

华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金
(原华安中证定向增发事件指数证券投资基金 (LOF))

2018 年第 4 季度报告

2018 年 12 月 31 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：二〇一九年一月二十一日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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 1 月 17 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2018 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§2 基金产品概况

2.1 华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

基金简称	华安创业板50ETF联接
基金主代码	160422
交易代码	160422
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年11月8日
报告期末基金份额总额	14,562,989.23份
投资目标	通过投资于目标ETF，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	本基金为目标ETF 的联接基金，目标ETF 是采用完全复制法实现对标的指数紧密跟踪的全被动指数基金。 本基金通过把接近全部的基金资产投资于目标ETF、标的指数成份股和备选成份股进行被动式指

	数化投资，实现对业绩比较基准的紧密跟踪。正常情况下，本基金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%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人将采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。
业绩比较基准	95%×创业板50指数收益率+5%×商业银行税后活期存款利率
风险收益特征	本基金属于目标ETF的联接基金，目标ETF为股票型指数基金，因此本基金的预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金主要投资于目标ETF，紧密跟踪标的指数，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。
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

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	159949
基金运作方式	交易型开放式(ETF)
基金合同生效日	2016 年 6 月 30 日
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2016 年 7 月 22 日
基金管理人名称	华安基金管理有限公司
基金托管人名称	中国建设银行股份有限公司

2.1.2 目标基金产品说明

投资目标	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	本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。当指数编制方法变更、成份股发生变更、成份股权重由于自由流通量调整而发生变化、成份股派发现金股息、配

	股及增发、股票长期停牌、市场流动性不足等情况发生时，基金管理人将对投资组合进行优化，尽量降低跟踪误差。
业绩比较基准	创业板 50 指数收益率
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货币市场基金、债券型基金和混合型基金。

2.2 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
报告期末基金份额总额	11,080,140.09份
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。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期 (2018年11月8日-2018 年12月31日)	报告期 (2018年10月1日 -2018年11月7日)
1.本期已实现收益	-213,487.04	-2,783,736.82
2.本期利润	-1,042,773.22	-809,875.78
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0924	-0.0723
4.期末基金资产净值	12,807,043.46	7,507,751.12
5.期末基金份额净值	0.8794	0.6776

3.2 基金净值表现

3.2.1 华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

（报告期：2018年11月8日-2018年12月31日）

3.2.1.1 本报告期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	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④

过去三个月	-8.47%	1.52%	-8.61%	1.65%	0.14%	-0.13%
-------	--------	-------	--------	-------	-------	--------

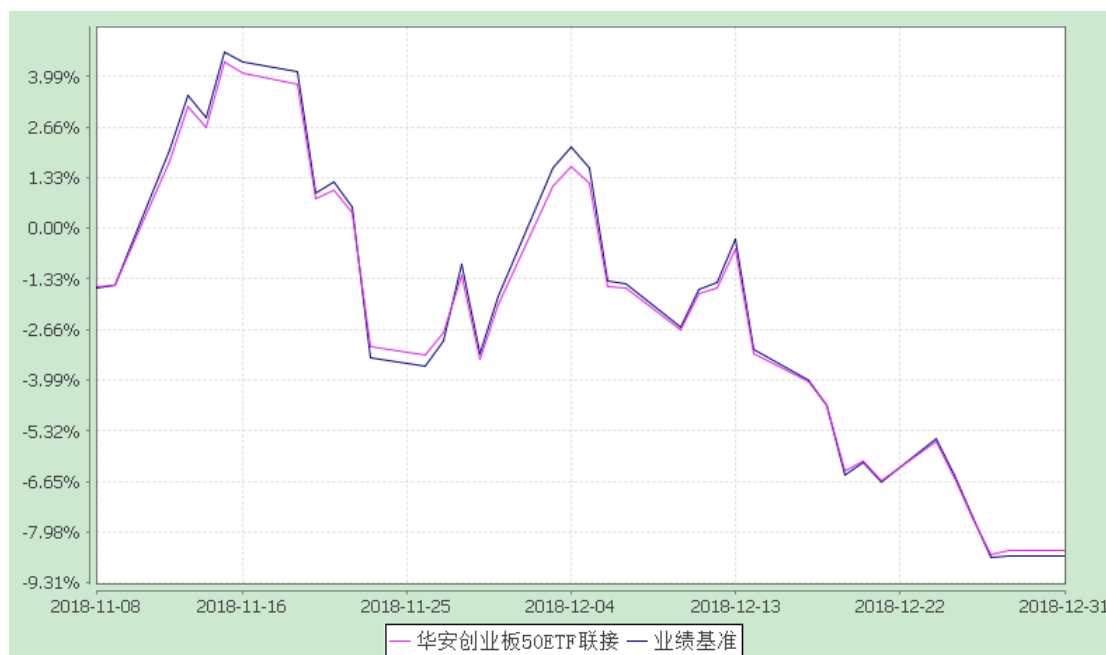
注：1、本基金转型日期为2018年11月8日，截止报告期末，本基金转型后基金合同生效未满一年。

2、根据《华安创业板50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》的规定，基金管理人自基金合同生效之日起6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。

3.2.1.2 自基金转型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

华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金
 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

(2018 年 11 月 8 日-2018 年 12 月 31 日)



3.2.2 华安中证定向增发事件指数证券投资基金 (LOF)

(报告期：2018年10月1日-2018年11月7日)

3.2.2.1 本报告期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	净值增长率①	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	①-③	②-④
----	--------	-----------	------------	--------------	-----	-----

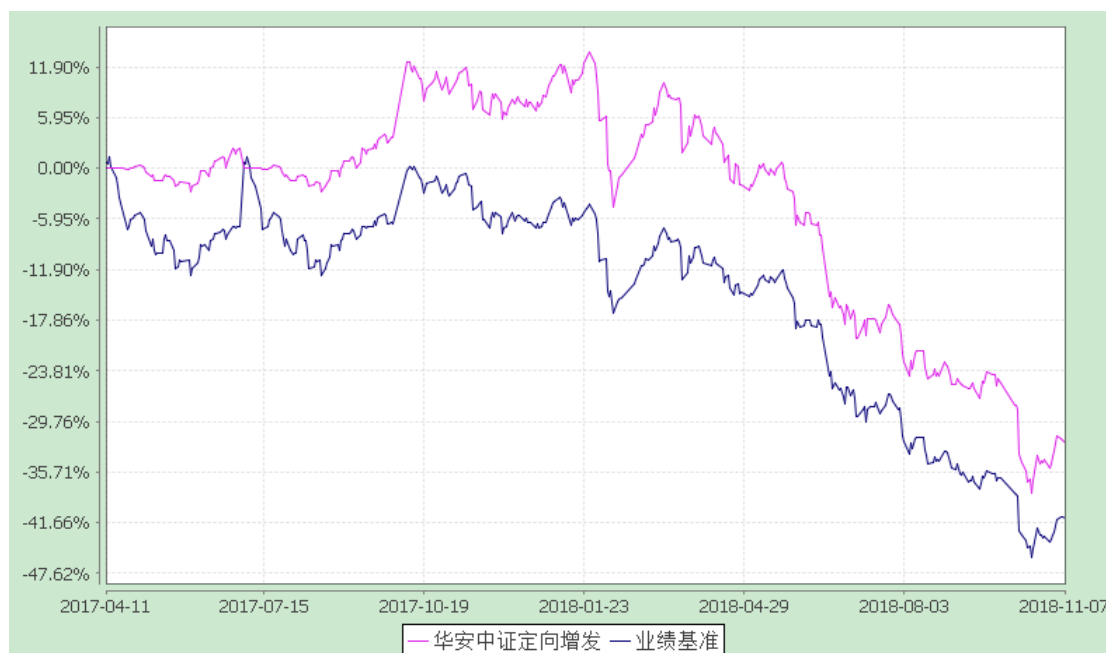
				④		
过去三个月	-9.39%	2.38%	-7.80%	2.21%	-1.59%	0.17%

3.2.2.2 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

(2018 年 10 月 1 日-2018 年 11 月 7 日)



§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
许之彦	本基金的基金经理、指数与量	2018-11-08	-	15 年	理学博士，15 年证券、基金从业经验，CQF(国际数量金融工程师)。曾在广发证券和中山大学经济管理学院博士后流动站从事金融工程工

	<p>化投资部高级总监、总经理助理</p>			<p>作，2005 年加入华安基金管理有限公司，曾任研究发展部数量策略分析师，2008 年 4 月至 2012 年 12 月担任华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金的基金经理，2009 年 9 月起同时担任上证 180 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。2010 年 11 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。2011 年 9 月起同时担任华安深证 300 指数证券投资基金 (LOF) 的基金经理。2013 年 6 月起担任指数投资部高级总监。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的基金经理。2014 年 11 月至 2015 年 12 月担任华安中证高分红指数增强型证券投资基金的基金经理。2015 年 6 月起同时担任华安中证全指证券公司指数分级证券投资基金、华安中证银行指数分级证券投资基金的基金经理。2015 年 7 月起担任华安创业板 50 指数分级证券投资基金的基金经理。2016 年 6 月起担任华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。</p>
--	-----------------------	--	--	---

					2017 年 12 月起,同时担任华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金、华安沪深 300 量化增强型指数证券投资基金的基金经理。2018 年 11 月起,同时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 公平交易专项说明

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、发送邮件、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，则投资部门在风控部门的监督参与下，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；风险管理部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。

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，出现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 1 次，未出现异常交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

四季度，国内经济仍处于明显的下行通道。12 月官方制造业 PMI 为 49.4%，为两年以来首次跌破荣枯线，显示制造业景气度继续回落。尽管近期货币政策放

松持续加码,但由于传导渠道的不畅及滞后效应,目前来看,实体信用尚未出现明显改善,需求仍延续疲弱态势。创业板在四季度受经济下行压力加重、中美贸易摩擦不断、去杠杆化、信用违约等宏观因素的影响表现不佳,创业板 50 指数下跌 14.36%。

投资管理上,基金采取完全复制的管理方法跟踪指数,并利用量化工具进行精细化管理,从而控制每日跟踪误差、以及净值表现与业绩基准的偏差幅度。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2018 年 12 月 31 日,本基金份额净值为 0.8794 元,本报告期(2018 年 10 月 1 日-2018 年 11 月 7 日)份额净值增长率为-9.39%,同期业绩比较基准增长率为-7.80%,本报告期(2018 年 11 月 8 日-2018 年 12 月 31 日)份额净值增长率为-8.47%,同期业绩比较基准增长率为-8.61%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望一季度,中美经贸关系极有可能迎来一段缓和期,但国内宏观经济的下行压力仍然很大,出口及消费需求预计仍将维持低迷,房地产投资增速将逐步下行,而基建投资的提速将承担起经济托底的重任。预计货币政策和财政政策逆周期调节的力度将进一步加大,全面的降准或降息、地方债发行的提速及较大规模的减税降费等举措都极有可能在年初推出,以进一步缓解经济下行压力。对于创业板公司,须格外关注商誉新规实施对业绩的实质影响,我们认为,目前创业板的估值已部分反映了商誉减值风险的预期。创业板 50 成分股的商誉减值压力相对整体创业板上市公司而言较小,而且,自 2019 年起商誉减值对业绩的冲击将边际趋弱,叠加政府对高新技术企业政策红利的不断释放及市场流动性的逐步改善,我们认为,有基本面支撑的成长公司已经具备较强的投资价值。

作为基金管理人,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 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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

§5 投资组合报告

5.1 华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

(报告期：2018年11月8日-2018年12月31日)

5.1.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	46,566.00	0.34
	其中：股票	46,566.00	0.34
2	基金投资	11,923,437.90	87.95
3	固定收益投资	1,557.92	0.01
	其中：债券	1,557.92	0.01
	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	-	-
	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	1,389,216.76	10.25
8	其他各项资产	195,960.49	1.45
9	合计	13,556,739.07	100.00

5.1.2 期末投资目标基金明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金	股票型	交易型开放式 (ETF)	华安基金管理有限公司	11,923,437.90	93.10

5.1.3 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.1.3.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	24,940.00	0.19
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	9,626.00	0.08
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	12,000.00	0.09
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	46,566.00	0.36

5.1.4 报告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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300618	寒锐钴业	200	14,816.00	0.12

2	300676	华大基因	200	12,000.00	0.09
3	300634	彩讯股份	200	4,774.00	0.04
4	300134	大富科技	400	3,760.00	0.03
5	300053	欧比特	400	3,264.00	0.03
6	300085	银之杰	400	3,184.00	0.02
7	300222	科大智能	200	3,100.00	0.02
8	300431	暴风集团	200	1,668.00	0.01

5.1.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	1,557.92	0.01
8	同业存单	-	-
8	其他	-	-
9	合计	1,557.92	0.01

5.1.6 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	123017	寒锐转债	16	1,557.92	0.01

5.1.7 报告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。

5.1.8 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。

5.1.9 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证投资。

5.1.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.1.10.1 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。

5.1.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在股指期货投资中主要遵循有效管理投资策略,根据风险管理的原则,以套期保值为目的,主要采用流动性好、交易活跃的期货合约,通过对现货和期货市场运行趋势的研究,结合股指期货定价模型寻求其合理估值水平,与现货资产进行匹配,通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

本基金运用股指期货的情形主要包括:对冲系统性风险;对冲特殊情况下的流动性风险,如大额申购赎回等;对冲因其他原因导致无法有效跟踪标的指数的风险;利用金融衍生品的杠杆作用,降低股票和目标ETF 仓位频繁调整的交易成本,达到有效跟踪对标的指数的目的。

5.1.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.1.11.1 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。

5.1.11.2 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。

5.1.12 投资组合报告附注

5.1.12.1 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。

5.1.12.2 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。

5.1.12.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
----	----	-------

1	存出保证金	3,115.07
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	301.61
5	应收申购款	192,543.81
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	195,960.49

5.1.12.4 报告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。

5.1.12.5 报告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。

5.1.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.2 华安中证定向增发事件指数证券投资基金 (LOF)

(报告期: 2018年10月1日-2018年11月7日)

5.2.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	7,155,775.00	89.67
	其中: 股票	7,155,775.00	89.67
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中: 债券	-	-
	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	-	-
	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	821,109.14	10.29
8	其他各项资产	3,375.24	0.04
9	合计	7,980,259.38	100.00

5.2 期末投资目标基金明细

5.2.3 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.3.1 指数投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	163,822.00	2.18
C	制造业	494,996.00	6.59
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	320,218.00	4.27
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	218,432.00	2.91
S	综合	-	-

合计	1,197,468.00	15.95
----	--------------	-------

5.2.3.2 积极投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	3,120,892.00	41.57
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	2,037,716.00	27.14
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	35,940.00	0.48
N	水利、环境和公共设施管理业	263,395.00	3.51
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	307,816.00	4.10
R	文化、体育和娱乐业	192,548.00	2.56
S	综合	-	-
	合计	5,958,307.00	79.36

5.2.4.1 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前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300222	科大智能	19,600	311,836.00	4.15

2	300413	芒果超媒	6,400	218,432.00	2.91
3	300072	三聚环保	15,200	183,160.00	2.44
4	300383	光环新网	12,600	171,738.00	2.29
5	002128	露天煤业	20,200	163,822.00	2.18
6	300085	银之杰	16,000	148,480.00	1.98

5.2.4.2 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前五名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300059	东方财富	51,400	664,088.00	8.85
2	300003	乐普医疗	12,000	368,400.00	4.91
3	300015	爱尔眼科	10,900	307,816.00	4.10
4	300408	三环集团	14,300	275,275.00	3.67
5	300122	智飞生物	6,100	259,555.00	3.46

5.2.5 报告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。

5.2.6 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券投资。

5.2.7 报告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。

5.2.8 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。

5.2.9 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证投资。

5.2.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.2.10.1 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。

5.2.10.2 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。

5.2.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.2.11.1 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。

5.2.11.2 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。

5.2.12 投资组合报告附注

5.2.12.1 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。

5.2.12.2 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。

5.2.12.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	815.76
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	752.72
5	应收申购款	1,806.76
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	3,375.24
---	----	----------

5.2.12.4 报告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。

5.2.12.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.2.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	002128	露天煤业	163,822.00	2.18	重大事项停牌

5.2.12.5.2 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。

5.2.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

§6 开放式基金份额变动

6.1 华安创业板50交易型开放式指数证券投资基金联接基金

单位：份

本报告期期初基金份额总额	11,080,140.09
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	7,548,798.85
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	792,790.99
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-3,273,158.72
本报告期期末基金份额总额	14,562,989.23

6.2 华安中证定向增发事件指数证券投资基金 (LOF)

单位：份

本报告期期初基金份额总额	12,088,781.30
基金合同生效日起至报告期期末基金总申	167,081.68

购份额	
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	1,175,722.89
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	11,080,140.09

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

7.2.1 华安创业板50交易型开放式指数证券投资基金联接基金

无。

7.2.2 华安中证定向增发事件指数证券投资基金 (LOF)

无。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

- 1、《华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》
- 2、《华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书》
- 3、《华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》
- 4、《华安中证定向增发事件指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》
- 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》
- 6、《华安中证定向增发事件指数证券投资基金 (LOF) 托管协议》

8.2 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>。

8.3 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
二〇一九年一月二十一日