

**华安国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金**  
**2015 年年度报告**  
**2015 年 12 月 31 日**

基金管理人：华安基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一六年三月二十八日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本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 2016 年 3 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。

本报告期自 2015 年 6 月 29 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b>	2
1.1 重要提示	2
<b>§2 基金简介</b>	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	10
<b>§4 管理人报告</b>	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	17
4.9 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	17
<b>§5 托管人报告</b>	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	17
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	17
<b>§6 审计报告</b>	17
6.1 管理层对财务报表的责任	18
6.2 注册会计师的责任	18
6.3 审计意见	18
<b>§7 年度财务报表</b>	19
7.1 资产负债表	19
7.2 利润表	20
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	22
7.4 报表附注	23
<b>§8 投资组合报告</b>	46
8.1 期末基金资产组合情况	46
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	47
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	48
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	49
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	58
8.6 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	58

8.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	58
8.8	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 .....	58
8.9	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 .....	58
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	58
8.12	投资组合报告附注 .....	59
<b>§9</b>	<b>基金份额持有人信息</b> .....	<b>60</b>
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	60
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	60
9.3	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 .....	60
<b>§10</b>	<b>开放式基金份额变动</b> .....	<b>61</b>
<b>§11</b>	<b>重大事件揭示</b> .....	<b>61</b>
11.1	基金份额持有人大会决议 .....	61
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 .....	61
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	62
11.4	基金投资策略的改变 .....	62
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	62
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 .....	62
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	62
11.8	其他重大事件 .....	66
<b>§12</b>	<b>影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>71</b>
<b>§13</b>	<b>备查文件目录</b> .....	<b>71</b>
13.1	备查文件目录 .....	71
13.2	存放地点 .....	72
13.3	查阅方式 .....	72

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华安国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	华安国企改革主题灵活配置混合
基金主代码	001445
交易代码	001445
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 6 月 29 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	636,809,744.72 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金重点关注国企改革带来的市场投资机会，在严格控制风险的前提下，通过高安全边际的证券精选，力争为投资者带来资产的稳健增值。
投资策略	本基金采取相对灵活的资产配置策略。在大类资产配置过程中，本基金将使用定量与定性相结合的研究方法对宏观经济、国家政策、资金面和市场情绪等可能影响证券市场的重要因素进行研究和预测，结合使用公司自主研发的多因子动态资产配置模型、基于投资时钟理论的资产配置模型等经济模型，分析和比较股票、债券等市场和不同金融工具的风险收益特征，确定合适的资产配置比例，动态优化投资组合。股票投资中通过对国企改革相关上市公司的深入分析，挖掘该类型企业的投资价值。
业绩比较基准	50%×中证 800 指数收益率+50%×中国债券总指数收益率。
风险收益特征	本基金为混合型基金，基金的风险与预期收益高于债券型基金和货币市场基金、低于股票型基金，属于证券投资基金中的中高风险投资品种。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
----	-------	-------

名称		华安基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	钱鲲	田青
	联系电话	021-38969999	010-67595096
	电子邮箱	qiankun@huaan.com.cn	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		4008850099	010-67595096
传真		021-68863414	010-66275853
注册地址		上海市世纪大道8号上海国金中心二期31层、32层	北京市西城区金融大街25号
办公地址		上海市世纪大道8号上海国金中心二期31层、32层	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码		200120	100033
法定代表人		朱学华	王洪章

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金年度报告正文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

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市世纪大道100号环球金融中心50楼
注册登记机构	华安基金管理有限公司	上海市世纪大道8号上海国金中心二期31、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

金额单位：人民币元

<b>3.1.1 期间数据和指标</b>	<b>2015 年 6 月 29 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日</b>
本期已实现收益	196,846,170.13
本期利润	237,732,785.85
加权平均基金份额本期利润	0.1838
本期加权平均净值利润率	18.50%
本期基金份额净值增长率	23.60%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	<b>2015 年末</b>
期末可供分配利润	136,625,670.80
期末可供分配基金份额利润	0.2145
期末基金资产净值	787,299,838.07
期末基金份额净值	1.236
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>2015 年末</b>
基金份额累计净值增长率	23.60%

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、本基金于 2015 年 6 月 29 日成立。截止本报告期末，本基金成立不足一年。

5、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 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	42.56%	1.81%	10.56%	0.86%	32.00%	0.95%

过去六个月	23.60%	2.57%	-6.12%	1.37%	29.72%	1.20%
自基金成立起至今	23.60%	2.55%	-5.45%	1.40%	29.05%	1.15%

注：本基金业绩比较基准： $50\% \times$ 中证 800 指数收益率 $+50\% \times$ 中国债券总指数收益率。

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）、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、中小企业私募债、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、资产支持证券等）、债券回购、银行存款、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。

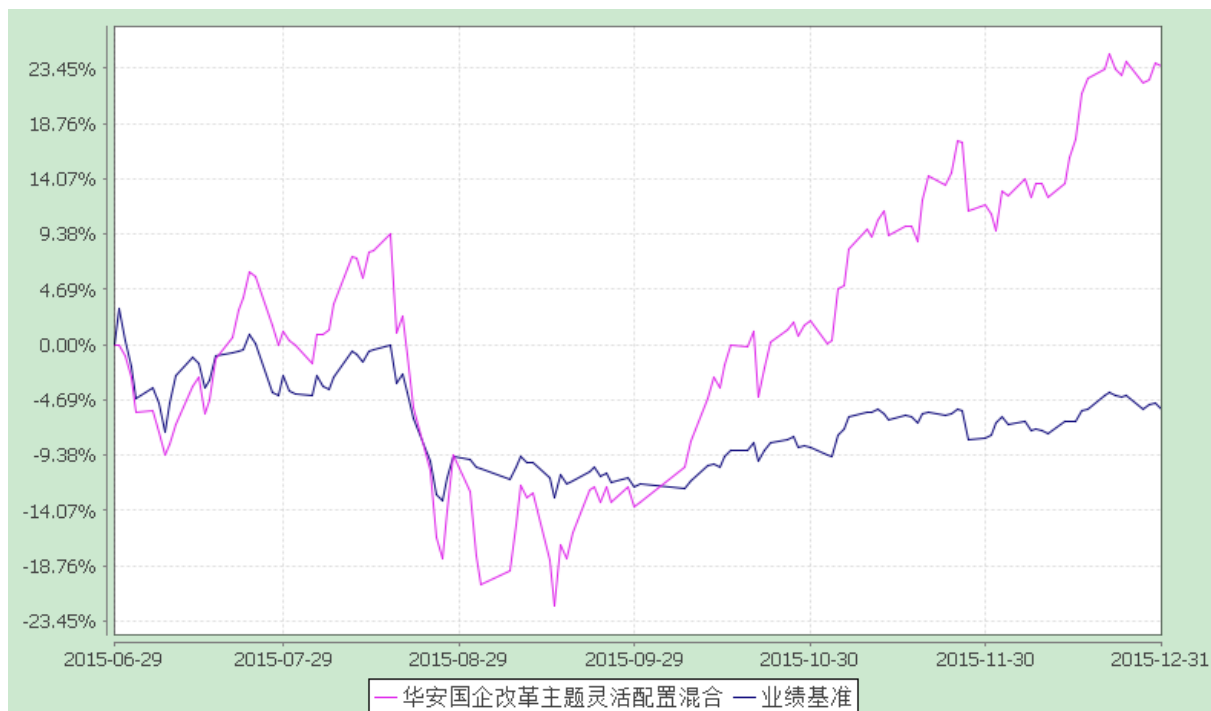
基金的投资组合比例为：股票占基金资产的比例为 0-95%；投资于国企改革主题相关的证券的比例不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

### 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

华安国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金

自基金合同生效以来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  
(2015 年 6 月 29 日至 2015 年 12 月 31 日)



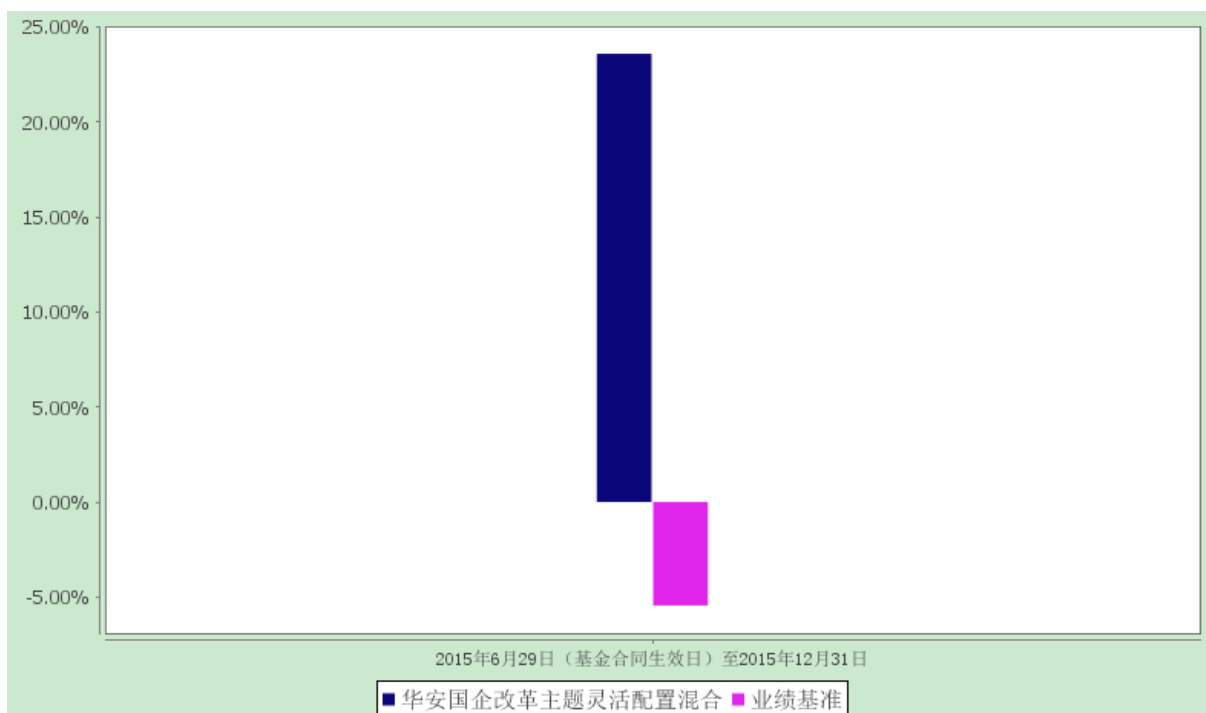


注：本基金于 2015 年 6 月 29 日成立，2015 年 12 月 28 日建仓期截止。建仓期结束日，本基金的各项资产配置比例已符合合同约定。

### 3.2.3 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

华安国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金

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

本基金过去三年没有利润分配。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

华安基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1998]20 号文批准于 1998 年 6 月设立，是国内首批基金管理公司之一，注册资本 1.5 亿元人民币，公司总部设在上海陆家嘴金融贸易区。目前的股东为上海电气（集团）总公司、上海国际信托有限公司、上海工业投资（集团）有限公司、上海锦江国际投资管理有限公司和国泰君安投资管理股份有限公司。

截至 2015 年 12 月 31 日，公司旗下共管理华安创新混合、华安中国 A 股增强指数、华安现金富利货币、华安宝利配置混合、华安宏利混合、华安中小盘成长混合、华安策略优选混合、华安核心优选混合、华安稳定收益债券、华安动态灵活混合、华安强化收益债券、华安行业轮动混合、华安上证 180ETF、华安上证 180ETF 联接、华安上证龙头企业 ETF、华安上证龙头企业 ETF 联接、华安升级主题混合、华安稳固收益债券、华安可转债、华安深证 300 指数（LOF）、华安科技动力混合、华安四季红债券、华安香港精选股票、华安大中华升级股票、华安标普石油指数基金（QDII-LOF）、华安月月鑫短期理财债券、华安季季鑫短期理财债券、华安月安鑫短期理财债券、华安沪深 300 指数分级、华安逆向策略、华安日日鑫货币、华安安心收益债券、华安信用增强债券、华安纯债、华安保本混合、华安双债添利债券、华安安信消费混合、华安纳斯达克 100 指数、华安黄金易 ETF、华安黄金 ETF 联接、华安沪深 300 量化增强、华安年年红债券、华安生态优先混合、华安中证细分地产 ETF、华安中证细分医药 ETF、华安大国新经济股票、华安新活力混合、华安安顺灵活配置混合、华安财汇通货币、华安国际龙头（DAX）ETF、华安国际龙头（DAX）ETF 联接、华安高分红指数增强、华安中证细分医药 ETF 联接、华安安享灵活配置混合、华安年年盈定期开放债券、华安物联网主题股票、华安新丝路主题股票、华安新动力灵活配置混合、华安智能装备主题股票、华安媒体互联网混合、华安新机遇保本混合、华安新优选灵活配置混合、华安新回报灵活配置混合、华安中证全指证券指数分级、华安中证银行指数分级、华安国企改革主题混合、华安添颐养老混合发起式、华安创业板 50 指数分级、华安新乐享保本混合、华安安益保本混合、华安乐惠保本混合等 71 只开放式基金。管理资产规模达到 1558.45 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	2015-06-29	-	15 年	中央财经大学硕士研究生，15 年银行、基金从业经历。曾在上海银行从事信贷员、交易员及风险管理。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 月起同时担任本基金的基金经理。
苏圻涵	本基金的基金经理、全球投资部助理总监	2015-06-29	-	11 年	博士研究生，11 年证券、基金从业经历,持有基金从业执业证书。2004 年 6 月加入华安基金管理有限公司，曾先后于研究发展部、战略策划部工作，担任行业研究员和产品经理职务。目前任职于全球投资部，担任基金经理职务。2010 年 9 月起担任华安香港精选投票型证券投资基金的基金经理。2011 年 5 月起同时担任华安大中华升级股票型证券投资基金的基金经理。2015 年 6 月起同时担任本基金的基金经理。
王嘉	本基金的基金经理	2015-07-17	-	13 年	硕士，13 年金融、证券行业从业经验。曾任上海市思也企业咨询有限公司研究员、上海市新理益投资管理有限公司研究员、莫尼塔投资咨询有限公司研究员、元大京华证券上海代表处研究员、兴业证券研究发展中心研究员。2010 年 5 月加入华安基金，现任基金投资部基金经理。2015 年 7 月起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。

注：1.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。

2.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有关法律法规及《华安国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同》、《华安国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》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，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 1 次，未出现异常交易。原因是各投资组合分别按照其交易策略交易时，虽相关投资组合买卖数量极少，但由于个股流动性较差，交易量稀少，致使成交较少的单边交易量仍然超过该证券当日成交量的 5%。从同向交易统计检验和实际检查的结果来看，未发现异常。

### 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

华安国企改革基金成立于 2015 年 6 月 29 日，在大幅动荡的市场环境下，本基金在建仓期采取了中性的建仓策略。7 月 31 日开放申购赎回之后，仓位逐步提升，因此在 8 月份的调整中回撤幅度较大。4 季度本基金把握住了市场反弹机会，在结构上也以成长为主，因此显著跑赢同期大盘和比较基准。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2015 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 1.236 元，本报告期份额净值增长率为 23.60%，同期业绩比较基准增长率为-5.45%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

对经济判断：2016 年中国经济预计依然将处于缓慢的探底过程之中。2016 年包括中国在内的全球经济形势都较为复杂，全年经济体的景气周期也不尽同步，导致货币周期、经济政策的协同性较差，进一步加剧了判断中国经济趋势的难度。本基金将重点关注三个较为主要的不确定的因素，分别是：美联储加息进程、国内供给侧改革以及地产去库存的推进。以上三个因素很大程度上决定人民币汇率以及国内经济的走势，进而对 A 股市场产生较大的影响。

股市展望：目前全部 A 股剔除银行后，无论 PE、PB，均还处于历史均值附近，但创业板估值处于相对的高位。

从 PE、PB 的相对变化可以看出，创业板盈利增速的优势开始体现。同时值得注意的是，最近 4 个季度除 2015 年 3 季度外，中证 500 均大幅跑赢沪深 300 指数。整体看来，2016 年大指数具备估值支撑，向下的空间有限，大小股票涨幅中位数可能相对接近。

操作思路：本基金计划保持相对中性的仓位，相对看好消费升级受益领域，以及云计算、高端制造和新材料。除此之外，同时受益于信贷刺激和政策刺激的周期品，相关行业存在逆袭的可能。对于国有企业改革，2016 年将是具体改革措施的推进之年，本基金对国企改革板块将保持高度关注，自下而上选择有望实质性推进改革并实现业绩增长的个股。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，公司合规监察稽核部从维护基金份额持有人利益、保障基金的合规运作出发，重点在法律事务、合规管理、内部稽核、信息披露、反洗钱、员工行为规范等方面开展工作，深化员工的合规意识，推动公司的合规文化和内部风险控制机制的完善与优化。

监察稽核工作重点集中于以下几个方面：

(1) 继续深化“主动合规”的管理理念，强化全体员工的合规意识和风险控制意识，通过定期组织员工进行职业道德规范、反洗钱、防范利益冲突、客户信息保密、销售适用性等方面的合规培训和内部审计，推动公司建立良好的内控环境和合规文化。

(2) 强化内控建设，持续进行投资管理人员合规培训，坚守“三条底线”；

(3) 做好在新基金产品开发、新投资品种、及其他创新业务中法律、合规及风险控制方面的支持，坚持定期对投资、研究、交易、核算、销售等相关业务活动的日常合规性检查。

(4) 推动落实公司投资、运营业务操作流程标准化，细化各相关部门在各业务环节的操作流程及工作职责，降低操作风险发生的概率。

(5) 按照法规的要求，做好旗下各只基金的信息披露工作，做到信息披露的真实、完整、准确、及时。

(6) 有计划地对公司投资研究、基金销售、后台运营等相关业务部门进行了多次全面或专项稽核，强化对公司制度执行和风控措施的落实。

本基金管理人承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范和控制各种风险，保障基金份额持有人的合法权益。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

##### 1、估值政策及重大变化

无。

##### 2、估值政策重大变化对基金资产净值及当期损益的影响

无。

##### 3、有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历的描述

###### (1) 公司方面

公司建立基金估值委员会，组成人员包括：总经理助理（分管投资研究）、基金投资部总监、研究发展部总监、固定收益部总监、指数投资部总监、基金运营部总经理及相关负责人员。

主要职责包括：证券发行机构发生了严重影响证券价格的重大事件时，负责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；同时将采用确定的方法以及采用该方法对相关证券估值后与基金的托管银行进行沟通。

相关人员专业胜任能力及工作经历：

翁启森，基金投资部兼全球投资部总监，工业工程学硕士。曾在台湾 JP 证券任金融产业分析师及投资经理，台湾摩根富林明投信投资管理部任基金经理，台湾中信证券投资总监助理，台湾保德信投信任基金经理。2008 年 4 月加入华安基金管理有限公司，现华安香港精选、华安大中华升级基金、华安宏利股票型基金、华安大国新经济股票型基金的基金经理，华安基金管理有限公司总经理助理、基金投资部兼全球投资部总监。

赵敏：研究生学历。曾在上海社会科学院人口与发展研究所工作，历任华安基金管理有限公司综合管理部总经理、电子商务部总经理、上海营销总部总经理，现任华安基金管理有限公司总经理助理。

杨明，投资研究部总监，研究生学历，12 年金融、证券、基金从业经验，曾在上海银行工作。2004 年 10 月进入华安基金管理有限公司，担任研究发展部宏观研究员，现任华安优选的基金经理，投资研究部总监。

贺涛，金融学硕士，固定收益部副总监。曾任长城证券有限责任公司债券研究员，华安基金管理有限公司债券研究员、债券投资风险管理员、固定收益投资经理。现任华安稳定收益债券基金、华安可转债基金、华安信用增强债券基金、华安双债添利债券基金、华安月月鑫短期理财、华安季季鑫短期理财、华安月安鑫短期理财、华安汇财货币、华安年年红的基金经理，固定收益部副总监。

许之彦，指数投资部总监，理学博士，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，现任华安上证 180ETF 及华安上证 180ETF 联接、华安深证 300 指数证券投资基金 (LOF)、华安易富黄金 ETF 及联接基金的基金经理,指数投资部总监。

陈林，基金运营部总经理，工商管理硕士，高级会计师，CPA 中国注册会计师协会非执业会员。曾在安永大华会计师事务所工作，2004 年 11 月加入华安基金管理有限公司，曾任财务核算部副总监、公司财务部总经理，现任基金运营部总经理。

## (2) 托管银行

托管银行根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任，并且认真核查公司采用的估值政策和程序。

## (3) 会计师事务所

对相关估值模型、假设及参数的适当性出具审核意见和报告。

## 4、基金经理参与或决定估值的程度

本基金的基金经理杨明作为估值委员会成员参与了基金的估值方法的讨论与确认。

## 5、参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突



参与估值流程各方之间无任何重大利益冲突。

6、已签约的任何定价服务的性质与程度等信息  
无。

#### **4.8 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。

#### **4.9 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**

无。

### **§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**

安永华明（2016）审字第 60971571\_B31 号

华安国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人：

我们审计了后附的华安国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金财务报表，包括 2015 年 12 月 31 日的资产负债表和 2015 年 6 月 29 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日止期间的利润表及所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。

### 6.1 管理层对财务报表的责任

编制和公允列报财务报表是基金管理人华安基金管理有限公司的责任。这种责任包括：（1）按照企业会计准则的规定编制财务报表，并使其实现公允反映；（2）设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。

### 6.2 注册会计师的责任

我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价基金管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。

我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

### 6.3 审计意见

我们认为，上述财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了华安国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年 6 月 29 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净值变动情况。

安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)

中国注册会计师

郭杭翔 蒋燕华

上海市世纪大道 100 号环球金融中心 50 楼

2016 年 3 月 23 日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：华安国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015 年 12 月 31 日
资产：		-
银行存款	7.4.7.1	102,215,070.44
结算备付金		11,629,253.02
存出保证金		2,329,389.67
交易性金融资产	7.4.7.2	667,523,965.35
其中：股票投资		667,523,965.35
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	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收证券清算款		20,789,072.96
应收利息	7.4.7.5	28,593.40
应收股利		-
应收申购款		2,414,751.53
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
<b>资产总计</b>		<b>806,930,096.37</b>
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015 年 12 月 31 日
负债：		-

短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		2,158,630.67
应付赎回款		8,202,301.17
应付管理人报酬	7.4.10.2	1,040,798.62
应付托管费	7.4.10.2	173,466.43
应付销售服务费		-
应付交易费用	7.4.7.7	7,767,388.72
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	287,672.69
<b>负债合计</b>		<b>19,630,258.30</b>
<b>所有者权益：</b>		<b>-</b>
实收基金	7.4.7.9	636,809,744.72
未分配利润	7.4.7.10	150,490,093.35
<b>所有者权益合计</b>		<b>787,299,838.07</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>		<b>806,930,096.37</b>

注：(1) 报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.236 元，基金份额总额 636,809,744.72 份。

(2) 本基金合同于 2015 年 6 月 29 日生效。

## 7.2 利润表

会计主体：华安国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 6 月 29 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期
----	-----	----

		2015 年 6 月 29 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		<b>277,311,841.17</b>
1.利息收入		1,940,285.78
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,525,411.65
债券利息收入		414,874.13
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）		229,235,289.80
其中：股票投资收益	7.4.7.12	228,279,315.18
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	-125,351.27
资产支持证券投资收益	7.4.7.14	-
贵金属投资收益	7.4.7.15	-
衍生工具收益	7.4.7.16	-
股利收益	7.4.7.17	1,081,325.89
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	40,886,615.72
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.19	5,249,649.87
<b>减：二、费用</b>		<b>39,579,055.32</b>
1. 管理人报酬	7.4.10.2	9,690,239.22
2. 托管费	7.4.10.2	1,615,039.89
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	7.4.7.20	28,001,132.24
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用	7.4.7.21	272,643.97

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		237,732,785.85
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		237,732,785.85

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 6 月 29 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 6 月 29 日（基金合同生效日）至 2015 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）	1,799,465,454.32	-	1,799,465,454.32
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	237,732,785.85	237,732,785.85
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）	-1,162,655,709.60	-87,242,692.50	-1,249,898,402.10
其中：1.基金申购款	311,454,166.48	15,788,642.67	327,242,809.15
2.基金赎回款	-1,474,109,876.08	-103,031,335.17	-1,577,141,211.25
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）	636,809,744.72	150,490,093.35	787,299,838.07

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码（序号）从 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：章国富，会计机构负责人：陈林

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

华安国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”),系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]1057 号《关于准予华安国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》的核准,由华安基金管理有限公司作为管理人自 2015 年 6 月 11 日至 2015 年 6 月 25 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(2015)验字第 60971571\_B25 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 2015 年 6 月 29 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 1,798,704,229.38 元,在募集期间产生的存款利息为人民币 761,224.94 元,以上实收基金(本息)合计为人民币 1,799,465,454.32 元,折合 1,799,465,454.32 份基金份额。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,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括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)、债券(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、中小企业私募债、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、资产支持证券等)、债券回购、银行存款、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。

基金的投资组合比例为:股票占基金资产的比例为 0-95%;投资于国企改革主题相关的证券的比例不低于非现金基金资产的 80%;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%;权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

本基金业绩比较基准: 50%×中证 800 指数收益率+50%×中国债券总指数收益率。

### 7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体

会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 7.4.3 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 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年 6 月 29 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净值变动情况。

#### 7.4.4 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。

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间系 2015 年 6 月 29 日（基金合同生效日）起至 2015 年 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 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。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

###### (1) 金融资产分类

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



本基金目前持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票投资、债券投资和衍生工具；

## (2) 金融负债分类

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

### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

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

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

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

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

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

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

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

#### (1) 股票投资

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

入账；

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

(2) 债券投资

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

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

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

(3) 权证投资

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

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

(4) 股指期货投资

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

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

(5) 分离交易可转债

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

(6) 回购协议

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

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要

意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。本基金主要金融工具的估值方法如下：

(1) 存在活跃市场的金融工具

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

(2) 不存在活跃市场的金融工具

当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。本基金采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术，优先使用相关可观察输入值，只有在可观察输入值无法取得或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值。

**7.4.4.6 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。

**7.4.4.7 实收基金**

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

**7.4.4.8 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)”。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

(1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 1.50% 的年费率逐日计提；

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率逐日计提；

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

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

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 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) 每一基金份额享有同等分配权；

(3) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

#### 7.4.5.3 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。

### 7.4.6 税项

#### 7.4.6.1 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、国家税务总局财税字[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。

#### 7.4.6.2 营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[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，继续免征营业税和企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[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。

#### 7.4.6.3 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[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、国家税务总局财税字[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、国家税务总局财税字[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。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

**7.4.7.1 银行存款**

单位：人民币元

项目	本期末	
	2015 年 12 月 31 日	
活期存款	102,215,070.44	
定期存款	-	
其他存款	-	
合计	102,215,070.44	

**7.4.7.2 交易性金融资产**

单位：人民币元

项目	本期末		
	2015 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	626,637,349.63	667,523,965.35	40,886,615.72
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	626,637,349.63	667,523,965.35	40,886,615.72

**7.4.7.3 衍生金融资产/负债**

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

**7.4.7.4 买入返售金融资产**

**7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

**7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

**7.4.7.5 应收利息**

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	22,312.10
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	5,233.10
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	1,048.20
合计	28,593.40

**7.4.7.6 其他资产**

本基金本报告期末无其他资产余额。

**7.4.7.7 应付交易费用**

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	7,767,388.72
银行间市场应付交易费用	-
合计	7,767,388.72

**7.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元



项目	本期末
	2015 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	27,672.69
其他应付款	-
预提费用	260,000.00
合计	287,672.69

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2015 年 6 月 29 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	1,799,465,454.32	1,799,465,454.32
本期申购	311,454,166.48	311,454,166.48
本期赎回（以“-”号填列）	-1,474,109,876.08	-1,474,109,876.08
本期末	636,809,744.72	636,809,744.72

注：（1）申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

（2）本基金合同于 2015 年 6 月 29 日生效。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 1,798,704,229.38 元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币 761,224.94 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 1,799,465,454.32 元，折合 1,799,465,454.32 份基金份额。

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期利润	196,846,170.13	40,886,615.72	237,732,785.85
本期基金份额交易产生的变动数	-60,220,499.33	-27,022,193.17	-87,242,692.50
其中：基金申购款	20,216,392.42	-4,427,749.75	15,788,642.67
基金赎回款	-80,436,891.75	-22,594,443.42	-103,031,335.17
本期已分配利润	-	-	-

本期末	136,625,670.80	13,864,422.55	150,490,093.35
-----	----------------	---------------	----------------

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2015 年 6 月 29 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	1,397,808.68
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	116,979.67
其他	10,623.30
合计	1,525,411.65

#### 7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2015 年 6 月 29 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	9,145,395,713.31
减：卖出股票成本总额	8,917,116,398.13
买卖股票差价收入	228,279,315.18

#### 7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2015年6月29日（基金合同生效日）至2015年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	80,321,808.58
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	79,514,800.00
减：应收利息总额	932,359.85
买卖债券差价收入	-125,351.27

#### 7.4.7.14 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

**7.4.7.15 贵金属投资收益**

**7.4.7.15.1 贵金属投资收益项目构成**

本基金本报告期无贵金属投资收益。

**7.4.7.15.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

本基金本报告期无贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入。

**7.4.7.15.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

本基金本报告期无贵金属投资收益——赎回差价收入。

**7.4.7.15.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

本基金本报告期无贵金属投资收益——申购差价收入。

**7.4.7.16 衍生工具收益**

**7.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

**7.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益**

本基金本报告期无衍生工具收益——其他投资收益。

**7.4.7.17 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期
	2015年6月29日（基金合同生效日）至2015年12月31日
股票投资产生的股利收益	1,081,325.89
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,081,325.89

**7.4.7.18 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期
	2015年6月29日（基金合同生效日）至2015年12月31日
1.交易性金融资产	40,886,615.72
——股票投资	40,886,615.72

——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
合计	40,886,615.72

#### 7.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2015年6月29日（基金合同生效日）至2015年12月31日
基金赎回费收入	5,243,452.24
其他	6,197.63
合计	5,249,649.87

#### 7.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2015年6月29日（基金合同生效日）至2015年12月31日
交易所市场交易费用	28,001,132.24
银行间市场交易费用	-
合计	28,001,132.24

#### 7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2015年6月29日（基金合同生效日）至2015年12月31日
审计费用	80,000.00

信息披露费	180,000.00
银行汇划费用	9,643.97
帐户维护费	3,000.00
合计	272,643.97

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 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	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
上海国际信托有限公司	基金管理人的股东
上海电气(集团)总公司	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

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。

###### 7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

###### 7.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。

**7.4.10.1.4 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。

**7.4.10.1.5 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。

**7.4.10.2 关联方报酬**

**7.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期
	2015年6月29日（基金合同生效日）至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	9,690,239.22
其中：支付销售机构的客户维护费	5,690,301.74

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.50% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。

**7.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期
	2015年6月29日（基金合同生效日）至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,615,039.89

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月初 5 个工作日内从基金财产中一次性支取，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

无。

#### 7.4.10.3 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。

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

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

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。

##### 7.4.10.4.2 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。

#### 7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年6月29日（基金合同生效日）至2015年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	102,215,070.44	1,397,808.68

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末在承销期内直接购入关联方承销的证券。

#### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末进行利润分配。

### 7.4.12 期末（2015 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

#### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

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。

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单盘价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002612	朗姿股份	2015-12-22	筹划重大事项	75.46	-	-	504,409.00	28,887,063.60	38,062,703.14	
002707	众信旅游	2015-11-16	筹划重大事项	52.62	2016-03-15	47.36	331,400.00	18,349,755.52	17,438,268.00	
600729	重庆百货	2015-07-24	筹划重大事项	29.26	2016-01-04	29.90	999,970.00	30,265,818.25	29,259,122.20	
300336	新文化	2015-12-24	筹划重大事项	42.00	-	-	415,100.00	16,548,746.28	17,434,200.00	
002502	骅威股份	2015-08-20	筹划重大事项	31.99	2016-01-14	23.35	300,000.00	7,308,154.93	9,597,000.00	

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2015 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证券款余额。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2015 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证券款余额。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金，基金的风险与预期收益高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金，属于证券投资基金中的中高风险投资品种。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相



关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金重点关注国企改革带来的市场投资机会，在严格控制风险的前提下，通过高安全边际的证券精选，力争为投资者带来资产的稳健增值。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部等相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立合规与风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理和投资风险、绩效评估等。监察稽核部对公司执行总裁负责，并由督察长分管。风险管理部向督察长和总裁汇报工作。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具，通过特定的风险量化指标、模型，形成常规的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### **7.4.13.2 信用风险**

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行工商银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

#### **7.4.13.3 流动性风险**

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持证券均在证券交易所上市，因此除附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。

#### **7.4.13.4 市场风险**

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### **7.4.13.4.1 利率风险**

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金等，其余金融资产和金融负债均不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2015 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	102,215,070.44	-	-	-	102,215,070.44
结算备付金	11,629,253.02	-	-	-	11,629,253.02
存出保证金	2,329,389.67	-	-	-	2,329,389.67
交易性金融资产	-	-	-	667,523,965.35	667,523,965.35
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	20,789,072.96	20,789,072.96
应收利息	-	-	-	28,593.40	28,593.40
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	2,414,751.53	2,414,751.53
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	116,173,713.13	-	-	690,756,383.24	806,930,096.37
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	-	-	-	2,158,630.67	2,158,630.67
应付赎回款	-	-	-	8,202,301.17	8,202,301.17
应付管理人报酬	-	-	-	1,040,798.62	1,040,798.62
应付托管费	-	-	-	173,466.43	173,466.43
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	7,767,388.72	7,767,388.72
应付税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	287,672.69	287,672.69
负债总计	-	-	-	19,630,258.30	19,630,258.30
利率敏感度缺口	116,173,713.13	-	-	671,126,124.94	787,299,838.07

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金于 2015 年 12 月 31 日未持有债券资产，且持有的银行存款均为活期存款，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金采取相对稳定的资产配置策略，一般情况下将保持股票配置比例的相对稳定，避免因过于主动的仓位调整带来额外的风险。在大类资产配置过程中，本基金将使用定量与定性相结合的研究方法对宏观经济、国家政策、资金面和市场情绪等可能影响证券市场的重要因素进行研究和预测，结合使用公司自主研发的多因子动态资产配置模型、基于投资时钟理论的资产配置模型等经济模型，分析和比较股票、债券等市场和不同金融工具的风险收益特征，确定合适的资产配置比例，动态优化投资组合。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金股票投资占基金资产的比例范围为 0%-95%，其中投资于国企改革主题相关的证券比例不低于非现金基金资产的 80%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日

	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	667,523,965.35	84.79
交易性金融资产—基金投资	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-
合计	667,523,965.35	84.79

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注 7.4.1)以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位: 人民币万元)
		本期末 2015 年 12 月 31 日
	业绩比较基准增加 5%	增加约 5,984
	业绩比较基准减少 5%	减少约 5,984

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 7.4.14.1 公允价值

##### 7.4.14.1.1 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。

##### 7.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

##### 7.4.14.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于 2015 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 555,732,672.01 元，属于第二层次的余额为人民币 111,791,293.34 元，无属于第三层次余额。

##### 7.4.14.1.2.2 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、可转换债券、资产支持证券和私募债券，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、可转换债券、资产支持证券和私募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、可转换债券、资产支持证券和私募债券公允价值应属第二层次或第三层次。

#### 7.4.14.1.2.3 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。

#### 7.4.14.2 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。

#### 7.4.14.3 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。

#### 7.4.14.4 财务报表的批准

本财务报表已于 2016 年 3 月 23 日经本基金的基金管理人批准。

## §8 投资组合报告

### 8.1 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	667,523,965.35	82.72
	其中：股票	667,523,965.35	82.72
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	113,844,323.46	14.11
7	其他各项资产	25,561,807.56	3.17
8	合计	806,930,096.37	100.00

## 8.2 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	14,990,000.00	1.90
B	采矿业	-	-
C	制造业	420,889,828.76	53.46
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	29,259,122.20	3.72
G	交通运输、仓储和邮政业	30,771,420.00	3.91
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	25,301,259.39	3.21
J	金融业	7,415,100.00	0.94
K	房地产业	76,573,959.00	9.73
L	租赁和商务服务业	17,438,268.00	2.21
M	科学研究和技术服务业	26,135,680.00	3.32
N	水利、环境和公共设施管理业	1,315,128.00	0.17
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	17,434,200.00	2.21
S	综合	-	-
	合计	667,523,965.35	84.79

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	300285	国瓷材料	1,680,000	76,440,000.00	9.71
2	002366	台海核电	724,700	47,793,965.00	6.07
3	002329	皇氏集团	1,661,606	46,358,807.40	5.89
4	600556	慧球科技	1,600,700	43,330,949.00	5.50
5	002612	朗姿股份	504,409	38,062,703.14	4.83
6	600225	天津松江	3,671,700	30,805,563.00	3.91
7	601333	广深铁路	6,142,000	30,771,420.00	3.91
8	002152	广电运通	949,777	29,433,589.23	3.74
9	600729	重庆百货	999,970	29,259,122.20	3.72
10	300384	三联虹普	310,400	26,135,680.00	3.32
11	600037	歌华有线	1,175,163	25,301,259.39	3.21
12	600734	实达集团	990,300	24,084,096.00	3.06
13	002260	德奥通航	500,000	22,600,000.00	2.87
14	002707	众信旅游	331,400	17,438,268.00	2.21
15	300336	新文化	415,100	17,434,200.00	2.21
16	600351	亚宝药业	991,500	15,487,230.00	1.97
17	600257	大湖股份	1,000,000	14,990,000.00	1.90
18	600093	禾嘉股份	913,873	14,960,101.01	1.90
19	002045	国光电器	789,300	14,917,770.00	1.89
20	002072	凯瑞德	600,000	14,532,000.00	1.85
21	000036	华联控股	1,400,000	12,558,000.00	1.60
22	002594	比亚迪	179,400	11,553,360.00	1.47
23	002502	骅威股份	300,000	9,597,000.00	1.22
24	000567	海德股份	314,700	9,126,300.00	1.16
25	600775	南京熊猫	416,700	7,979,805.00	1.01
26	000953	河池化工	489,000	7,897,350.00	1.00
27	002655	共达电声	303,800	7,491,708.00	0.95
28	600328	兰太实业	496,800	7,432,128.00	0.94
29	600369	西南证券	749,000	7,415,100.00	0.94
30	002215	诺普信	152,911	2,932,832.98	0.37
31	002656	卡奴迪路	73,000	2,088,530.00	0.27
32	000888	峨眉山 A	88,800	1,315,128.00	0.17



## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	600048	保利地产	218,153,859.69	27.71
2	002215	诺普信	179,177,795.38	22.76
3	601333	广深铁路	175,677,023.64	22.31
4	002152	广电运通	174,053,673.24	22.11
5	300285	国瓷材料	173,619,266.25	22.05
6	000858	五粮液	148,449,934.33	18.86
7	002366	台海核电	144,403,441.66	18.34
8	300016	北陆药业	130,156,766.40	16.53
9	600483	福能股份	127,697,459.67	16.22
10	002318	久立特材	127,133,303.39	16.15
11	600270	外运发展	124,214,849.65	15.78
12	002045	国光电器	109,896,142.75	13.96
13	000002	万科A	109,456,792.32	13.90
14	600958	东方证券	106,998,269.17	13.59
15	601628	中国人寿	94,209,752.22	11.97
16	601211	国泰君安	91,660,194.79	11.64
17	000524	岭南控股	88,271,136.71	11.21
18	600030	中信证券	88,159,202.76	11.20
19	300070	碧水源	76,612,877.64	9.73
20	601872	招商轮船	76,498,992.13	9.72
21	000728	国元证券	75,042,601.45	9.53
22	000828	东莞控股	73,928,222.87	9.39
23	000800	一汽轿车	73,634,747.21	9.35
24	601599	鹿港科技	73,498,858.23	9.34
25	002299	圣农发展	73,178,310.53	9.29
26	600259	广晟有色	73,053,799.45	9.28
27	601888	中国国旅	72,742,697.69	9.24
28	601818	光大银行	71,436,286.35	9.07
29	600207	安彩高科	69,221,318.30	8.79
30	601985	中国核电	67,402,189.50	8.56
31	002443	金洲管道	63,064,138.43	8.01
32	000568	泸州老窖	61,302,101.19	7.79
33	000920	南方汇通	58,565,326.30	7.44
34	600556	慧球科技	57,993,814.13	7.37
35	601555	东吴证券	56,976,215.28	7.24

36	002344	海宁皮城	52,976,612.60	6.73
37	600196	复星医药	52,940,000.00	6.72
38	300346	南大光电	52,495,725.60	6.67
39	300156	神雾环保	51,123,722.71	6.49
40	300160	秀强股份	51,090,309.02	6.49
41	002572	索菲亚	50,934,533.35	6.47
42	601328	交通银行	50,321,122.33	6.39
43	000625	长安汽车	49,838,476.30	6.33
44	300166	东方国信	49,734,523.59	6.32
45	000998	隆平高科	49,723,576.16	6.32
46	002612	朗姿股份	49,528,615.83	6.29
47	600292	中电远达	49,180,458.43	6.25
48	601788	光大证券	48,946,345.00	6.22
49	601669	中国电建	47,128,022.82	5.99
50	600037	歌华有线	46,653,100.37	5.93
51	600328	兰太实业	46,532,218.13	5.91
52	000961	中南建设	46,372,902.55	5.89
53	002085	万丰奥威	45,868,105.63	5.83
54	002329	皇氏集团	45,681,357.95	5.80
55	600637	东方明珠	43,030,752.63	5.47
56	600729	重庆百货	42,642,753.85	5.42
57	601088	中国神华	42,616,959.13	5.41
58	002172	澳洋科技	42,573,628.82	5.41
59	600382	广东明珠	41,830,787.62	5.31
60	002594	比亚迪	41,760,721.57	5.30
61	600728	佳都科技	41,167,065.74	5.23
62	002376	新北洋	39,693,485.31	5.04
63	601021	春秋航空	39,508,929.32	5.02
64	600521	华海药业	39,468,150.16	5.01
65	600257	大湖股份	38,815,870.10	4.93
66	002196	方正电机	38,510,201.36	4.89
67	000987	广州友谊	38,373,084.04	4.87
68	002273	水晶光电	38,297,659.28	4.86
69	000952	广济药业	38,092,449.81	4.84
70	300145	南方泵业	37,691,509.00	4.79
71	000528	柳工	36,936,210.18	4.69
72	601766	中国中车	36,515,587.00	4.64
73	600566	济川药业	36,451,321.00	4.63
74	600518	康美药业	36,179,318.58	4.60
75	002305	南国置业	36,151,808.32	4.59
76	000401	冀东水泥	35,707,313.26	4.54
77	300356	光一科技	35,627,157.18	4.53
78	002086	东方海洋	35,529,473.48	4.51
79	002051	中工国际	35,039,847.10	4.45

80	601600	中国铝业	34,980,000.00	4.44
81	600818	中路股份	34,513,785.90	4.38
82	002094	青岛金王	34,402,020.47	4.37
83	300018	中元华电	33,830,974.00	4.30
84	600895	张江高科	33,817,669.61	4.30
85	600338	西藏珠峰	33,463,378.63	4.25
86	002101	广东鸿图	33,364,114.26	4.24
87	002230	科大讯飞	32,984,903.37	4.19
88	300355	蒙草抗旱	32,855,778.51	4.17
89	002712	思美传媒	31,629,567.65	4.02
90	002177	御银股份	31,585,401.14	4.01
91	600734	实达集团	31,359,759.87	3.98
92	002027	七喜控股	31,193,382.29	3.96
93	002260	德奥通航	30,615,253.25	3.89
94	600563	法拉电子	30,557,154.60	3.88
95	601166	兴业银行	30,477,906.07	3.87
96	600889	南京化纤	30,385,067.95	3.86
97	002241	歌尔声学	30,340,923.34	3.85
98	000027	深圳能源	30,196,049.48	3.84
99	300369	绿盟科技	30,102,111.43	3.82
100	600225	天津松江	30,004,133.23	3.81
101	600122	宏图高科	29,607,609.00	3.76
102	002251	步步高	29,467,797.34	3.74
103	000567	海德股份	28,878,231.34	3.67
104	000633	合金投资	28,789,540.50	3.66
105	300162	雷曼股份	28,753,041.80	3.65
106	002470	金正大	28,661,947.26	3.64
107	002340	格林美	27,348,047.16	3.47
108	300203	聚光科技	27,224,254.88	3.46
109	603199	九华旅游	27,184,396.00	3.45
110	002249	大洋电机	26,610,379.26	3.38
111	600561	江西长运	26,502,339.11	3.37
112	600195	中牧股份	26,379,330.00	3.35
113	300367	东方网力	26,080,174.50	3.31
114	600716	凤凰股份	25,441,109.27	3.23
115	600999	招商证券	25,400,322.40	3.23
116	002450	康得新	25,360,152.94	3.22
117	002348	高乐股份	25,334,817.36	3.22
118	600648	外高桥	25,050,721.45	3.18
119	600701	工大高新	24,717,150.00	3.14
120	002369	卓翼科技	24,654,674.82	3.13
121	002072	凯瑞德	24,431,566.78	3.10
122	002502	骅威股份	24,360,516.44	3.09
123	000988	华工科技	24,330,797.68	3.09

124	601688	华泰证券	24,307,110.68	3.09
125	300012	华测检测	24,044,909.47	3.05
126	603885	吉祥航空	23,765,487.47	3.02
127	002488	金固股份	23,540,745.45	2.99
128	600310	桂东电力	23,496,549.61	2.98
129	600351	亚宝药业	23,458,920.76	2.98
130	300135	宝利国际	23,169,319.00	2.94
131	002657	中科金财	23,141,949.00	2.94
132	002037	久联发展	22,926,345.34	2.91
133	601199	江南水务	22,792,241.90	2.89
134	600745	中茵股份	22,606,203.00	2.87
135	601000	唐山港	22,549,282.00	2.86
136	600703	三安光电	22,496,773.01	2.86
137	002596	海南瑞泽	22,430,574.60	2.85
138	600570	恒生电子	22,176,849.78	2.82
139	600052	浙江广厦	22,116,020.51	2.81
140	002008	大族激光	21,951,992.20	2.79
141	000915	山大华特	21,850,489.63	2.78
142	600201	生物股份	21,844,766.00	2.77
143	600058	五矿发展	21,713,719.76	2.76
144	002367	康力电梯	21,616,057.13	2.75
145	600285	羚锐制药	21,527,057.50	2.73
146	300384	三联虹普	21,525,017.00	2.73
147	000666	经纬纺机	21,475,115.61	2.73
148	600269	赣粤高速	21,435,857.00	2.72
149	000802	北京文化	21,407,429.98	2.72
150	600093	禾嘉股份	21,345,215.67	2.71
151	600884	杉杉股份	21,253,917.00	2.70
152	601886	江河创建	21,194,420.04	2.69
153	600279	重庆港九	21,066,815.64	2.68
154	002123	荣信股份	20,861,406.13	2.65
155	601991	大唐发电	20,397,688.10	2.59
156	002142	宁波银行	19,866,194.24	2.52
157	600548	深高速	19,675,698.27	2.50
158	601038	一拖股份	19,438,864.27	2.47
159	603308	应流股份	19,345,112.00	2.46
160	300137	先河环保	19,144,008.98	2.43
161	000822	山东海化	19,063,531.41	2.42
162	002739	万达院线	18,819,456.00	2.39
163	600223	鲁商置业	18,655,379.73	2.37
164	000887	中鼎股份	18,396,351.00	2.34
165	002707	众信旅游	18,349,755.52	2.33
166	002308	威创股份	18,279,601.05	2.32
167	002349	精华制药	17,813,058.43	2.26

168	002357	富临运业	17,805,861.30	2.26
169	002312	三泰控股	17,682,507.15	2.25
170	000559	万向钱潮	17,600,154.70	2.24
171	000902	新洋丰	17,566,670.34	2.23
172	600711	盛屯矿业	17,487,074.00	2.22
173	600593	大连圣亚	17,364,222.57	2.21
174	002586	围海股份	17,309,599.77	2.20
175	300019	硅宝科技	17,280,000.00	2.19
176	002446	盛路通信	17,139,583.00	2.18
177	300237	美晨科技	17,069,477.26	2.17
178	002664	信质电机	16,889,283.62	2.15
179	000652	泰达股份	16,800,374.95	2.13
180	600184	光电股份	16,710,261.78	2.12
181	000671	阳光城	16,619,010.06	2.11
182	300336	新文化	16,548,746.28	2.10
183	300468	四方精创	16,547,790.00	2.10
184	002050	三花股份	16,365,989.91	2.08
185	300083	劲胜精密	16,299,627.63	2.07
186	002229	鸿博股份	16,286,910.00	2.07
187	002583	海能达	16,252,068.70	2.06
188	300031	宝通科技	16,198,569.56	2.06
189	600198	大唐电信	16,130,558.84	2.05
190	002381	双箭股份	16,099,001.00	2.04
191	600718	东软集团	15,952,940.00	2.03
192	300302	同有科技	15,905,703.80	2.02
193	601186	中国铁建	15,892,119.52	2.02
194	002170	芭田股份	15,789,855.53	2.01

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。

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	600048	保利地产	231,585,848.21	29.42
2	002215	诺普信	185,132,055.30	23.51
3	601333	广深铁路	149,757,809.46	19.02
4	002152	广电运通	143,633,701.70	18.24
5	600483	福能股份	140,867,559.16	17.89
6	300285	国瓷材料	132,207,804.10	16.79
7	000858	五粮液	130,844,250.46	16.62

8	300016	北陆药业	127,080,974.93	16.14
9	600270	外运发展	123,692,564.67	15.71
10	002045	国光电器	117,843,936.83	14.97
11	000002	万 科 A	114,362,804.76	14.53
12	600958	东方证券	103,676,113.43	13.17
13	000524	岭南控股	98,007,797.84	12.45
14	002366	台海核电	94,784,918.73	12.04
15	002318	久立特材	94,598,030.01	12.02
16	601628	中国人寿	93,648,369.82	11.89
17	601599	鹿港科技	91,991,727.11	11.68
18	300070	碧水源	86,642,918.39	11.01
19	002299	圣农发展	85,394,566.29	10.85
20	600030	中信证券	85,062,703.89	10.80
21	000828	东莞控股	82,929,483.83	10.53
22	600207	安彩高科	81,094,732.58	10.30
23	601211	国泰君安	80,207,353.90	10.19
24	601818	光大银行	75,314,683.00	9.57
25	000728	国元证券	73,545,585.19	9.34
26	601872	招商轮船	71,231,425.25	9.05
27	601985	中国核电	69,509,885.98	8.83
28	000800	一汽轿车	67,443,418.58	8.57
29	601888	中国国旅	66,819,025.43	8.49
30	000920	南方汇通	62,995,688.25	8.00
31	300346	南大光电	61,858,987.85	7.86
32	600259	广晟有色	61,554,536.40	7.82
33	000625	长安汽车	61,124,829.86	7.76
34	000568	泸州老窖	60,472,927.81	7.68
35	002443	金洲管道	60,071,228.74	7.63
36	002344	海宁皮城	56,692,815.26	7.20
37	601555	东吴证券	55,750,325.58	7.08
38	600196	复星医药	54,652,869.55	6.94
39	300160	秀强股份	53,623,955.17	6.81
40	002572	索菲亚	53,267,876.51	6.77
41	002094	青岛金王	51,362,812.08	6.52
42	600292	中电远达	50,404,033.94	6.40
43	002085	万丰奥威	50,373,111.00	6.40
44	000961	中南建设	49,984,133.00	6.35
45	300156	神雾环保	49,518,577.30	6.29
46	002196	方正电机	48,757,861.21	6.19
47	601328	交通银行	48,100,769.05	6.11
48	300166	东方国信	47,965,502.01	6.09
49	601788	光大证券	47,552,739.37	6.04
50	002027	七喜控股	47,344,939.45	6.01
51	600382	广东明珠	47,084,497.08	5.98

52	000952	广济药业	45,829,771.34	5.82
53	002172	澳洋科技	45,275,882.70	5.75
54	002273	水晶光电	44,300,165.59	5.63
55	600637	东方明珠	43,801,089.16	5.56
56	000987	广州友谊	43,724,151.63	5.55
57	002376	新北洋	42,854,396.06	5.44
58	002086	东方海洋	41,626,349.80	5.29
59	601669	中国电建	41,284,539.44	5.24
60	600328	兰太实业	41,047,343.46	5.21
61	300356	光一科技	40,617,042.44	5.16
62	000528	柳 工	40,570,822.77	5.15
63	600728	佳都科技	40,560,711.84	5.15
64	600521	华海药业	40,383,885.95	5.13
65	601021	春秋航空	39,627,184.65	5.03
66	601600	中国铝业	37,678,468.00	4.79
67	002305	南国置业	37,542,638.41	4.77
68	600895	张江高科	37,057,218.87	4.71
69	600566	济川药业	36,741,061.99	4.67
70	000401	冀东水泥	35,217,566.34	4.47
71	601766	中国中车	34,850,109.80	4.43
72	600518	康美药业	34,429,113.58	4.37
73	601088	中国神华	34,070,000.00	4.33
74	300355	蒙草抗旱	33,910,056.29	4.31
75	300145	南方泵业	33,588,367.00	4.27
76	002101	广东鸿图	33,244,042.54	4.22
77	600889	南京化纤	33,023,365.14	4.19
78	300162	雷曼股份	32,931,363.87	4.18
79	002177	御银股份	32,888,206.50	4.18
80	002230	科大讯飞	32,612,339.69	4.14
81	600818	中路股份	32,501,535.90	4.13
82	002348	高乐股份	32,380,591.59	4.11
83	002241	歌尔声学	32,210,489.55	4.09
84	600563	法拉电子	31,978,857.28	4.06
85	000998	隆平高科	31,312,088.02	3.98
86	002594	比亚迪	31,228,965.81	3.97
87	300369	绿盟科技	30,158,284.31	3.83
88	000027	深圳能源	30,136,385.24	3.83
89	600648	外高桥	30,114,250.75	3.83
90	002470	金正大	30,107,012.85	3.82
91	601166	兴业银行	30,042,340.06	3.82
92	600716	凤凰股份	29,581,847.22	3.76
93	000633	合金投资	29,128,187.50	3.70
94	002340	格林美	28,985,602.58	3.68
95	002251	步 步 高	28,939,632.54	3.68

96	002450	康得新	28,856,981.30	3.67
97	603199	九华旅游	28,252,609.46	3.59
98	000988	华工科技	28,117,871.74	3.57
99	600122	宏图高科	27,827,055.50	3.53
100	600701	工大高新	27,787,625.46	3.53
101	002612	朗姿股份	27,784,281.25	3.53
102	600338	西藏珠峰	27,752,764.68	3.53
103	600561	江西长运	27,217,063.18	3.46
104	300203	聚光科技	27,070,432.60	3.44
105	002249	大洋电机	26,766,427.70	3.40
106	600195	中牧股份	26,340,611.00	3.35
107	600052	浙江广厦	26,118,755.15	3.32
108	600745	中茵股份	26,010,181.71	3.30
109	002712	思美传媒	25,783,673.00	3.27
110	600201	生物股份	25,761,689.95	3.27
111	601199	江南水务	25,705,454.81	3.27
112	600999	招商证券	25,694,590.00	3.26
113	002051	中工国际	25,647,389.92	3.26
114	603885	吉祥航空	25,052,663.20	3.18
115	002369	卓翼科技	24,794,871.14	3.15
116	300012	华测检测	24,473,802.29	3.11
117	600884	杉杉股份	24,319,465.95	3.09
118	000915	山大华特	23,877,358.05	3.03
119	000567	海德股份	23,796,000.00	3.02
120	600593	大连圣亚	23,582,716.37	3.00
121	000666	经纬纺机	23,335,500.55	2.96
122	002367	康力电梯	23,327,062.51	2.96
123	300367	东方网力	23,320,250.13	2.96
124	002123	荣信股份	23,264,890.83	2.96
125	600570	恒生电子	23,045,404.61	2.93
126	601000	唐山港	22,997,710.95	2.92
127	002657	中科金财	22,622,690.50	2.87
128	002008	大族激光	22,338,283.96	2.84
129	002488	金固股份	22,157,071.25	2.81
130	601688	华泰证券	22,001,209.00	2.79
131	600285	羚锐制药	21,980,211.22	2.79
132	600257	大湖股份	21,880,143.60	2.78
133	000802	北京文化	21,840,200.40	2.77
134	600310	桂东电力	21,734,263.47	2.76
135	600703	三安光电	21,365,448.98	2.71
136	600548	深高速	21,235,331.57	2.70
137	601886	江河创建	21,232,851.85	2.70
138	603308	应流股份	21,208,369.50	2.69
139	600279	重庆港九	21,080,401.08	2.68



140	002357	富临运业	20,963,034.60	2.66
141	300018	中元华电	20,906,100.00	2.66
142	300135	宝利国际	20,823,003.10	2.64
143	002308	威创股份	20,495,195.60	2.60
144	300083	劲胜精密	20,022,183.90	2.54
145	600037	歌华有线	20,005,269.00	2.54
146	601038	一拖股份	19,724,376.98	2.51
147	300137	先河环保	19,721,406.92	2.50
148	002446	盛路通信	19,693,114.00	2.50
149	600269	赣粤高速	19,674,879.00	2.50
150	002502	潍威股份	19,550,699.48	2.48
151	002586	围海股份	19,475,074.81	2.47
152	002037	久联发展	19,409,455.00	2.47
153	002349	精华制药	19,384,870.00	2.46
154	002142	宁波银行	19,315,661.52	2.45
155	601991	大唐发电	19,014,813.95	2.42
156	000887	中鼎股份	18,785,605.00	2.39
157	002739	万达院线	18,765,271.00	2.38
158	600223	鲁商置业	18,521,906.64	2.35
159	600184	光电股份	18,488,840.04	2.35
160	002016	世荣兆业	17,908,816.16	2.27
161	600058	五矿发展	17,865,197.80	2.27
162	000822	山东海化	17,835,257.44	2.27
163	002596	海南瑞泽	17,756,704.60	2.26
164	000559	万向钱潮	17,572,961.05	2.23
165	002170	芭田股份	17,469,291.09	2.22
166	000671	阳光城	17,072,310.71	2.17
167	300302	同有科技	17,042,104.45	2.16
168	000902	新洋丰	17,026,204.45	2.16
169	002050	三花股份	16,985,954.75	2.16
170	300019	硅宝科技	16,985,473.02	2.16
171	600711	盛屯矿业	16,939,600.00	2.15
172	600198	大唐电信	16,864,386.80	2.14
173	300051	三五互联	16,568,093.20	2.10
174	600734	实达集团	16,519,327.47	2.10
175	002664	信质电机	16,503,331.00	2.10
176	300031	宝通科技	16,477,772.24	2.09
177	002312	三泰控股	16,312,923.43	2.07
178	600083	博信股份	16,291,386.49	2.07
179	002229	鸿博股份	16,249,482.00	2.06
180	600683	京投银泰	16,047,680.56	2.04
181	600718	东软集团	16,043,409.02	2.04
182	000807	云铝股份	15,880,336.00	2.02
183	600031	三一重工	15,800,835.52	2.01

184	600776	东方通信	15,758,218.90	2.00
-----	--------	------	---------------	------

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。

#### 8.4.3 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	9,543,753,747.76
卖出股票的收入（成交）总额	9,145,395,713.31

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。

#### 8.5 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。

#### 8.6 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。

#### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 8.9 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。

#### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 8.10.1 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。

##### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，有选择地投资于流动性好、交易活跃的股指期货合约。

本基金在进行股指期货投资时，首先将基于对证券市场总体行情的判断和组合风险收益的分析

确定投资时机以及套期保值的类型（多头套期保值或空头套期保值），并根据风险资产投资（或拟投资）的总体规模和风险系数决定股指期货的投资比例；其次，本基金将在综合考虑证券市场和期货市场运行趋势以及股指期货流动性、收益性、风险特征和估值水平的基础上进行投资品种选择，以对冲风险资产组合的系统性风险和流动性风险。

### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 8.11.1 本期国债期货投资政策

无。

#### 8.11.2 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。

#### 8.11.3 本期国债期货投资评价

无。

### 8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体不存在被监管部门立案调查的，在本报告编制日前一年内也不存在受到公开谴责、处罚的情况。

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

#### 8.12.3 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	2,329,389.67
2	应收证券清算款	20,789,072.96
3	应收股利	-
4	应收利息	28,593.40
5	应收申购款	2,414,751.53
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	25,561,807.56

#### 8.12.4 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。

### 8.12.5 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	002612	朗姿股份	38,062,703.14	4.83	筹划重大事项
2	600729	重庆百货	29,259,122.20	3.72	筹划重大事项

### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

## §9 基金份额持有人信息

### 9.1 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
19,696	32,331.93	0.00	0.00%	636,809,744.72	100.00%

### 9.2 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	16,882.23	0.00%

### 9.3 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、基金投资和研发部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间为 0；

本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 0。

## §10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2015 年 6 月 29 日)基金份额总额	1,799,465,454.32
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	311,454,166.48
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	1,474,109,876.08
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	636,809,744.72

## §11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 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、本基金管理人重大人事变动如下：

(1) 2015 年 3 月 7 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，尚志民先生不再担任本基金管理人的副总经理。

(2) 2015 年 6 月 27 日，基金管理人发布了华安安享灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告，施卫平先生不再担任本基金的基金经理。

(3) 2015 年 6 月 30 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，秦军先生不再担任本基金管理人的副总经理。

(4) 2015 年 7 月 11 日，基金管理人发布了华安基金管理有限公司高级管理人员变更公告，童威先生新任本基金管理人的总经理。

(5) 2015 年 7 月 18 日，基金管理人发布了华安国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告，增聘王嘉先生为本基金的基金经理，与苏圻涵先生、杨明先生共同管理本基金。

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：

(1) 本基金托管人 2015 年 1 月 4 日发布任免通知，聘任张力铮为中国建设银行投资托管业务部副总经理。

(2) 本基金托管人 2015 年 9 月 18 日发布任免通知，解聘纪伟中国建设银行投资托管业务部副总经理职务。

### 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

报告期内无基金投资策略的改变。

### 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 80,000.00 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

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 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	
财达证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
中银国际证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	1	411,969,299.44	2.20%	383,666.15	2.25%	-
中山证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国国际金融有限公司	1	85,101,793.30	0.46%	79,253.94	0.46%	-
招商证券股份有限公司	3	2,345,592,807.14	12.55%	2,140,539.50	12.53%	-
长江证券股份有限公司	1	1,824,427,026.22	9.76%	1,699,084.11	9.94%	-

长城证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	1	212,350,946.81	1.14%	197,229.78	1.15%	-
新时代证券有限责任公司	1	240,510,539.84	1.29%	223,986.11	1.31%	-
湘财证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
西南证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
万联证券有限责任公司	1	141,642,989.90	0.76%	131,911.94	0.77%	-
天风证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
申银万国证券股份有限公司	1	1,562,322,993.75	8.36%	1,394,039.84	8.16%	-
上海证券有限责任公司	2	1,937,014,840.91	10.36%	1,743,985.57	10.21%	-
瑞银证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
齐鲁证券有限公司	1	-	-	-	-	-
联讯证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
华安证券有限责任公司	1	39,938,957.61	0.21%	37,195.21	0.22%	-
宏源证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	1	277,970,102.32	1.49%	258,872.88	1.51%	-
国信证券股份有限公司	1	591,181,967.05	3.16%	550,565.02	3.22%	-
国泰君安证券股份有限公司	1	4,026,316,978.12	21.54%	3,661,887.76	21.43%	-
国盛证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
广州证券有限责任公司	2	88,199,145.10	0.47%	80,376.02	0.47%	-
广发证券股份有限公司	1	2,002,271,463.73	10.71%	1,864,705.16	10.91%	-
光大证券股份有限公司	1	1,595,779,982.86	8.54%	1,454,230.81	8.51%	-

方正证券股份 有限公司	1	1,306,557,626.97	6.99%	1,186,532.75	6.94%	-
东北证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
德邦证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
财富证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-

注：1、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副总经理审批

公司分管副总经理对相关部门提交的《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 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
财达证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
中银国际证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中山证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国国际金融有限公司	26,727,133.82	16.76%	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长江证券股份有限公司	52,636,866.30	33.00%	-	-	-	-
长城证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	79,196,269.08	49.65%	-	-	-	-
新时代证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
湘财证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
西南证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
万联证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
天风证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
申银万国证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
上海证券有限	-	-	-	-	-	-

责任公司						
瑞银证券有限 责任公司	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券有限 公司	-	-	-	-	-	-
联讯证券有限 责任公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
华安证券有限 责任公司	-	-	-	-	-	-
宏源证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
海通证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
国信证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券 股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国盛证券有限 责任公司	-	-	-	-	-	-
广州证券有限 责任公司	-	-	-	-	-	-
广发证券股份 有限公司	955,421.03	0.60%	-	-	-	-
光大证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
方正证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
东北证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
德邦证券有限 责任公司	-	-	-	-	-	-
财富证券有限 责任公司	-	-	-	-	-	-

### 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	2015-03-07
2	华安基金管理有限公司关于基金电子交易	《上海证券报》、《证	2015-03-12

	平台延长工行直联结算方式费率优惠活动的公告	券时报》、《中国证券报》和公司网站	
3	华安基金管理有限公司关于旗下基金调整交易所固定收益品种估值方法的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2015-03-31
4	华安基金管理有限公司关于基金电子交易平台暂停部分基金通过支付宝渠道申购、定期定额投资业务的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2015-04-08
5	华安基金管理有限公司关于基金电子交易平台开展机构客户认购、申购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	2015-06-02
6	华安国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金基金份额发售公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2015-06-08
7	华安国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2015-06-08
8	华安国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金托管协议	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2015-06-08
9	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金在官方京东店开展认购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	2015-06-10
10	华安基金管理有限公司关于在京东电商平台开通华安基金官方旗舰店基金网上直销业务的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2015-06-10
11	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	2015-06-12
12	华安基金管理有限公司关于华安国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金增加招商银行股份有限公司为销售机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2015-06-12
13	华安基金管理有限公司关于华安国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金增加招商银行股份有限公司为销售机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2015-06-13
14	华安基金管理有限公司关于旗下华安国企改革主题灵活配置混合基金增加上海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	2015-06-16
15	华安基金管理有限公司关于华安国企改革主题灵活配置混合基金增加销售机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2015-06-17
16	华安基金管理有限公司关于华安国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金提前结束募集的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2015-06-25

17	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时间的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2015-06-29
18	华安国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同生效公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2015-06-30
19	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	2015-06-30
20	华安基金管理有限公司关于公司及高管投资旗下基金相关事宜的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2015-07-07
21	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“新宁物流”等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	2015-07-10
22	华安基金管理有限公司高级管理人员变更公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2015-07-11
23	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加同花顺申购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	2015-07-14
24	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“西安饮食”等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	2015-07-15
25	华安国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2015-07-18
26	华安基金管理有限公司关于华安国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换和定期定额业务公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2015-07-29
27	华安基金关于参加数米基金网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	2015-08-05
28	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加京东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	2015-08-12
29	华安基金管理有限公司关于中信浙江并入中信证券期间基金业务安排的提示性公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2015-08-12
30	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加泉州银行股份有限公司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	2015-08-13
31	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“双龙股份”、“碧水源”股票估值调	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券	2015-08-13

	整的公告	报》和公司网站	
32	关于华安基金管理有限公司旗下基金参加中金公司优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2015-08-19
33	华安基金管理有限公司关于基金电子直销平台延长“赎回转认购”交易费率优惠时间的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2015-08-20
34	华安基金管理有限公司关于参加天天基金网费率优惠的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2015-08-22
35	华安基金管理有限公司关于华安旗下基金调整单笔最低申购金额的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2015-08-27
36	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“蓝色光标”等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	2015-08-27
37	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“铜陵有色”等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	2015-08-28
38	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加陆金所为销售机构并参加费率优惠的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2015-08-31
39	华安基金管理有限公司关于基金电子交易平台延长机构客户认购、申购费率优惠时间的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2015-09-02
40	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“骅威股份”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	2015-09-07
41	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	2015-09-11
42	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加宏信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	2015-09-16
43	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加长量基金为销售机构并参加费率优惠的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2015-09-22
44	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“碧水源”、“富瑞特装”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	2015-10-15
45	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加富济财富为销售机构并参加费率优惠的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2015-10-26
46	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金	《上海证券报》、《证	2015-10-26

	增加乐融多源为销售机构并参加费率优惠的公告	券时报》、《中国证券报》和公司网站	
47	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海联泰资产管理有限公司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	2015-10-26
48	华安基金管理有限公司关于参加长量基金费率优惠的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2015-10-30
49	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加大泰金石投资管理有限公司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	2015-11-04
50	华安基金管理有限公司关于参加京东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	2015-11-05
51	华安基金管理有限公司关于华安基金管理有限公司旗下基金参加诺亚正行优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2015-11-07
52	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加盈米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	2015-11-13
53	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“青岛金王”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	2015-11-14
54	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加华龙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	2015-11-18
55	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加利得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	2015-11-25
56	华安基金管理有限公司关于基金电子直销平台延长“赎回转认购”交易费率优惠时间的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2015-11-27
57	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金开通并参加中国工商银行股份有限公司基金定期定额投资及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	2015-11-30
58	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加君德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	2015-12-02
59	华安基金管理有限公司关于参加京东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	2015-12-03
60	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加新兰德为销售机构并参加费率优惠活	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券	2015-12-07

	动的公告	报》和公司网站	
61	华安基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金调整单笔最低赎回份额、单笔最低转换转出份额和最低保留余额限制的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2015-12-10
62	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	2015-12-10
63	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加东莞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	2015-12-15
64	华安基金管理有限公司关于电子直销平台延长“微钱宝”账户交易费率优惠时间的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2015-12-25
65	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金开通并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	2015-12-31
66	华安基金管理有限公司关于参加东莞银行费率优惠的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2015-12-31
67	华安基金管理有限公司关于旗下基金因指数熔断交易规则实施调整开放时间的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2015-12-31

注：前款所涉重大事件已作为临时报告在《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站www.huaan.com.cn上披露。

## §12 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## §13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、《华安国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- 2、《华安国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》
- 3、《华安国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- 4、中国证监会批准华安国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金设立的文件；
- 5、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告原件；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
- 7、基金托管人业务资格批件和营业执照；

8、华安基金管理有限公司开放式基金业务规则；

### 13.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的办公场所，并登载于基金管理人互联网站 <http://www.huaan.com.cn>。

### 13.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站查阅，或在营业时间内至基金管理人或基金托管人的办公场所免费查阅。

华安基金管理有限公司

二〇一六年三月二十八日