华安聚利18个月定期开放债券型证券投资基金 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:中国民生银行股份有限公司
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。

基金托管人中国民生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1月1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	华安聚利18个月定开债	
基金主代码	002948	
交易代码	002948	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016年8月9日	
基金管理人	华安基金管理有限公司	
基金托管人	中国民生银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	354,530,418.24份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华安聚利18个月定开债A	华安聚利18个月定开债C
下属分级基金的交易代码	002948	002949
报告期末下属分级基金的份额总额	344,274,728.59份	10,255,689.65份

2.2 基金产品说明

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	封闭期内策略: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,动态调整大类资产配置比例,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,综合考量各类券种的流动性、供求关系、风险及收益率水平等,自下而上地精选个券 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,属于证券投资基金中的中等风险品种,其预期的风险及预期的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。

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	中国民生银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陆莅	罗菲菲
	联系电话	021-38969999	010-58560666
	电子邮箱	luying@huaan.com.cn	tgbfxjdzx@cmbc.com.cn
客户服务电话		4008850099	95568
传真		021-68863414	010-58560798

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

金额单位:人民币元

3.1.1期间数据和指标	2018年		2017年		2016年8月9日(基金合同生效日)至2016年12月31日	
	华安聚利18个月定开债A	华安聚利18个月定开债C	华安聚利18个月定开债A	华安聚利18个月定开债C	华安聚利18个月定开债A	华安聚利18个月定开债C
本期已实现收益	15,645,895.73	926,014.10	19,631,581.97	1,830,532.07	-8,292,842.23	-1,427,094.61
本期利润	27,357,109.89	1,450,506.28	34,867,397.97	3,863,521.96	-27,335,426.33	-3,979,347.95
加权平均基金份额本期利润	0.0543	0.0399	0.0232	0.0192	-0.0182	-0.0197
本期加权平均净值利润率	5.28%	3.96%	2.34%	1.94%	-1.83%	-1.98%
本期基金份额净值增长率	6.17%	5.73%	2.36%	1.95%	-1.82%	-1.97%
3.1.2期末数据和指标	2018年末		2017年末		2016年末	
	华安聚利18个月定开债A	华安聚利18个月定开债C	华安聚利18个月定开债A	华安聚利18个月定开债C	华安聚利18个月定开债A	华安聚利18个月定开债C
期末可供分配基金份额利润	0.0393	0.0294	0.0050	-0.0006	-0.0182	-0.0197
期末基金资产净值	367,324,521.75	10,837,338.62	1,510,399,291.42	201,543,886.83	1,475,531,893.45	197,680,364.87
期末基金份额净值	1.0670	1.0567	1.0050	0.9994	0.9818	0.9803

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

1. 华安聚利18个月定开债A:

3.1.1期间数据和指标	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	1.10%	0.04%	1.99%	0.05%	-0.89%	-0.01%
过去六个月	3.41%	0.05%	2.57%	0.06%	0.84%	-0.01%
过去一年	6.17%	0.06%	4.79%	0.07%	1.38%	-0.01%
自基金合同生效起至今	6.70%	0.06%	-1.01%	0.08%	7.71%	-0.02%

2. 华安聚利18个月定开债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	0.99%	0.04%	1.99%	0.05%	-1.00%	-0.01%
过去六个月	3.20%	0.06%	2.57%	0.06%	0.63%	0.00%
过去一年	5.73%	0.06%	4.79%	0.07%	0.94%	-0.01%
自基金合同生效起至今	5.67%	0.06%	-1.01%	0.08%	6.68%	-0.02%

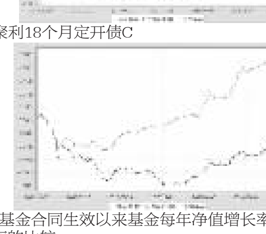
3.2.2自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华安聚利18个月定期开放债券型证券投资基金

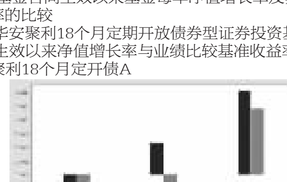
自基金合同生效以来份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2016年8月9日至2018年12月31日)

1、华安聚利18个月定开债A



2、华安聚利18个月定开债C

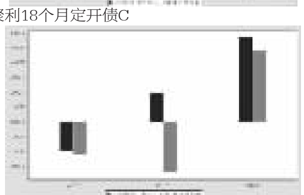


3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

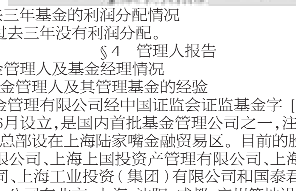
华安聚利18个月定期开放债券型证券投资基金

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、华安聚利18个月定开债A



2、华安聚利18个月定开债C



3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年没有利润分配。

§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		
石雨欣	本基金的基金经理	2016-08-09	-	12年	硕士研究生,12年相关行业从业经验,曾任联合资信评估有限公司高级分析师。2008年1月加入华安基金管理有限公司,任固定收益部信用分析师。2015年7月至2017年6月,担任华安信用四季红债券型证券投资基金的基金经理。2015年7月起担任华安稳固收益债券型证券投资基金的基金经理。2016年2月至2018年8月,担任华安安康保本混合型证券投资基金的基金经理。2018年8月起,同时担任华安安康灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016年8月起同时担任本基金的基金经理。2016年12月起,同时担任华安新恒利灵活配置混合型证券投资基金、华安新瑞利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017年1月起,同时担任华安新安平灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018年2月起,同时担任华安丰利18个月定期开放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 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年除美国经济一枝独秀,其他主要经济体包括中国的经济增长均开始放缓,年初全球通胀预期有所上行。一季度国内监管政策逐步落地,资管新规细则出台,债市震荡加剧。3月底中美贸易战引发避险情绪升温,经济增长预期开始悲观,国内跟随美联储加息的步伐开始放缓,4月份意外降准确认货币开始边际宽松,社融大幅下滑,信用紧缩导致信用违约事件频发,市场波动进一步加剧。下半年开始经济增长压力显现,宏观政策从去杠杆转为稳增长,央行通过降准释放资金保持资金合理充裕,各类宽信用政策开始出台,但由于宽信用主体以中小微和民企为主,宽信用效果并不显著,债市收益率进一步大幅下行。随着信用缓释工具的推出,民企融资环境改善,中低等级信用利差进一步被压缩。全年债券收益率总体大幅下行,中债综合全价指数上涨4.79%。

本基金去年3月份进入新一期运作期,年初以保持流动性为主,3月份进入新一期运作后,以配置高等级中等久期信用债配置为主,同时保持高杠杆操作增厚组合收益,期内基金业绩超越比较基准。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2018年12月31日,华安聚利18个月定开债A份额净值为1.0670元,C份额净值为1.0567元;华安聚利18个月定开债A份额净值增长率为6.17%,同期业绩比较基准增长率为4.79%,C份额净值增长率为5.73%,同期业绩比较基准增长率为4.79%。

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,市场对美国经济增长预期有所下降,美联储不断释放鸽派信号,全球进入经济下滑通道。国内经济增长压力进一步加大,制造业和房地产投资增长均有放缓的趋势,基建增长是投资稳定的关键,在地方专项债大幅提高额度以及各项宽财政政策刺激下,基建有望企稳,但回升幅度可能有限。受中美贸易摩擦的影响出口可能会对经济的拖累有所增大,同时受房地产和汽车消费大幅下滑的拖累,消费也显著下滑,稳增长压力依然较大。政策的重心依然是推动宽货币向宽信用的转变,二三季度是经济能否企稳的关键期。上半年货币政策可能继续保持稳健基调不变,短端收益率的稳定依然可期,中长端利率的波动将会加大,债市将进入震荡阶段。

本基金2019年9月结束本期运作,组合将保持中短久期、高等级信用债配置为主,逐步压缩久期和杠杆,获取相对稳定的收益。

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的利益。

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

本报告期内,中国民生银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同、托管协议的有关规定,依法安全保管了基金财产,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

本报告期内,按照相关法律法规和基金合同、托管协议的有关规定,本托管人对本基金的投资运作方面进行了监督,对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

本报告期内,本基金未进行利润分配。

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

本托管人复核审查的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

§6 审计报告

本报告期的基金财务会计报告经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)审计,注册会计师签字出具了安永华明(2019)审字第60971571_B41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:华安聚利18个月定期开放债券型证券投资基金

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	上年度末 2017年12月31日
资产:	-	-
银行存款	2,892,776.46	6,402,470.23
结算备付金	2,983,723.92	4,426,798.39
存出保证金	19,471.65	39,788.29
交易性金融资产	711,747,000.00	1,599,640,000.00
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	711,747,000.00	1,599,640,000.00
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	-	60,030,290.05
应收证券清算款	-	-
应收利息	9,529,725.90	43,251,273.16
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	727,172,697.93	1,713,790,620.12
负债和所有者权益	本期末 2018年12月31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	347,999,390.00	-
应付证券清算款	39,164.45	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	144,352.54	1,161,167.79
应付托管费	48,117.50	217,718.96
应付销售服务费	3,677.82	68,361.65
应付交易费用	10,736.68	30,193.47
应交税费	78,222.30	-
应付利息	347,176.27	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	340,000.00	370,000.00
负债合计	349,010,837.56	1,847,441.87
所有者权益:	-	-
实收基金	354,530,418.24	1,704,527,032.60
未分配利润	23,631,442.13	7,416,145.65
所有者权益合计	378,161,860.37	1,711,943,178.25
负债和所有者权益总计	727,172,697.93	1,713,790,620.12

注:报告截止日2018年12月31日,基金份额净值为1.0667元,基金份额总额354,530,418.24份,其中A类基金份额净值1.0670元,基金份额总额344,274,728.59份;C类基金份额净值1.0567元,基金份额总额10,255,689.65份。

7.2 利润表

会计主体:华安聚利18个月定期开放债券型证券投资基金

本报告期:2018年1月1日至2018年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
一、收入	41,439,971.47	78,333,254.10
1.利息收入	45,835,157.26	101,869,184.18
其中:存款利息收入	1,344,018.85	385,395.37
债券利息收入	42,592,894.56	100,555,161.69
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	1,898,243.85	928,627.12
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	-16,630,892.13	-40,848,353.82
其中:股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-16,630,892.13	-40,848,353.82
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)	12,235,706.34	17,268,805.89
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	-	43,617.85
减:二、费用	12,632,355.30	39,602,334.17
1. 管理人报酬	4,002,703.73	13,485,836.40
2. 托管费	847,653.91	2,528,594.37
3. 销售服务费	150,792.17	795,230.98
4. 交易费用	17,371.73	41,702.29
5. 利息支出	7,042,463.60	22,326,678.34
其中:卖出回购金融资产支出	7,042,463.60	22,326,678.34
6. 税金及附加	141,425.77	-
7. 其他费用	429,944.39	424,291.79
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	28,807,616.17	38,730,919.93
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	28,807,616.17	38,730,919.93

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:华安聚利18个月定期开放债券型证券投资基金

本报告期:2018年1月1日至2018年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1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)	1,704,527,032.60	7,416,145.65	1,711,943,178.25
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	28,807,616.17	28,807,616.17
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)	-1,349,996,614.36	-12,592,319.69	-1,362,588,934.05
其中:1.基金申购款	12,882.34	123.67	13,006.01
2.基金赎回款	-1,350,009,496.70	-12,592,443.36	-1,362,601,940.06
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)	354,530,418.24	23,631,442.13	378,161,860.37
项目	上年度可比期间 2017年1月1日至2017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)	1,704,527,032.60	-31,314,774.28	1,673,212,258.32
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	38,730,919.93	38,730,919.93
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)	-	-	-
其中:1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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)	1,704,527,032.60	7,416,145.65	1,711,943,178.25

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

华安聚利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]1292号《关于准予华安聚利18个月定期开放债券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8月9日生效,首次设立募集规模为1,704,527,032.60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,基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国债、金融债、中央银行票据、地方政府债、城投债、中期票据、企业债、公司债、短期融资券、可分离交易可转债的纯债部分、资产支持证券、次级债、中小企业私募债券、债券回购、银行存款、同业存单等固定收益类资产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相关规定)。本基金不参与股票、权证等权益类资产投资。

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。

本基金的投资组合比例为:基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%,但每次开放期开始前一个月至开放期结束后一个月的期间不受前述比例限制。开放期内,基金持有现金或到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于5%,封闭期内不受上述5%的比例限制,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。 本基金业绩比较基准:中债综合全价指数。

7.4.2 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理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《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〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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于2018年12月31日的财务状况以及2018年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 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。

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

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

7.4.6.1 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定,经国务院批准,自2016年5月1日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点,金融业纳入试点范围,由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税;国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税;存款利息收入不征收增值税;

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46号文《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》的规定,金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入;

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定,金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入;

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140号文《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》的规定,本基金运营过程中发生的增值税应税行为,以本基金的基金管理人为增值税纳税人;

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定,自2018年1月1日起,本基金的基金管理人运营本基金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。对本基金在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为,未缴纳增值税的,不再缴纳;已缴纳增值税的,已纳税额从本基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

7.4.6.2 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例(2011年修订)》、《征收教育费附加的暂行规定(2011年修订)》及相关地方教育附加的征收规定,凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人,都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加(除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外)及地方教育费附加。

?

7.4.6.3 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定,自2004年1月1日起,对证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入,继续免征企业所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定,对证券投资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。

7.4.6.4 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定,自2008年10月9日起,对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

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、注册登记机构、基金销售机构
中国民生银行股份有限公司("中国民生银行")	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	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

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

7.4.8.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.8.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.8.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行回购交易。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

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1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	4,002,703.73	13,485,836.40
其中:支付销售机构的客户维护费	616,268.75	3,415,708.59

注:2018年8月10日前,基金管理费按前一日的基金资产净值的0.80%的年费率计提。自2018年8月10日起,基金管理费按前一日的基金资产净值的0.45%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×基金管理费年费率/当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提,逐日累计至每月月末,按月支付。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	847,653.91	2,528,594.37

注:基金托管费按前一日的基金资产净值的0.15%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×基金托管费年费率/当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提,逐日累计至每月月末,按月支付。

7.4.8.2.3 销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年12月31日 当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华安聚利18个月定开债A	华安聚利18个月定开债C	合计
华安基金管理有限公司	-	438.94	438.94
民生银行	-	122,192.13	122,192.13
合计	-	122,631.07	122,631.07
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日 当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华安聚利18个月定开债A	华安聚利18个月定开债C	合计
华安基金管理有限公司	-	455.37	455.37
民生银行	-	632,495.58	632,495.58
合计	-	632,950.95	632,950.95

注:本基金A类基金份额不收取销售服务费,C类基金份额销售服务费按前一日C类基金份额资产净值的0.40%年费率计提。计算方法如下:

H=E×C类基金销售服务费年费率/当年天数

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E为C类基金份额前一日的基金资产净值

销售服务费每日计提,逐日累计至每月月末,按月支付。

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

单位:人民币元

获得销售服务费的各关联方名称						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额
民生银行	103,427,190.00		-	-	-	80,750,000.00
上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额
民生银行	-		-	-	-	-

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

本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

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1月1日至2018年12月31日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国民生银行股份有限公司	2,892,776.46	461,033.25	6,402,470.23	99,086.97

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

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限证券股票。

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

截至本报告期末2018年12月31日止,本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额人民币139,999,390.00元,是以如下债券作为质押:

金额单位:人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量(张)	期末估值总额
101651025	16百联集MTN002	2019-01-08	99.88	300,000.00	29,964,000.00
101651056	16光明MTN002	2019-01-08	99.88	200,000.00	19,976,000.00
101801058	18京能源MTN002	2019-01-08	101.24	300,000.00	30,372,000.00
101801172	18广核电力MTN004	2019-01-08	100.72	200,000.00	20,144,000.00
101456052	14中核MTN001	2019-01-02	101.45	100,000.00	10,145,000.00
101559035	15中航机MTN001	2019-01-02	101.16	300,000.00	30,348,000.00
合计				1,400,000.00	140,949,000.00

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2018年12月31日止,基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额人民币208,000,000.00元,于2019年1月2日、2019年1月4日(先后)到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1 公允价值

7.4.14.1.1 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贷款和应收款项以及其他金融负债,其因剩余期限不长,公允价值与账面价值相若。?

7.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

7.4.14.1.2.1 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人民币0.00元,属于第二层次的余额为人民币711,747,000.00元,属于第三层次的余额为人民币0.00元(于2017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人民币0.00元,属于第二层次的余额为人民币1,599,640,000.00元,属于第三层次的余额为人民币0.00元)。

7.4.14.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

7.4.14.1.2.3 第三层次公允价值余额和本期变动金额

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工具第三层次公允价值本期未发生变动。

7.4.14.2 承诺事项

截至资产负债表日,本基金无需要说明的承诺事项。

7.4.14.3 其他事项

截至资产负债表日,本基金无需要说明的其他重要事项。

7.4.14.4 财务报表的批准

本财务报表已于2019年3月26日经本基金的基金管理人批准。

§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	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	711,747,000.00	97.88
	其中:债券	711,747,000.00	97.88
	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	5,876,500.38	0.81
7	其他各项资产	9,549,197.55	1.31
8	合计	727,172,697.93	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境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有股票投资。

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初基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金本报告期末未持有股票。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金本报告期末未持有股票。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	公允价值	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	320,692,000.00	84.80
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	333,140,000.00	88.09
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	57,915,000.00	15.31
9	其他	-	-
10	合计	711,747,000.00	188.21

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

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	101452023	14中外运MTN001	300,000	30,576,000.00	8.09
2	101755028	17苏交通MTN004	300,000	30,534,000.00	8.07
3	101753037	17苏国信MTN002	300,000	30,486,000.00	8.06
4	101801058	18京能源MTN002	300,000	30,372,000.00	8.03
5	101559035	15中航机MTN001	300,000	30,348,000.00	8.03

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

本基金本报告期未投资股指期货。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	19,471.65
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	9,529,725.90
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,549,197.55

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

本基金本报告期末未持有处于流通受限情况的股票。

§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

份额级别	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
华安聚利18个月定开债A	495	695,504.50	300,053,000.00	87.16%	44,221,728.59	12.84%
华安聚利18个月定开债C	1,087	9,434.86	0.00	0.00%	10,255,689.65	100.00%
合计	1,582	224,102.67	300,053,000.00	84.63%	54,477,418.24	15.37%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	华安聚利18个月定开债A	6.37	0.00%
	华安聚利18个月定开债C	3.30	0.00%
	合计	9.67	0.00%

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

项目	华安聚利18个月定开债A	华安聚利18个月定开债C
基金合同生效日(2016年8月9日)基金份额总额	1,502,867,319.78	201,659,712.82
本报告期期初基金份额总额	1,502,867,319.78	201,659,712.82
本报告期基金总申购份额	10,561.53	2,320.81
减:本报告期基金总赎回份额	1,158,603,152.72	191,406,343.98
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	344,274,728.59	10,255,689.65

§11 重大事件揭示

11.1基金份额持有人大会决议

本基金于从于2018年7月17日至2018年8月8日期间以通讯方式召开了基金份额持有人大会,会议期间审议并通过了《关于华安聚利18个月定期开放债券型证券投资基金降低基金管理费率的议案》,决议自2018年8月9日起生效,并已按规定向中国证券监督管理委员会备案。本次持有人大会详情请见本基金管理人于2018年8月10日发布的《关于华安聚利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》。

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:

本基金托管人中国民生银行股份有限公司于2018年4月19日公告,根据工作需要,任命张庆先生担任本公司资产托管部总经理,主持资产托管部相关工作。

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60,000.00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	
东兴证券	2	-	-	-	-	-

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
东兴证券	376,841,136.25	100.00%	3,905,000,000.00	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
机构	1	20180212-20181231	300,053,000.00	0.00	0.00	300,053,000.00	84.63%
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