

**华安安康保本混合型证券投资基金**  
**2018 年半年度报告**  
**2018 年 6 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：二〇一八年八月二十四日

## 1 重要提示及目录

### 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。本半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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 8 月 22 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>1 重要提示及目录</b>	2
1.1 重要提示	2
<b>2 基金简介</b>	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>3 主要财务指标和基金净值表现</b>	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
<b>4 管理人报告</b>	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
<b>5 托管人报告</b>	13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	13
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	13
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
<b>6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	17
<b>7 投资组合报告</b>	38
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	38
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	38
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	40
7.6 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	41
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	41
7.8 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	41
7.9 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	41
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	41
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	42
7.12 投资组合报告附注	42
<b>8 基金份额持有人信息</b>	43
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	43

8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	43
8.3	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 .....	43
<b>9</b>	<b>开放式基金份额变动 .....</b>	<b>43</b>
<b>10</b>	<b>重大事件揭示 .....</b>	<b>44</b>
10.1	基金份额持有人大会决议 .....	44
10.2	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 .....	44
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	44
10.4	基金投资策略的改变 .....	44
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	44
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	44
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	44
10.7.2	基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况 .....	46
10.8	其他重大事件 .....	47
<b>11</b>	<b>备查文件目录 .....</b>	<b>49</b>
11.1	备查文件目录 .....	49
11.2	存放地点 .....	50
11.3	查阅方式 .....	50

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华安安康保本混合型证券投资基金	
基金简称	华安安康保本混合	
基金主代码	002363	
交易代码	002363	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 2 月 1 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	
报告期末基金份额总额	1,813,910,469.24 份	
下属分级基金的基金简称	华安安康保本混合 A	华安安康保本混合 C
下属分级基金的交易代码	002363	002364
报告期末下属分级基金的份额总额	1,546,594,141.06 份	267,316,328.18 份

### 2.2 基金产品说明

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），动态调整固定收益类资产与权益类资产的投资比例，以确保基金在一段时间以后其价值不低于事先设定的某一目标价值，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	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	钱鲲	郭明
	联系电话	021-38969999	010-66105798
	电子邮箱	qiankun@huaan.com.cn	custody@icbc.com.cn

客户服务电话	4008850099	95588
传真	021-68863414	010-66105799
注册地址	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	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址	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	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码	200120	100140
法定代表人	朱学华	易会满

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.huaan.com.cn
基金半年度报告备置地点	上海市世纪大道8号上海国金中心二期31、32层

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	华安基金管理有限公司	上海市世纪大道8号上海国金中心二期31、32层
基金保证人	重庆三峡担保集团股份有限公司	重庆市渝北区青枫北路12号3幢

## 3 主要财务指标和基金净值表现

### 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	报告期（2018年1月1日至2018年6月30日）	
	华安安康保本混合 A	华安安康保本混合 C
本期已实现收益	13,057,411.83	1,530,070.03
本期利润	19,285,551.74	2,605,612.47
加权平均基金份额本期利润	0.0115	0.0086
本期加权平均净值利润率	1.10%	0.83%
本期基金份额净值增长率	1.16%	0.78%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)	
	华安安康保本混合 A	华安安康保本混合 C

期末可供分配利润	73,658,106.24	8,905,712.22
期末可供分配基金份额利润	0.0476	0.0333
期末基金资产净值	1,621,716,459.42	276,474,393.40
期末基金份额净值	1.049	1.034
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>报告期末(2018 年 6 月 30 日)</b>	
	华安安康保本混合 A	华安安康保本混合 C
基金份额累计净值增长率	4.90%	3.40%

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

华安安康保本混合 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
过去一个月	0.10%	0.06%	0.23%	0.01%	-0.13%	0.05%
过去三个月	0.48%	0.04%	0.69%	0.01%	-0.21%	0.03%
过去六个月	1.16%	0.06%	1.36%	0.01%	-0.20%	0.05%
过去一年	2.74%	0.06%	2.75%	0.01%	-0.01%	0.05%
自基金合同生效起至今	4.90%	0.06%	6.64%	0.01%	-1.74%	0.05%

华安安康保本混合 C

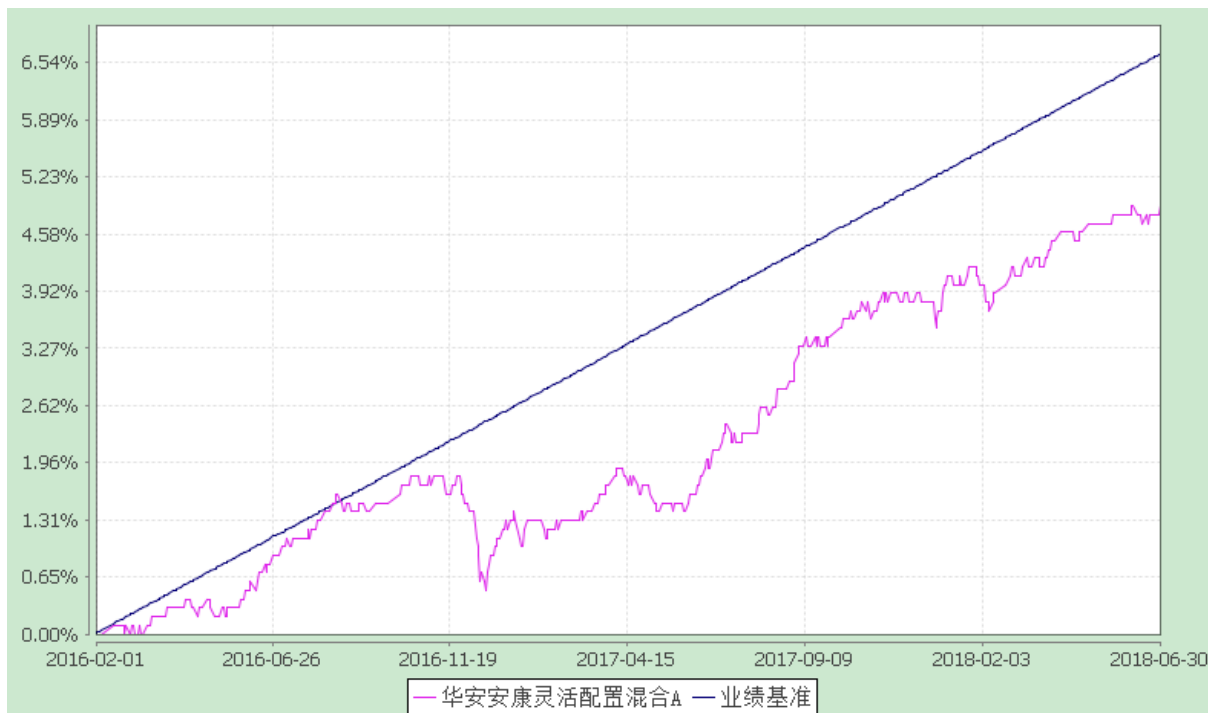
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.00%	0.04%	0.23%	0.01%	-0.23%	0.03%
过去三个月	0.29%	0.04%	0.69%	0.01%	-0.40%	0.03%
过去六个月	0.78%	0.05%	1.36%	0.01%	-0.58%	0.04%
过去一年	2.07%	0.06%	2.75%	0.01%	-0.68%	0.05%
自基金合同生效起至今	3.40%	0.06%	6.64%	0.01%	-3.24%	0.05%

#### 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

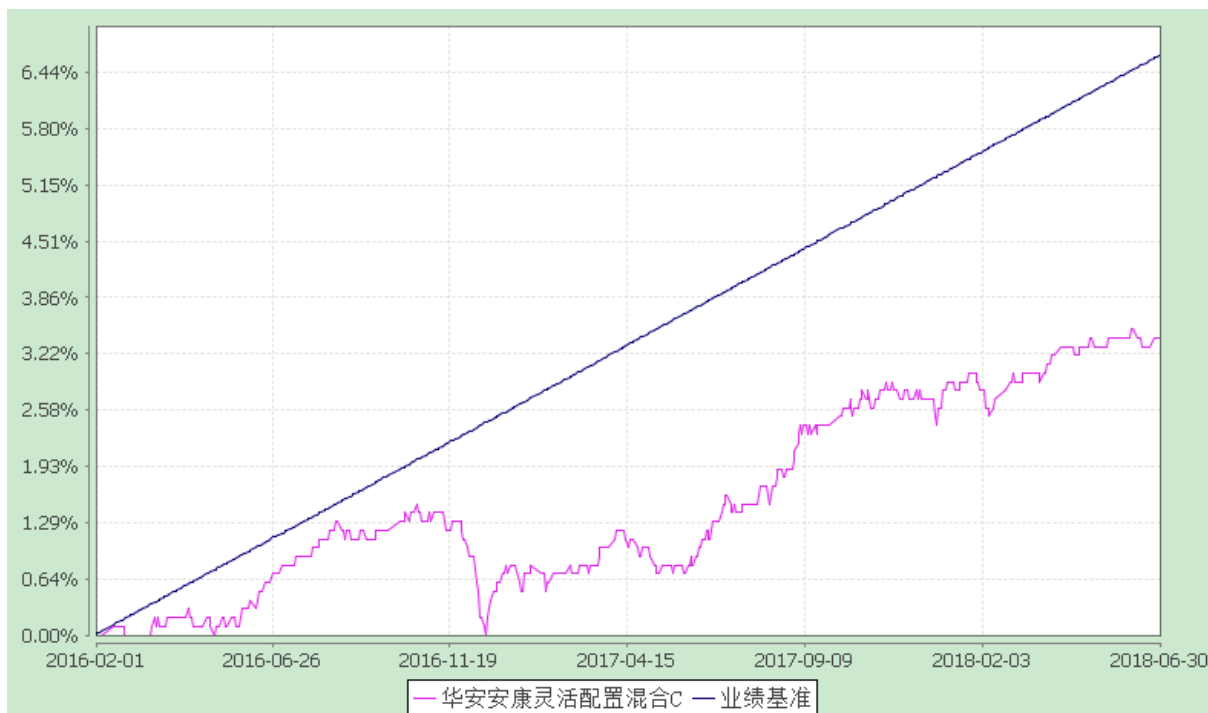
较

华安安康保本混合型证券投资基金  
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2016 年 2 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日)

华安安康保本混合 A



华安安康保本混合 C





## 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投资管理股份有限公司、上海国际信托有限公司、上海工业投资（集团）有限公司、上海锦江国际投资管理有限公司和国泰君安创新投资有限公司。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 6 月 30 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 103 只开放式基金，管理资产规模达到 2,460.80 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	2016-02-01	-	11 年	硕士研究生，11 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 月起担任华安稳固收益债券型证券投资基金的基金经理。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。2016 年 2 月起担任本基金的基金经理。2016 年 8 月起同时担任华安聚利 18 个月定期开放债券型证券投资基金的基金经理。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。

王嘉	本基金的基金经理	2016-02-18	-	14 年	硕士，14 年金融、证券行业从业经验。曾任上海市思也企业咨询有限公司研究员、上海市新理益投资管理有限公司研究员、莫尼塔投资咨询有限公司研究员、元大京华证券上海代表处研究员、兴业证券研究发展中心研究员。2010 年 5 月加入华安基金，现任基金投资部基金经理。2015 年 7 月起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 2 月至 2018 年 1 月，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 月起，同时担任本基金的基金经理。2018 年 2 月起，同时担任华安宝利配置证券投资基金的基金经理。2018 年 6 月起，同时担任华安新机遇灵活配置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合规守信情况的说明

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、邮件发送、登录在研究报告管理系统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。

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。

#### 4.3.2 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，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 3 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 年上半年随着全球经济增速有所放缓以及中美贸易摩擦不断升级,国内经济增长稳中趋缓,出口对经济形成一定负面拖累。由于地方政府债务整顿以及财政支出的下滑,基建增速放缓,制造业投资有所好转但幅度有限,房地产投资保持了良好的增长,部分弥补了基建投资的下滑,总体上投资保持小幅回落。随着居民可支配收入增速下滑,消费上半年增速放缓。由于食品价格下跌,通胀总体上保持了温和态势,对货币政策的约束有限。上半年货币政策总体上保持稳健态势,但央行公开市场操作灵活度继续提高,二季度降准部分置换 MLF 使得货币市场维持相对宽松格局,资金利率中枢显著下移,但在去杠杆和资管新规落地的严监管下,非标压缩导致社融增速明显下滑。在宽货币紧信用格局下,债券收益率总体下行,利率债和高等级信用债收益下行幅度较大,中低等级信用债继续分化。

本基金期内临近保本期到期,逐步降低权益仓位,组合操作以短期流动性资产投资为主,期内收益表现一般。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2018 年 6 月 30 日,华安安康保本混合 A 份额净值为 1.049 元,C 份额净值为 1.034 元;华安安康保本混合 A 份额净值增长率为 1.16%,C 份额净值增长率为 0.78%,同期业绩比较基准增长率为 1.36%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年,国内经济依然存在一定下滑压力,央行货币政策边际放松有利于宽货币向宽信用传导,社融增速有望修复,基于上半年财政支出增长较好以及减税的推动,财政政策可能发力,经济下滑幅度有限。通胀总体上可能继续保持温和,货币政策将继续维持相对稳健。债市在经济基本面下滑幅度有限以及货币政策维持相对稳健的情况下,仍有一定下行空间,但幅度相对有限。

本基金三季度将继续保持高等级信用债配置为主,保持适度久期和杠杆操作。

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，本基金托管人在对华安安康保本混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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，华安安康保本混合型证券投资基金的管理人——华安基金管理有限公司在华安安康保本混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何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，华安安康保本混合型证券投资基金未进行利润分配。

### **5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见**

本托管人依法对华安基金管理有限公司编制和披露的华安安康保本混合型证券投资基金 2018 年半年度报告中财务指标、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进行了

核查，以上内容真实、准确和完整。

## 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：华安安康保本混合型证券投资基金

报告截止日：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		-	-
银行存款	6.4.7.1	8,613,544.72	244,282,865.90
结算备付金		-	822,459.34
存出保证金		70,572.14	87,372.22
交易性金融资产	6.4.7.2	1,664,901,000.00	1,939,617,629.07
其中：股票投资		-	95,707,629.07
基金投资		-	-
债券投资		1,664,901,000.00	1,843,910,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	203,000,295.00	142,500,333.75
应收证券清算款		-	7,112,122.20
应收利息	6.4.7.5	25,631,078.99	30,950,393.50
应收股利		-	-
应收申购款		1,811.40	695.88
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,902,218,302.25	2,365,373,871.86
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2018 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2017 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		1,001,305.62	5,633,852.01
应付管理人报酬		1,890,482.49	2,483,359.09
应付托管费		315,080.42	413,893.16
应付销售服务费		138,629.84	198,447.04

应付交易费用	6.4.7.7	363,287.20	247,428.47
应交税费		112,722.28	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	205,941.58	442,680.67
负债合计		4,027,449.43	9,419,660.44
<b>所有者权益：</b>		-	-
实收基金	6.4.7.9	1,813,910,469.24	2,275,137,530.76
未分配利润	6.4.7.10	84,280,383.58	80,816,680.66
所有者权益合计		1,898,190,852.82	2,355,954,211.42
负债和所有者权益总计		1,902,218,302.25	2,365,373,871.86

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.046 元，基金份额总额 1,813,910,469.24 份，其中 A 类基金份额净值 1.049 元，基金份额总额 1,546,594,141.06 份；C 类基金份额净值 1.034 元，基金份额总额 267,316,328.18 份。

## 6.2 利润表

会计主体：华安安康保本混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		<b>38,108,169.89</b>	<b>68,307,552.53</b>
1.利息收入		42,915,941.95	77,939,954.02
其中：存款利息收入	6.4.7.11	895,385.74	11,104,182.41
债券利息收入		38,353,999.48	56,121,135.00
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		3,666,556.73	10,714,636.61
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-13,318,280.37	-46,255,701.20
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-10,282,896.29	3,335,860.40
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-3,034,875.08	-49,718,011.10
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-	-
股利收益	6.4.7.17	-509.00	126,449.50
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	7,303,682.35	31,951,547.37

4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	1,206,825.96	4,671,752.34
<b>减：二、费用</b>		<b>16,217,005.68</b>	<b>31,206,409.13</b>
1. 管理人报酬		12,267,662.31	24,514,823.87
2. 托管费		2,044,610.39	4,085,803.96
3. 销售服务费		933,251.66	1,897,987.57
4. 交易费用	6.4.7.20	595,885.02	369,490.48
5. 利息支出		97,165.52	100,497.32
其中：卖出回购金融资产支出		97,165.52	100,497.32
6.税金及附加		48,889.68	-
7. 其他费用	6.4.7.21	229,541.10	237,805.93
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>21,891,164.21</b>	<b>37,101,143.40</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>21,891,164.21</b>	<b>37,101,143.40</b>

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安安康保本混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 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）	2,275,137,530.76	80,816,680.66
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	21,891,164.21	21,891,164.21
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）	-461,227,061.52	-18,427,461.29	-479,654,522.81
其中：1.基金申购款	664,539.64	27,407.24	691,946.88
2.基金赎回款	-461,891,601.16	-18,454,868.53	-480,346,469.69
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）	1,813,910,469.24	84,280,383.58	1,898,190,852.82
项目	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 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）	4,652,809,039.22	48,621,378.84	4,701,430,418.06
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	37,101,143.40	37,101,143.40
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）	-1,227,346,953.46	-17,088,299.54	-1,244,435,253.00
其中：1.基金申购款	626,571.21	6,611.60	633,182.81
2.基金赎回款	-1,227,973,524.67	-17,094,911.14	-1,245,068,435.81
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）	3,425,462,085.76	68,634,222.70	3,494,096,308.46

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

华安安康保本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]64 号《关于准予华安安康保本混合型证券投资基金注册的批复》的核准,由华安基金管理有限公司作为管理人自 2016 年 1 月 18 日到 2016 年 1 月 28 日止期间向社会公开募集,募集期结束经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)验证并出具安永华明(2016)验字第 60971571\_B07 验资报告后,向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2016 年 2 月 1 日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金(本金)为人民币 5,198,204,037.97 元,在募集期间产生的存款利息为人民币 1,889,631.19 元,以上实收基金(本息)合计为人民币 5,200,093,669.16 元,折合 5,200,093,669.16 份基金份额,其中 A 类份额 4,324,785,413.60 份, C 类份额 875,308,255.56 份。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,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《华安安康保本混合型证券投资基金基金合同》的规定,除提前到期情形外,本基金以 30 个月为一个保本周期,第一个保本周期自基金合同生效日起至 30 个公历月后的对应日止,此后各保

本周期自本基金公告的保本周期起始之日起至 30 个公历月后对应日止；如对应日为非工作日或无该对应日，则顺延至下一个工作日。保本周期届满时，若符合保本基金存续条件，本基金转入下一保本周期；基金管理人将在保本周期到期前公告到期处理规则，确定下一个保本周期的起始时间；第一个保本周期之后各保本周期自基金公告的保本周期起始之日起至 30 个公历月后对应日止，若该对应日为非工作日或无该对应日，则顺延至下一个工作日。但在保本周期内，如本基金份额累计净值增长率连续 15 个工作日达到或超过预设的触发收益率，则基金管理人将在基金份额累计净值增长率连续达到或超过触发收益率的第 15 个工作日当日起 10 个工作日内，公告本基金当期保本周期提前到期（提前到期日距离满足提前到期条件之日起不超过 20 个工作日，且不得晚于非提前到期情形下的保本周期到期日）。

本基金第一个保本周期到期日，如基金份额持有人认购并持有到期的基金份额与到期日基金份额净值的乘积（以下简称“可赎回金额”）加上该部分基金份额累计分红金额之和低于认购保本金额，则基金管理人应补足该差额（即“保本赔付差额”），并在保本周期到期日后 20 个工作日内（含第 20 个工作日）将该差额支付给基金份额持有人。

其后各保本周期到期日，如基金份额持有人过渡期申购并持有到期以及从上一保本周期转入当期保本周期并持有到期的基金份额可赎回金额加上该部分基金份额在当期保本周期内的累计分红款项之和低于其保本金额，由当期有效的基金合同、《保证合同》或《风险买断合同》约定的基金管理人或保本义务人将保本赔付差额支付给基金份额持有人。

本基金到期操作期间为保本周期到期日及之后 5 个工作日（含第 5 个工作日）。在到期操作期间内，本基金接受赎回和转换转出申请，不接受申购和转换转入申请。如果基金份额持有人在到期操作期间内未选择赎回或转换转出，则基金管理人根据本基金到期存续形式视其默认选择转入下一保本周期或继续持有转型后的“华安安康灵活配置混合型证券投资基金”基金份额，默认操作日期为到期操作期间的最后一个工作日。

基金管理人有权视业务需要设定过渡期。过渡期指到期操作期间结束日的下一工作日至下一保本周期开始日前一工作日的区间，最长不超过 20 个工作日，具体由基金管理人在当期保本周期到期前公告的到期处理规则中确定。投资人在过渡期内申请购买本基金基金份额的行为称为“过渡期申购”。在过渡期内，投资人转换转入本基金基金份额，视同为过渡期申购。过渡期内，本基金将暂停办理日常赎回和转换转出业务。过渡期内，本基金不收取基金管理费、基金托管费和销售服务费。过渡期最后一个工作日（即下一保本周期开始日前一工作日）为下一保本周期的基金份额折算日。

在折算日，基金份额持有人所持有的基金份额（包括投资人到期操作期间内默认选择转入下一保本周期的基金份额和过渡期申购的基金份额）在其资产净值总额保持不变的前提下，变更登记为基金份额净值为 1.000 元的基金份额，基金份额数按折算比例相应调整。

本基金第一个保本周期由重庆三峡担保集团股份有限公司作为担保人，为基金管理人的保本义务提供不可撤销的连带责任保证；本基金第一个保本周期后各保本周期涉及的保本保障事宜，由基金管理人与担保人或保本义务人届时签订的保证合同或风险买断合同决定，并由基金管理人在当期保本周期开始前公告。保本周期届满时，若符合保本基金存续条件，本基金转入下一保本周期。保本周期届满时，在满足法律法规和基金合同规定的基金存续要求的前提下，若本基金不符合上述保本基金存续条件，则本基金将按基金合同的约定变更为“华安安康灵活配置混合型证券投资基金”。同时，基金的投资目标、投资范围、投资策略以及基金费率等相关内容也将根据基金合同的约定作相应修改。

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）、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货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。

本基金根据中国宏观经济情况和证券市场的阶段性变化，按照投资组合保险机制将资产配置于固定收益类资产与权益类资产。本基金投资的固定收益类资产为国内依法发行交易的国债、中央银行票据、政策性金融债、商业银行金融债及次级债、企业债、公司债、可转换债券、分离交易可转换债券、短期融资券、中期票据、地方政府债、城投债、中小企业私募债、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产；本基金投资的权益类资产为国内依法发行上市的股票、权证、股指期货等权益类资产。

本基金将根据中国宏观经济情况和证券市场的阶段性变化，按照投资组合保险机制对固定收益类资产和权益类资产的投资比例进行动态调整。本基金投资的股票等权益类资产占基金资产的比例不高于 40%；债券、货币市场工具等固定收益类资产占基金资产的比例不低于 60%；现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%。

本基金整体业绩比较基准：三年期银行定期存款收益率（税后）。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部颁布的《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（以下合称“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的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《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。

#### **6.4.3 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 6 月 30 日的财务状况以及 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

#### **6.4.4 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。

#### **6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

##### **6.4.5.1 会计政策变更的说明**

本基金本报告期无会计政策变更。

##### **6.4.5.2 会计估计变更的说明**

本基金本报告期无会计估计变更。

##### **6.4.5.3 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。

#### **6.4.6 税项**

##### **6.4.6.1 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。

#### 6.4.6.2 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。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，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；

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，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（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 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，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

#### 6.4.6.3 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[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。

#### 6.4.6.4 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；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《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》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按 25% 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；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《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》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
活期存款	8,613,544.72
定期存款	-
其他存款	-

合计	8,613,544.72
----	--------------

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	1,663,700,822.17	1,664,901,000.00
	合计	1,663,700,822.17	1,664,901,000.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,663,700,822.17	1,664,901,000.00	1,200,177.83

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	13,000,000.00	-
银行间市场	190,000,295.00	-
合计	203,000,295.00	-

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日

应收活期存款利息	2,260.56
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	25,557,573.89
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	71,215.92
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	28.62
合计	25,631,078.99

#### 6.4.7.6 其他资产

无余额。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	327,412.84
银行间市场应付交易费用	35,874.36
合计	363,287.20

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	7,585.49
预提账户维护费	-
预提审计费	49,588.57
预提信息披露费	148,767.52
合计	205,941.58

#### 6.4.7.9 实收基金

华安安康保本混合 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日



	基金份额	账面金额
上年度末	1,913,996,109.88	1,913,996,109.88
本期申购	578,486.99	578,486.99
本期赎回（以“-”号填列）	-367,980,455.81	-367,980,455.81
本期末	1,546,594,141.06	1,546,594,141.06

华安安康保本混合 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	361,141,420.88	361,141,420.88
本期申购	86,052.65	86,052.65
本期赎回（以“-”号填列）	-93,911,145.35	-93,911,145.35
本期末	267,316,328.18	267,316,328.18

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

华安安康保本混合 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	76,949,613.61	-5,514,966.98	71,434,646.63
本期利润	13,057,411.83	6,228,139.91	19,285,551.74
本期基金份额交易产生的变动数	-16,348,919.20	751,039.19	-15,597,880.01
其中：基金申购款	25,364.74	-669.10	24,695.64
基金赎回款	-16,374,283.94	751,708.29	-15,622,575.65
本期已分配利润	-	-	-
本期末	73,658,106.24	1,464,212.12	75,122,318.36

华安安康保本混合 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	10,405,865.94	-1,023,831.91	9,382,034.03
本期利润	1,530,070.03	1,075,542.44	2,605,612.47
本期基金份额交易产生的变动数	-3,030,223.75	200,642.47	-2,829,581.28
其中：基金申购款	2,860.39	-148.79	2,711.60

基金赎回款	-3,033,084.14	200,791.26	-2,832,292.88
本期已分配利润	-	-	-
本期末	8,905,712.22	252,353.00	9,158,065.22

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
活期存款利息收入	303,169.17	
定期存款利息收入	588,541.69	
其他存款利息收入	-	
结算备付金利息收入	2,921.67	
其他	753.21	
合计	895,385.74	

#### 6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期	
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
卖出股票成交总额	221,004,869.39	
减：卖出股票成本总额	231,287,765.68	
买卖股票差价收入	-10,282,896.29	

#### 6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期	
	2018年1月1日至2018年6月30日	
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	2,699,252,702.25	
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	2,641,799,125.08	
减：应收利息总额	60,488,452.25	
买卖债券差价收入	-3,034,875.08	

#### 6.4.7.14 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.15 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.16 衍生工具收益

#### 6.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

#### 6.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期无衍生工具收益——其他投资收益。

#### 6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
股票投资产生的股利收益	-509.00
基金投资产生的股利收益	-
合计	-509.00

#### 6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
1.交易性金融资产	7,303,682.35
——股票投资	780,481.36
——债券投资	6,523,200.99
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	7,303,682.35

#### 6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
基金赎回费收入	1,199,075.52
转换费收入	7,750.44
合计	1,206,825.96

### 6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	579,910.02
银行间市场交易费用	15,975.00
合计	595,885.02

### 6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2018年1月1日至2018年6月30日
审计费用	49,588.57
信息披露费	148,767.52
银行汇划费用	12,585.01
账户维护费	18,300.00
其他费用	300.00
合计	229,541.10

### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 6.4.8.1 或有事项

无。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

### 6.4.9 关联方关系

#### 6.4.9.1 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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
中国工商银行股份有限公司(“工商银行”)	基金托管人、基金代销机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

**6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易**

**6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易**

**6.4.10.1.1 股票交易**

无。

**6.4.10.1.2 权证交易**

无。

**6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金**

无。

**6.4.10.2 关联方报酬**

**6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月 30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6 月30日
当期发生的基金应支付的管理费	12,267,662.31	24,514,823.87
其中：支付销售机构的客户维护费	4,881,580.42	9,289,845.76

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.2%年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。基金管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.2\% \div \text{当年天数}$$

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

**6.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月 30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6 月30日
当期发生的基金应支付的托管费	2,044,610.39	4,085,803.96

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.2%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

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

### 6.4.10.2.3 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6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华安安康保本混合 A	华安安康保本混合 C	合计
工商银行	-	405,963.03	405,963.03
华安基金管理有限公司	-	1,852.50	1,852.50
合计	-	407,815.53	407,815.53
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6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华安安康保本混合 A	华安安康保本混合 C	合计
华安基金管理有限公司	-	3,887.25	3,887.25
工商银行	-	698,574.61	698,574.61
合计	-	702,461.86	702,461.86

注：本基金 C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.6% 年费率计提。销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.6\% \div \text{当年天数}$$

H 为本基金 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为本基金 C 类基金份额前一日的基金资产净值

### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

#### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

#### 6.4.10.4.2 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

基金管理公司主要股东及其控制的机构本报告期末无投资本基金的情况。

**6.4.10.5 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		上年度可比期间	
	2018年1月1日至2018年6月30日		2017年1月1日至2017年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	8,613,544.72	303,169.17	84,167,755.13	410,836.90

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

**6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

无。

**6.4.10.7 其他关联交易事项的说明**

**6.4.10.7.1 其他关联交易事项的说明**

无。

**6.4.11 利润分配情况**

无。

**6.4.12 期末（2018 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券**

**6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

无。

**6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

本基金本期末未持有流通受限股票。

**6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**

**6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

截至报告期末 2018 年 6 月 30 日止，本基金无银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

**6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

截至报告期末 2018 年 6 月 30 日止，本基金无交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

**6.4.13 金融工具风险及管理**

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。本基金通过运用投资组合保险基数，有效控制本金损失的风险，在本金安全的基础上实现基金资产的稳定增值。

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部等相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理和投资风险、绩效评估等。监察稽核部和风险管理部对公司督察长负责。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。从定量分析的角度出发，根据

本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具，通过特定的风险量化指标、模型，形成常规的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本公司在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在经中国人民银行和中国证券监督管理委员会所批准的具有基金托管资格和基金代销资格的银行，并根据本公司管理交易对手的经验进行筛选，因而与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险；在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元



短期信用评级	本期末 2018年6月30日	上年末 2017年12月31日
A-1	-	100,448,000.00
A-1 以下	-	-
未评级	1,664,901,000.00	1,542,734,000.00
合计	1,664,901,000.00	1,643,182,000.00

注：未评级债券为超短期融资券、同业存单。

#### 6.4.13.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2018年6月30日	上年末 2017年12月31日
AAA	-	150,753,000.00
AAA 以下	-	-
未评级	-	49,975,000.00
合计	-	200,728,000.00

注：未评级债券为国债、政策性金融债

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非

常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人主要通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在段时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在银行间同业市场交易，其余亦可在证券交易所市场交易，因此除附注中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理,通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%,且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%,本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的 30%。

本基金所持部分证券在证券交易所上市,其余亦可在银行间同业市场交易,部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注。此外,本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求,其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算,确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时,本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度;按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理,以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外,本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度:根据质押品的资质确定质押率水平;持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额;并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时,可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施,本基金在本报告期内流动性情况良好。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险,包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

#### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2018年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	8,613,544.72	-	-	-	8,613,544.72
存出保证金	70,572.14	-	-	-	70,572.14
交易性金融资产	1,664,901,000.00	-	-	-	1,664,901,000.00
买入返售金融资产	203,000,295.00	-	-	-	203,000,295.00
应收利息	-	-	-	25,631,078.99	25,631,078.99
应收申购款	-	-	-	1,811.40	1,811.40
资产总计	1,876,585,411.86	-	-	25,632,890.39	1,902,218,302.25
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,001,305.62	1,001,305.62
应付管理人报酬	-	-	-	1,890,482.49	1,890,482.49
应付托管费	-	-	-	315,080.42	315,080.42
应付销售服务费	-	-	-	138,629.84	138,629.84
应付交易费用	-	-	-	363,287.20	363,287.20
应交税费	-	-	-	112,722.28	112,722.28
其他负债	-	-	-	205,941.58	205,941.58
负债总计	-	-	-	4,027,449.43	4,027,449.43
利率敏感度缺口	1,876,585,411.86	-	-	21,605,440.96	1,898,190,852.82
上年度末 2017年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计

资产					
银行存款	244,282,865.90	-	-	-	244,282,865.90
结算备付金	822,459.34	-	-	-	822,459.34
存出保证金	87,372.22	-	-	-	87,372.22
交易性金融资产	1,843,910,000.00	-	-	95,707,629.07	1,939,617,629.07
买入返售金融资产	142,500,333.75	-	-	-	142,500,333.75
应收证券清算款	-	-	-	7,112,122.20	7,112,122.20
应收利息	-	-	-	30,950,393.50	30,950,393.50
应收申购款	-	-	-	695.88	695.88
资产总计	2,231,603,031.21	-	-	133,770,840.65	2,365,373,871.86
负债					
应付赎回款	-	-	-	5,633,852.01	5,633,852.01
应付管理人报酬	-	-	-	2,483,359.09	2,483,359.09
应付托管费	-	-	-	413,893.16	413,893.16
应付销售服务费	-	-	-	198,447.04	198,447.04
应付交易费用	-	-	-	247,428.47	247,428.47
其他负债	-	-	-	442,680.67	442,680.67
负债总计	-	-	-	9,419,660.44	9,419,660.44
利率敏感度缺口	2,231,603,031.21	-	-	124,351,180.21	2,355,954,211.42

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的	
		影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
	市场利率上升 25 个基点	减少约 27	减少约 131
	市场利率下降 25 个基点	增加约 27	增加约 131

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金投资的股票等风险资产占基金资产的比例不高于 40%；债券、货币市场工具等保本资产占基金资产的比例不低于 60%；现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%。

此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日		上年度末 2017 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	-	-	95,707,629.07	4.06
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	-	-	95,707,629.07	4.06

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2018 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性权益类投资，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响。

### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本财务报表已于 2018 年 8 月 23 日经本基金的基金管理人批准。

## 7 投资组合报告

### 7.1 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	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,664,901,000.00	87.52
	其中：债券	1,664,901,000.00	87.52
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	203,000,295.00	10.67
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	8,613,544.72	0.45
8	其他各项资产	25,703,462.53	1.35
9	合计	1,902,218,302.25	100.00

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 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。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票投资。

### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 7.4.1 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

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	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601155	新城控股	26,215,506.36	1.11
2	600622	光大嘉宝	11,137,194.00	0.47
3	002146	荣盛发展	11,074,361.72	0.47
4	600606	绿地控股	10,567,658.00	0.45
5	000961	中南建设	10,268,436.50	0.44
6	601111	中国国航	9,009,878.00	0.38
7	300225	金力泰	8,719,060.00	0.37
8	000717	韶钢松山	8,646,680.00	0.37
9	601318	中国平安	6,128,900.00	0.26
10	600845	宝信软件	5,822,066.20	0.25
11	603369	今世缘	5,749,320.05	0.24
12	600029	南方航空	5,319,779.00	0.23
13	300285	国瓷材料	5,049,279.00	0.21
14	000537	广宇发展	4,297,476.48	0.18
15	600519	贵州茅台	4,277,943.00	0.18
16	600760	中航沈飞	1,712,962.00	0.07
17	002926	华西证券	282,324.24	0.01
18	300741	华宝股份	101,325.00	0.00
19	002925	盈趣科技	68,670.00	0.00
20	300737	科顺股份	61,023.35	0.00

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。

#### 7.4.2 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

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	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300285	国瓷材料	28,732,611.26	1.22
2	002366	台海核电	27,641,674.79	1.17
3	601155	新城控股	26,188,554.99	1.11
4	000537	广宇发展	12,221,269.49	0.52
5	600048	保利地产	12,105,367.00	0.51
6	002146	荣盛发展	11,941,004.00	0.51
7	600693	东百集团	11,719,645.77	0.50
8	600606	绿地控股	11,536,364.00	0.49
9	000961	中南建设	10,442,622.00	0.44
10	601111	中国国航	9,400,627.60	0.40
11	000717	韶钢松山	8,406,783.00	0.36

12	600622	光大嘉宝	8,253,134.32	0.35
13	002694	顾地科技	7,114,198.70	0.30
14	600845	宝信软件	6,078,718.82	0.26
15	603369	今世缘	5,947,041.79	0.25
16	601318	中国平安	5,788,750.00	0.25
17	600029	南方航空	5,650,445.00	0.24
18	600519	贵州茅台	4,583,042.00	0.19
19	300225	金力泰	3,177,748.00	0.13
20	600760	中航沈飞	1,785,145.00	0.08

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。

### 7.4.3 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	134,799,655.25
卖出股票的收入（成交）总额	221,004,869.39

注：本项“买入股票的成本（成交）总额”和“卖出股票的收入（成交）总额”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。

### 7.5 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	110,000,000.00	5.79
	其中：政策性金融债	110,000,000.00	5.79
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	953,672,000.00	50.24
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	601,229,000.00	31.67
9	其他	-	-
10	合计	1,664,901,000.00	87.71



## 7.6 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	111818033	18 华夏银行 CD033	3,000,000	293,280,000.00	15.45
2	011800609	18 中核建 SCP003	1,500,000	150,345,000.00	7.92
3	011800179	18 大唐集 SCP002	1,100,000	110,506,000.00	5.82
4	170207	17 国开 07	1,100,000	110,000,000.00	5.79
5	011800885	18 光明 SCP005	1,000,000	100,140,000.00	5.28

## 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

## 7.8 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。

## 7.9 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。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 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。

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，有选择地投资于流动性好、交易活跃的股指期货合约。

本基金在进行股指期货投资时，首先将基于对证券市场总体行情的判断和组合风险收益的分析确定投资时机以及套期保值的类型（多头套期保值或空头套期保值），并根据权益类资产投资（或拟投资）的总体规模和风险系数决定股指期货的投资比例；其次，本基金将在综合考虑证券市场和期货市场运行趋势以及股指期货流动性、收益性、风险特征和估值水平的基础上进行投资品种选择，以对冲权益类资产组合的系统性风险和流动性风险。此外，基金管理人还将建立股指期货交易决策

部门或小组，授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项，同时针对股指期货交易制定投资决策流程和风险控制等制度并报董事会批准。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

无。

### 7.11.2 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。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

无。

## 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

7.12.2 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。

### 7.12.3 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	70,572.14
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	25,631,078.99
5	应收申购款	1,811.40
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	25,703,462.53

### 7.12.4 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。

**7.12.5 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存在流通受限情况的股票。

**8 基金份额持有人信息**

**8.1 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
华安安康保本混合 A	9,627	160,651.72	35,005,425.00	2.26%	1,511,588,716.06	97.74%
华安安康保本混合 C	2,067	129,325.75	100,049.50	0.04%	267,216,278.68	99.96%
合计	11,694	155,114.63	35,105,474.50	1.94%	1,778,804,994.74	98.06%

**8.2 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	华安安康保本混合 A	20.70	0.00%
	华安安康保本混合 C	13.20	0.00%
	合计	33.90	0.00%

**8.3 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、基金投资和研发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。

**9 开放式基金份额变动**

单位：份

项目	华安安康保本混合 A	华安安康保本混合 C
基金合同生效日(2016 年 2 月 1 日)基金份额总额	4,324,785,413.60	875,308,255.56
本报告期期初基金份额总额	1,913,996,109.88	361,141,420.88
本报告期基金总申购份额	578,486.99	86,052.65

减：本报告期基金总赎回份额	367,980,455.81	93,911,145.35
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,546,594,141.06	267,316,328.18

注：总申购份额含转换入份额。总赎回份额含转换出份额。

## 10 重大事件揭示

### 10.1 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。

### 10.2 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：

无。

### 10.3 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。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内无基金投资策略的改变。

### 10.5 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。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内无管理人、托管人及其高级管理人员受证券监管部门稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 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	
广发华福	1	-	-	-	-	-
中投证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
宏信证券	1	-	-	-	-	-
红塔证券	1	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-

瑞银证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
民族证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
上海华信	1	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
中天证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	88,950,136.58	25.06%	82,840.00	25.30%	-
中泰证券	2	66,049,947.39	18.61%	60,191.10	18.38%	-
国金证券	2	58,113,807.73	16.37%	53,679.23	16.39%	-
华创证券	1	50,666,736.77	14.27%	47,185.65	14.41%	-
广发证券	1	27,641,674.79	7.79%	25,189.83	7.69%	-
西藏东方财富	1	19,336,460.20	5.45%	17,621.31	5.38%	-
国泰君安	1	17,712,572.06	4.99%	16,141.36	4.93%	-
民生证券	1	13,851,504.57	3.90%	12,899.74	3.94%	-
天风证券	1	4,792,195.01	1.35%	4,367.20	1.33%	-
中信证券	1	4,583,042.00	1.29%	4,268.18	1.30%	-
招商证券	1	2,355,077.00	0.66%	2,146.21	0.66%	-
东兴证券	1	948,215.60	0.27%	883.03	0.27%	-

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：

2018 年 4 月完成租用托管在工行的上交所红塔证券 22250 交易单元

**10.7.2 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
广发华福	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
宏信证券	-	-	-	-	-	-
红塔证券	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
民族证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
上海华信	-	-	-	-	-	-

恒泰证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
中天证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	70,000,000.00	84.34%	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
西藏东方财富	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	13,000,000.00	15.66%	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华安基金管理有限公司关于旗下产品实施增值税政策的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2018-01-03
2	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“台海核电”股票估值调整的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2018-01-05
3	关于旗下部分基金增加大河财富为销售机构并参加费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2018-01-09
4	关于旗下部分基金增加电盈基金为销售机构并参加费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2018-01-16
5	关于旗下部分基金增加国金证券为销售机构并参加费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2018-01-20
6	关于旗下部分基金参加华信证券费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2018-02-08

7	华安基金管理有限公司关于副总经理变更的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2018-02-13
8	关于旗下部分基金增加众禄为销售机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2018-03-08
9	关于基金电子交易平台延长工行直联结算方式费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2018-03-14
10	关于电子直销平台开展“微钱宝”账户交易费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2018-03-21
11	关于旗下公开募集证券投资基金根据流动性风险管理规定修改基金合同的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2018-03-24
12	华安安康保本混合型证券投资基金基金合同修改前后对照表	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2018-03-24
13	华安基金管理有限公司关于旗下基金参加东海证券费率优惠的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2018-03-27
14	关于旗下部分基金参加中国工商银行股份有限公司费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2018-03-29
15	华安基金关于参加中国银行优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2018-04-11
16	华安基金关于参加华安证券优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2018-04-12
17	华安基金管理有限公司关于暂停上海华信证券有限责任公司销售旗下基金业务公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2018-04-13
18	关于旗下部分基金增加鑫鼎盛为销售机构并参加费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2018-04-14
19	关于旗下部分基金增加唐鼎耀华为销售机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2018-04-20
20	华安基金关于参加中经北正优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2018-04-26
21	关于旗下部分基金增加钜派为销售机构并参加费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2018-05-18



		司网站	
22	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“金力泰”股票估值调整的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2018-05-24
23	关于基金电子交易平台汇付天天盈渠道关闭基金支付服务的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2018-06-11
24	关于华安暂停与浙江金观诚开展基金销售合作业务的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2018-06-12
25	关于华安暂停与苏州财路开展基金销售合作业务的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2018-06-13
26	关于基金电子交易平台延长工行直联结算方式费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2018-06-15
27	关于旗下部分基金增加嘉实财富为销售机构并参加费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2018-06-26
28	关于电子直销平台延长“微钱宝”账户交易费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2018-06-27
29	关于基金电子交易平台调整微钱宝快速取现服务限额的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2018-06-27

注：前款所涉重大事件已作为临时报告在《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 [www.huaan.com.cn](http://www.huaan.com.cn) 上披露。

## 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- 1、《华安安康保本混合型证券投资基金基金合同》
- 2、《华安安康保本混合型证券投资基金招募说明书》
- 3、《华安安康保本混合型证券投资基金托管协议》
- 4、中国证监会批准华安安康保本混合型证券投资基金设立的文件；
- 5、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告原件；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
- 7、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 8、华安基金管理有限公司开放式基金业务规则。

## 11.2 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>。

## 11.3 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

二〇一八年八月二十四日