

# 华安养老目标日期 2030 三年持有期混合型发起 式基金中基金(FOF) 2019 年半年度报告摘要

2019 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：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一九年八月二十八日

## 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 8 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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 4 月 26 日起至 6 月 30 日止。

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	华安养老 2030 三年
基金主代码	006575
交易代码	006575
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019 年 4 月 26 日
基金管理人	华安基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	252,789,288.58 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制投资风险的前提下，力争获取超越业绩比较基准的投资收益，为基金份额持有人创造持续稳定的投资回报。
投资策略	<p>本基金通过严谨的资产配置策略与证券投资基金精选策略，在严格控制投资风险的前提下，力争实现基金资产持续稳定增值。</p> <p>本基金为养老目标日期策略基金，基金资产根据华安养老目标日期基金设定的下滑曲线进行动态配置调整，即随着投资人生命周期的变化以及目标日期的临近（本基金为 2030 年），本基金投资风格相应由“进取”，进而转变为“稳健”，最后转变为“保守”，逐步降低权益类资产（包括股票、股票型基金、在基金合同中明确约定基金资产 50% 以上投资于股票的混合型基金）的配置比例，增加固定收益类资产的配置比例。</p> <p>在实际管理过程中，本基金具体各类资产配置比例由基金管理人根据中国宏观经济情况和证券市场阶段性变化，在限定范围内做适度主动调整，以求基金资产在各类资产的投资中达到风险和收益的平衡。</p>
业绩比较基准	$\text{中证 800 指数收益率} \times X + \text{中债综合财富（总值）指数收益率} \times (1-X)$ 其中，X 值为本基金各阶段权益类资产（包括股票、股票型基金、在基金合同中明确约定基金资产 50% 以上投资于股票的混合型基金）配置中枢。（配置中枢详见基金合同）
风险收益特征	本基金为混合型基金中基金（FOF），风险与预期收益高于债券型基金中基金、债券型基金，高于货币型基金中基金、货币基金，低于股票型基金中基金、股票型基金。

### 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	中国建设银行股份有限公司
信息披露	姓名	陆滢	田青
	联系电话	021-38969999	010-67595096

负责人	电子邮箱	luying@huaan.com.cn	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		4008850099	010-67595096
传真		021-68863414	010-66275853

## 2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告摘要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

## 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（2019 年 4 月 26 日（基金合同生效日）至 2019 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	582,968.92
本期利润	1,330,730.42
加权平均基金份额本期利润	0.0054
本期基金份额净值增长率	0.53%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019 年 6 月 30 日)
期末可供分配基金份额利润	0.0023
期末基金资产净值	254,139,536.06
期末基金份额净值	1.0053

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

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	0.29%	0.07%	2.41%	0.59%	-2.12%	-0.52%

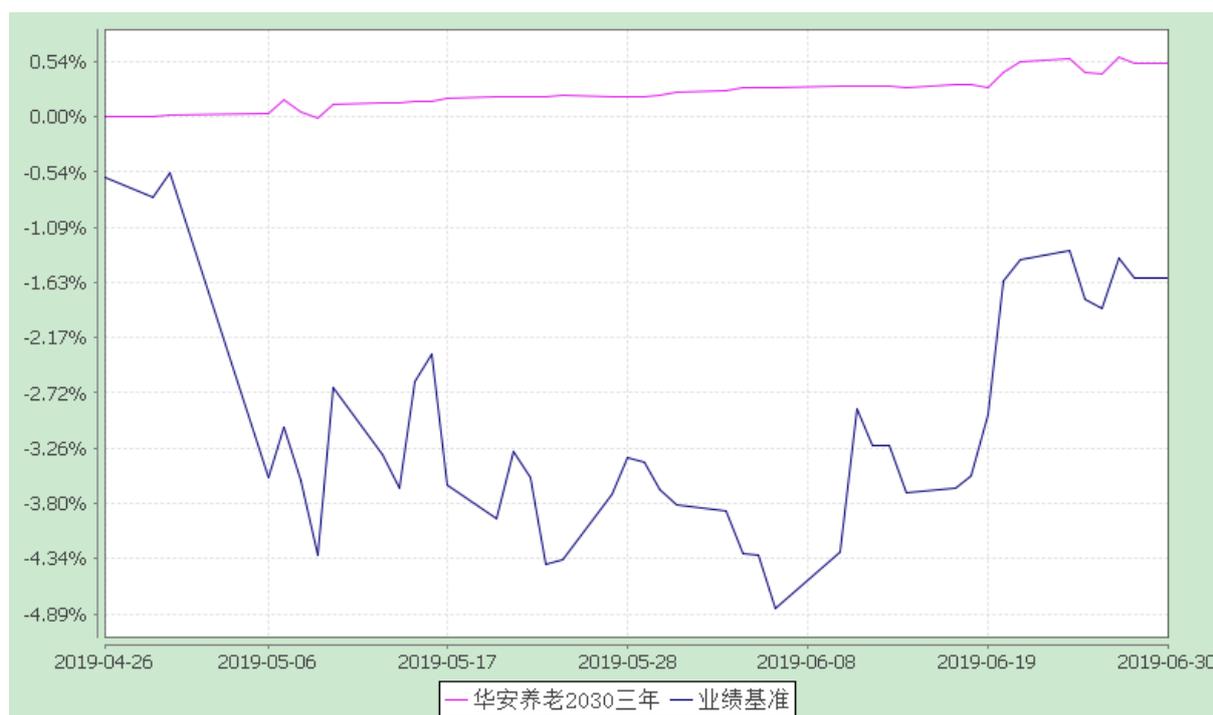
自基金合同生效起至今	0.53%	0.06%	-1.58%	0.80%	2.11%	-0.74%
------------	-------	-------	--------	-------	-------	--------

### 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

华安养老目标日期 2030 三年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)

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

(2019 年 4 月 26 日至 2019 年 6 月 30 日)



注：本基金成立日期为 2019 年 4 月 26 日，截止报告期末，本基金成立后基金合同生效未满一年。

## 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、西安、

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 2019 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 123 只开放式基金，管理资产规模达到 3171.00 亿元人民币。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
杨志远	本基金的基金经理	2019-04-26	-	7 年	硕士研究生，7 年证券、基金行业从业经验。曾任上海证券有限责任公司研究员、东海基金管理有限公司产品经理、中银基金管理有限公司高级产品经理。2016 年 8 月加入华安基金，现任基金组合投资部基金经理。2019 年 4 月起担任本基金的基金经理。
何移直	本基金的基金经理	2019-04-26	-	26 年	博士研究生，26 年金融相关行业从业经验。曾任东海明珠期货经纪有限公司证券分析师、光彩事业投资管理集团投资主管、中国网络通信股份有限公司高级经理、荷兰 APX 交易所集团数量风险分析师、荷兰 Nidera 交易集团投资风险分析师、金思维投资咨询(上海)有限公司。2010 年 9 月加入华安基金，历任风险管理部高级总监、企业发展部高级总监、专户量化部总监。现任基金组合投资部基金经理。2019 年 4 月起担任本基金的基金经理。

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》，将各投资组合在研究分析、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。

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》，公司风险管理部会同基金投资、交易部门讨论制定了各类投资组合针对股票、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。同时加强了对各类投资组合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，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 0 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

2019 年上半年市场风险偏好经历“过山车”，波动率先下后上。国内股票市场整体上涨，上证综指累计上涨 19.45%，深证综指累计上涨 23.23%，沪深 300 累计上涨 27.07%，中小板综指累计上涨 19.99%，创业板综指累计上涨 20.94%。不及海外债券利率的趋势性下行，国内债券市场维持震荡格局，十年期国债到期收益率与年初基本持平。货币政策稳健偏宽松格局下，资金利率显著下行。

报告期内，本基金仍处于建仓期，综合考虑本基金资金的属性、资本市场的波动性等因素，管理人力争本基金平稳起步，固收类资产先行配置、权益类资产稳步增加，基金单位净值总体平稳增长。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2019 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.0053 元，本报告期份额净值增长率为 0.53%，同期业绩比较基准增长率为-1.58%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

中国经济长期仍具备较强的韧性，贸易摩擦难以改变我国出口大国的大趋势；货币政策来看，中短期来看流动性大概率无忧。海外“水位”上升凸显中国利率债的投资价值，对海外资金形成较强的吸引力。

各主要股票指数估值已经处于历史较低位置，是长期投资非常好的区域。近几年股票市场出现较大幅度波动，股票指数整体仍处于较低水平，但基金市场上仍有不少基金的净值创下历史新高，我们始终认为“好基金、好价格、长期持有”，实现盈利是大概率事件。作为机构投资者，我们希望

凭借自身在基金投资和风险管理方面的优势，通过长期投资来获取长期稳健的回报。

“稳中求进”仍是我们未来投资操作的主旋律，组合层面，我们仍将保持多元化、分散化的配置，为短期波动做好防御准备。

#### 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、研究部总监、固定收益部总监、指数与量化投资部总监、基金运营部高级总监、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

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

## 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

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

报告期内，本基金未实施利润分配。

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

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

# 6 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：华安养老目标日期 2030 三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日
<b>资 产：</b>		-
银行存款	6.4.7.1	8,971,572.51
结算备付金		2,195,152.04
存出保证金		25,634.64
交易性金融资产	6.4.7.2	211,145,021.22
其中：股票投资		-
基金投资		190,161,821.22
债券投资		20,983,200.00
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	37,500,000.00
应收证券清算款		-
应收利息	6.4.7.5	239,587.18
应收股利		2,500.13
应收申购款		44,988.09
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	99.00

资产总计		260,124,554.81
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2019年6月30日</b>
<b>负 债:</b>		-
短期借款		-
交易性金融负债	6.4.7.3	-
衍生金融负债		-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		5,749,568.31
应付赎回款		-
应付管理人报酬		158,500.53
应付托管费		38,954.93
应付销售服务费		-
应付交易费用	6.4.7.7	-
应交税费		1,034.98
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	36,960.00
负债合计		5,985,018.75
<b>所有者权益:</b>		-
实收基金	6.4.7.9	252,789,288.58
未分配利润	6.4.7.1 0	1,350,247.48
所有者权益合计		254,139,536.06
负债和所有者权益总计		260,124,554.81

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0053 元，基金份额总额 252,789,288.58 份。

## 6.2 利润表

会计主体：华安养老目标日期 2030 三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)

本报告期：2019 年 4 月 26 日（基金合同生效日）至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019年4月26日（基金合同生效日）至2019 年6月30日
<b>一、收入</b>		<b>1,817,489.50</b>
1.利息收入		607,185.37
其中：存款利息收入	6.4.7.11	37,907.09
债券利息收入		64,173.69
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		505,104.59

其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		462,338.34
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-
基金投资收益		214,045.14
债券投资收益	6.4.7.13	-
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	248,293.20
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	747,761.50
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	204.29
<b>减：二、费用</b>		<b>486,759.08</b>
1. 管理人报酬		347,159.68
2. 托管费		85,310.43
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.4.7.20	12,565.30
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		494.45
7. 其他费用	6.4.7.21	41,229.22
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>1,330,730.42</b>
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>1,330,730.42</b>

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安养老目标日期 2030 三年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)

本报告期：2019 年 4 月 26 日（基金合同生效日）至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 4 月 26 日（基金合同生效日）至 2019 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）	243,149,236.40	-	243,149,236.40
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,330,730.42	1,330,730.42
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净	9,640,052.18	19,517.06	9,659,569.24

值减少以“-”号填列)			
其中：1. 基金申购款	9,640,052.18	19,517.06	9,659,569.24
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)	252,789,288.58	1,350,247.48	254,139,536.06

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

华安养老目标日期 2030 三年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)(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 1661 号《关于准予华安养老目标日期 2030 三年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)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《华安养老目标日期 2030 三年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，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 243,115,289.12 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(2019)第 0266 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华安养老目标日期 2030 三年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)基金合同》于 2019 年 4 月 26 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 243,149,236.40 份基金份额，其中认购资金利息折合 33,947.28 份基金份额。本基金的基金管理人为华安基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

本基金为发起式基金，发起资金认购部分为 51,487,904.63 份基金份额，发起资金认购方承诺使用发起资金认购的基金份额持有期限不少于 3 年。

本基金设置投资者最短持有期限为三年。对于每份基金份额，自基金合同生效之日(含)(对于认购份额而言)起或自基金份额申购确认日(含)(对于申购份额而言)起至 3 个公历年后对应日(如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)的前一日为最短持有期限，最短持有期限内基

金份额持有人不能提出赎回申请。每份基金份额的最短持有期限结束日的下一工作日(含)起,基金份额持有人可提出赎回申请。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安养老目标日期 2030 三年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括经中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金(包括 QDII 基金,以下简称“证券投资基金”)、香港互认基金、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(包括国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、可交换债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券等)、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。除为申购股票型 ETF 而持有股票外,本基金不直接投资股票、权证等权益类资产。除为申购债券型 ETF 而持有相关种类债券外,本基金不直接买入信用类债券;因股票型 ETF 赎回所形成的股票、债券型 ETF 赎回所形成的信用类债券,原则上在二十个交易日内卖出。本基金的投资组合比例为:80%以上的基金资产投资于证券投资基金,其中,投资于股票、股票型基金、混合型基金和商品基金(含商品期货基金和黄金 ETF)等品种的比例合计不超过基金资产的 60%,现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。

根据《华安养老目标日期 2030 三年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)基金合同》的有关规定,本基金采用目标日期投资策略,随着所设定目标日期的临近,将逐步降低权益类资产(包括股票、股票型基金、在基金合同中明确约定基金资产 50%以上投资于股票的混合型基金)的配置比例,增加固定收益类资产的配置比例。本基金的业绩比较基准为:中证 800 指数收益率 $\times X$  +中债综合财富(总值)指数收益率 $\times(1-X)$ 。其中, X 值为本基金各阶段权益类资产(包括股票、股票型基金、在基金合同中明确约定基金资产 50%以上投资于股票的混合型基金)配置中枢。

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 8 月 26 日批准报出。

#### 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 2019 年 06 月 30 日的财务状况以及 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 06 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 6.4.4.1 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。

##### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 6.4.4.3 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债券投资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。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卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等

#### 6.4.4.4 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债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。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和债券投资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。

#### **6.4.4.6 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。

#### **6.4.4.7 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。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### **6.4.4.8 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)。

#### **6.4.4.9 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。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债

券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

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。

#### **6.4.4.10 费用的确认和计量**

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务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。

#### **6.4.4.11 基金的收益分配政策**

本基金同一类别的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，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按红利发放日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

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。

#### **6.4.4.12 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。

#### **6.4.4.13其他重要的会计政策和会计估计**

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1)对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

### **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**

本基金本报告期未发生会计政策变更。

#### **6.4.5.2会计估计变更的说明**

本基金本报告期未发生会计估计变更。

#### **6.4.5.3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。

#### 6.4.6 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[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。

对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，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起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、债券的差价收入，股票的股息、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。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。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。

(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。

(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。

## 6.4.7 关联方关系

### 6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

无。

### 6.4.7.2 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	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	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。

## 6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.8.1.1 股票交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易，无上年度可比期间。

#### 6.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易，无上年度可比期间。

#### 6.4.8.1.3 债券交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易，无上年度可比期间。

#### 6.4.8.1.4 债券回购交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券回购交易，无上年度可比期间。

#### 6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期无应支付关联方的佣金，无上年度可比期间。

#### 6.4.8.2 关联方报酬

##### 6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2019年4月26日（基金合同生效日）至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	347,159.68
其中：支付销售机构的客户维护费	13,755.18

注：管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.90\% \div \text{当年天数}$$

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扣除基金财产中本基金管理人所发行或运作管理的证券投资基金份额所对应资产净值的剩余部分（若为负数，则取 0），基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

##### 6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2019年4月26日（基金合同生效日）至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	85,310.43

注：托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

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扣除由本基金托管人所托管的证券投资基金份额所对应的资产净值的剩余部分（若为负数，则取 0），基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

#### 6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

#### 6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

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

份额单位：份

项目	本期	
	2019年4月26日（基金合同生效日）至2019年6月30日	
基金合同生效日（2019年4月26日）持有的基金份额	50,000,000.00	
报告期初持有的基金份额	-	
报告期间申购/买入总份额	-	
报告期间因拆分变动份额	-	
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	
报告期末持有的基金份额	50,000,000.00	
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	19.78%	

**6.4.8.5 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	
	2019年4月26日（基金合同生效日）至2019年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	8,971,572.51	33,439.03

**6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

无。

**6.4.8.7 其他关联交易事项的说明**

项目	本期费用	
	2019年4月26日（基金合同生效日）至2019年6月30日	
当期交易基金产生的申购费（元）	-	
当期交易基金产生的赎回费（元）	-	
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	204.29	
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	15,067.66	
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	4,852.30	

当期交易基金产生的交易费 (元)	430.62
---------------------	--------

注：无上年度可比期间。

#### 6.4.9 期末（2019 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.9.1 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。

##### 6.4.9.2 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股票。

##### 6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末，本基金无因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。

###### 6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## 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	190,161,821.22	73.10
3	固定收益投资	20,983,200.00	8.07
	其中：债券	20,983,200.00	8.07
	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	37,500,000.00	14.42
	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	11,166,724.55	4.29
8	其他各项资产	312,809.04	0.12
9	合计	260,124,554.81	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。

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期末未买入股票。

### 7.4.2 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

本基金本报告期末未卖出股票。

## 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	20,983,200.00	8.26
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	20,983,200.00	8.26

**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	019611	19 国债 01	210,000	20,983,200.00	8.26

**7.7 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。

**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

无。

### 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

根据本基金基金合同，本基金不能投资于国债期货。

#### 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。

### 7.12 本报告期投资基金情况

#### 7.12.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的基金投资明细

序号	基金代码	基金名称	运作方式	持有份额 (份)	公允价值 (元)	占基金资产 净值比例 (%)	是否属于基金 管理人及管理 人关联方所管 理的基金
1	040040	华安纯债 A	契约型开 放式	23,816,65 5.82	25,443,33 3.41	10.01%	是
2	000286	银华信用 季季红债 券 A	契约型开 放式	22,810,86 3.13	24,156,70 4.05	9.51%	否
3	000032	易方达信 用债债券 A	契约型开 放式	16,749,58 1.24	20,132,99 6.65	7.92%	否
4	519152	新华纯债 添利债券 发起 A	契约型开 放式	16,266,26 7.12	19,096,59 7.60	7.51%	否
5	000305	中银中高 等级债券 A	契约型开 放式	16,021,67 7.66	16,838,78 3.22	6.63%	否
6	510300	华泰柏瑞 沪深 300ETF	交易型开 放式	4,300,000. 00	16,593,70 0.00	6.53%	否
7	510500	南方中证 500ETF	交易型开 放式	2,800,000. 00	14,929,60 0.00	5.87%	否
8	001021	华夏亚债 中国债券 指数 A	契约型开 放式	11,344,40 8.43	13,999,00 0.00	5.51%	否
9	000874	华安现金	契约型开	12,053,53	12,053,53	4.74%	是

		宝货币 B	放式	2.94	2.94		
10	511010	国泰上证 5 年期国债 ETF	交易型开放式	93,400.00	10,943,024.20	4.31%	否
11	510180	华安上证 180ETF	交易型开放式	2,426,656.00	8,534,549.15	3.36%	是
12	512500	华夏中证 500ETF	交易型开放式	3,000,000.00	7,440,000.00	2.93%	否

### 7.13 投资组合报告附注

**7.13.1** 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。

**7.13.2** 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。

#### 7.13.3 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	25,634.64
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	2,500.13
4	应收利息	239,587.18
5	应收申购款	44,988.09
6	其他应收款	99.00
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	312,809.04

#### 7.13.4 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。

#### 7.13.5 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

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
17,661	14,313.42	50,497,747.10	19.98%	202,291,541.48	80.02%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	10,863,240.79	4.30%

### 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

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	>100

### 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总 数	持有份额占 基金总份额 比例	发起份额总 数	发起份额占 基金总份额 比例	发起份额承 诺持有期限
基金管理人固有资金	50,000,000.0 0	19.78%	50,000,000.0 0	19.78%	三年
基金管理人高级管理人员	288,849.79	0.11%	288,849.79	0.11%	三年
基金经理等人员	1,199,054.84	0.47%	1,199,054.84	0.47%	三年
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	51,487,904.6 3	20.37%	51,487,904.6 3	20.37%	-

## 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2019 年 4 月 26 日）基金份额总额	243,149,236.40
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	9,640,052.18
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	-
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	252,789,288.58

## 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：

无。

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：

托管人中国建设银行 2019 年 6 月 4 日发布公告，聘任蔡亚蓉为中国建设银行股份有限公司资产托管业务部总经理。

### 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

2019 年 1 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。2019 年 2 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。

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	
湘财证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中山证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	3	-	-	-	-	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	3	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
联讯证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	3	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
广州证券	2	-	-	-	-	-
新时代证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	1	-	-	-	-	-
财富证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	3	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-

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：

2019年2月完成租用托管在建设银行的新时代证券深圳007691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
兴业证券	20,958,700.00	100.00%	734,300,00.00	100.00%	-	-

## 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 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	20190426-20190527	0.00	50,000,000.00	0.00	50,000,000.00	19.78%
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。							

### 11.2 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

二〇一九年八月二十八日