基金管理人:华安基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一九年八月二十八日

华安睿明两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金

2019 半年度 报告摘要

2019年6月30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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年8月26日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2019年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	华安睿明两年定开混合	
基金主代码	005695	
交易代码	005695	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018年4月23日	
基金管理人	华安基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	476,576,002.90份	
下属分级基金的基金简称	华安睿明两年定开混合A	华安睿明两年定开混合C
下属分级基金的交易代码	005695	005696
报告期末下属分级基金的份额总额	443,261,301.83份	33,314,701.07份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制投资组合风险的前提下,力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金采取相对灵活的资产配置策略。 本基金采用多因素分析框架,从宏观经济环境、政策因素、市场利率水平、资金供求因素、市场投资价值等方面,采取定量与定性相结合的分析方法,对证券市场投资机会与风险进行综合研判,给出股票、债券和货币市场工具等资产投资机会的整体评估,作为资产配置的重要依据。基金管理人将根据股市、债市等的相对风险收益预期,调整股票、债券和货币市场工具等资产的配置比例。
业绩比较基准	40%×沪深300指数收益率+10%×恒生指数收益率(经汇率调整)+50%×(每个封闭期首日的中债企业债AA+两年到期收益率+1%)
风险收益特征	本基金为混合型基金,其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金,但低于股票型基金。本基金将投资港股通标的股票,港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陆澄	郭明
	联系电话	021-38969999	010-66105799
	电子邮箱	luying@huaan.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4008850099	95588
传真		021-68863414	010-66105798

2.4 信息披露方式

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

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019年1月1日至2019年6月30日)	
	华安睿明两年定开混合A	华安睿明两年定开混合C
本期已实现收益	16,441,878.65	1,070,544.29
本期利润	18,946,680.18	1,258,462.51
加权平均基金份额本期利润	0.0427	0.0378
本期基金份额净值增长率	4.71%	4.19%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)	
	华安睿明两年定开混合A	华安睿明两年定开混合C
期末可供分配基金份额利润	-0.0535	-0.0647
期末基金资产净值	421,888,704.64	31,334,391.42
期末基金份额净值	0.9518	0.9406

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: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

华安睿明两年定开混合A

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
自基金合同生效起至今	-4.82%	0.47%	4.35%	0.68%	-9.17%	-0.21%
过去一个月	1.51%	0.17%	3.01%	0.54%	-1.50%	-0.37%
过去三个月	-0.34%	0.45%	0.30%	0.68%	-0.64%	-0.23%
过去六个月	4.71%	0.42%	13.32%	0.69%	-8.61%	-0.27%
过去一年	0.50%	0.48%	6.69%	0.70%	-6.19%	-0.22%

华安睿明两年定开混合C

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
自基金合同生效起至今	-5.94%	0.47%	4.35%	0.68%	-10.29%	-0.21%
过去一个月	1.43%	0.17%	3.01%	0.54%	-1.58%	-0.37%
过去三个月	-0.58%	0.45%	0.30%	0.68%	-0.88%	-0.23%
过去六个月	4.19%	0.42%	13.32%	0.69%	-9.13%	-0.27%
过去一年	-0.51%	0.48%	6.69%	0.70%	-7.20%	-0.22%

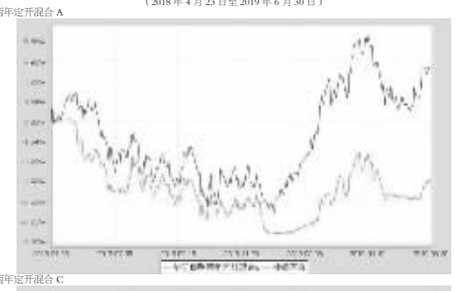
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华安睿明两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金

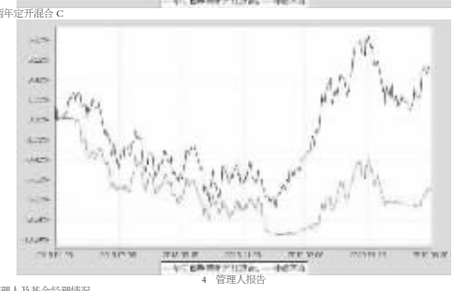
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2018年4月23日至2019年6月30日)

华安睿明两年定开混合A



华安睿明两年定开混合C



4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

华安基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1998]20号文批准于1998年6月设立,是国内首批基金管理公司之一,注册资本1.5亿元人民币,公司总部设在上海陆家嘴金融贸易区。目前的股东为国泰君安证券股份有限公司、上海上国投资产管理有限公司、上海锦江国际投资管理有限公司、上海工业投资(集团)有限公司和国泰君安投资管理股份有限公司。公司在北京、上海、西安、成都、广州等地设有分公司,在香港和上海设有子公司——华安(香港)资产管理有限公司,华安未来资产管理有限公司。截至2019年6月30日,公司旗下共管理华安创新混合、华安MSCI中国A、华安稳定收益债券、华安黄金易ETF、华安沪港深外延增长混合、华安全球美元收益债券等123只开放式基金,管理资产规模达到317.00亿元人民币。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
杨明	本基金的基金经理、投资研究部高级总监	2018-04-23	-	19年	中央财经大学硕士研究生,19年银行、基金从业经历。曾在上海银行从事信贷员、交易及风险管理。2004年10月加入华安基金管理有限公司,任研究发展部研究员。现任投资研究部总监。2013年6月起担任华安策略优选混合型证券投资基金的基金经理。2014年6月起担任投资研究部高级总监。2015年6月至2016年9月同时担任华安国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016年3月至2018年3月同时担任华安沪港深外延增长灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016年5月至2018年10月,同时担任华安安福灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018年10月起,同时担任华安安福灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018年11月起,同时担任华安红利精选混合型证券投资基金的基金经理。2018年4月起,同时担任本基金的基金经理。2018年12月起,同时担任华安创新证券投资基金的基金经理。

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 管理人对投资期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对投资期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,公司制定了《华安基金管理有限公司公平交易管理制度》,将各投资组合在研究分析、投资决策、交易执行等方面全部纳入公平交易管理中。控制措施包括:在研究环节,研究员在为公司管理的各类投资组合提供研究信息、投资建议过程中,使用融会发言、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权限,投资组合经理在授权范围内自主决策,超过授权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,则按未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twind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,以确保不签订单与投资组合授权意向一一对应。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授监督参与下,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投资决策、交易执行等情况进行监控、分析及风险评估,并定期向公司管理层提交报告。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以价交易的交易价格公允性进行审查,对不同投资组合临近交易日的同向交易的交易时机和交易价差进行分析。

本报告期内,公司公平交易制度总体执行情况良好。

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

本报告期内,除指数基金以外的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的次数为0次,未出现异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

中国经济一季度出现企稳迹象,但整体仍继续面临减速压力,主要是调结构带来的转型摩擦,中美谈判转变再出变数对经济和市场构成严重冲击。

本基金在报告期内小幅上涨,主要是因为风险因素导致仓位过低。

从所投资公司近期的经营情况看,他大多数表现不错,体现了这些公司优秀的经营管理能力,总体情况令人满意。

4.4.2 报告期内基金业绩表现

截至2019年6月30日,本基金A类份额净值为0.9518元,本报告期份额净值增长率为4.71%;本基金C类份额净值为0.9406元,本报告期份额净值增长率为4.19%。同期业绩比较基准增长率为13.32%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

经济仍有下行压力,但内因超出是正面的;实体领域供给侧改革,抑制了产能的低水平扩张;金融领域供给侧改革,抑制了信用的高风险扩张,两者都对经济扩张速度构成制约。但实体供给侧改革和金融供给侧改革,有利于优质企业收割行业空间,增速下降的背后是生产和金融效率的提升、环境的改善、优质企业良好的效益。同时,由于经济中过剩、无效、盲目部分的降低,以及消费、服务的占比扩大,导致增速下降的同时波幅大大降低,这也有助于提升经济效率、降低系统性风险。总体上,我仍然认为周期性下行压力2015年已经结束了,2016年以来经济波动内因是速度与质量之间的主动交换,具有长期正面的含义。

贸易战无疑加大了短期下行压力,但这也谈不到一些较性因素;没有经历有效的加产能,负向的加速数很小;进行了有效的去库存,负向的乘数效应很小;老百姓的就业、收入、储蓄率、资产负债率总体仍然稳定,之前一两年P2P大面积暴雷对居民财富和消费的冲击正在淡去;银行资本和按备充分,货币政策也还有很大的操作空间,银行推持正常风险偏好的基础仍然较好;金融供给侧改革做减法的同时开始启动做加法;大规模减税的效果才刚刚开始,未来仍有进一步降低的空间(与财权和国企改革结合)。即便美国对剩余中国进口品全部加税,猜测直接冲击也会在两年内被消化掉(97年下半年亚洲金融危机冲击开始,到2000年经济已经开始走出来了),真正的长期压力在科技上。

回顾历史,改革从来是中国发展的最大、最关键、最持久的驱动力。当前,中国正在进行深刻的经济和社会转型,大国正在进行一场转型竞赛。对中国而言,转型的核心是从速度优先到质量优先,从规模引领到创新驱动。中美摩擦对中国最大的促进是推动中国加大对科技和教育投入,加快科技教育体制改革,推动"知识生产体系"的现代化。从潜力看,尽管中国经济体量已经很大,面临的资源、环境、老龄化约束越来越大,但人均收入仍然不高,城市化、信息化、全球化带来的需求仍然巨大,从而依靠体制改革、技术进步、提升人力资本来实现持续增长的空间仍然巨大。

尽管面临种种转型的困难和冲击,我们看到政府仍在坚定推动改革开放向深水区前进,在系统性重构中国的经济和社会管理体制,努力为中国的长期繁荣奠定基础。虽然当前压力加大,但只要能够抗住继续往前走,前途十分光明。行百里者半九十,到了关键时刻。

美国的问题来自其内部。打击中国、与全球第一大供应链和第二大市场市场相隔离,并不能解决这些问题,反而会打击到美国的资本和消费,导致问题更加严峻。保持美国"相对优势"和指动美国"再次伟大"之间存在着内在矛盾,鱼与熊掌不可兼得。美国的技术优势、金融优势、军事优势,无法改变这个基本经济逻辑。如果在对抗中美都出现衰落,世界将会更加动荡,美国的利益会受到更多的损失。因此,中长期之内,美国必然在两个目标之间反复摇摆,中美关系也将随之起伏。

另一方面,以市场化、法治化、国际化为方向的改革,使中国与西方经济体系并没有根本上的冲突,反而美国的压力有助于推动中国加快这一方向的改变。不谋求势力范围控制力、不输出意识形态,使中国崛起不具有文明对抗性和和益排他性,美国的压力将使得中国更加愿意对共他国家开放市场、分享发展机会。

时间站在中国一边,只要发展思路正确、执行坚决,中国的进一步发展壮大是可以预期的。中国实力的提升,又会反过来对打压中国的势力构成遏制,推动世界走向合作共赢。尽管这是一个长期复杂多变的过程,但我们对于前途并不悲观。

当前,A股股价已经从前期高点有所回落,结合盈利的积累,估值已经回调到一个比较低的水平,其所包含的预期已经比较谨慎。虽然内外压力作用下难以出现今年上半年那样系统性的机会,但大幅下跌的概率不高,更可能维持震荡分化的局面。

我们将继续来持价值投资理念,在新的形势下,更加严格地检视企业的成长逻辑,谨慎买涨到走势,保持合理的安全边际,坚定投资于被低估的具有战略远见、未雨绸缪、执行有力,形成了面向未来的压倒性竞争优势的企业,努力为投资者谋取良好的长期回报。

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、研究部总监、固定收益部总监、指数与量化投资部总监、基金运营部高级总监、风险管理部总监等人员组成,具有多年的证券、基金从业经验,熟悉相关法律法规,具备行业研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论,但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内,参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期不进行收益分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内,本基金托管人在对华安睿明两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何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

本报告期内,华安睿明两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金的管理人——华安基金管理有限公司在华安睿明两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在合理要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内,华安睿明两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对华安基金管理有限公司编制和披露的华安睿明两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金2019年半年度报告中财务指标、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进行了核查,以上内容真实、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:华安睿明两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日:2019年6月30日

单位:人民币元

资产	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
资产:	-	-
银行存款	60,941,839.78	98,415,326.98
结算备付金	621,247.64	23,479,701.74
存出保证金	314,683.87	3,289,480.15
交易性金融资产	393,944,269.14	193,324,879.06
其中:股票投资	106,509,169.14	8,100,879.06
基金投资	-	-
债券投资	287,435,100.00	185,224,000.00
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	-	99,940,349.91
应收证券清算款	-	12,505,257.26
应收利息	4,340,134.27	4,188,741.90
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	460,162,174.70	435,143,737.00
负债和所有者权益	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
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	4,552,161.24	6.73
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	552,260.40	561,374.50
应付托管费	92,043.39	93,562.41
应付销售服务费	25,464.36	26,004.72
应付交易费用	1,621,119.99	1,144,835.27
应交税费	1,509.30	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	94,519.96	300,000.00
负债合计	6,939,078.64	2,125,783.63
所有者权益:	-	-
实收基金	476,576,002.90	476,576,002.90
未分配利润	-23,352,906.84	-43,558,049.53
所有者权益合计	453,223,096.06	433,017,953.37
负债和所有者权益总计	460,162,174.70	435,143,737.00

注:报告截止日2019年6月30日,基金份额净值0.9510元,基金份额总额476,576,002.90份,其中A类基金份额净值0.9518元,份额总额443,261,301.83份;C类基金份额净值0.9406元,份额总额33,314,701.07份。

6.2 利润表

会计主体:华安睿明两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2019年1月1日至2019年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年4月23日(基金合同生效日)至2018年6月30日
一、收入	26,974,743.44	-22,317,843.91
1.利息收入	4,723,015.81	2,055,624.66
其中:存款利息收入	448,467.62	309,599.40
债券利息收入	4,195,647.81	347,786.15
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	78,900.38	1,398,239.11
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	19,559,007.88	-21,110,692.80
其中:股票投资收益	19,312,311.20	-22,939,431.80
基金投资收益	-	-
债券投资收益	100,870.00	-
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	145,826.68	1,828,739.00
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	2,692,719.75	-3,262,775.77
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	-	-
减:二、费用	6,769,600.75	2,944,637.50
1. 管理人报酬	3,317,677.72	1,309,514.75
2. 托管费	552,946.36	218,252.48
3. 销售服务费	153,268.28	60,975.51
4. 交易费用	2,628,669.42	1,272,651.63
5. 利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6.税金及附加	693.01	-
7. 其他费用	116,345.96	83,243.13
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	20,205,142.69	-25,262,481.41
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	20,205,142.69	-25,262,481.41

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:华安睿明两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2019年1月1日至2019年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	476,576,002.90	-43,558,049.53	433,017,953.37
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	20,205,142.69	20,205,142.69
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)	-	-	-
其中:1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	476,576,002.90	-23,352,906.84	453,223,096.06

项目	上年度可比期间 2018年4月23日(基金合同生效日)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)	476,576,002.90	-	476,576,002.90
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-25,262,481.41	-25,262,481.41
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)	-	-	-
其中:1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	476,576,002.90	-25,262,481.41	451,313,521.49

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

华安睿明两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金(以下简称"本基金"),系经中国证监监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监许可[2018]246号《关于准予华安睿明两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》的核准,由基金管理人华安基金管理有限公司自2018年4月9日至2018年4月17日止期间向社会公开募集,募集期结束经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)验证并出具安永华明(2018)验字第60971571_B03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2018年4月23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476,473,303.20元,在募集期间产生的存款利息为人民币102,699.70元,以上实收基金(本息)合计为人民币476,576,002.90元,折合476,576,002.90份基金份额,其中A类基金份额443,261,301.83份,C类基金份额33,314,701.07份。本基金的基金管理人及注册登记机构为华安基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行的股票(含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票),内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许投资的规定范围内的香港联合交易所上市的股票(以下简称"港股通标的股票")、债券(包括国债、金融债、企业债、公司债、可交换债、可转换债券、分离交易可转债、可交换债、央行票据、中期票据、短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、权证、股指期货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的相关规定)。本基金将根据法律法规的规定参与融资融券业务中的融资业务。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。

基金的投资组合比例为:封闭期内,股票资产占基金资产的比例为0%—100%;在开放期,股票资产占基金资产的比例为0%—95%。港股通标的股票投资比例不超过全部股票资产的50%。在开放期内,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,本基金持有的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%。封闭期内本基金不受前述5%的限制,但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,应当保持不低于交易保证金一倍的现金。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,基金管理人在履行适当程序后,本基金的投资范围相应调整。

本基金的业绩比较基准为:40%×沪深300指数收益率+10%×恒生指数收益率(经汇率调整)+50%×(每个封闭期首日的中债企业债AA+两年到期收益率+1%)。

6.4.2 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信息业务的指导意见》、《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(年度报告与半年度报告)》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金于2019年6月30日的财务状况以及自2019年1月1日起至2019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

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

6.4.6.1 印花税

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

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

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

(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买入返售金融商品业务及持有政府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。

(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和地方教育费附加。本基金的具体缴纳标准如下:

城市维护建设税 - 按实际缴纳的流转税的7%计缴。

教育费附加 - 按实际缴纳的流转税的3%计缴。

地方教育附加 - 按实际缴纳的流转税的2%计缴。

(4) 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号《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《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]1号《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。

(5) 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号《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《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《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