

**华安信用增强债券型证券投资基金**  
**2018 年半年度报告摘要**  
**2018 年 6 月 30 日**

基金管理人：华安基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一八年八月二十四日

## 1 重要提示

### 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 8 月 22 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	华安信用增强债券
基金主代码	040045
交易代码	040045
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012 年 12 月 24 日
基金管理人	华安基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	5,850,031.33 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金以信用债券为主要投资对象，合理控制信用风险，在追求本金安全的基础上谨慎投资，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金充分发挥基金管理人的研究优势，将规范化的基本面研究、严谨的信用分析与积极主动的投资风格相结合，在分析和判断宏观经济运行状况和金融市场运行趋势的基础上，本着追求绝对收益的原则动态调整大类金融资产比例，自上而下决定债券组合久期及债券类属配置；同时，在严谨深入的信用分析基础上，综合考量信用债券的信用评级，以及各类债券的流动性、供求关系和收益率水平等，自下而上地精选个券。
业绩比较基准	中债企业债总指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金，属于证券投资基金中较低风险的品种，其预期的风险收益水平低于股票基金和混合基金，高于货币市场基金。

### 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	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	钱鲲	王永民
	联系电话	021-38969999	010-66594896
	电子邮箱	qiankun@huaan.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		4008850099	95566
传真		021-68863414	010-66594942

### 2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告摘要的管理人互联网网址	www.huaan.com.cn
基金半年度报告备置地点	上海市世纪大道 8 号上海国金中心二期 31、32 层

### 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	4,050.98
本期利润	-229,585.02
加权平均基金份额本期利润	-0.0276
本期基金份额净值增长率	-5.10%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018 年 6 月 30 日)
期末可供分配基金份额利润	-0.0295
期末基金资产净值	5,677,164.44
期末基金份额净值	0.9705

注：1.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如：封闭式基金交易佣金，开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.37%	0.49%	-0.21%	0.03%	0.58%	0.46%
过去三个月	-3.72%	0.47%	-0.47%	0.07%	-3.25%	0.40%
过去六个月	-5.10%	0.44%	-0.05%	0.05%	-5.05%	0.39%
过去一年	-1.48%	0.38%	-3.30%	0.05%	1.82%	0.33%
过去三年	-0.76%	0.40%	-15.81%	0.09%	15.05%	0.31%
自基金合同生效起至今	35.42%	0.38%	-13.41%	0.10%	48.83%	0.28%

##### 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

华安信用增强债券型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2012 年 12 月 24 日至 2018 年 6 月 30 日)



## 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

华安基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1998]20 号文批准于 1998 年 6 月设立，是国内首批基金管理公司之一，注册资本 1.5 亿元人民币，公司总部设在上海陆家嘴金融贸易区。目前的股东为国泰君安投资管理股份有限公司、上海国际信托有限公司、上海工业投资（集团）有限公司、上海锦江国际投资管理有限公司和国泰君安创新投资有限公司。公司在北京、上海、沈阳、成都、广州等地设有分公司，在香港和上海设有子公司—华安（香港）资产管理有限公司、华安未来资产管理有限公司。截至 2018 年 6 月 30 日，公司旗下共管理华安创新混合、华安 MSCI 中国 A、华安现金富利货币、华安稳定收益债券、华安黄金易 ETF、华安沪港深外延增长混合、华安全球美元收益债券等 103 只开放式基金，管理资产规模达到 2,460.80 亿元人民币。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		

<p>郑可成</p>	<p>本基金的基金经理，固定收益部助理总监</p>	<p>2012-12-29</p>	<p>-</p>	<p>16 年</p> <p>硕士研究生，16 年证券基金从业经历。2001 年 7 月至 2004 年 12 月在闽发证券有限责任公司担任研究员，从事债券研究及投资，2005 年 1 月至 2005 年 9 月在福建儒林投资顾问有限公司任研究员，2005 年 10 月至 2009 年 7 月在益民基金管理有限公司任基金经理，2009 年 8 月至今任职于华安基金管理有限公司固定收益部。2010 年 12 月起担任华安稳固收益债券型证券投资基金的基金经理。2012 年 9 月起同时担任华安安心收益债券型证券投资基金的基金经理。2012 年 11 月至 2017 年 7 月同时担任华安日日鑫货币市场基金的基金经理。2012 年 12 月起同时担任本基金的基金经理。2013 年 5 月起同时担任华安保本混合型证券投资基金的基金经理。2014 年 8 月至 2015 年 1 月，同时担任华安七日鑫短期理财债券型证券投资基金的基金经理，2014 年 8 月起，同时担任华安年年红定期开放债券型证券投资基金的基金经理。2015 年 3 月起担任华安新动力灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2015 年 5 月起同时担任华安新机遇灵活配置混合型证券投资基金、华安新优选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2015 年 6 月起同时担任华安添颐混合型发起式证券投资基金的基金经理。2015 年 11 月起，同时担任华安安益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2015 年 12 月至 2018 年 1 月，同时担任华安乐惠保本混合型证券投资基金的基金经理。2016 年 2 月至 2017 年 7 月，同时担任华安安康保本混合型证券投资基金的基金经理。2016 年 4 月至 2017 年 7 月，同时担任华安安禧保本混合型证券投资基金的基金经理。2016 年 10 月至 2018 年 1 月，同时担任华安安润</p>
------------	---------------------------	-------------------	----------	---

					灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 2 月起, 同时担任华安安享灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 3 月起, 同时担任华安现金宝货币市场基金的基金经理。
--	--	--	--	--	---

注: 此处的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日, 即以公告日为准。证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内, 本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、招募说明书等有关基金法律文件的规定, 本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产, 在控制风险的前提下, 为基金份额持有人谋求最大利益, 不存在违法违规或未履行基金合同承诺的情形。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

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

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

本报告期内，因组合流动性管理或投资策略调整需要，除指数基金以外的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的次数为 3 次，未出现异常交易。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2018 年上半年全球宏观经济出现一些分化。美国经济进一步走强，失业率下降，通胀缓步抬升；欧洲表现则相对偏弱。我国宏观经济体现出一定的韧性，但面临向下的风险。首先，社会融资渠道出现堵塞，非标融资受到金融监管的影响大幅下滑，委托贷款和信托贷款出现负增长；其次，债券违约向上市公司扩散，部分公司股权质押触及平仓线，地方政府平台融资受限，导致基建投资出现断崖式下滑；再有，中美贸易战为中国未来添加下行风险。面对风险，货币政策在一季度开始边际上的宽松，监管政策也较以前有所放松，导致债券收益率在今年上半年出现快速下行。权益市场受到信用收缩和贸易战影响，风险偏好显著降低，在指数整体下跌过程中，中小市值个股受损更为严重，消费类股票显现出明显防御性。

本基金在一季度受到规模剧烈缩减和个别停牌个股复牌的影响，净值出现较大波动。同时由于规模小太无法有效参与债券市场正常投资，净值增长受到影响。二季度保持了较高的权益仓位，净值波动较大。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2018 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 0.9705 元，本报告期份额净值增长率为-5.10%，同期业绩比较基准增长率为-0.05%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2018 年下半年。宏观经济短期韧性仍在，但金融去杠杆导致投资增速预期下行和中美贸易战导致出口预期下行这两个因素叠加下，后续经济存在下行压力，对应上市公司整体业绩增速 2 季度或继续上行，但 3 季度往后面临回落风险。中美贸易战加剧的背景下，国内政策转向为适度扩大内需，货币政策和监管政策已经转松，财政政策预计未来会有新的稳增长举措。在宽货币和稳信用的结合下，无风险利率或将进入区间震荡。目前解决小微企业融资难、融资贵的问题已经得到中央的重视，预计信用违约风险将得到缓和，信用利差有进一步压缩的空间。下半年权益面临的系统性风险将会大幅减轻，3 季度存在修复性反弹机会。虽然中美贸易战带来的经济下行压力和美联储持续加息带来的利率上行压力是两大灰犀牛，对权益市场会形成长期压制，但短期股市已过分担忧。我们认为决定短期股市方向的最核心因素仍是国内货币政策的取向，底线思维告诉我们大概率不会出现处置风险的风险，国内政策有足够的微调空间以确保市场平稳。

本基金将在下半年仍然以中低久期信用债为主要配置品种，在控制信用风险的前提下适当配置一些中高收益的券种以增强静态收益水平。对于长久期利率债，保持波段操作态度。权益方面将仓位总体控制在中性偏高水平，积极把握结构性行情，策略上重点关注前景确定、业绩优异、股价底部的成长性行业和个股。具体操作上通过自下而上精选确定性成长品种作为配置核心，结合自上而下的仓位调整和主题筛选，力争取得超额收益。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本基金管理人设有估值委员会，负责在证券发行机构发生了严重影响证券价格的重大事件时，

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

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内实施了 2017 年度第三次分红和 2018 年度第一次分红。

2017 年度第三次分红，分红方案为：0.240 元/10 份，权益登记日及除息日：2018 年 1 月 17 日；现金红利发放日：2018 年 1 月 18 日。

2018 年度第一次分红，分红方案为：0.080 元/10 份，权益登记日及除息日：2018 年 4 月 19 日；现金红利发放日：2018 年 4 月 20 日。

#### 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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对华安信用增强债券型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回

价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

### 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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：华安信用增强债券型证券投资基金

报告截止日：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>	-	-
银行存款	4,735,579.60	2,000,438.48
结算备付金	2,492.73	281,756.78
存出保证金	3,524.33	12,497.34
交易性金融资产	997,715.00	3,319,880.00
其中：股票投资	997,715.00	933,800.00
基金投资	-	-
债券投资	-	2,386,080.00
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	-	20,500,000.00
应收证券清算款	-	-
应收利息	855.15	84,707.36
应收股利	-	-
应收申购款	10,919.83	75,463.75
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
<b>资产总计</b>	<b>5,751,086.64</b>	<b>26,274,743.71</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 2018 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2017 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>	-	-
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-

衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	10,105.68	1,979.35
应付管理人报酬	1,386.97	6,505.21
应付托管费	462.36	2,168.41
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	7,418.87	14,654.32
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	54,548.32	270,000.00
<b>负债合计</b>	<b>73,922.20</b>	<b>295,307.29</b>
<b>所有者权益：</b>	<b>-</b>	<b>-</b>
实收基金	5,850,031.33	24,635,239.52
未分配利润	-172,866.89	1,344,196.90
<b>所有者权益合计</b>	<b>5,677,164.44</b>	<b>25,979,436.42</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>	<b>5,751,086.64</b>	<b>26,274,743.71</b>

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.9705 元，基金份额总额 5,850,031.33 份。

## 6.2 利润表

会计主体：华安信用增强债券型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>	<b>-126,507.18</b>	<b>1,295,786.09</b>
1.利息收入	61,780.60	1,077,155.91
其中：存款利息收入	20,805.29	21,353.54
债券利息收入	4,722.97	1,042,151.84
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	36,252.34	13,650.53
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	40,106.77	-508,220.96
其中：股票投资收益	27,127.81	-125,368.68
基金投资收益	-	-
债券投资收益	10,934.28	-406,108.28
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	2,044.68	23,256.00
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-233,636.00	669,927.87
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	5,241.45	56,923.27
<b>减：二、费用</b>	<b>103,077.84</b>	<b>617,647.90</b>
1. 管理人报酬	12,474.86	206,087.07
2. 托管费	4,158.37	68,695.68
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	12,078.99	101,227.07
5. 利息支出	-	85,299.65
其中：卖出回购金融资产支出	-	85,299.65
6.税金及附加	17.00	-
7. 其他费用	74,348.62	156,338.43
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>-229,585.02</b>	<b>678,138.19</b>
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>-229,585.02</b>	<b>678,138.19</b>

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安信用增强债券型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	24,635,239.52	1,344,196.90	25,979,436.42
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-229,585.02	-229,585.02
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）	-18,785,208.19	-649,478.95	-19,434,687.14
其中：1.基金申购款	670,911.49	2,851.16	673,762.65
2.基金赎回款	-19,456,119.68	-652,330.11	-20,108,449.79
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）	-	-637,999.82	-637,999.82
五、期末所有者权益（基金净值）	5,850,031.33	-172,866.89	5,677,164.44

项目	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	80,161,655.98	4,419,219.42	84,580,875.40
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	678,138.19	678,138.19
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）	-29,786,040.73	-1,778,056.68	-31,564,097.41
其中：1.基金申购款	20,113,337.97	531,013.12	20,644,351.09
2.基金赎回款	-49,899,378.70	-2,309,069.80	-52,208,448.50
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）	-	-1,437,224.61	-1,437,224.61
五、期末所有者权益（基金净值）	50,375,615.25	1,882,076.32	52,257,691.57

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：朱学华，主管会计工作负责人：赵敏，会计机构负责人：陈林

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

华安信用增强债券型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2012]1627 号文《关于核准华安信用增强债券型证券投资基金募集的批复》的核准，由华安基金管理有限公司作为管理人于 2012 年 12 月 11 日至 2012 年 12 月 20 日向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所验证并出具安永华明（2012）验字第 60971571\_B11 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 2012 年 12 月 24 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 910,904,328.77 元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币 87,654.93 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 910,991,983.70 元，折合 910,991,983.70 份基金份额。本基金的基金管理人和注册登记机构为华安基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国债、金融债、中央银行票据、地方政府债、城投债、中期票据、企业债、公司债、短期融资券、可转债、分离交易可转债、资产支持证

券、次级债、中小企业私募债、债券回购、银行存款等固定收益类品种，国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证等权益类品种以及法律法规或监管机构允许基金投资的其它金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。

本基金投资于固定收益类资产的比例不低于基金资产的 80%，其中对信用债券的投资比例不低于债券类资产的 80%；现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%；本基金投资于股票、权证等权益类资产的比例不高于基金资产净值的 20%。

本基金的业绩比较基准为：中债企业债总指数收益率。

本财务报表由本基金的基金管理人华安基金管理有限公司于 2018 年 8 月 23 日批准报出。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部 2006 年 2 月颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的应用指南、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>》及其他中国证监会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2018 年 6 月 30 日的财务状况以及 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本会计期间不存在会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本会计期间不存在会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本会计期间不存在差错更正。

#### 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[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定，对基金取得的股票的股息、红利收入，债券的利息收入、储蓄存款利息收入，由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税；

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；

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 关联方关系

### 6.4.7.1 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
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	基金托管人、基金代销机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.8.1.1 股票交易

无。

#### 6.4.8.1.2 权证交易

无。

#### 6.4.8.1.3 债券交易

无。

#### 6.4.8.1.4 应支付关联方的佣金

无。

### 6.4.8.2 关联方报酬

#### 6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月 30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月 30日

当期发生的基金应支付的管理费	12,474.86	206,087.07
其中：支付销售机构的客户维护费	7,053.52	11,718.10

注：支付基金管理人华安基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.3% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.3\% / \text{当年天数}$$

#### 6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018年1月1日至2018年6月30日	2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	4,158.37	68,695.68

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.1% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.1\% / \text{当年天数}$$

#### 6.4.8.3 各关联方投资本基金的情况

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

无。

##### 6.4.8.3.2 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

无。

#### 6.4.8.4 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2018年1月1日至2018年6月30日		2017年1月1日至2017年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司	4,735,579.60	20,036.02	5,397,679.10	19,184.82

#### 6.4.8.5 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

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

##### 6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

## 6.4.9.2 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

### 6.4.9.2.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2018 年 06 月 30 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。

### 6.4.9.2.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2018 年 6 月 30 日止，本基金无因从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

## 6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	997,715.00	17.35
	其中：股票	997,715.00	17.35
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	4,738,072.33	82.39
7	其他各项资产	15,299.31	0.27

8	合计	5,751,086.64	100.00
---	----	--------------	--------

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	374,575.00	6.60
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	623,140.00	10.98
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	997,715.00	17.57

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	300036	超图软件	15,000	305,850.00	5.39
2	000938	紫光股份	4,000	250,400.00	4.41

3	300017	网宿科技	20,000	214,200.00	3.77
4	002371	北方华创	2,500	124,175.00	2.19
5	002474	榕基软件	13,000	103,090.00	1.82

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于基金管理人网站的半年度报告正文。

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000877	天山股份	582,216.00	2.24
2	000672	上峰水泥	565,464.00	2.18
3	600340	华夏幸福	532,500.00	2.05
4	601111	中国国航	508,800.00	1.96
5	002236	大华股份	295,500.00	1.14
6	300036	超图软件	277,361.00	1.07
7	000938	紫光股份	274,363.00	1.06
8	300017	网宿科技	274,200.00	1.06
9	300458	全志科技	228,780.00	0.88
10	300316	晶盛机电	205,986.00	0.79
11	002396	星网锐捷	170,834.00	0.66
12	002371	北方华创	135,260.00	0.52
13	002474	榕基软件	129,480.00	0.50

注：本项“买入金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

##### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601600	中国铝业	770,700.00	2.97
2	600340	华夏幸福	643,078.00	2.48
3	000877	天山股份	606,082.81	2.33
4	000672	上峰水泥	572,750.00	2.20
5	601111	中国国航	446,000.00	1.72
6	002236	大华股份	244,646.00	0.94
7	300458	全志科技	244,069.00	0.94
8	300316	晶盛机电	223,564.00	0.86

9	002396	星网锐捷	145,511.00	0.56
---	--------	------	------------	------

注：本项“卖出金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	4,180,744.00
卖出股票的收入（成交）总额	3,896,400.81

注：本项“买入股票的成本（成交）总额”和“卖出股票的收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

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前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期没有投资贵金属。

#### 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

本基金本报告期没有投资股指期货。

##### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

#### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 7.11.1 本期国债期货投资政策

无。

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期没有投资国债期货。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

无。

## 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查的，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

7.12.2 本基金投资的前十名股票中，不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	3,524.33
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	855.15
5	应收申购款	10,919.83
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	15,299.31

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有处于流通受限情况的股票。

## 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例
428	13,668.30	0.00	0.00%	5,850,031.33	100.00%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	13.90	0.00%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

本公司高级管理人员、基金投资和研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。

## 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2012 年 12 月 24 日）基金份额总额	910,991,983.70
本报告期期初基金份额总额	24,635,239.52
本报告期基金总申购份额	670,911.49
减：本报告期基金总赎回份额	19,456,119.68
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	5,850,031.33

## 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本报告期内本基金管理人重大人事变动如下：

2018 年 2 月 13 日，基金管理人发布了《华安基金管理有限公司关于副总经理变更的公告》，翁启森先生、姚国平先生、谷媛媛女士新任本基金管理人的副总经理。

2、本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动如下：

无。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金财产、基金托管业务的诉讼。报告期内基金管理人无涉及本基金财产的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内无基金投资策略的改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘为基金审计的会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内无管理人、托管人及其高级管理人员受证券监管部门稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
安信证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	3,422,304.00	42.37%	3,118.77	42.04%	-
西南证券	1	2,130,378.00	26.38%	1,984.13	26.74%	-
长江证券	1	1,753,762.81	21.71%	1,598.21	21.54%	-
中泰证券	1	770,700.00	9.54%	717.76	9.67%	-

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，最大限度地调动物体资源，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
安信证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	2,410,934.28	100.00%	-	-	-	-
西南证券	-	-	40,000.00	100.00%	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-

**11 影响投资者决策的其他重要信息**

**11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况**

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比	期初份	申购份	赎回份额	持有份额	份额占比

		例达到或者超过 20%的时间区间	额	额			
机构	1	20180101-201801 22	11,404 ,942.9 6	0.00	11,404,9 42.96	0.00	0.00%
	2	20180101-201801 22	7,128, 327.00	0.00	7,128,32 7.00	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。							

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

华安基金管理有限公司

二〇一八年八月二十四日