华安睿安定期开放混合型证券投资基金 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:平安银行股份有限公司
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。

基金托管人平安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	华安睿安定期开放混合	
基金主代码	003508	
交易代码	003508	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017年3月15日	
基金管理人	华安基金管理有限公司	
基金托管人	平安银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	45,463,479.31份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华安睿安定开A	华安睿安定开C
下属分级基金的交易代码	003508	003509
报告期末下属分级基金的份额总额	32,973,086.80份	12,490,392.51份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的前提下,力争为基金份额持有人创造持续稳定的投资回报。
投资策略	本基金以三个公历年(即36个月)为一个运作周期,在每个运作周期前确定大类资产初始配比,达到初始配比目标后除证券价格波动等客观因素影响大类资产配比,不做频繁的主动大类资产配置调整。通过期初以一定比例投资于债券类资产作为安全垫,为总投资组合的本金安全提供保障,同时以有限比例投资于权益类资产而保有对股票市场一定的暴露度,以争取为组合创造超额收益。
业绩比较基准	沪深300指数收益率*30%+中债综合全价指数收益率*70%
风险收益特征	本基金为混合型基金,其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金,但低于股票型基金,属于中等预期收益风险水平的投资品种。

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	平安银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陆霞	李帅帅
	联系电话	021-38969999	0755-25878287
	电子邮箱	luying@huaan.com.cn	LISHUAISHUAI1306@pingan.com.cn
客户服务电话		4008850099	95511-3
传真		021-68863414	0755-82080387

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	中国(上海)自由贸易试验区世纪大道8号国金中心二期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3月15日(基金合同生效日)至2017年12月31日	
	华安睿安定开A	华安睿安定开C	华安睿安定开A	华安睿安定开C
本期已实现收益	1,194,753.64	25,490.39	6,023,103.86	3,031,337.96
本期利润	2,763,039.82	342,715.53	4,564,626.81	2,603,986.19
加权平均基金份额本期利润	0.0557	0.0170	0.0379	0.0367
本期加权平均净值利润率	5.25%	1.60%	3.76%	3.67%
本期基金份额净值增长率	-0.48%	-1.39%	3.81%	3.99%
3.1.2期末数据和指标	2018年末		2017年末	
	华安睿安定开A	华安睿安定开C	华安睿安定开A	华安睿安定开C
期末可供分配基金份额利润	0.0331	0.0254	0.0381	0.0399
期末基金资产净值	34,062,851.53	12,807,739.22	109,154,350.67	33,754,830.29
期末基金份额净值	1.0331	1.0254	1.0381	1.0399

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

1. 华安睿安定开A:

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
过去一年	-0.48%	0.49%	-5.38%	0.40%	4.90%	0.09%
过去三个月	-2.50%	0.47%	-2.31%	0.48%	-0.19%	-0.01%
过去六个月	-4.48%	0.47%	-2.53%	0.44%	-1.95%	0.03%
自基金合同生效起至今	3.31%	0.43%	-2.05%	0.32%	5.36%	0.11%

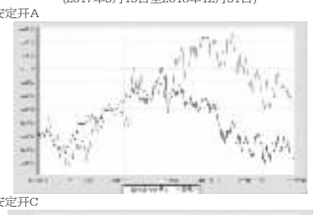
2. 华安睿安定开C:

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
过去一年	-1.39%	0.49%	-5.38%	0.40%	3.99%	0.09%
过去三个月	-2.65%	0.47%	-2.31%	0.48%	-0.34%	-0.01%
过去六个月	-4.65%	0.47%	-2.53%	0.44%	-2.12%	0.03%
自基金合同生效起至今	2.54%	0.44%	-2.05%	0.32%	4.59%	0.12%

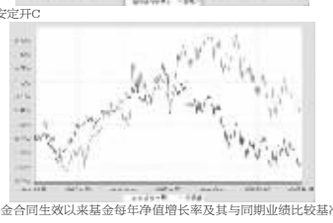
3.2.2自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华安睿安定期开放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
(2017年3月15日至2018年12月31日)

1、华安睿安定开A



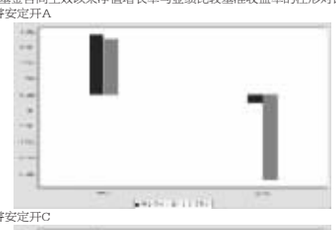
2、华安睿安定开C



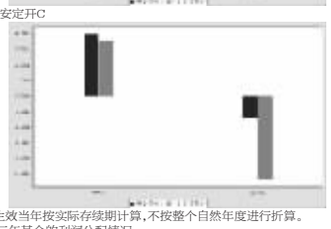
3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华安睿安定期开放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、华安睿安定开A



2、华安睿安定开C



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		
朱才敬	本基金的基金经理	2017-03-15	-	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、华安月安鑫短期理财债券型证券投资基金的基金经理。2014年11月起,同时担任华安汇财通货币市场基金、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,同时担任华安安盛保本混合型证券投资基金的基金经理。2018年10月起,同时担任华安安福灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。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,同时担任本基金的基金经理。
蒋璐	本基金的基金经理	2017-03-15	-	11年	硕士,11年从业经历,曾任国泰君安证券有限公司研究员、华宏兴业基金管理有限公司研究员。2011年6月加入华安基金管理有限公司,担任投资研究部行业分析师、基金经理助理。2015年6月起担任华安动态灵活配置混合型证券投资基金的基金经理;2015年6月至2016年9月担任华安安信消费服务混合型证券投资基金、华安升级主题混合型证券投资基金的基金经理;2015年11月至2018年9月,担任华安新乐享保本混合型证券投资基金的基金经理。2018年9月起,同时担任华安新乐享灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017年3月起,同时担任本基金的基金经理。2018年6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。2018年12月起,同时担任华安财趋先锋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,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。受经济下行和中美贸易摩擦影响,股票市场在全年震荡下行。

本基金在报告期内维持组合中短久期操作,维持高等级信用策略;权益方面,积极把握结构性投资机会,通过自下而上精选低估值高成长品种作为配置核心,结合自上而下的仓位调整和主题筛选,力争取得超额收益。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2018年12月31日,华安睿安A份额净值为1.0331元,C份额净值为1.0254元;华安睿安A份额净值增长率为-0.48%,C份额净值增长率为-1.39%,同期业绩比较基准增长率为-5.38%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

市场对于19年经济增速下行已形成共识,但对何时能够见底尚存分歧。结合18年底政治局会议和中央经济工作会议的指导精神,我们倾向于认为19年逆周期政策调控的力度会显著加大,无论是货币政策还是财政政策,边际宽松的趋势非常明确,以确保“稳就业、稳金融、稳外贸、稳外资、稳投资、稳预期”的目标得以顺利实现。从长期视角看,当下重战略做多期。因PB估值是最好的长期指标,18年底已处于熊市底部水平。从短期视角看,A股逐步筑底走强的概率较高。具体分析决定股市方向的三大因素:一是盈利角度,预期经济基本面和上市公司盈利仍处于下行通道,但其对19年股市走向的影响不大;二是无风险收益率角度,19年利率会有小幅下降空间;三是风险溢价的变化将是19年股市的决定性力量,而风险偏好的提升是确定的长期趋势,短期中美贸易战缓和及国内稳增长政策发力将边际上扭转市场的极度悲观情绪。风格预测:随着托底政策逐步加码、经济底部日益明朗,19年市场风险偏好较18年有望显著回升,小微企业和高科技制造业将成为本轮信贷宽松的最大赢家,预计上半年价值成长各领风骚,下半年成长优势愈发明显。债券方面,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。

基于上述对于市场的预判,我们计划在19年将本基金的权益仓位总体控制在较高水平,积极挖掘趋势性和结构性投资机会。具体操作以自下而上优选高科技制造领域的低估值真成长品种作为核心配置,结合自上而下的仓位调整和主题筛选,力争取得超额收益。投资方向上相对看好5G、云计算、人工智能、柔性屏、新能源及新能源汽车、军工、基建等。债券方面将继续维持组合中短久期操作,高等级信用策略。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

本基金报告期内基金持有人数不低于200人;基金资产净值连续超过20个工作日低于5000万元。

§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,平安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。

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

本报告期,本托管人复核的财务指标、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真实、准确、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 蒋燕华 沈熙苑签字出具了安永华明(2019)审字第60971571_B43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:华安睿安定期开放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	上年度末 2017年12月31日
资产:	-	-
银行存款	5,858,952.35	6,995,813.56
结算备付金	124,599.00	324,228.11
存出保证金	61,489.29	125,806.19
交易性金融资产	40,862,896.00	129,331,304.20
其中:股票投资	10,509,896.00	40,483,704.20
基金投资	-	-
债券投资	30,353,000.00	88,847,600.00
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	-	6,000,000.00
应收证券清算款	-	-
应收利息	498,563.20	1,599,676.24
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	47,406,499.84	144,376,828.30
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	-	-
应付证券清算款	-	770,591.10
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	60,150.82	182,764.42
应付托管费	10,025.15	30,460.76
应付销售服务费	6,575.92	17,270.91
应付交易费用	159,157.20	116,560.15
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	300,000.00	350,000.00
负债合计	535,909.09	1,467,647.34
所有者权益:	-	-
实收基金	45,463,479.31	137,604,375.30
未分配利润	1,407,111.44	5,304,805.66
所有者权益合计	46,870,590.75	142,909,180.96
负债和所有者权益总计	47,406,499.84	144,376,828.30

注:(1)报告截止日2018年12月31日,基金份额净值1.0310元,基金份额总额45,463,479.31份。其中A类基金份额净值1.0331元,基金份额总额32,973,086.80份;C类基金份额净值1.0254元,基金份额总额12,490,392.51份。

(2)本基金基金合同于2017年3月15日生效,上年度可比期间自2017年3月15日至2017年12月31日。

7.2 利润表

会计主体:华安睿安定期开放混合型证券投资基金

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3月15日(基金合同生效日)至2017年12月31日
一、收入	5,696,175.20	11,723,857.61
1.利息收入	1,947,446.38	4,882,614.30
其中:存款利息收入	54,408.77	2,883,345.02
债券利息收入	1,851,166.79	1,446,614.91
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	41,870.82	552,654.37
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	1,381,742.96	8,198,982.72
其中:股票投资收益	1,024,564.39	7,643,412.74
基金投资收益	-	-
债券投资收益	165,019.15	8,489.49
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	192,159.42	547,080.49
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	1,885,511.32	-1,885,828.82
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	481,474.54	528,089.41
减:二、费用	2,590,419.85	4,555,244.61
1. 管理人报酬	1,117,325.98	2,297,755.70
2. 托管费	186,221.01	382,959.30
3. 销售服务费	128,583.50	338,257.55
4. 交易费用	815,719.52	1,167,976.38
5. 利息支出	5,369.65	2,306.68
其中:卖出回购金融资产支出	5,369.65	2,306.68
6. 税金及附加	0.19	-
7. 其他费用	337,200.00	365,900.00
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	3,105,755.35	7,168,613.00
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	3,105,755.35	7,168,613.00

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:华安睿安定期开放混合型证券投资基金

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)	137,604,375.30	5,304,805.66	142,909,180.96
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	3,105,755.35	3,105,755.35
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)	-92,140,896.99	-7,003,449.57	-99,144,345.56
其中:1.基金申购款	91,020.49	6,548.17	97,568.66
2.基金赎回款	-92,231,916.48	-7,009,997.74	-99,241,914.22
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)	45,463,479.31	1,407,111.44	46,870,590.75

项目	上年度可比期间 2017年3月15日(基金合同生效日)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)	220,232,149.99	-	220,232,149.99
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	7,168,613.00	7,168,613.00
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)	-82,627,774.69	-1,863,807.34	-84,491,582.03
其中:1.基金申购款	2,611.53	61.90	2,673.43
2.基金赎回款	-82,630,386.22	-1,863,869.24	-84,494,255.46
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)	137,604,375.30	5,304,805.66	142,909,180.96

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

华安睿安定期开放混合型证券投资基金(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]2170号《关于准予华安睿安定期开放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2017年3月15日生效,首次设立募集规模为220,232,149.99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,基金托管人为平安银行股份有限公司。

本基金的投资对象是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、债券(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、短期融资券、超短期融资券、中期票据、中小企业私募债等)、资产支持证券、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)。

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:本基金投资于债券的比例不低于50%,但在每个期间开放期开始前10个工作日至期间开放期结束后10个工作日、到期开放期前3个月至到期开放期结束后3个月,基金投资不受前述比例限制;本基金投资于股票的比例不高于基金资产的50%。在开放期,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,本基金持有的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%。在封闭期,本基金不受前述5%的限制,但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,应当保持不低于交易保证金一倍的现金。其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如果法律法规对该比例要求有变更的,以变更后的比例为准,本基金的投资范围会做相应调整。

本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率*30%+中债综合全价指数收益率*70%。

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 印花税

经国务院批准,财政部、国家税务总局研究决定,自2008年4月24日起,调整证券(股票)交易印花税税率,由原先的3‰调整为1‰;

经国务院批准,财政部、国家税务总局研究决定,自2008年9月19日起,调整由出让方按证券(股票)交易印花税税率缴纳印花税,受让方不再征收,税率不变;

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让,暂免征收印花税。

7.4.6.2 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。

7.4.6.3 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。

7.4.6.4 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[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入,暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税;

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。

?

7.4.6.5 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入,暂免征收流通股股东应缴纳的个人所