

华安中证定向增发事件指数证券投资基金（LOF）

2017年半年度报告

2017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：二〇一七年八月二十五日

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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 23 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 2017 年 4 月 11 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	错误！未定义书签。
2.2 基金产品说明	错误！未定义书签。
2.3 基金管理人和基金托管人	错误！未定义书签。
2.4 信息披露方式	错误！未定义书签。
2.5 其他相关资料	错误！未定义书签。
3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	错误！未定义书签。
3.2 基金净值表现	错误！未定义书签。
4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	错误！未定义书签。
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	错误！未定义书签。
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	错误！未定义书签。
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	错误！未定义书签。
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	错误！未定义书签。
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	错误！未定义书签。
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	错误！未定义书签。
5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	错误！未定义书签。
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	错误！未定义书签。
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	错误！未定义书签。
6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	错误！未定义书签。
6.2 利润表	错误！未定义书签。
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	错误！未定义书签。
6.4 报表附注	错误！未定义书签。
7 投资组合报告	36
7.1 期末基金资产组合情况	错误！未定义书签。
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	错误！未定义书签。
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	错误！未定义书签。
7.4 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	错误！未定义书签。
7.5 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	错误！未定义书签。
7.6 报告期内股票投资组合的重大变动	错误！未定义书签。
7.7 期末按债券品种分类的债券投资组合	错误！未定义书签。
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细	错误！未定义书签。
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细	错误！未定义书签。
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细	错误！未定义书签。
7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	错误！未定义书签。
7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	错误！未定义书签。
7.13 投资组合报告附注	错误！未定义书签。
8 基金份额持有人信息	45
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	错误！未定义书签。

8.2 期末上市基金前十名持有人	错误！未定义书签。
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	错误！未定义书签。
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	错误！未定义书签。
9 开放式基金份额变动	46
10 重大事件揭示	46
10.1 基金份额持有人大会决议	错误！未定义书签。
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	错误！未定义书签。
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	错误！未定义书签。
10.4 基金投资策略的改变	错误！未定义书签。
10.5 报告期内改聘会计师事务所情况	错误！未定义书签。
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	错误！未定义书签。
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	错误！未定义书签。
10.8 其他重大事件	错误！未定义书签。
11 影响投资者决策的其他重要信息	错误！未定义书签。
12 备查文件目录	错误！未定义书签。
12.1 备查文件目录	错误！未定义书签。
12.2 存放地点	错误！未定义书签。
12.3 查阅方式	错误！未定义书签。

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华安中证定向增发事件指数证券投资基金（LOF）
基金简称	华安中证定向增发
场内简称	定增事件
基金主代码	160422
交易代码	160422
基金运作方式	上市契约型开放式
基金合同生效日	2017年4月11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	106,041,752.94 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2017年5月26日

2.2 基金产品说明

投资目标	通过被动的指数化投资管理，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金为被动式股票指数基金，采用完全复制标的指数的方法跟踪标的指数，即按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。若因特殊情况（如市场流动性不足、个别成份股被限制投资、法律法规禁止或限制投资等）导致无法获得足够数量的股票时，基金可能不能按照成份股权重持有成份股，基金管理人将采用合理方法替代等指数投资技术适当调整基金投资组合，并可在条件允许的情况下，辅以金融衍生工具进行投资管理，以有效控制基金的跟踪误差，追求尽可能贴近标的指数的表现，力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。
业绩比较基准	95%×中证定向增发事件指数收益率+5%×同期银行活期存款利率（税后）
风险收益特征	本基金为股票型基金，属于较高风险、较高预期收益的基金品种，其风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	钱鲲	田青
	联系电话	021-38969999	010-67595096
	电子邮箱	qiankun@huaan.com.cn	tianqing1.zh@ccb.com

客户服务电话	4008850099	010-67595096
传真	021-68863414	010-66275853
注册地址	上海市世纪大道8号上海国金中心二期31层、32层	北京市西城区金融大街25号
办公地址	上海市世纪大道8号上海国金中心二期31层、32层	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码	200120	100033
法定代表人	朱学华	王洪章

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层、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层、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（2017年4月11日（基金合同生效日）至2017年6月30日）
本期已实现收益	-207,830.02
本期利润	1,051,579.95
加权平均基金份额本期利润	0.0041
本期加权平均净值利润率	0.41%
本期基金份额净值增长率	2.26%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)
期末可供分配利润	248,774.53
期末可供分配基金份额利润	0.0023
期末基金资产净值	108,441,566.45
期末基金份额净值	1.0226
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017年6月30日)
基金份额累计净值增长率	2.26%

注：1、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。

2、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，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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）。

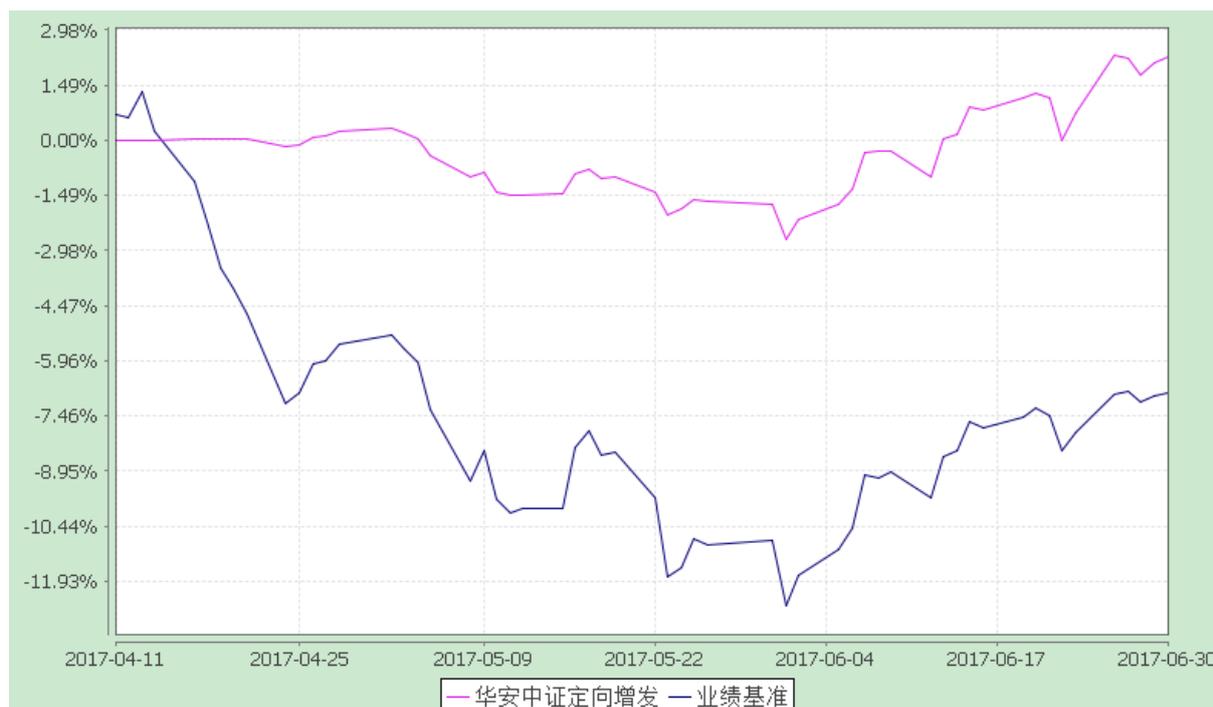
3.2 基金净值表现

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	4.05%	0.65%	4.52%	0.80%	-0.47%	-0.15%
自基金合同生效起至今	2.26%	0.46%	-6.82%	0.96%	9.08%	-0.50%

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

华安中证定向增发事件指数证券投资基金（LOF）
 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
 （2017年4月11日至2017年6月30日）



注：本基金于2017年4月11日成立，截止本报告期末，本基金成立不满一年。

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。目前的股东为上海电气（集团）总公司、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2017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96只开放式基金，管理资产规模达到1478.85亿元人民币。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
徐宜宜	本基金的基金经理	2017-04-11	-	11年	管理学硕士，CFA（国际金融分析师），FRM（金融风险管理师），11年证券、基金行业从业经历，具有基金从业资格。曾在美国道富全球投资管理公司担任对冲基金助理、量化分析师和风险管理师等职。2011年1月加入华安基金管理有限公司被动投资部从事海外被动投资的研究工作。2011年5月至2012年12月担任上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理职务。2012年3月起同时担任华安标普全球石油指数证券投资基金的基金经理。2013年7月起同时担任华安易富黄金交易型开放式证券投资基金的基金经理。2013年8月起同时担任华安易富黄金交易型开放式证券投资基金联接基金及本

					基金的基金经理。2013年12月至2016年9月同时担任华安中证细分地产交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2014年8月起同时担任华安国际龙头（DAX）交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理。2017年4月起，同时担任本基金的基金经理。
苏卿云	本基金的基金经理	2017-06-26	-	9年	硕士研究生，9年证券行业从业经历。曾任上海证券交易所基金业务部经理。2016年7月加入华安基金，任指数与量化投资事业总部ETF业务负责人。2016年12月起，担任华安日日鑫货币市场基金的基金经理。2017年6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，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

定增事件指数在报告期内表现为剧烈震荡下跌的走势，产品成立以来基准下跌 6.82%。回顾上

半年，伴随着严监管，去杠杆，去泡沫以及 IPO 加速发行的节奏，以及流动性的收紧，A 股市场呈现较为明显的风格转换，资金抱团现象明显，蓝筹股表现较好。政策方面，证监会二月份出台的《上市公司非公开发行股票实施细则》，以及近期出台的《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》，均对定增市场的准入和退出提出了更高的要求。整个定增市场在报告期内急速冷却，而小市值股票总体看大幅跑输了市场总体水平。本基金于 4 月 11 日成立，尚处于建仓期。建仓期间，本基金秉持灵活，稳健建仓的原则，在基准大幅下跌的情况下，为投资者取得了正向收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2017 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.0226 元，本报告期份额净值增长率为 2.26%，同期业绩比较基准增长率为-6.82%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

经过上半年的调整，2017 年下半年我们预计 A 股市场在风格上逐渐趋于中性。流动性趋于稳定以及 A 股纳入 MSCI 的消息总体偏正面，而多家公司的定增项目获批表明了监管层的态度，定增市场近期出现再次活跃的迹象。我们认为符合监管导向，致力于公司成长的再融资是市场发挥健康机制的重要表现之一。

作为定向增发事件 LOF 基金的管理人，我们继续坚持积极将基金回报与指数相拟合的原则，降低跟踪偏离和跟踪误差，勤勉尽责，为投资者获得长期稳定的回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，负责在证券发行机构发生了严重影响证券价格的重大事件时，评估重大事件对投资品种价值的影响程度、评估对基金估值的影响程度、确定采用的估值方法、确定该证券的公允价值；同时将采用的估值方法以及采用该方法对相关证券的估值与基金的托管银行进行沟通。估值委员会成员由投资总监、研究总监、固定收益部总监、指数投资部总监、基金运营部总经理、风险管理部总监等人员组成，具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备行业研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由其按

约定分别提供银行间同业市场及交易所交易的债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期不进行收益分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金报告期内不存在基金持有人数低于 200 人或基金资产净值低于 5000 万元的情形。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，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：华安中证定向增发事件指数证券投资基金（LOF）

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日
资产：		-

银行存款	6.4.7.1	29,503,098.93
结算备付金		2,651,310.23
存出保证金		25,765.28
交易性金融资产	6.4.7.2	85,391,708.90
其中：股票投资		85,391,708.90
基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-
应收证券清算款		-
应收利息	6.4.7.5	4,077.48
应收股利		-
应收申购款		129.63
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	58,545.52
资产总计		117,634,635.97
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017年6月30日
负 债：		-
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		12,915.57
应付赎回款		8,612,218.30
应付管理人报酬	6.4.10.2	141,526.98
应付托管费	6.4.10.2	28,305.37
应付销售服务费		-
应付交易费用	6.4.7.7	220,272.06
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	177,831.24
负债合计		9,193,069.52
所有者权益：		-
实收基金	6.4.7.9	106,041,752.94
未分配利润	6.4.7.10	2,399,813.51
所有者权益合计		108,441,566.45
负债和所有者权益总计		117,634,635.97

注：1、报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0226 元，基金份额总额 106,041,752.94

份。

2、本基金合同于2017年4月11日生效。

6.2 利润表

会计主体：华安中证定向增发事件指数证券投资基金（LOF）

本报告期：2017年4月11日（基金合同生效日）至2017年6月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017年4月11日（基金合同生效日）至2017 年6月30日
一、收入		2,205,505.92
1.利息收入		530,624.62
其中：存款利息收入	6.4.7.11	226,782.37
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		303,842.25
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		137,208.90
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-443,122.16
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	-
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.14	-
股利收益	6.4.7.15	580,331.06
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	1,259,409.97
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	278,262.43
减：二、费用		1,153,925.97
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	562,827.64
2. 托管费	6.4.10.2.2	112,565.48
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.4.7.18	319,060.57
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用	6.4.7.19	159,472.28
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,051,579.95
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,051,579.95

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安中证定向增发事件指数证券投资基金（LOF）

本报告期：2017年4月11日（基金合同生效日）至2017年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2017年4月11日（基金合同生效日）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）	309,484,316.78	-	309,484,316.78
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,051,579.95	1,051,579.95
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）	-203,442,563.84	1,348,233.56	-202,094,330.28
其中：1.基金申购款	97,429.57	220.34	97,649.91
2.基金赎回款	-203,539,993.41	1,348,013.22	-202,191,980.19
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）	106,041,752.94	2,399,813.51	108,441,566.45

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：朱兴华，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

华安中证定向增发事件指数证券投资基金（LOF）（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〕1901号《关于准予华安中证定向增发事件指数证券投资基金（LOF）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2017年2月20日到2017年3月31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（2017）验字第60971571_B07号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2017年4月11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309,322,194.35元，在募集期间产生的存款利息为人民

币 162,122.43 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 309,484,316.78 元，折合 309,484,316.78 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，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括中证定向增发事件指数的成分股及其备选成分股、其他国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票）、权证、股指期货、固定收益资产（国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债券、中期票据、可转换债券（含分离交易可转债）、短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款等）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）。本基金将根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。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。

本基金组合投资比例为：股票资产投资比例不低于基金资产的 90%，投资于中证定向增发事件指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%；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%；权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。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： $95\% \times \text{中证定向增发事件指数收益率} + 5\% \times \text{同期银行活期存款利率}$ （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 2017 年 6 月 30 日的财务

状况以及 2017 年 4 月 11 日（基金合同生效日）至 2017 年 6 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

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间系 2017 年 4 月 11 日（基金合同生效日）起至 2017 年 6 月 30 日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

本基金目前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主要包括股票投资、债券投资和衍生工具；

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

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

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公

允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

金融资产转移，是指本基金将金融资产让与或交付给该金融资产发行方以外的另一方(转入方)；本基金已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的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；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的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债；

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

(1) 股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

卖出股票于成交日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(2) 债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

(3) 权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(4) 股指期货投资

买入或卖出股指期货投资于成交日确认为股指期货投资。股指期货初始合约价值按成交金额确认；

股指期货平仓于成交日确认衍生工具投资收益，股指期货的初始合约价值按移动加权平均法于成交日结转；

(5) 分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

(6) 回购协议

基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。本基金主要金融工具的估值方法如下：

(1) 存在活跃市场的金融工具

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，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值的，应对最近交易的市价进行调整，确定公允价值。

(2) 不存在活跃市场的金融工具

当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。本基金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，优先使用相关可观察输入值，只有在可观察输入值无法取得或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。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损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益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收益/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益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利得/(损失)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确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，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

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/(损失)于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 权证投资收益/(损失)于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(8) 股指期货投资收益/(损失)于平仓日确认，并按平仓成交金额与其初始合约价值的差额入账；

(9) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(10) 公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(11) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

6.4.4.10 费用的确认和计量

(1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 1.00% 的年费率逐日计提；

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.20% 的年费率逐日计提；

(3) 基金指数许可使用费按前一日的基金资产净值的 0.02% 的年费率逐日计提；

(4) 卖出回购金融资产支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提；

(5) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资。登记在基金份额持有人开放式基金账户下的基金份额，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。登记在基金份额持有人深圳证券账户下的基金份额，只能选择现金分红的方式，具体权益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定；

(2) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每

单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

- (3) 每一基金份额享有同等分配权；
- (4) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在不违背法律法规及基金合同的规定、且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人经与基金托管人协商一致，可在中国证监会允许的条件下调整基金收益的分配原则，不需召开基金份额持有人大会。

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 2017年6月30日	
	活期存款	29,503,098.93
定期存款	-	
其他存款	-	
合计	29,503,098.93	

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	84,132,298.93	85,391,708.90	1,259,409.97
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	-	-	-
交易所市场	-	-	-

	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		84,132,298.93	85,391,708.90	1,259,409.97

6.4.7.3 买入返售金融资产

无。

6.4.7.4 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应收活期存款利息	2,993.23
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	1,073.79
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	0.02
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	10.44
合计	4,077.48

6.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
其他应收款	-
待摊费用	58,545.52
合计	58,545.52

6.4.7.6 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
交易所市场应付交易费用	220,272.06
银行间市场应付交易费用	-
合计	220,272.06

6.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	32,458.07
预提账户维护费	-
预提审计费	18,340.02
预提信息披露费	82,527.66
应付指数使用费	44,505.49
合计	177,831.24

6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017年4月11日（基金合同生效日）至2017年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	309,484,316.78	309,484,316.78
本期申购	97,429.57	97,429.57
本期赎回（以“-”号填列）	-203,539,993.41	-203,539,993.41
本期末	106,041,752.94	106,041,752.94

注：（1）申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

（2）本基金合同于2017年4月11日生效。

6.4.7.9 未分配利润

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
本期利润	-207,830.02	1,259,409.97	1,051,579.95
本期基金份额交易产生的变动数	456,604.55	891,629.01	1,348,233.56
其中：基金申购款	-192.75	413.09	220.34
基金赎回款	456,797.30	891,215.92	1,348,013.22
本期已分配利润	-	-	-
本期末	248,774.53	2,151,038.98	2,399,813.51

6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年4月11日（基金合同生效日）至2017年6月30

	日
活期存款利息收入	217,692.92
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	9,031.83
其他	57.62
合计	226,782.37

6.4.7.11 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2017年4月11日（基金合同生效日）至2017年6月30日
卖出股票成交总额	77,532,707.41
减：卖出股票成本总额	77,975,829.57
买卖股票差价收入	-443,122.16

6.4.7.12 债券投资收益

6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

无。

6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2017年4月11日（基金合同生效日）至2017年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	0.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	-
减：应收利息总额	-
买卖债券差价收入	-

6.4.7.13 衍生工具收益

无。

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2017年4月11日（基金合同生效日）至2017年6月30日
股票投资产生的股利收益	580,331.06
基金投资产生的股利收益	-
合计	580,331.06

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2017年4月11日（基金合同生效日）至2017年6月30日
1.交易性金融资产	1,259,409.97
——股票投资	1,259,409.97
——债券投资	-
——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	-
合计	1,259,409.97

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2017年4月11日（基金合同生效日）至2017年6月30日
基金赎回费收入	252,740.85
其他收入_其他	25,521.58
合计	278,262.43

6.4.7.17 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2017年4月11日（基金合同生效日）至2017年6月30日
交易所市场交易费用	319,060.57
银行间市场交易费用	-
合计	319,060.57

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2017年4月11日（基金合同生效日）至2017年6月30日
审计费用	18,340.02
信息披露费	82,527.66
银行汇划费用	1,884.63
上市年费	11,454.48
帐户维护费	360.00
指数使用费	44,505.49

其他费用	400.00
合计	159,472.28

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。

6.4.10 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
	2017年4月11日（基金合同生效日）至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	562,827.64

其中：支付销售机构的客户维护费	146,963.43
-----------------	------------

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的1%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1\% / \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2017年4月11日（基金合同生效日）至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	112,565.48

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的0.2%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.2\% / \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

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。

6.4.10.5 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	
	2017年4月11日（基金合同生效日）至2017年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	29,503,098.93	217,692.92

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。

6.4.11 利润分配情况

无。

6.4.12 期末（2017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

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002509	天广中茂	2017-06-12	重大事项	9.20	-	-	88,600.00	802,867.00	815,120.00	-
600318	新力金融	2017-04-27	重大事项	10.73	2017-08-08	11.50	93,000.00	999,504.25	997,890.00	-
600545	新疆城建	2017-06-22	重大资产重组事项	11.96	2017-07-03	12.44	154,200.00	1,826,665.99	1,844,232.00	-
600577	精达股份	2017-06-26	重大资产重组事项	4.80	2017-07-10	4.50	380,600.00	1,884,170.00	1,826,880.00	-

注：本基金截止至2017年6月30日止有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

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，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，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

本基金为被动式投资的股票型指数基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，其风险收益特征与标的指数所代表的市场组合的风险收益特征相似。本基金投资的金融工具主要为股票投资。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成

份股及其权重的变动进行相应调整,但因特殊情况(如流动性不足、成份股长期停牌、法律法规限制等)导致无法获得足够数量的股票时,本基金可以选择其他证券或证券组合对标的指数中的股票加以替换,从而能够紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

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、监察稽核部和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执行总裁负责,并由督察长分管。

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。

本基金的基金管理人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本基金的托管行中国建设银行,因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金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;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。

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。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。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、组合在短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。本基金投资于一家公司发行的股票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公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持证券均在证券交易所上市，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。

于 2017 年 06 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

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。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017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	29,503,098.93	-	-	-	29,503,098.93
结算备付金	2,651,310.23	-	-	-	2,651,310.23
存出保证金	25,765.28	-	-	-	25,765.28
交易性金融资产	-	-	-	85,391,708.90	85,391,708.90
应收利息	-	-	-	4,077.48	4,077.48
应收申购款	-	-	-	129.63	129.63
其他资产	-	-	-	58,545.52	58,545.52
资产总计	32,180,174.44	-	-	85,454,461.53	117,634,635.97
负债					
应付证券清算款	-	-	-	12,915.57	12,915.57
应付赎回款	-	-	-	8,612,218.30	8,612,218.30
应付管理人报酬	-	-	-	141,526.98	141,526.98
应付托管费	-	-	-	28,305.37	28,305.37
应付交易费用	-	-	-	220,272.06	220,272.06
其他负债	-	-	-	177,831.24	177,831.24
负债总计	-	-	-	9,193,069.52	9,193,069.5

					2
利率敏感度缺口	32,180,174.44	-	-	76,261,392.01	108,441,566.4
					5

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金于 2017 年 06 月 30 日未持有债券资产，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

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。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用完全复制标的指数的方法跟踪标的指数，即按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。股票资产投资比例不低于基金资产的 90%，投资于中证定向增发事件指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%；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%。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 2017年6月30日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	85,391,708.90	78.74
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	-	-
合计	85,391,708.90	78.74

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准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 2017年6月30日
	业绩比较基准上升5%	增加约195
	业绩比较基准下降5%	减少约195

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

（1）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。

（2）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。

（3）财务报表的批准

本财务报表已于2017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	85,391,708.90	72.59
	其中：股票	85,391,708.90	72.59
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	32,154,409.16	27.33
7	其他各项资产	88,517.91	0.08
8	合计	117,634,635.97	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 指数投资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 （%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	2,993,412.00	2.76
C	制造业	41,867,276.50	38.61
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,119,352.00	3.80
E	建筑业	7,231,428.00	6.67
F	批发和零售业	7,511,522.20	6.93
G	交通运输、仓储和邮政业	2,529,947.00	2.33
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,022,154.20	1.86

J	金融业	2,443,552.00	2.25
K	房地产业	10,720,778.00	9.89
L	租赁和商务服务业	1,871,613.00	1.73
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,180,032.00	1.09
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	781,916.00	0.72
S	综合	-	-
	合计	85,272,982.90	78.63

7.2.2 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	118,726.00	0.11
C	制造业	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	118,726.00	0.11

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

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

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	600297	广汇汽车	288,040	2,168,941.20	2.00
2	002340	格林美	344,990	2,087,189.50	1.92
3	002631	德尔未来	140,400	2,068,092.00	1.91
4	000627	天茂集团	254,300	2,054,744.00	1.89
5	000039	中集集团	111,400	2,008,542.00	1.85
6	000671	阳光城	342,900	1,995,678.00	1.84
7	601155	新城控股	106,050	1,966,167.00	1.81
8	000415	渤海金控	278,100	1,871,613.00	1.73
9	600545	新疆城建	154,200	1,844,232.00	1.70
10	600577	精达股份	380,600	1,826,880.00	1.68
11	002001	新和成	88,500	1,717,785.00	1.58
12	000878	云南铜业	125,000	1,648,750.00	1.52
13	600503	华丽家族	238,600	1,648,726.00	1.52
14	000488	晨鸣纸业	125,200	1,615,080.00	1.49
15	600675	中华企业	235,400	1,603,074.00	1.48
16	600039	四川路桥	381,100	1,585,376.00	1.46
17	002092	中泰化学	124,800	1,584,960.00	1.46
18	002226	江南化工	225,100	1,584,704.00	1.46
19	000425	徐工机械	418,700	1,570,125.00	1.45
20	000761	本钢板材	299,900	1,568,477.00	1.45
21	600729	重庆百货	55,500	1,489,620.00	1.37
22	002233	塔牌集团	120,800	1,470,136.00	1.36
23	002387	黑牛食品	95,200	1,467,984.00	1.35
24	601866	中远海发	407,600	1,467,360.00	1.35

25	002156	通富微电	140,100	1,426,218.00	1.32
26	600491	龙元建设	132,400	1,420,652.00	1.31
27	600856	中天能源	125,500	1,413,130.00	1.30
28	601238	广汽集团	54,100	1,409,846.00	1.30
29	000498	山东路桥	191,200	1,367,080.00	1.26
30	000987	越秀金控	116,900	1,359,547.00	1.25
31	002635	安洁科技	37,200	1,347,384.00	1.24
32	000975	银泰资源	104,800	1,323,624.00	1.22
33	002146	荣盛发展	132,300	1,305,801.00	1.20
34	000601	韶能股份	175,100	1,248,463.00	1.15
35	603986	兆易创新	15,900	1,237,179.00	1.14
36	600759	洲际油气	199,800	1,210,788.00	1.12
37	000826	启迪桑德	33,600	1,180,032.00	1.09
38	000616	海航投资	264,000	1,135,200.00	1.05
39	002389	南洋科技	52,000	1,095,120.00	1.01
40	600487	亨通光电	38,500	1,079,925.00	1.00
41	000582	北部湾港	93,620	1,062,587.00	0.98
42	000401	冀东水泥	68,700	1,057,293.00	0.97
43	600828	茂业商业	125,000	1,040,000.00	0.96
44	002558	巨人网络	22,360	1,033,479.20	0.95
45	600318	新力金融	93,000	997,890.00	0.92
46	600804	鹏博士	55,700	988,675.00	0.91
47	002048	宁波华翔	39,100	815,626.00	0.75
48	002509	天广中茂	88,600	815,120.00	0.75
49	002812	创新股份	8,300	672,300.00	0.62
50	000979	中弘股份	255,400	669,148.00	0.62
51	601116	三江购物	24,400	654,408.00	0.60
52	000050	深天马 A	31,800	654,126.00	0.60
53	600737	中粮糖业	62,800	592,832.00	0.55
54	300207	欣旺达	49,500	583,605.00	0.54
55	300256	星星科技	55,800	580,320.00	0.54
56	002608	江苏国信	42,300	528,327.00	0.49
57	300180	华峰超纤	19,700	525,793.00	0.48
58	002717	岭南园林	19,300	517,240.00	0.48
59	002120	韵达股份	9,800	505,680.00	0.47
60	300506	名家汇	17,600	496,848.00	0.46
61	601991	大唐发电	107,800	487,256.00	0.45
62	002050	三花智控	28,700	468,384.00	0.43
63	002575	群兴玩具	54,700	468,232.00	0.43
64	600188	兖州煤业	37,500	459,000.00	0.42
65	600008	首创股份	67,200	442,176.00	0.41
66	000639	西王食品	21,600	427,464.00	0.39
67	600760	中航黑豹	12,900	427,248.00	0.39
68	002176	江特电机	48,600	423,792.00	0.39

69	600875	东方电气	42,700	409,066.00	0.38
70	000829	天音控股	37,600	406,080.00	0.37
71	300323	华灿光电	28,700	398,356.00	0.37
72	600551	时代出版	25,200	397,908.00	0.37
73	000732	泰禾集团	23,800	396,984.00	0.37
74	000560	昆百大A	44,600	392,926.00	0.36
75	601169	北京银行	42,400	388,808.00	0.36
76	300216	千山药机	15,900	388,755.00	0.36
77	002721	金一文化	25,800	385,194.00	0.36
78	300144	宋城演艺	18,400	384,008.00	0.35
79	000818	方大化工	35,900	368,334.00	0.34
80	600869	智慧能源	13,000	87,490.00	0.08

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	000697	炼石有色	5,800	118,726.00	0.11

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	000039	中集集团	2,571,563.42	2.37
2	000671	阳光城	2,345,587.45	2.16
3	600297	广汇汽车	2,333,270.00	2.15
4	002631	德尔未来	2,324,591.00	2.14
5	002665	首航节能	2,319,025.00	2.14
6	002739	万达电影	2,304,779.84	2.13
7	000627	天茂集团	2,291,408.00	2.11
8	002387	黑牛食品	2,285,232.80	2.11
9	002648	卫星石化	2,271,438.23	2.09
10	000960	锡业股份	2,242,494.00	2.07
11	002340	格林美	2,239,162.78	2.06
12	600021	上海电力	2,237,154.00	2.06
13	000415	渤海金控	2,228,643.41	2.06
14	000878	云南铜业	2,218,571.89	2.05
15	002001	新和成	2,218,044.34	2.05
16	002233	塔牌集团	2,205,255.83	2.03

17	600256	广汇能源	2,203,476.78	2.03
18	000488	晨鸣纸业	2,193,061.01	2.02
19	002662	京威股份	2,190,029.00	2.02
20	002092	中泰化学	2,165,813.39	2.00

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	002739	万达电影	2,524,079.33	2.33
2	002648	卫星石化	2,369,049.00	2.18
3	002665	首航节能	2,274,635.86	2.10
4	600021	上海电力	2,228,359.41	2.05
5	000960	锡业股份	2,216,168.15	2.04
6	600256	广汇能源	2,138,350.00	1.97
7	002662	京威股份	2,036,009.24	1.88
8	600715	文投控股	1,963,975.00	1.81
9	601021	春秋航空	1,918,545.00	1.77
10	603993	洛阳钼业	1,911,292.00	1.76
11	002309	中利集团	1,906,304.00	1.76
12	601118	海南橡胶	1,811,565.00	1.67
13	002506	协鑫集成	1,340,935.50	1.24
14	600707	彩虹股份	1,329,428.00	1.23
15	000540	中天金融	1,306,380.00	1.20
16	002596	海南瑞泽	1,214,290.00	1.12
17	600869	智慧能源	1,203,958.16	1.11
18	600584	长电科技	1,202,941.92	1.11
19	600487	亨通光电	1,174,137.00	1.08
20	601689	拓普集团	1,146,090.00	1.06

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	162,108,128.50
卖出股票的收入（成交）总额	77,532,707.41

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

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

本基金本报告期末未持有债券投资。

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

本基金本报告期末投资股指期货。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。

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 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	25,765.28
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,077.48
5	应收申购款	129.63
6	其他应收款	-
7	待摊费用	58,545.52
8	其他	-
9	合计	88,517.91

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

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的 公允价值	占基金资产净 值比例(%)	流通受限情 况说明
1	600545	新疆城建	1,844,232.00	1.70	重大资产重组
2	600577	精达股份	1,826,880.00	1.68	重大资产重组

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前五名积极投资中不存在流通受限情况。

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
2,356	45,009.23	1,117,799.66	1.05%	104,923,953.28	98.95%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	陈国华	2,050,617.00	1.93%
2	钱细姣	1,991,581.57	1.88%
3	吴克柱	1,492,741.18	1.41%
4	许如勋	1,492,268.68	1.41%
5	招商证券股份有限公司	1,102,934.00	1.04%
6	程勇	1,003,243.00	0.95%
7	北京三友恒瑞科技有限公司	1,000,359.00	0.94%
8	徐文勇	1,000,291.00	0.94%
9	熊珊	1,000,233.00	0.94%
10	曾杰	995,790.79	0.94%

8.3 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	1,021.56	0.00%
------------------	----------	-------

8.4 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

基金合同生效日（2017 年 4 月 11 日）基金份额总额	309,484,316.78
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	97,429.57
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	203,539,993.41
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	106,041,752.94

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、本基金管理人重大人事变动如下：

2017 年 8 月 9 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》，章国富先生不再担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 报告期内改聘会计师事务所情况

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	
国盛证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
中山证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
财富证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
广州证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	2	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
联讯证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	3	-	-	-	-	-
国泰君安	1	127,756,168.57	53.31%	116,424.51	52.85%	-
兴业证券	1	94,323,477.28	39.36%	87,844.07	39.88%	-
天风证券	2	17,561,190.06	7.33%	16,003.48	7.27%	-

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：

无。

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	成交金额	占当期回购成交总	成交金额	占当期权证成交总

		额的比例		额的比例		额的比例
国盛证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
中山证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
财富证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
联讯证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	1,051,000, 000.00	100.00%	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-

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	关于基金电子交易平台延长工行直联结算方	《上海证券报》、《证券时	2017-02-13

	式费率优惠活动的公告	报》、《中国证券报》和公司网站	
2	华安中证定向增发事件指数证券投资基金（LOF）基金份额发售公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-02-15
3	华安中证定向增发事件指数证券投资基金（LOF）基金合同	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-02-15
4	华安中证定向增发事件指数证券投资基金（LOF）托管协议	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-02-15
5	华安中证定向增发事件指数证券投资基金（LOF）招募说明书	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-02-15
6	关于旗下华安定增事件指数基金增加招商银行、蛋卷基金为销售机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-02-16
7	华安中证定向增发事件指数证券投资基金（LOF）上网发售提示性公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-02-20
8	关于旗下华安定增事件指数基金增加中信银行为销售机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-02-21
9	关于旗下华安定增事件指数基金增加肯特瑞为销售机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-02-22
10	关于旗下华安旗下部分基金增加浦发银行为销售机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-03-07
11	关于旗下华安定增指数基金增加宁波银行为销售机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-03-16
12	关于旗下部分基金增加同花顺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	2017-03-25
13	关于电子直销平台延长“微钱宝”账户交易费率优惠活动时间公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-03-28
14	华安中证定向增发事件指数证券投资基金（LOF）基金合同生效公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-04-12
15	关于“微钱宝”快速取现服务升级的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-04-25

16	华安基金关于《深圳证券交易所分级基金业务管理指引》实施的风险提示性公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-04-25
17	华安基金关于《深圳证券交易所分级基金业务管理指引》实施的风险提示性公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-04-26
18	华安基金关于《深圳证券交易所分级基金业务管理指引》实施的风险提示性公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-04-27
19	华安基金关于《深圳证券交易所分级基金业务管理指引》实施的风险提示性公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-04-28
20	华安基金关于《深圳证券交易所分级基金业务管理指引》实施的风险提示性公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-04-29
21	华安基金关于《深圳证券交易所分级基金业务管理指引》实施的风险提示性公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-05-03
22	华安基金关于《深圳证券交易所分级基金业务管理指引》实施的风险提示性公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-05-04
23	华安基金关于《深圳证券交易所分级基金业务管理指引》实施的风险提示性公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-05-06
24	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	2017-05-10
25	关于旗下部分基金增加武汉伯嘉为销售机构并参加费率优惠的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-05-17
26	关于华安中证定向增发事件指数证券投资基金（LOF）开通跨系统转托管业务公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-05-23
27	华安中证定向增发事件指数证券投资基金（LOF）上市交易公告书	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-05-23
28	华安中证定向增发事件指数证券投资基金开放日常申购、赎回、转换和定期定额业务公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-05-23
29	华安中证定向增发事件指数证券投资基金上市交易提示性公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-05-26
30	关于旗下部分基金增加中民财富为销售机构并参加费率优惠的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公	2017-06-07

		司网站	
31	华安中证定向增发事件指数证券投资基金（LOF）基金经理变更公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-06-24
32	关于电子直销平台延长“微钱宝”账户交易费率优惠活动时间公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-06-27

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 上披露。

11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、《华安中证定向增发事件指数证券投资基金（LOF）基金合同》
- 2、《华安中证定向增发事件指数证券投资基金（LOF）招募说明书》
- 3、《华安中证定向增发事件指数证券投资基金（LOF）托管协议》
- 4、中国证监会批准华安中证定向增发事件指数证券投资基金（LOF）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。

二〇一七年八月二十五日