52%	–

注:1、券商专用交易单元选择标准:

基金管理人负责选择证券经营机构,选用其交易单元供本基金证券买卖专用,选择标准为:

（1）内部管理规范、严谨;具备健全的内控制度,并能满足基金运作高度保密的要求;

（2）研究实力较强,有固定的研究机构和专门研究人员,能够针对本基金业务需要,提供高质量的研究报告和较为全面的服务;

（3）具有战略规划和定位,能够积极推动多边业务合作,最大限度地调动整体资源,为基金投资赢取机会;

（4）其他有利于基金持有人利益的商业合作考虑。

2、券商专用交易单元选择程序:

(1) 对交易单元候选券商的综合服务进行评估

由相关部门牵头并组织有关人员依据上述交易单元选择标准和《券商服务评价办法》,对候选交易单元的券商服务质量和综合实力进行评估。

(2) 填写《新增交易单元申请审核表》

牵头部门汇总对各候选交易单元券商的综合评估结果,择优选出拟新增单元,填写《新增交易单元申请审核表》,对拟新增交易单元的必要性和合规性进行阐述。

(3) 候选交易单元名单提交分管领导审批

公司分管领导对相关部门提交的《新增交易单元申请审核表》及其对券商综合评估的结果进行审核,并签署审批意见。

(4)协议签署及通知托管人

基金管理人与被选择的券商签订《证券交易单元租用协议》,并通知基金托管人。

3、报告期内基金租用券商交易单元的变更情况:

无。

11.7.2基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
招商证券	–	–	–	–	3,951.08	100.00%
中信证券	–	–	485,100,000.00	100.00%	–	–

12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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
联接基金	1	20180604–20181231	0.00	80,000,000.00	12,000,000.00	68,000,000.00	87.20%
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。							

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

华安基金管理有限公司
二〇一九年三月三十日