

**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) 转型)**

**2018 年年度报告摘要**

**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

送出日期：二〇一九年三月三十日

## §1 重要提示

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 3 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自 2018 年 11 月 8 日起至 12 月 31 日止。

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

#### 2.1.1 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
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	14,562,989.23 份
基金合同存续期	不定期

##### 2.1.1.1 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 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	11,080,140.09 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

#### 2.2.1 华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

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	<p>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。</p> <p>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。</p>
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	<p>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。</p>

### 2.2.1.1 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	<p>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。</p>
业绩比较基准	创业板 50 指数收益率
风险收益特征	<p>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。</p>

### 2.2.2 华安中证定向增发事件指数证券投资基金 (LOF)

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	<p>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%。</p>
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	<p>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</p>

	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	陆滢	田青
	联系电话	021-38969999	010-67595096
	电子邮箱	luying@huaan.com.cn	tianqing1.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

登载基金年度报告摘要的管理人互联网网址	www.huaan.com.cn
基金年度报告备置地点	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、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

#### 3.1.1 华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

金额单位：人民币元

3.1.1.1 期间数据和指标	报告期	
	2018 年 11 月 8 日至 2018 年 12 月 31 日	
本期已实现收益		-213,487.04
本期利润		-1,042,773.22
加权平均基金份额本期利润		-0.0924
本期加权平均净值利润率		-10.41%
本期基金份额净值增		-8.47%

长率	
<b>3.1.1.2 期末数据和指标</b>	<b>2018 年末</b>
期末可供分配利润	-7,843,094.18
期末可供分配基金份额利润	-0.5386
期末基金资产净值	12,807,043.46
期末基金份额净值	0.8794

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）。

4、合同生效日当年的主要会计数据和财务指标按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.1.2 华安中证定向增发事件指数证券投资基金 (LOF)

金额单位：人民币元

3.1.2.1 期间数据和指标	报告期	2017 年	2016 年
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 11 月 7 日		
本期已实现收益	-3,552,606.08	4,842,783.66	-
本期利润	-4,565,500.96	5,703,902.35	-
加权平均基金份额本期利润	-0.3509	0.0527	-
本期加权平均净值利润率	-38.32%	5.19%	-
本期基金份额净值增长率	-37.50%	8.41%	-
3.1.2.2 期末数据和指标	报告期末(2018 年 11 月 7 日)	2017 年末	2016 年末
期末可供分配利润	-3,572,388.97	1,998,335.44	-
期末可供分配基金份额利润	-0.3224	0.0841	-
期末基金资产净值	7,507,751.12	25,771,213.30	-
期末基金份额净值	0.6776	1.0841	-

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)。

4、合同生效日当年的主要会计数据和财务指标按实际存续期计算, 不按整个自然年度进行折算。

### 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

##### 3.2.1.1 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

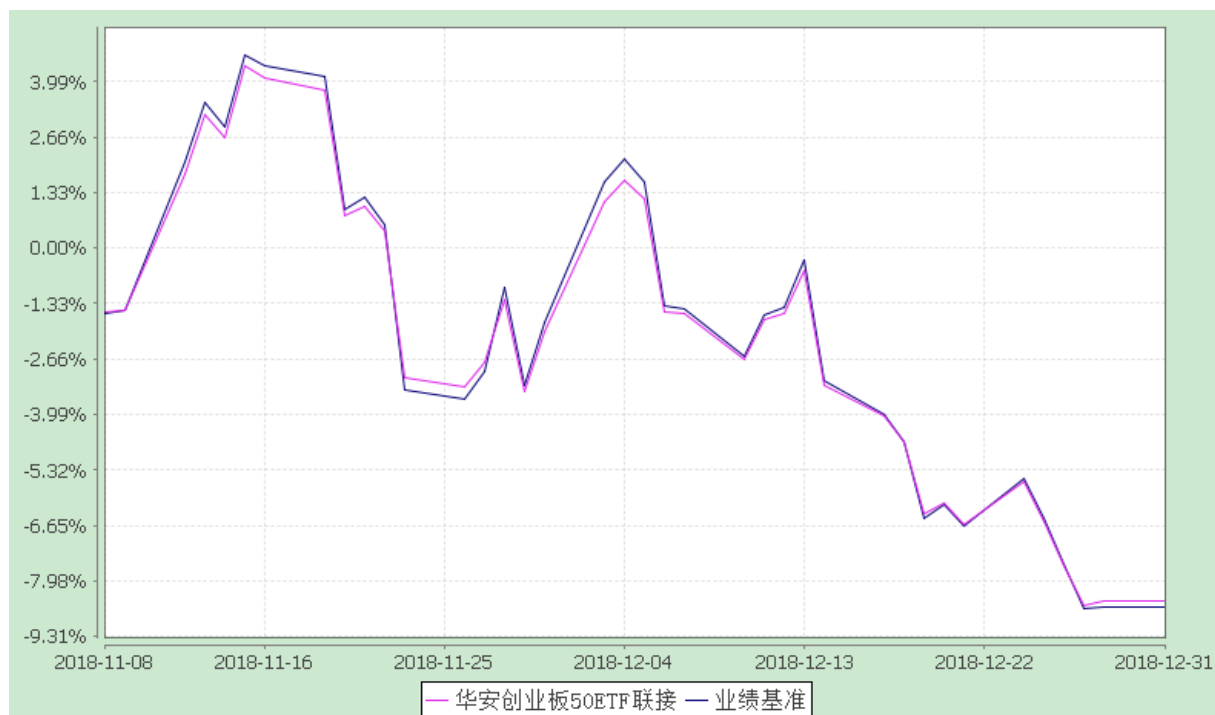
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-8.47%	1.52%	-8.61%	1.65%	0.14%	-0.13%
自基金成立起至今	-8.47%	1.52%	-8.61%	1.65%	0.14%	-0.13%

##### 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的历史走势对比图

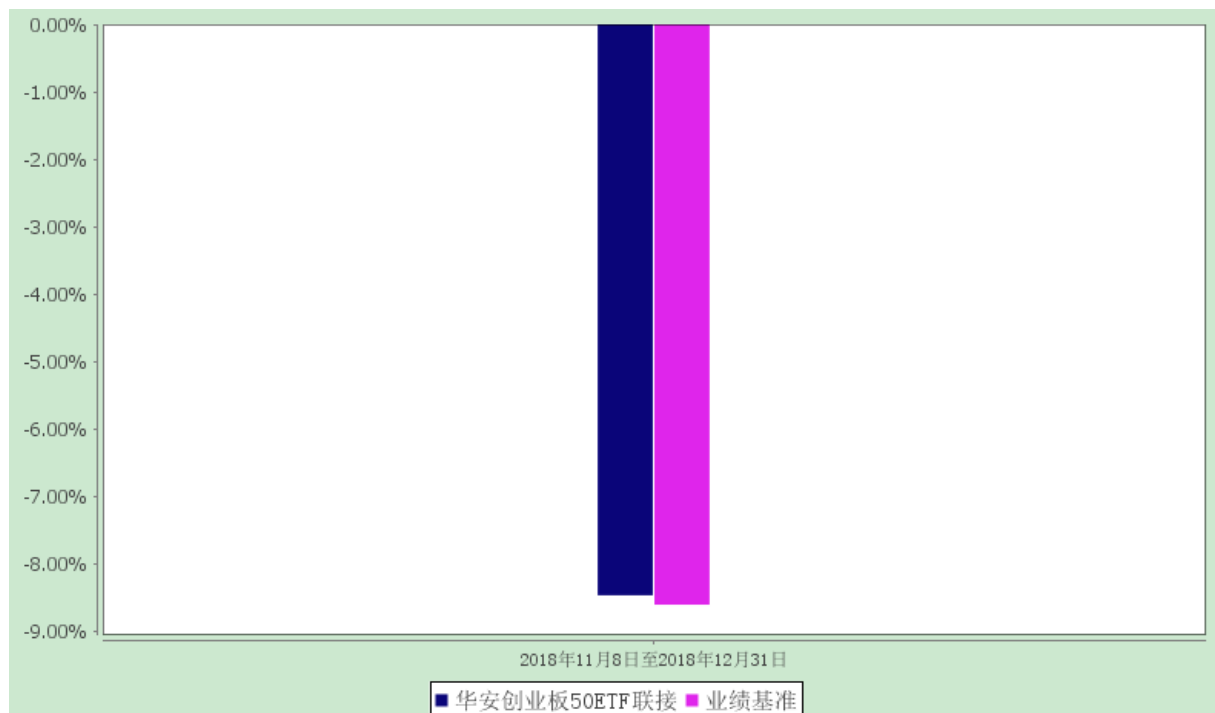
(2018 年 11 月 8 日至 2018 年 12 月 31 日)



### 3.2.1.3 自基金转型以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

自基金转型以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



注：合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.2.2 华安中证定向增发事件指数证券投资基金 (LOF)

#### 3.2.2.1 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
过去三个月	-12.45%	1.67%	-13.49%	1.57%	1.04%	0.10%
过去六个月	-31.97%	1.57%	-32.09%	1.50%	0.12%	0.07%
过去一年	-38.51%	1.45%	-40.10%	1.32%	1.59%	0.13%
自基金成立起至今	-32.24%	1.26%	-41.16%	1.18%	8.92%	0.08%

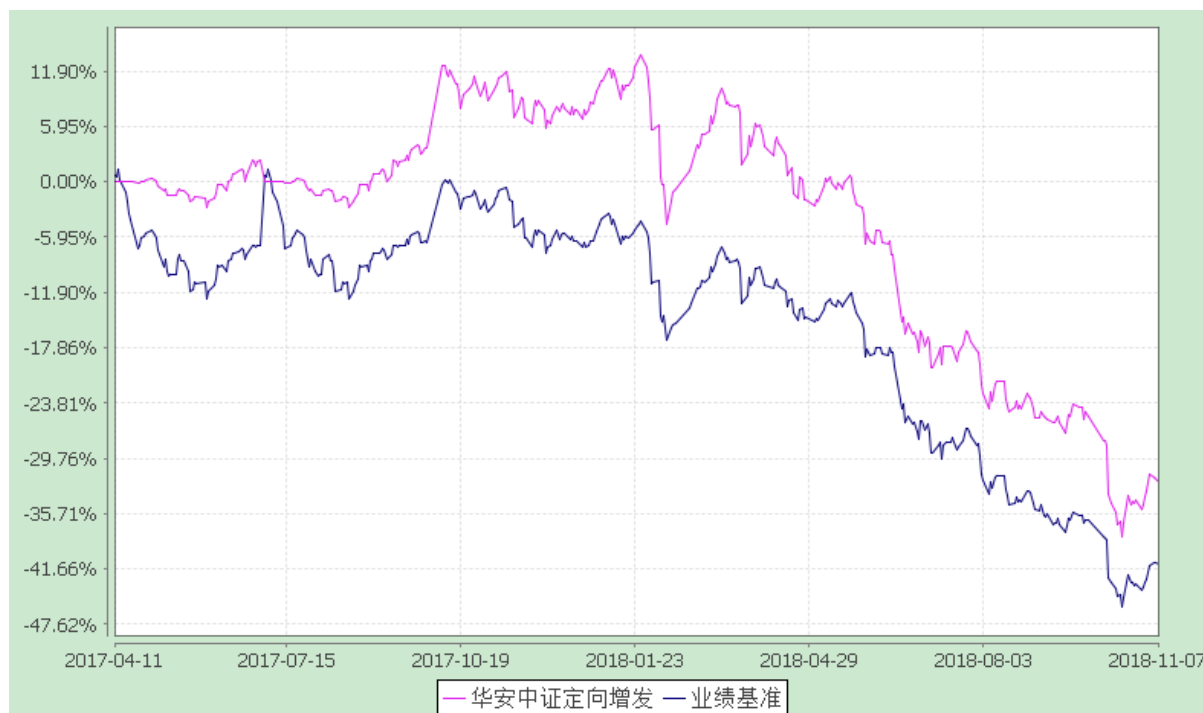
注：各阶段均以基金转型前最后运作日 2018 年 11 月 7 日为对日统计。

#### 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的历史走势对比图

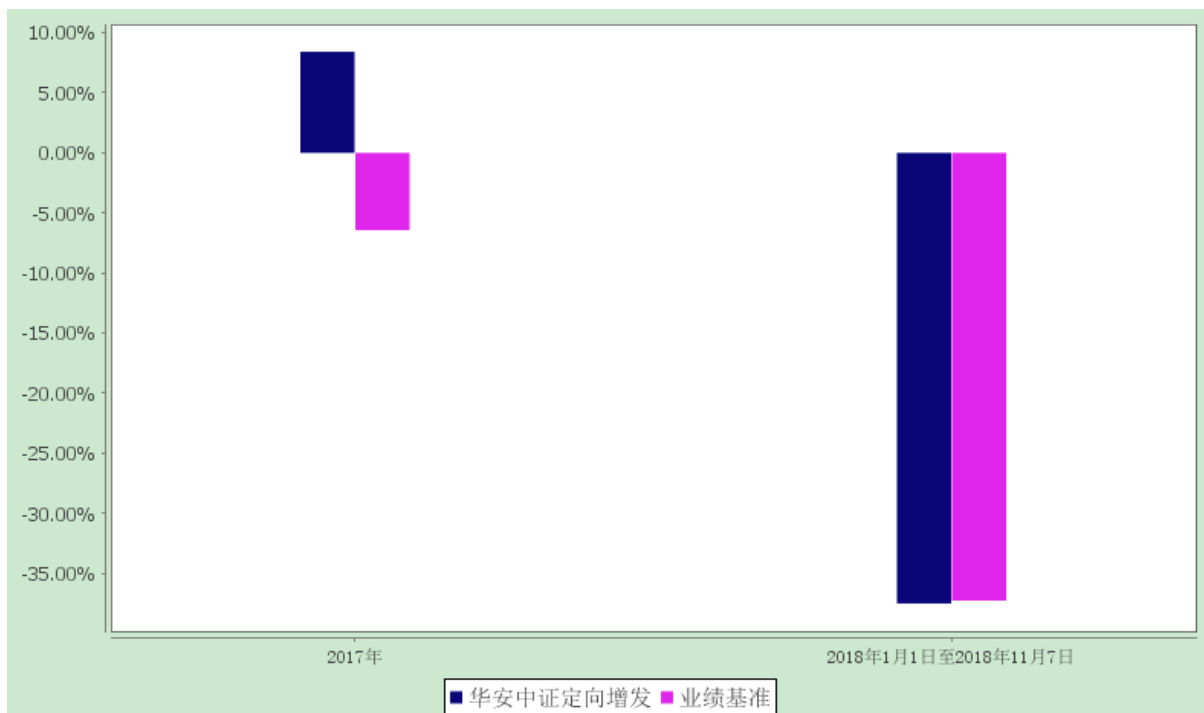
(2017 年 4 月 11 日至 2018 年 11 月 7 日)



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

华安中证定向增发事件指数证券投资基金 (LOF)

自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



注：合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

#### 3.3.1 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。

#### 3.3.2 华安中证定向增发事件指数证券投资基金 (LOF)

无。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

华安基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1998]20 号文批准于 1998 年 6 月设立，是国内首批基金管理公司之一，注册资本 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、沈阳、成都、广州等地设有分公司，在香港和上海设有子公司——华安（香港）资产管理有限公司、华安未来资产管理有限公司。截至 2018 年 12 月 31 日，公司旗下共管理华安创新混合、华安 MSCI 中国 A、华安现金富利货币、华安稳定收益债券、华安黄金易 ETF、华安沪港深外延增长混合、华安全

球美元收益债券等 108 只开放式基金，管理资产规模达到 2756.06 亿元人民币。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
许之彦	本基金的基金经理、指数与量化投资部高级总监、总经理助理	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。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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了《华安基金管理有限公司公平交易管理制度》，将封闭式基金、开放式基金、特定客户资产管理组合及其他投资组合资产在研究分析、投资决策、交易执行等方面全部纳入公平交易管理中。控制措施包括：在研究环节，研究员在为公司管理的各类投资组合提供研究信息、投资建议过程中，使用晨会发言、邮件发送、登录在研究报告管理系统中等方式来确保各类投资组合经理可以公平享有信息获取机会。在投资环节，公司各投资组合经理根据投资组合的风格和投资策略，制定并严格执行交易决策规则，以保证各投资组合交易决策的客观性和独立性。同时严格执行投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体授权机制，投资组合经理在授权范围内自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易环节，公司实行强制公平交易机制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。（1）交易所二级市场业务，遵循价格优先、时间优先、比例分配、综合平衡的控制原则，实现同一时间下达指令的投资组合在交易时机上的公平性。（2）交易所一级市场业务，投资组合经理按意愿独立进行业务申报，集中交易部以投资组合名义对外进行申报。若该业务以公司名义进行申报与中签，则按实际中签情况以价格优先、比例分配原则进行分配。若中签量过小无法合理进行比例分配，且以公司名义获得，则投资部门在合规监察员监督参与下，进行公平协商分配。（3）银行间市场业务遵循指令时间优先原则，先到先询价的控制原则。通过内部共同的 iwind 群，发布询价需求和结果，做到信息公开。若是多个投资组合进行一级市场投标，则各投资组合经理须以各投资组合名义向集中交易部下达投资意向，交易员以此进行投标，以确保中签结果与投资组合投标意

向一一对应。若中签量过小无法合理进行比例分配,且以公司名义获得,则投资部门在风险管理部投资监督参与下,进行公平协商分配。交易监控、分析与评估环节,公司风险管理部对公司旗下的各投资组合投资境内证券市场上市交易的投资品种、进行场外的非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购、不同投资组合同日和临近交易日的反向交易以及可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控,根据市场公认的第三方信息(如:中债登的债券估值),定期对各投资组合与交易对手之间议价交易的交易价格公允性进行审查,对不同投资组合临近交易日的同向交易的交易时机和交易价差进行分析。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内,公司公平交易制度总体执行情况良好。

本基金管理人通过统计检验的方法对管理的不同投资组合,在不同时间窗下(日内、3日内、5日内)的本年度同向交易价差进行了专项分析,未发现违反公平交易原则的异常情况。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,公司合规监察稽核部会同基金投资、交易部门讨论制定了公募基金、专户针对股票、债券、回购等投资品种在交易所及银行间的同日反向交易控制规则,并在投资系统中进行了设置,实现了完全的系统控制。同时加强了对基金、专户间的同日反向交易的监控与隔日反向交易的检查;风险管理部开发了同向交易分析系统,对相关同向交易指标进行持续监控,并定期对组合间的同向交易行为进行了重点分析。

本报告期内,因组合流动性管理或投资策略调整需要,除指数基金以外的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的次数为 4 次,未出现异常交易。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2018 年国内经济增速放缓,全年实际 GDP 同比增长 6.6%,较上年回落 0.2 个百分点。上半年,在去杠杆、严监管政策持续发力的环境下,表外融资大幅收缩,社融增速迅速回落,实体经济信用扩张受限;外部方面,中美贸易摩擦爆发,成为全年扰动全球资本市场的最大不确定因素。面对经济下行压力,下半年国内央行货币政策放松加码,各项针对民企融资难的多项政策陆续出台,但整个 2018 年实体信用未出现显著改善,需求仍延续疲弱态势,企业的盈利增速持续回落,尤其是商誉减值等因素对部分中小创公司业绩产生较大负面影响。受估值与业绩的双重压制,全年 A 股市场表

现惨淡,各主要指数全线下跌,创业板 50 指数全年下跌 34.09%。

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 1 月 1 日-2018 年 11 月 7 日)份额净值增长率为-37.50%,同期业绩比较基准增长率为-37.26%,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 2019 年,尽管国内宏观经济下行的压力依然较大,出口需求及消费预计仍将维持低迷,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。但另一方面,逆周期调节的货币政策及财政政策将进一步加大,尤其在美国经济下行压力加大,美联储货币政策的面临转向的背景下,国内货币政策调节空间进一步打开,中小企业融资环境有望改善,地方债及减税降费等举措也有望进一步缓解经济下行压力。外部方面,目前来看中美间贸易领域争端达成和解的概率较高。

2019 年前两月,受全球流动性边际宽松、中美贸易摩擦趋缓,国内社融数据大幅改善以及本身市场估值极低等多重利好影响和触发下,A 股市场迎来大幅反弹。我们认为,优质的成长股当前时点仍具备较高的配置价值,原因在于(1)商誉减值风险集中释放后,部分优质创业板公司有望迎来业绩增速拐点;(2)2019 年,外资有望为 A 股带来可观的增量资金,并且对创业板中的绩优龙头公司的认可度逐步提升;(3)2019 年国内无风险利率有望继续回落,有利于成长股的估值进一步提升;(4)未来科创版的推出将有助于凸显创业板中以 5G 和人工智能为代表的真正具备创新能力的高科技公司的投资价值。

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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本基金管理人设有估值委员会,负责在证券发行机构发生了严重影响证券价格的重大事件时,评估重大事件对投资品种价值的影响程度、评估对基金估值的影响程度、确定采用的估值方法、确

定该证券的公允价值；同时将采用的估值方法以及采用该方法对相关证券的估值与基金的托管银行进行沟通。估值委员会成员由投资总监、研究总监、固定收益部总监、指数投资部总监、基金运营部总经理、风险管理部总监等人员组成，具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备行业研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供银行间同业市场及交易所交易的债券品种的估值数据。

#### **4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

本报告期不进行收益分配。

#### **4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明**

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

## **§5 托管人报告**

### **5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明**

本报告期，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 审计报告

### 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

安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)审计了 2018 年 12 月 31 日的资产负债表、2018 年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表和财务报表附注,并出具了标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

### 6.2 华安中证定向增发事件指数证券投资基金 (LOF)

安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)审计了 2018 年 11 月 7 日的资产负债表、2018 年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表和财务报表附注,并出具了标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

## §7 年度财务报表

### 7.1 华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

#### 7.1.1 资产负债表

会计主体:华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

报告截止日:2018 年 12 月 31 日

单位:人民币元

资产	本期末 2018 年 12 月 31 日
资产:	-
银行存款	1,300,142.86
结算备付金	89,073.90
存出保证金	3,115.07
交易性金融资产	11,971,561.82
其中:股票投资	46,566.00
基金投资	11,923,437.90
债券投资	1,557.92
资产支持证券投资	-
贵金属投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	-
应收证券清算款	-
应收利息	301.61
应收股利	-

应收申购款	192,543.81
递延所得税资产	-
其他资产	-
<b>资产总计</b>	<b>13,556,739.07</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 2018 年 12 月 31 日</b>
负 债:	-
短期借款	-
交易性金融负债	-
衍生金融负债	-
卖出回购金融资产款	-
应付证券清算款	560,649.35
应付赎回款	46,803.69
应付管理人报酬	596.70
应付托管费	119.33
应付销售服务费	-
应付交易费用	21,351.11
应交税费	-
应付利息	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	120,175.43
<b>负债合计</b>	<b>749,695.61</b>
<b>所有者权益:</b>	-
实收基金	20,650,137.64
未分配利润	-7,843,094.18
<b>所有者权益合计</b>	<b>12,807,043.46</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>	<b>13,556,739.07</b>

注: (1) 报告截止日 2018 年 12 月 31 日, 基金份额净值 0.8794 元, 基金份额总额 14,562,989.23 份。

(2) 本基金由华安中证定向增发事件指数证券投资基金 (LOF) 转型而成, 转型日为 2018 年 11 月 8 日。

### 7.1.2 利润表

会计主体: 华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

本报告期: 2018 年 11 月 8 日至 2018 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

项目	本期
	2018 年 11 月 8 日至 2018 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>	<b>-1,010,457.14</b>
1.利息收入	1,313.01
其中：存款利息收入	1,312.57
债券利息收入	0.44
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	-
其他利息收入	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	-186,477.75
其中：股票投资收益	-186,449.25
基金投资收益	-
债券投资收益	-
资产支持证券投资收益	-
贵金属投资收益	-
衍生工具收益	-
股利收益	-28.50
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-829,286.18
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	3,993.78
<b>减：二、费用</b>	<b>32,316.08</b>
1. 管理人报酬	2,392.54
2. 托管费	478.50
3. 销售服务费	-
4. 交易费用	11,293.72
5. 利息支出	-
其中：卖出回购金融资产支出	-
6. 税金及附加	-
7. 其他费用	18,151.32
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>-1,042,773.22</b>
减：所得税费用	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>-1,042,773.22</b>

### 7.1.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

本报告期：2018 年 11 月 8 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 11 月 8 日至 2018 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	11,080,140.09	-3,572,388.97	7,507,751.12
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-1,042,773.22	-1,042,773.22
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）	9,569,997.55	-3,227,931.99	6,342,065.56
其中：1.基金申购款	10,685,338.43	-3,602,450.72	7,082,887.71
2.基金赎回款	-1,115,340.88	374,518.73	-740,822.15
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）	20,650,137.64	-7,843,094.18	12,807,043.46

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：朱学华，主管会计工作负责人：赵敏，会计机构负责人：陈林

## 7.1.4 报表附注

### 7.1.4.1 基金基本情况

华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（以下简称“本基金”）由华安中证定向增发事件指数证券投资基金（LOF）转型而成。华安中证定向增发事件指数证券投资基金（LOF）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，由基金管理人华安基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于 2017 年 4 月 11 日生效，首次设立募集规模为 309,484,316.78 份基金份额。根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《华安中证定向增发事件指数证券投资基金（LOF）基金合同》、《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》、中国证监会《关于准予华安中证定向增发事件指数证券投资基金（LOF）变更注册的批复》（证

监许可[2018]1326 号)和《关于华安中证定向增发事件指数证券投资基金 (LOF) 基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》的有关规定,华安中证定向增发事件指数证券投资基金 (LOF) 于 2018 年 11 月 8 日终止上市,原《华安中证定向增发事件指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》失效,《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》生效,华安中证定向增发事件指数证券投资基金 (LOF) 正式转型为华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人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。

本基金主要投资于目标 ETF 基金份额、标的指数成份股及其备选成份股,把接近全部的基金资产用于跟踪标的指数的表现。为更好地实现投资目标,本基金可少量投资于非成份股(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、国债、金融债、企业债、公司债、地方政府债券、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款、股指期货、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

本基金组合投资比例为:投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%。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%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。

本基金的业绩比较基准为:  $95\% \times \text{创业板 50 指数收益率} + 5\% \times \text{商业银行税后活期存款利率}$ 。

#### 7.1.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定(以下统称“企业会计准则”)编制,同时,对于在具体会计核算和信息披露方面,也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 7.1.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及自 2018 年 11 月 8 日（基金合同转型日）起至 2018 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净值变动情况。

#### 7.1.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

##### 7.1.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年自 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自 2018 年 11 月 8 日（基金合同转型日）起至 2018 年 12 月 31 日止。

##### 7.1.4.4.2 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。

##### 7.1.4.4.3 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等；

###### (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。

##### 7.1.4.4.4 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,或该收取金融资产现金流量的权利已转移,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;

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

本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。

### 7.1.4.4.5 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。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中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。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的金融工具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，按照估值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作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，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) 不存在活跃市场的金融工具,应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。采用估值技术确定公允价值时,应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,才使用不可观察输入值;

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的,基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后,按最能反映公允价值的方法估值;

(4) 如有新增事项,按国家最新规定估值。

#### **7.1.4.4.6 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。

#### **7.1.4.4.7 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。

#### **7.1.4.4.8 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)”。

#### 7.1.4.4.9 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) 资产支持证券投资收益/(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;

(8) 权证收益/(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;

(9) 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;

(10) 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;

(11) 公允价值变动收益/(损失)系本基金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、以公允价值计量且其变动计入当期损益的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;

(12) 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。

#### 7.1.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用在费用涵盖期间按基金合同或相关公告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。

#### 7.1.4.4.11 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。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;

(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, 可在按照监管部门要求履行适当程序后调整基金收益的分配原则, 不需召开基金份额持有人大会, 但应于变更实施日前在指定媒介公告。。

#### 7.1.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.1.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

##### 7.1.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

##### 7.1.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 7.1.4.6 税项

##### 7.1.4.6.1 印花税

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

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

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

#### 7.1.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，本基金的基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

#### 7.1.4.6.3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例(2011 年修订)》、《征收教育费附加的暂行规定(2011 年修订)》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

#### 7.1.4.6.4 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》

的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

#### 7.1.4.6.5 个人所得税

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

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。

#### 7.1.4.7 关联方关系

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(“建设银行”)	基金托管人、基金销售机构
国泰君安创新投资有限公司	基金管理人的股东(2018 年 12 月 5 日前)
上海国际信托有限公司	基金管理人的股东(2018 年 12 月 5 日前)
国泰君安证券股份有限公司	基金管理人的股东(自 2018 年 12 月 5 日起)、基金销售机构
上海上国投资资产管理有限公司	基金管理人的股东(自 2018 年 12 月 5

	日起)
上海工业投资(集团)有限公司	基金管理人的股东
上海锦江国际投资管理有限公司	基金管理人的股东
国泰君安投资管理股份有限公司	基金管理人的股东
华安资产管理(香港)有限公司	基金管理人的全资子公司
华安未来资产管理(上海)有限公司	基金管理人的全资子公司

注：1.下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

2.根据华安基金管理有限公司于 2018 年 12 月 7 日发布的公告，经华安基金管理有限公司股东会第五十六次会议决议、第五十九次会议决议及中国证券监督管理委员会证监许可[2018]2012 号文核准，华安基金管理有限公司股东国泰君安创新投资有限公司、上海国际信托有限公司将各持有的华安基金管理有限公司 20%的股权分别转让给国泰君安证券股份有限公司和上海上国投资资产管理有限公司。自 2018 年 12 月 5 日起，华安基金管理有限公司股东变更为国泰君安证券股份有限公司、上海上国投资资产管理有限公司、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。

#### 7.1.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.1.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.1.4.8.1.1 股票交易

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行股票交易。

###### 7.1.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行权证交易。

###### 7.1.4.8.1.3 债券交易

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券交易。

###### 7.1.4.8.1.4 债券回购交易

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行回购交易。

###### 7.1.4.8.1.5 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。

##### 7.1.4.8.2 关联方报酬

###### 7.1.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2018年11月8日至2018年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	2,392.54
其中：支付销售机构的客户维护费	2,745.71

注：基金管理费按前一日的基金资产净值扣除所持有目标 ETF 份额所对应的资产净值后余额（若为负数，则取 0）的 0.50% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{基金管理费率} / \text{当年天数}$$

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所持有目标 ETF 份额所对应的资产净值后的余额

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

#### 7.1.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2018年11月8日至2018年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	478.50

注：基金托管费按前一日的基金资产净值扣除所持有目标 ETF 份额所对应的资产净值后余额（若为负数，则取 0）的 0.10% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{基金托管费率} / \text{当年天数}$$

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基金所持有目标 ETF 份额所对应的资产净值后的余额

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

#### 7.1.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 7.1.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

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

本基金的基金管理人本报告期末运用固有资金投资本基金。

##### 7.1.4.8.4.2 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

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末未投资本基金。

#### 7.1.4.8.5 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 2018年11月8日至2018年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
建设银行	1,300,142.86	1,136.06

#### 7.1.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 7.1.4.8.7 其他关联交易事项的说明

##### 7.1.4.8.7.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期末，持有 27,291,000 份目标 ETF 基金份额，占其总份额的比例为 0.13%。

#### 7.1.4.9 期末（2018年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.1.4.9.1 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。

##### 7.1.4.9.2 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。

##### 7.1.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.1.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2018 年 12 月 31 日止，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金融资产款余额。

###### 7.1.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2018 年 12 月 31 日止，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金融资产款余额。

#### 7.1.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 7.1.4.10.1 公允价值

###### 7.1.4.10.1.1 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括贷款和应收款项以及其他金融负债，其因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

###### 7.1.4.10.1.2 以公允价值计量的金融工具

###### 7.1.4.10.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于 2018 年 12 月 31 日，本基金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中属于第一层次的余额为人民币 11,971,561.82 元，属于第二层次的余额为人民币 0.00 元，属于第三层次的余额为人民币 0.00 元。

#### 7.1.4.10.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关股票和可转换债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。

#### 7.1.4.10.1.2.3 第三层次公允价值余额和本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具第三层次公允价值本期未发生变动。

#### 7.1.4.10.2 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。

#### 7.1.4.10.3 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。

#### 7.1.4.10.4 财务报表的批准

本财务报表已于 2019 年 3 月 26 日经本基金的基金管理人批准。

## 7.2 华安中证定向增发事件指数证券投资基金 (LOF)

### 7.2.1 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：2018 年 11 月 7 日

单位：人民币元

资产	本期末 2018 年 11 月 7 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日-
资产：	-	-
银行存款	821,109.14	2,236,763.49
结算备付金	-	159,816.69
存出保证金	815.76	40,939.59
交易性金融资产	7,155,775.00	24,171,864.52
其中：股票投资	7,155,775.00	24,171,864.52
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	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	-

应收利息	752.72	508.17
应收股利	-	-
应收申购款	1,806.76	1,637.23
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
<b>资产总计</b>	<b>7,980,259.38</b>	<b>26,611,529.69</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 2018 年 11 月 7 日</b>	<b>上年度末 2017 年 12 月 31 日-</b>
负 债:	-	-
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	310,841.61	-
应付赎回款	23,970.92	389,348.19
应付管理人报酬	1,445.84	23,283.52
应付托管费	289.18	4,656.68
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	13,061.07	51,560.61
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	122,899.64	371,467.39
<b>负债合计</b>	<b>472,508.26</b>	<b>840,316.39</b>
<b>所有者权益:</b>	-	-
实收基金	11,080,140.09	23,772,877.86
未分配利润	-3,572,388.97	1,998,335.44
<b>所有者权益合计</b>	<b>7,507,751.12</b>	<b>25,771,213.30</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>	<b>7,980,259.38</b>	<b>26,611,529.69</b>

注: (1) 报告截止日 2018 年 11 月 7 日, 基金份额净值 0.6776 元, 基金份额总额 11,080,140.09 份。

(2) 本基金基金合同于 2017 年 4 月 11 日生效。上年度可比期间为 2017 年 4 月 11 日至 2017 年 12 月 31 日。

(3) 本基金自 2018 年 11 月 8 日起转型为华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金。

## 7.2.2 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：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 11 月 7 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 11 月 7 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日-
<b>一、收入</b>	<b>-3,990,355.80</b>	<b>7,730,597.30</b>
1.利息收入	8,960.28	551,012.78
其中：存款利息收入	8,960.28	247,170.53
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）	-3,021,967.89	5,881,514.98
其中：股票投资收益	-3,089,850.77	5,206,698.40
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	67,882.88	674,816.58
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-1,012,894.88	861,118.69
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	35,546.69	436,950.85
<b>减：二、费用</b>	<b>575,145.16</b>	<b>2,026,694.95</b>
1. 管理人报酬	101,145.90	795,645.23
2. 托管费	20,229.21	159,128.99
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	64,355.40	531,853.53
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 税金及附加	-	-
7. 其他费用	389,414.65	540,067.20
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>-4,565,500.96</b>	<b>5,703,902.35</b>

减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>-4,565,500.96</b>	<b>5,703,902.35</b>

### 7.2.3 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：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 11 月 7 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 11 月 7 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）	23,772,877.86	1,998,335.44	25,771,213.30
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-4,565,500.96	-4,565,500.96
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）	-12,692,737.77	-1,005,223.45	-13,697,961.22
其中：1.基金申购款	19,730,822.75	-4,642,057.83	15,088,764.92
2.基金赎回款	-32,423,560.52	3,636,834.38	-28,786,726.14
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）	11,080,140.09	-3,572,388.97	7,507,751.12
项目	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	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）	-	5,703,902.35	5,703,902.35
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填	-285,711,438.92	-3,705,566.91	-289,417,005.83

列)			
其中: 1.基金申购款	36,844,679.04	2,879,383.18	39,724,062.22
2.基金赎回款	-322,556,117.96	-6,584,950.09	-329,141,068.05
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)	23,772,877.86	1,998,335.44	25,771,213.30

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：朱学华，主管会计工作负责人：赵敏，会计机构负责人：陈林

## 7.2.4 报表附注

### 7.2.4.1 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，由基金管理人华安基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于 2017 年 4 月 11 日生效，首次设立募集规模为 309,484,316.78 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人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。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《华安中证定向增发事件指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》、《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》、中国证监会《关于准予华安中证定向增发事件指数证券投资基金 (LOF) 变更注册的批复》(证监许可[2018]1326 号) 和《关于华安中证定向增发事件指数证券投资基金 (LOF) 基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》的有关规定，本基金基金管理人华安基金管理有限公司向深圳证券交易所申请终止本基金的上市交易业务，并获得深圳证券交易所《终止上市通知书》(深证上[2018]515 号) 同意。自本基金终止上市之日起，基金名称变更为“华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金”。本基金管理人根据持有人大会决议执行基金的正式转型，将本基金转型为华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金份额，转型基准日为 2018 年 11 月 8 日。转型基准日登记在册的本基金的基金份额将全部转为华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金份额。

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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；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）。

#### 7.2.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《华安中证定向增发事件指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》、《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》、中国证监会《关于准予华安中证定向增发事件指数证券投资基金 (LOF) 变更注册的批复》（证监许可[2018]1326 号）和《关于华安中证定向增发事件指数证券投资基金 (LOF) 基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》的有关规定，本基金自 2018 年 11 月 8 日转型为华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金。

故本财务报表仍以持续经营为基础列报。

#### 7.2.4.3 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 11 月 7 日的财务状况以及自 2018 年 1 月 1 日起至 2018 年 11 月 7 日止期间的经营成果和净值变动情况。

#### 7.2.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 7.2.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.2.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

##### 7.2.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

##### 7.2.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 7.2.4.6 税项

##### 7.2.4.6.1 印花税

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

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

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

##### 7.2.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入

以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，本基金的基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对本基金在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从本基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

#### 7.2.4.6.3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011 年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

#### 7.2.4.6.4 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

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

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，

对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

#### 7.2.4.6.5 个人所得税

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

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。

#### 7.2.4.7 关联方关系

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(“建设银行”)	基金托管人、基金销售机构
国泰君安创新投资有限公司	基金管理人的股东
上海国际信托有限公司	基金管理人的股东
上海工业投资(集团)有限公司	基金管理人的股东
上海锦江国际投资管理有限公司	基金管理人的股东
国泰君安投资管理股份有限公司	基金管理人的股东
华安资产管理(香港)有限公司	基金管理人的全资子公司
华安未来资产管理(上海)有限公司	基金管理人的全资子公司

注：1. 下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.2.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.2.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 7.2.4.8.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

#### 7.2.4.8.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

#### 7.2.4.8.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行回购交易。

#### 7.2.4.8.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 7.2.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

#### 7.2.4.8.2 关联方报酬

##### 7.2.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年11 月7日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12 月31日-
当期发生的基金应支付的管理费	101,145.90	795,645.23
其中：支付销售机构的客户维护费	35,161.95	241,508.63

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.00% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{基金管理费率} / \text{当年天数}$$

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。

##### 7.2.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年11 月7日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12 月31日-
当期发生的基金应支付的托管费	20,229.21	159,128.99

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times \text{基金托管费率} / \text{当年天数}$

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。

#### 7.2.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 7.2.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

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

本基金的基金管理人于本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

##### 7.2.4.8.4.2 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

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资本基金。

#### 7.2.4.8.5 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 2018年1月1日至2018年11月7日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月 31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
建设银行	821,109.14	8,618.41	2,236,763.49	236,462.13

#### 7.2.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 7.2.4.8.7 其他关联交易事项的说明

##### 7.2.4.8.7.1 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.2.4.9 期末（2018年11月7日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.2.4.9.1 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。

##### 7.2.4.9.2 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
002128	露天煤业	2018-10-31	重大事项停牌	8.11	2018-11-08	8.21	20,200.00	181,373.46	163,822.00	
300053	欧比特	2018-11-06	重大事项停牌	9.14	2018-11-20	10.05	6,200.00	56,190.00	56,668.00	
300362	天翔环境	2018-06-08	重大事项停牌	7.00	2018-12-10	8.69	5,900.00	78,640.51	41,300.00	

### 7.2.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.2.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2018 年 11 月 7 日止, 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金融资产款余额。

#### 7.2.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2018 年 11 月 7 日止, 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金融资产款余额。

### 7.2.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

#### 7.2.4.10.1 公允价值

##### 7.2.4.10.1.1 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括贷款和应收款项以及其他金融负债, 其因剩余期限不长, 公允价值与账面价值相若。

##### 7.2.4.10.1.2 以公允价值计量的金融工具

###### 7.2.4.10.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于 2018 年 11 月 7 日, 本基金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中属于第一层次的余额为人民币 6,893,985.00 元, 属于第二层次的余额为人民币 261,790.00 元, 属于第三层次的余额为人民币 0.00 元 (于 2017 年 12 月 31 日, 本基金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中属于第一层次的余额为人民币 22,599,509.12 元, 属于第二层次的余额为人民币 1,572,355.40 元, 属于第三层次的余额为人民币 0.00 元)。

###### 7.2.4.10.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券, 若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况, 本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关股票和可转换债券的公允价值列入第一层次; 并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度, 确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。

###### 7.2.4.10.1.2.3 第三层次公允价值余额和本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具第三层次公允价值本期未发生变动。

#### 7.2.4.10.2 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。

#### 7.2.4.10.3 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。

#### 7.2.4.10.4 财务报表的批准

本财务报表已于 2019 年 3 月 26 日经本基金的基金管理人批准。

## §8 投资组合报告

### 8.1 华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

#### 8.1.1 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	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

#### 8.1.2 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	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

	式指数证 券投资基 金					
--	-------------------	--	--	--	--	--

### 8.1.3 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.1.3.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	-	-
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

#### 8.1.4 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

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	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

### 8.1.5 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 8.1.5.1 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	300059	东方财富	657,500.00	5.13
2	300124	汇川技术	364,060.00	2.84
3	300015	爱尔眼科	338,694.00	2.64
4	300136	信维通信	332,918.00	2.60
5	300003	乐普医疗	294,198.00	2.30
6	300024	机器人	252,329.00	1.97
7	300146	汤臣倍健	248,595.00	1.94
8	300408	三环集团	246,188.00	1.92
9	300122	智飞生物	219,094.00	1.71
10	300070	碧水源	215,391.00	1.68
11	300750	宁德时代	190,526.00	1.49
12	300666	江丰电子	186,687.00	1.46
13	300253	卫宁健康	170,927.00	1.33
14	300450	先导智能	157,547.00	1.23
15	300168	万达信息	155,587.00	1.21
16	300017	网宿科技	147,096.00	1.15
17	300274	阳光电源	146,290.00	1.14
18	300072	三聚环保	145,508.00	1.14
19	300699	光威复材	145,015.00	1.13
20	300618	寒锐钴业	139,197.00	1.09

注：本项的“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）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。

#### 8.1.5.2 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	300222	科大智能	266,826.00	2.08
2	300618	寒锐钴业	170,965.00	1.33
3	002128	露天煤业	160,994.00	1.26
4	300413	芒果超媒	120,333.00	0.94
5	300676	华大基因	117,413.00	0.92
6	300059	东方财富	114,840.00	0.90
7	300085	银之杰	106,566.00	0.83
8	300003	乐普医疗	60,522.00	0.47
9	300015	爱尔眼科	56,660.00	0.44
10	300634	彩讯股份	53,075.00	0.41
11	300408	三环集团	43,000.00	0.34
12	300122	智飞生物	42,980.00	0.34
13	300024	机器人	42,916.00	0.34
14	300146	汤臣倍健	38,515.00	0.30
15	300070	碧水源	36,029.00	0.28
16	300253	卫宁健康	31,250.00	0.24
17	300750	宁德时代	30,578.00	0.24
18	300362	天翔环境	30,090.00	0.23
19	300017	网宿科技	26,635.00	0.21
20	300072	三聚环保	26,200.00	0.20

注：本项的“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）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。

### 8.1.5.3 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	7,162,764.00
卖出股票的收入（成交）总额	1,934,007.00

注：本项的“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）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。

### 8.1.6 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	-	-
	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	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,557.92	0.01

### 8.1.7 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	123017	寒锐转债	16	1,557.92	0.01

### 8.1.8 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 8.1.9 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

### 8.1.10 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。

### 8.1.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 8.1.11.1 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。

#### 8.1.11.2 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。

### 8.1.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 8.1.12.1 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。

#### 8.1.12.2 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。

### 8.1.13 投资组合报告附注

8.1.13.1 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。

8.1.13.2 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。

#### 8.1.13.3 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	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

#### 8.1.13.4 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。

#### 8.1.13.5 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。

## 8.2 华安中证定向增发事件指数证券投资基金 (LOF)

### 8.2.1 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	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

## 8.2.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.2.1 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	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

### 8.2.3 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	-	-
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

### 8.2.4 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

#### 8.2.4.1 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	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

#### 8.2.4.2 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

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	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

## 8.2.5 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.2.5.1 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	300059	东方财富	662,305.00	2.57
2	002340	格林美	440,974.00	1.71
3	300222	科大智能	386,637.00	1.50
4	601288	农业银行	381,400.00	1.48
5	300003	乐普医疗	371,844.00	1.44
6	002230	科大讯飞	341,767.00	1.33
7	000019	深深宝 A	325,332.00	1.26
8	300015	爱尔眼科	310,213.00	1.20
9	002366	台海核电	307,913.00	1.19
10	002092	中泰化学	297,783.00	1.16
11	300408	三环集团	288,680.00	1.12
12	002146	荣盛发展	269,533.00	1.05
13	000732	泰禾集团	257,300.00	1.00
14	300750	宁德时代	255,961.00	0.99
15	300024	机器人	240,312.00	0.93
16	300122	智飞生物	235,793.00	0.91
17	601866	中远海发	226,235.00	0.88
18	300124	汇川技术	221,228.00	0.86
19	002161	远望谷	217,218.84	0.84
20	300070	碧水源	205,176.00	0.80

注：本项的“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）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。

### 8.2.5.2 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	601155	新城控股	1,123,323.12	4.36
2	002340	格林美	968,964.60	3.76
3	000425	徐工机械	806,407.00	3.13
4	000039	中集集团	805,530.00	3.13
5	002226	江南化工	778,978.50	3.02
6	002092	中泰化学	667,076.00	2.59
7	600346	恒力股份	649,438.93	2.52
8	002146	荣盛发展	640,726.00	2.49
9	300244	迪安诊断	630,775.44	2.45
10	000488	晨鸣纸业	614,165.00	2.38
11	601866	中远海发	555,162.00	2.15
12	600673	东阳光科	489,658.00	1.90
13	000732	泰禾集团	473,935.96	1.84
14	300222	科大智能	470,707.00	1.83
15	000301	东方盛虹	458,828.00	1.78
16	000878	云南铜业	455,727.00	1.77
17	002596	海南瑞泽	450,958.00	1.75
18	600318	新力金融	418,217.00	1.62
19	601288	农业银行	408,058.00	1.58
20	002812	恩捷股份	407,614.40	1.58

注：本项的“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）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。

### 8.2.5.3 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	12,773,906.13
卖出股票的收入（成交）总额	25,687,250.00

注：本项的“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）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。

### 8.2.6 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。

### 8.2.7 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。

## **8.2.8 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**

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## **8.2.9 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贵金属投资明细**

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

## **8.2.10 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。

## **8.2.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**

### **8.2.11.1 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。

### **8.2.11.2 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。

## **8.2.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

### **8.2.12.1 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。

### **8.2.12.2 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。

## **8.2.13 投资组合报告附注**

8.2.13.1 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。

8.2.13.2 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。

### **8.2.13.3 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	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

#### 8.2.13.4 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。

#### 8.2.13.5 期末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	002128	露天煤业	163,822.00	2.18	重大事项停牌

#### 8.2.13.6 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。

### §9 基金份额持有人信息

#### 9.1 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)

##### 9.2.1 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	华安基金管理有限公司基金 临时账户	1,346,549.61	9.25%
2	王景	634,509.18	4.36%
3	何岳骅	442,363.38	3.04%
4	王俊锋	418,383.19	2.87%
5	邱祖豪	384,400.27	2.64%
6	田煌炜	329,380.55	2.26%
7	陈妙婷	233,541.14	1.60%

8	杨利军	209,739.52	1.44%
9	徐瑞	202,384.50	1.39%
10	赵文菊	196,639.40	1.35%

### 9.2.2 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	173,149.32	1.19%

### 9.2.3 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	-
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

注：本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间为 0；

## 9.3 华安中证定向增发事件指数证券投资基金 (LOF)

(报告期：2018年1月1日-2018年11月7日)

### 9.3.1 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
3,317	3,340.41	0.00	0.00%	11,080,140.09	100.00%

### 9.3.2 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	邱祖豪	545,074.21	4.92%
2	冯予蜀	410,000.00	3.70%
3	陈妙婷	331,158.06	2.99%
4	卢月华	326,057.00	2.94%
5	杨利军	297,407.70	2.68%
6	赵文菊	278,831.92	2.52%
7	王宏奇	200,034.00	1.81%
8	卓存谦	198,307.80	1.79%
9	赵国星	198,118.80	1.79%
10	韩雨丽	169,081.58	1.53%

### 9.3.3 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	4,491.54	0.04%

#### 9.3.4 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

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	-
本基金基金经理持有本开放式基金	0

注：本公司高级管理人员、基金投资和研究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。

### §10 开放式基金份额变动

#### 10.1 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)

单位：份

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

#### 10.2 华安中证定向增发事件指数证券投资基金 (LOF)

(报告期：2018年1月1日-2018年11月7日)

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
本报告期期初基金份额总额	23,772,877.86
本报告期基金总申购份额	19,730,822.75
减：本报告期基金总赎回份额	32,423,560.52
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	11,080,140.09

## §11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本基金于从 2018 年 9 月 10 日起至 2018 年 10 月 8 日期间以通讯方式召开了基金份额持有人大会，会议期间审议并通过了《关于华安中证定向增发事件指数证券投资基金 (LOF) 转型并修改基金合同等相关事项的议案》，决议自 2018 年 10 月 9 日起生效，并已按规定向中国证券监督管理委员会备案。本次持有人大会详情请见本基金管理人于 2018 年 10 月 10 日发布的《关于华安定增事件基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》。

### 11.2 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。

### 11.3 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。

### 11.4 基金投资策略的改变

本基金管理人于 2018 年 10 月 10 日发布了《关于华安定增事件基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，自 2018 年 11 月 8 日起“华安中证定向增发事件指数证券投资基金 (LOF)”转型为“华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金”，基金的投资策略作出相应的改变。详情请见本基金管理人相关公告。

### 11.5 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。

报告年度应支付给聘任会计师事务所的报酬为人民币 50,000.00 元。

目前的审计机构已提供审计服务的连续年限：自基金合同生效日起至今。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

2018 年 4 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。2018 年 5 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。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

#### 11.7.1.1 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	
东北证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	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	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
联讯证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	3	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	3	-	-	-	-	-

中山证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	2	7,847,141.00	86.26%	7,151.23	86.26%	-
中泰证券	1	1,249,630.00	13.74%	1,138.81	13.74%	-

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 12 月完成租用托管在建设银行的光大证券深圳 007279 交易单元

#### 11.7.1.2 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		基金交易	
	成交金额	占当期债券成	成交金额	占当期回购成	成交金额	占当期权证成	成交金额	占当期基金成

		交总额 的比例		交总额 的比例		交总额 的比例		交总额 的比例
东北 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
万联 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	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰 君安	-	-	-	-	-	-	-	-
中信 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
上海 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华安 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
湘财 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
联讯 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西南 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河	-	-	-	-	-	-	-	-

证券									
兴业 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
广发 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
方正 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中银 国际	-	-	-	-	-	-	-	-	-
天风 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中信 建投	-	-	-	-	-	-	-	-	-
财达 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
招商 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中山 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-
光大 证券	-	-	-	-	-	-	570,492.0 0	100%	
中泰 证券	-	-	-	-	-	-	-	-	

## 11.7.2 华安中证定向增发事件指数证券投资基金 (LOF)

### 11.7.2.1 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	
国信证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
中山证券	1	-	-	-	-	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-

和讯证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
财富证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
广州证券	2	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	10,241,301.84	26.63%	9,332.93	26.47%	-
天风证券	2	6,079,441.37	15.81%	5,540.26	15.71%	-
国泰君安	1	4,928,372.00	12.81%	4,491.33	12.74%	-
光大证券	1	4,431,258.72	11.52%	4,038.14	11.45%	-
广发证券	1	2,471,613.00	6.43%	2,301.74	6.53%	-
方正证券	3	2,464,559.06	6.41%	2,245.81	6.37%	-
长江证券	2	2,208,957.01	5.74%	2,057.49	5.84%	-
中信证券	1	1,704,621.00	4.43%	1,587.71	4.50%	-
兴业证券	1	1,548,423.10	4.03%	1,442.12	4.09%	-
中信建投	1	1,538,023.03	4.00%	1,432.34	4.06%	-
中金公司	1	536,489.00	1.39%	499.62	1.42%	-
华泰证券	1	274,668.00	0.71%	255.72	0.73%	-
招商证券	3	33,429.00	0.09%	31.13	0.09%	-

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。

11.7.2.2 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
国信证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
中山证券	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
联讯证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
财富证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-

广州证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-

### 11.8 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“中弘股份”、“万华化学”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	2018-01-11
3	华安基金管理有限公司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
4	华安基金管理有限公司华安中证定向增发事件指数证券投资基金 (LOF) 2017 年第 4 季度报告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2018-01-22
5	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“群兴玩具”、“天夏智慧”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	2018-02-08
6	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
7	华安基金关于参加信达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	2018-03-13
8	华安基金管理有限公司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
9	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增	《上海证券报》、《证券	2018-03-14

	加上海基煜基金销售有限公司为销售机构的公告	时报》、《中国证券报》和公司网站	
10	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“雅克科技”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	2018-03-15
11	华安基金管理有限公司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
12	华安基金管理有限公司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
13	华安基金管理有限公司华安中证定向增发事件指数证券投资基金 (LOF) 基金合同 (更新)	公司网站	2018-03-24
14	华安基金管理有限公司华安中证定向增发事件指数证券投资基金 (LOF) 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
15	华安基金管理有限公司华安中证定向增发事件指数证券投资基金 (LOF) 托管协议 (更新)	公司网站	2018-03-24
16	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
17	华安基金管理有限公司华安中证定向增发事件指数证券投资基金 (LOF) 2017 年年度报告	公司网站	2018-03-27
18	华安基金管理有限公司华安中证定向增发事件指数证券投资基金 (LOF) 2017 年年度报告 (摘要)	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2018-03-27
19	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
20	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
21	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
22	华安中证定向增发事件指数证券投资基金 (LOF) 2018 年第 1 季度报告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2018-04-21
23	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
24	华安基金管理有限公司关于上海钜派钰茂基金销售有限公司延后代销部分基金的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》	2018-05-23

		和公司网站	
25	华安中证定向增发事件指数证券投资基金 (LOF) 更新的招募说明书摘要 (2018 年第 1 号)	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2018-05-26
26	华安中证定向增发事件指数证券投资基金 (LOF) 更新的招募说明书 (2018 年第 1 号)	公司网站	2018-05-26
27	关于华安信用四季红债券基金 C 类增加招商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	2018-06-02
28	华安基金管理有限公司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
29	华安基金管理有限公司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
30	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
31	华安基金管理有限公司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
32	华安基金管理有限公司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
33	关于旗下部分基金增加挖财为销售机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2018-07-18
34	华安中证定向增发事件指数证券投资基金 (LOF) 2018 年第 2 季度报告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2018-07-18
35	华安基金关于参加上海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	2018-07-25
36	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“鹏欣资源”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	2018-08-09
37	华安中证定向增发事件指数证券投资基金 (LOF) 暂停场内申购业务的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2018-08-11
38	华安基金关于参加东海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	2018-08-16
39	华安中证定向增发事件指数证券投资基金 (LOF) 2018 年半年度报告	公司网站	2018-08-24

40	华安中证定向增发事件指数证券投资基金 (LOF) 2018 年半年度报告 (摘要)	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2018-08-24
41	华安中证定向增发事件指数证券投资基金基金份额持有人大会的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2018-08-30
42	华安中证定向增发事件指数证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2018-08-31
43	华安中证定向增发事件指数证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2018-09-03
44	华安基金管理有限公司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	2018-09-14
45	华安基金管理有限公司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	2018-09-28
46	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	2018-09-29
47	华安定增事件持有人大会计票日开始停牌的提示性公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2018-10-09
48	关于华安定增事件基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2018-10-10
49	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“齐翔腾达”、“首航节能”、“美的集团”、“世纪华通”、“芒果超媒”股票估值	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2018-10-16
50	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“天翔环境”、“巨人网络”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	2018-10-19
51	华安中证定向增发事件指数证券投资基金 (LOF) 2018 年第 3 季度报告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2018-10-26
52	关于华安中证定向增发事件指数证券投资基金 (LOF) 终止上市的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2018-11-05
53	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	公司网站	2018-11-05
54	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	公司网站	2018-11-05
55	华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基	《上海证券报》、《证券	2018-11-05

	金联接基金招募说明书	时报》、《中国证券报》 和公司网站	
56	关于华安中证定向增发事件指数证券投资基金 (LOF) 终止上市的提示性公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2018-11-07
57	华安基金关于参加安信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	2018-11-10
58	关于华安创业板 50ETF 联接基金增加东莞农商银行作为销售机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2018-11-14
59	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“确权”登记指引	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2018-11-14
60	关于华安创业板 50ETF 联接基金增加工商银行作为销售机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2018-11-19
61	关于华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金开放申购、赎回及定投业务的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2018-11-19
62	关于华安创业板 50ETF 联接基金增加江海证券为销售机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2018-11-23
62	关于华安旗下部分基金增加开源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	2018-11-24
64	关于旗下部分基金增加植信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	2018-11-24
65	关于华安创业板 50ETF 联接基金增加兴业证券为销售机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2018-11-28
66	关于华安创业板 50ETF 联接基金增加民生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	2018-12-05
67	华安基金管理有限公司关于公司股东变更的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2018-12-07
68	华安基金管理有限公司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	2018-12-12
69	华安基金关于参加君德汇富优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2018-12-21

70	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加众升财富为销售机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2018-12-26
71	关于旗下部分基金参加中国工商银行股份有限公司基金定期定额投资优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2018-12-28
72	华安基金管理有限公司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	2018-12-28

注：前款所涉重大事项已作为临时报告在《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

## §12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 华安创业板50交易型开放式指数证券投资基金联接基金

#### 12.1.1 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

无。

### 12.2 华安中证定向增发事件指数证券投资基金 (LOF)

#### 12.2.1 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
个人	1	20180904-20180910	0.00	6,648,490.49	6,648,490.49	0.00	0.00%
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。							

### 12.3 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

二〇一九年三月三十日