

**华安创新证券投资基金**  
**2016 年年度报告摘要**  
**2016 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：交通银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一七年三月二十八日

## §1 重要提示

### 1.1 重要提示

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

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 3 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	华安创新混合	
基金主代码	040001	
交易代码	040001(前端)	041001(后端)
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2001 年 9 月 21 日	
基金管理人	华安基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	3,356,485,682.03 份	
基金合同存续期	不定期	

### 2.2 基金产品说明

投资目标	<p>基金管理人将以分散投资风险，提高基金资产的安全性，并积极追求投资收益的稳定增长为目标，以诚信原则及专业经营方式，将本基金投资于具有良好流动性的金融工具，主要包括国内依法公开发行、上市的股票、债券以及经中国证监会批准的允许基金投资的其它金融工具。</p>
投资策略	<p>本基金主要投资创新类上市公司以实现基金的投资收益，通过建立科学合理的投资组合，为投资者降低和分散投资风险，提高基金资产的安全性。这里的创新是指科技创新、管理创新和制度创新等方面。创新类上市公司包括高新技术产业创新公司和传统产业创新公司。</p> <p>高新技术产业创新公司主要集中在信息技术、生物医药和新材料等高新技术产业等领域，包括电子信息及网络技术、生物技术及新医药、光机电一体化、航空航天技术、海洋技术、新材料、新能源等领域内主业突出的上市公司。</p> <p>传统产业类型的上市公司中，如果已在或正在管理制度、营销体系、技术开发和生产体系等方面进行创新，具有较大潜在发展前景和经济效益的上市公司也属于本基金的主要投资范围。</p> <p>本基金在选择上市公司时主要考虑以下因素：公司创新能力强，主营业务</p>

	<p>市场空间大，财务状况良好，具有相当竞争优势等。</p> <p>本基金的投资组合将通过持有基金管理人确认的并符合法律规定的一定比例的高流动性资产，如国债和现金，从而保持基金资产良好的流动性。</p>
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为=75%×沪深 300 指数收益率+25%×中债国债总财富指数收益率
风险收益特征	无

### 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	交通银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	钱鲲	陆志俊
	联系电话	021-38969999	95559
	电子邮箱	qiankun@huaan.com.cn	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		4008850099	95559
传真		021-68863414	021-62701216

### 2.4 信息披露方式

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

## §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2016 年	2015 年	2014 年
本期已实现收益	-464,904,347.24	1,333,539,938.24	473,294,514.50
本期利润	-586,734,481.73	1,274,917,525.15	651,537,492.22
加权平均基金份额本期利润	-0.1691	0.2811	0.0895
本期基金份额净值增长率	-18.89%	27.74%	14.62%

3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
期末可供分配基金份额利润	0.4813	0.6328	0.3491
期末基金资产净值	2,396,671,293.59	3,142,267,270.25	4,523,321,150.73
期末基金份额净值	0.714	0.892	0.707

注：1、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。

2、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，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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 3 个月	-3.90%	0.62%	0.91%	0.55%	-4.81%	0.07%
过去 6 个月	-5.80%	0.62%	3.87%	0.58%	-9.67%	0.04%
过去 1 年	-18.89%	1.30%	-7.91%	1.05%	-10.98%	0.25%
过去 3 年	18.76%	1.47%	34.20%	1.32%	-15.44%	0.15%
过去 5 年	29.28%	1.29%	36.91%	1.20%	-7.63%	0.09%
自基金成立起至今	308.79%	1.23%	115.52%	1.30%	193.27%	-0.07%

注：本基金的业绩比较基准为沪深 300 指数收益率×75%+中债国债总财富指数收益率×25%。

根据本基金合同的有关规定，本基金的投资范围为国内依法公开发行、上市的股票、债券及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。本基金的股票、债券投资比例不低于基金资产总值的 80%；投资于国家债券的比例不低于基金资产净值的 20%。

#### 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

华安创新证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

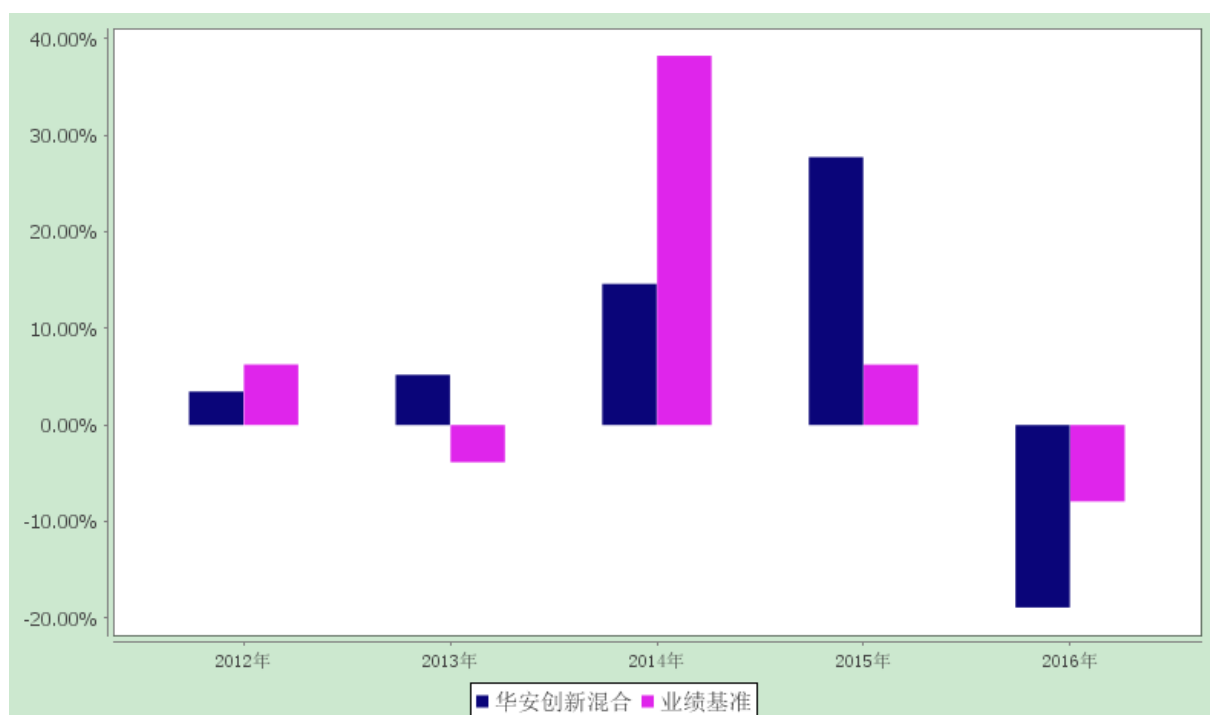
(2001 年 9 月 21 日至 2016 年 12 月 31 日)



### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华安创新证券投资基金

过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2016年	0.100	19,037,703.41	16,106,719.70	35,144,423.11	-
2015年	0.100	32,115,266.24	26,485,993.04	58,601,259.28	-
2014年	0.100	42,428,922.61	34,925,530.30	77,354,452.91	-
合计	0.300	93,581,892.26	77,518,243.04	171,100,135.30	-

## §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2016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ETF、华安上证龙头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、华安信用四季红债券、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、华安逆向策略混合、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、华安汇财货币、华安国际龙头（DAX）ETF、华安国际龙头（DAX）ETF联接、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、华安安康保本混合、华安安华保本混合、华安沪港

深外延增长混合、华安全球美元收益债券、华安安禧保本混合、华安全球美元票息债券、华安创业板 50ETF、华安安进保本混合发起式、华安聚利 18 个月定开债、华安智增精选灵活配置混合、华安新财富灵活配置混合、华安安润灵活配置混合、华安睿享定开混合发起式、华安新希望灵活配置混合、华安鼎丰债券发起式、华安新瑞利灵活配置混合、华安新泰利灵活配置混合、华安新恒利灵活配置混合、华安事件驱动量化策略混合、华安新丰利灵活配置混合等 89 只开放式基金。管理资产规模达到 1632.85 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		
杨鑫鑫	本基金的基金经理	2014-12-30	2016-09-21	8 年	硕士研究生，具有基金从业资格，8 年基金行业从业资格。2008 年 7 月应届进入华安基金管理有限公司，先后担任研究发展部行业研究员、基金投资部基金经理助理。2013 年 6 月起担任华安核心优选混合型证券投资基金的基金经理。2014 年 12 月至 2016 年 9 月担任本基金的基金经理。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 4 月起担任华安新丝路主题股票型证券投资基金的基金经理。
廖发达	本基金的基金经理	2015-08-06	-	15 年	博士研究生，15 年金融行业从业经验，曾任上海证大投资管理有限公司副经理、金鹰基金研究员、中国人寿资产管理研究员、太平洋资产管理投资经理。2015 年 6 月加入华安基金管理有限公司，2015 年 8 月起担任本基金的基金经理。2016 年 2 月起担任华安安华保本混合型证券投资基金的基金经理。2016 年 8 月起同时担任华安安进保本混合型发起式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 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了《华安基金管理有限公司公平交易管理制度》，将封闭式基金、开放式基金、特定客户资产管理组合及其他投资组合资产在研究分析、投资决策、交易执行等方面全部纳入公平交易管理中。控制措施包括：在研究环节，研究员在为公司管理的各类投资组合提供研究信息、投资建议过程中，使用晨会发言、邮件发送、登录在研究报告管理系统中等方式来确保各类投资组合经理可以公平享有信息获取机会。在投资环节，公司各投资组合经理根据投资组合的风格和投资策略，制定并严格执行交易决策规则，以保证各投资组合交易决策的客观性和独立性。同时严格执行投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体授权机制，投资组合经理在授权范围内自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易环节，公司实行强制公平交易机制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。（1）交易所二级市场业务，遵循价格优先、时间优先、比例分配、综合平衡的控制原则，实现同一时间下达指令的投资组合在交易时机上的公平性。（2）交易所一级市场业务，投资组合经理按意愿独立进行业务申报，集中交易部以投资组合名义对外进行申报。若该业务以公司名义进行申报与中签，则按实际中签情况以价格优先、比例分配原则进行分配。若中签量过小无法合理进行比例分配，且以公司名义获得，则投资部门在合规监察员监督参与下，进行公平协商分配。（3）银行间市场业务遵循指令时间优先原则，先到先询价的控制原则。通过内部共同的 iwind 群，发布询价需求和结果，做到信息公开。若是多个投资组合进行一级市场投标，则各投资组合经理须以各投资组合名义向集中交易部下达投资意向，交易员以此进行投标，以确保中签结果与投资组合投标意向一一对应。若中签量过小无法合理进行比例分配，且以公司名义获得，则投资部门在风险管理部投资监督参与下，进行公平协商分配。交易监控、分析与评估环节，公司风险管理部对公司旗下的各投资组合投资境内证券市场上市交易的投资品种、进行场外的非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购、不同投资组合同日和临近交易日的反向交易以及可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控，根据市场公认的第三方信息（如：中债登的债券估值），定期对各投资组合与交易对手之间议价交易的交易价格公允性进行审查，对不同投资组合临近交易日的同

向交易的交易时机和交易价差进行分析。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

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

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

本报告期内，因组合流动性管理或投资策略调整需要，除指数基金以外的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的次数为 9 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

2016 年，上证 50 指数下跌 5.53%，创业板指数下跌 27.71%，低估值大盘价值股、周期股显著战胜以 TMT 为代表的中小盘成长股。分月度看，年初 A 股市场全面、大幅下跌且 2 次熔断，1 月份各指数跌幅都在 20% 以上。1 月份之后，市场风格进一步分化。大盘价值股、周期股在供给侧改革、PPI 上行、利率下行、保险资金举牌等因素推动下，震荡上行，收复 1 月份的绝大部分跌幅。而中小创受相对估值高、大小非解禁等因素影响，虽然期间出现了半导体、新能源汽车等结构性机会，但整体呈现震荡调整格局，全年表现仍差强人意。

组合投资方面，报告期内，本基金在资产配置上保持中性仓位；但在行业配置上低配了银行、家电、食品饮料、钢铁、煤炭等行业，而高配了电子、半导体、传媒等中小盘成长股，虽然通过自上而下和自下而上相结合筛选个股，并进行了一定的波段操作，但行业配置的偏差导致了基金净值低于了比较基准。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2016 年 12 月 31 日,本基金份额净值为 0.714 元,本报告期份额净值增长率为-18.89%, 同期业绩比较基准增长率为-7.91%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2016 年中央经济工作会议提出了 2017 年中国经济、金融去杠杆、控风险、稳中求进的基本政策取向和稳健中性的货币政策。在改革方面, 2017 年, 供给侧改革、混合所有制改革将继续推进。党的十九大即将召开、中美经贸关系、一带一路政策的推进等将成为影响 2017 年中国经济、证券市场的重要事件主题。

随着沪港通、深港通的开通, A 股市场与港股市场的关联度将进一步增强, H 股市场波动对 A 股市场的影响将显著增强。中国后工业化时代的环保硬约束、供给侧改革、寡头定价权等使得行业龙头的竞争力显著提升。微信时代的信息快速传递和机构配置的流动性要求等使得龙头股溢价效应逐步显现。

供给侧改革将继续成为 2017 年中国经济的重要内容, 因而供给侧改革受益的行业特别是行业龙头将继续受益。估值低、业绩稳健增长的医药、消费股以及 PEG 合理、内生增长好的优质成长股特别是消费电子具有良好投资机会。

下一阶段,本基金将采取相对审慎、相对均衡的配置策略,在总体操作上,一季度保持相对积极态度,自上而下与自下而上相结合,积极寻找调整充分、估值合理的结构性机会。在操作上,以绝对收益思路,通过组合的动态调整,在控制回撤的条件下,实现基金业绩的持续、稳健增长。

#### 4.6 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: 基金投资部兼全球投资部高级总监、投资研究部高级总监、固定收益部总监、指数投资部高级总监、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高级总监，总经理助理，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，台湾保德信投信基金经理。2008 年 4 月加入华安基金管理有限公司，现任华安香港精选股票、华安大中华升级股票、华安大国新经济股票、华安物联网主题股票的基金经理，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高级总监。

杨明，投资研究部高级总监，研究生学历。曾在上海银行从事信贷员、交易员及风险管理。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，现任华安策略优选混合、华安沪港深外延增长混合、华安安禧保本的基金经理，投资研究部高级总监。

贺涛，金融学硕士，固定收益部总监。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。现任华安现金富利货币、华安稳定收益债券、华安可转债、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、华安信用增强债券、华安双债添利债券、华安汇财通货币、华安年年盈定期开放式债券、华安新回报灵活配置、华安新乐享保本、华安乐惠保本、华安安华保本、华安安进保本、华安新希望混合、华安睿享定开混合的基金经理，固定收益部总监。

许之彦，指数投资部高级总监，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 (LOF)、华安易富黄金 ETF 及联接、华安中证全指证券公司指数分级、华安中证银行指数分级、华安创业板 50 指数分级、华安创业板 50ETF 的基金经理，指数投资部高级总监。

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

本基金的基金经理未参与基金的估值。

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。

**4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

本报告期内共实施一次分红，分红方案为：0.10 元/10 份，权益登记日及除息日：2016 年 1 月 21 日；现金红利发放日：2016 年 1 月 22 日。

**4.8 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明**

无。

**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**

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**

2016 年度，基金托管人在华安创新证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

**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**

2016 年度，华安基金管理有限公司在华安创新证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金进行了 1 次收益分配，分配金额为 35144423.11 元，符合基金合同的规定。

### 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

2016 年度，由华安基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关华安创新证券投资基金的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

## §6 审计报告

本报告期的基金财务会计报告经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计，注册会计师单峰 张振波签字出具了普华永道中天审字(2017)第 20221 号标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：华安创新证券投资基金

报告截止日：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产：	-	-
银行存款	78,350,787.52	274,883.45
结算备付金	188,105,844.36	201,318,269.45
存出保证金	2,897,326.67	4,143,048.71
交易性金融资产	2,077,947,818.59	2,920,290,689.24
其中：股票投资	1,516,520,578.59	2,231,996,089.24
基金投资	-	-
债券投资	561,427,240.00	688,294,600.00
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	100,000,270.00	-
应收证券清算款	-	28,052,931.27
应收利息	10,606,946.01	14,934,533.89
应收股利	-	-
应收申购款	32,061.06	86,001.38
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
<b>资产总计</b>	<b>2,457,941,054.21</b>	<b>3,169,100,357.39</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
	<b>2016 年 12 月 31 日</b>	<b>2015 年 12 月 31 日</b>
负 债：	-	-
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	40,513,451.63	-
应付赎回款	789,087.55	3,503,742.99
应付管理人报酬	3,110,662.10	3,961,223.79
应付托管费	518,443.71	660,204.01
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	15,316,023.05	17,435,575.88
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	1,022,092.58	1,272,340.47
<b>负债合计</b>	<b>61,269,760.62</b>	<b>26,833,087.14</b>
<b>所有者权益：</b>	-	-

实收基金	781,063,469.78	819,426,223.49
未分配利润	1,615,607,823.81	2,322,841,046.76
<b>所有者权益合计</b>	<b>2,396,671,293.59</b>	<b>3,142,267,270.25</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>	<b>2,457,941,054.21</b>	<b>3,169,100,357.39</b>

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.714 元，基金份额总额 3,356,485,682.03 份。

## 7.2 利润表

会计主体：华安创新证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>	<b>-440,911,136.21</b>	<b>1,411,087,275.72</b>
1.利息收入	24,339,551.03	39,541,098.12
其中：存款利息收入	3,682,491.60	4,501,720.63
债券利息收入	20,550,089.55	34,376,853.57
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	106,969.88	662,523.92
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	-343,477,894.21	1,429,806,182.71
其中：股票投资收益	-350,791,581.83	1,401,300,867.82
基金投资收益	-	-
债券投资收益	1,052,595.60	944,969.74
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	6,261,092.02	27,560,345.15
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填	-121,830,134.49	-58,622,413.09



列)		
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	57,341.46	362,407.98
<b>减：二、费用</b>	<b>145,823,345.52</b>	<b>136,169,750.57</b>
1. 管理人报酬	38,652,946.44	56,085,454.24
2. 托管费	6,442,157.75	9,347,575.73
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	100,284,608.13	70,287,694.31
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	443,633.20	449,026.29
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>-586,734,481.73</b>	<b>1,274,917,525.15</b>
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>-586,734,481.73</b>	<b>1,274,917,525.15</b>

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安创新证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 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）	819,426,223.49	2,322,841,046.76	3,142,267,270.25
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-586,734,481.73	-586,734,481.73
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	-38,362,753.71	-85,354,318.11	-123,717,071.82

列)			
其中：1.基金申购款	13,318,159.56	29,063,994.20	42,382,153.76
2.基金赎回款	-51,680,913.27	-114,418,312.31	-166,099,225.58
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）	-	-35,144,423.11	-35,144,423.11
五、期末所有者权益（基金净值）	781,063,469.78	1,615,607,823.81	2,396,671,293.59
项目	上年度可比期间		
	2015 年 1 月 1 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）	1,489,803,837.02	3,033,517,313.71	4,523,321,150.73
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,274,917,525.15	1,274,917,525.15
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）	-670,377,613.53	-1,926,992,532.82	-2,597,370,146.35
其中：1.基金申购款	40,662,933.77	109,527,047.39	150,189,981.16
2.基金赎回款	-711,040,547.30	-2,036,519,580.21	-2,747,560,127.51
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）	-	-58,601,259.28	-58,601,259.28
五、期末所有者权益（基金净值）	819,426,223.49	2,322,841,046.76	3,142,267,270.25

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

华安创新证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2001]第 33 号《关于同意华安创新证券投资基金设立的批复》核准,由华安基金管理有限公司依照《证券投资基金管理暂行办法》及其实施细则、《开放式证券投资基金试点办法》等有关规定和《华安创新证券投资基金基金契约》(后更名为《华安创新证券投资基金基金合同》)发起,并于 2001 年 9 月 21 日募集成立。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 5,000,001,124.00 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道验字(2001)第 84 号验资报告予以验证。本基金的基金管理人为华安基金管理有限公司,基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《华安创新证券投资基金招募说明书》和《华安创新证券投资基金基金份额拆分公告》的有关规定,本基金于 2007 年 10 月 26 日进行了基金份额拆分,拆分比例为 1:4.297369516,并于 2007 年 10 月 29 日进行了份额变更登记。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安创新证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为国内依法公开发行、上市的股票、债券及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。本基金的股票、债券投资比例不低于基金资产总值的 80%;投资于国家债券的比例不低于基金资产净值的 20%。根据《华安基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金变更业绩比较基准的公告》的规定,自 2015 年 9 月 8 日起本基金的业绩比较基准由“中信标普 300 指数收益率×75% + 中信标普国债指数收益率×25%”变更为“中信标普 300 指数收益率×75%+中债国债总财富指数收益率×25%”。

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 2017 年 3 月 24 日批准报出。

### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准

则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华安创新证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

#### **7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

本基金 2016 年度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 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### **7.4.5 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**

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### **7.4.5.2 会计估计变更的说明**

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### **7.4.5.3 差错更正的说明**

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### **7.4.6 税项**

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、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》、财税[2015]101 号《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》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《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》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对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，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2) 对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，股票的股息、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。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，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，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 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。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

#### 7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
华安基金管理有限公司(“华安基金公司”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
交通银行股份有限公司(“交通银行”)	基金托管人、基金销售机构
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：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.8.1.1 股票交易

无。

**7.4.8.1.2 权证交易**

无。

**7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金**

无。

**7.4.8.2 关联方报酬**

**7.4.8.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12 月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12 月31日
当期发生的基金应支付的管理费	38,652,946.44	56,085,454.24
其中：支付销售机构的客户维护费	4,014,062.06	6,082,165.78

注：支付基金管理人华安基金公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5%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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.5\% / \text{当年天数}。$$

**7.4.8.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12 月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12 月31日
当期发生的基金应支付的托管费	6,442,157.75	9,347,575.73

注：支付基金托管人交通银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25%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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数}。$$

**7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

无。

**7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况**

**7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

无。

**7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况**

无。

**7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2016年1月1日至2016年12月31日		2015年1月1日至2015年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行	78,350,787.52	346,173.39	274,883.45	657,172.66

注：1. 本基金的银行存款由基金托管人 交通银行保管，按银行同业利率计息。

2. 本基金用于证券交易结算的资金通过“交通银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司，按银行同业利率计息。于 2016 年 12 月 31 日的相关余额在资产负债表中的“结算备付金”科目中单独列示(2015 年 12 月 31 日：同)。

**7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

无。

**7.4.8.7 其他关联交易事项的说明**

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

**7.4.9 期末（2016 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券**

**7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元

7.4.9.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注

				型						
002838	道恩股份	2016-12-28	2017-01-06	新股中签	15.28	15.28	682.00	10,420.96	10,420.96	-
002840	华统股份	2016-12-29	2017-01-10	新股中签	6.55	6.55	1,814.00	11,881.70	11,881.70	-
300583	赛托生物	2016-12-29	2017-02-06	新股中签	40.29	40.29	1,582.00	63,738.78	63,738.78	-
300586	美联新材	2016-12-26	2017-01-04	新股中签	9.30	9.30	1,006.00	9,355.80	9,355.80	-
300587	天铁股份	2016-12-28	2017-01-05	新股中签	14.11	14.11	1,438.00	20,290.18	20,290.18	-
300588	熙菱信息	2016-12-27	2017-01-05	新股中签	4.94	4.94	1,380.00	6,817.20	6,817.20	-
300591	万里马	2016-12-30	2017-01-10	新股中签	3.07	3.07	2,397.00	7,358.79	7,358.79	-
601375	中原证券	2016-12-20	2017-01-03	新股中签	4.00	4.00	26,695.00	106,780.00	106,780.00	-
603032	德新交运	2016-12-27	2017-01-05	新股中签	5.81	5.81	1,628.00	9,458.68	9,458.68	-
603035	常熟汽饰	2016-12-27	2017-01-05	新股中签	10.44	10.44	2,316.00	24,179.04	24,179.04	-
603186	华正新材	2016-12-26	2017-01-03	新股中签	5.37	5.37	1,874.00	10,063.38	10,063.38	-
603228	景旺电子	2016-12-28	2017-01-06	新股中签	23.16	23.16	3,491.00	80,851.56	80,851.56	-
603266	天龙股份	2016-12-30	2017-01-10	新股中签	14.63	14.63	1,562.00	22,852.06	22,852.06	-
603689	皖天然气	2016-12-30	2017-01-10	新股中签	7.87	7.87	4,818.00	37,917.66	37,917.66	-
603877	太平鸟	2016-12-29	2017-01-09	新股中签	21.30	21.30	3,180.00	67,734.00	67,734.00	-

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

#### 7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票	股票	停牌	停牌	期末估	复牌	复牌	数量	期末	期末	备注
----	----	----	----	-----	----	----	----	----	----	----



代码	名称	日期	原因	值单价	日期	开 盘 单 价	(单位：股)	成本总额	估值总额	
300271	华宇软件	2016-12-19	重大事项	17.45	-	-	1,056,500.00	18,355,116.25	18,435,925.00	-
300323	华灿光电	2016-04-18	重大事项	8.76	2017-01-09	8.65	2,376,900.00	20,338,413.59	20,821,644.00	-
600626	申达股份	2016-12-15	重大事项	13.69	2017-01-12	13.70	87,500.00	1,221,581.00	1,197,875.00	-
600859	王府井	2016-09-27	重大事项	16.28	-	-	1,000,000.00	17,847,819.36	16,280,000.00	-

注：本基金截至 2016 年 12 月 31 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

#### 7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至报告期末 2016 年 12 月 31 日止，本基金无银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

##### 7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至报告期末 2016 年 12 月 31 日止，本基金无交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

###### (a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：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：相关资产或负债的不可观察输入值。

###### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

###### (i) 各层次金融工具公允价值

于 2016 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 1,459,295,434.80 元,属于第二层次的余额为 618,652,383.79 元,无属于第三层次的余额(2015 年 12 月 31 日:第一层次 0.00 元,无属于第二层次以及第三层次的余额)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券,若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况,本基金不会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将相关股票和债券的公允价值列入第一层次;并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2016 年 12 月 31 日,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2015 年 12 月 31 日:同)。

(d) 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应收款项和其他金融负债,其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## §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	1,516,520,578.59	61.70

	其中：股票	1,516,520,578.59	61.70
2	固定收益投资	561,427,240.00	22.84
	其中：债券	561,427,240.00	22.84
	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	100,000,270.00	4.07
	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	266,456,631.88	10.84
7	其他各项资产	13,536,333.74	0.55
8	合计	2,457,941,054.21	100.00

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 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	86,376,755.00	3.60
B	采矿业	44,879,453.60	1.87
C	制造业	641,100,083.81	26.75
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	31,431,025.66	1.31
E	建筑业	130,676,406.75	5.45
F	批发和零售业	52,137,672.28	2.18
G	交通运输、仓储和邮政业	46,647,115.68	1.95
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	127,425,930.89	5.32
J	金融业	191,133,312.40	7.97
K	房地产业	-	-

L	租赁和商务服务业	79,508,700.00	3.32
M	科学研究和技术服务业	28,517,192.00	1.19
N	水利、环境和公共设施管理业	30,118,728.72	1.26
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	26,568,201.80	1.11
S	综合	-	-
	合计	1,516,520,578.59	63.28

### 8.3 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	600093	禾嘉股份	4,230,600	61,343,700.00	2.56
2	601818	光大银行	11,689,228	45,704,881.48	1.91
3	601336	新华保险	1,037,300	45,412,994.00	1.89
4	600598	北大荒	3,601,200	43,934,640.00	1.83
5	000998	隆平高科	1,980,500	42,442,115.00	1.77
6	300011	鼎汉技术	1,951,115	40,427,102.80	1.69
7	000630	铜陵有色	11,722,586	36,105,564.88	1.51
8	600114	东睦股份	1,838,200	31,635,422.00	1.32
9	601117	中国化学	4,311,132	29,186,363.64	1.22
10	300285	国瓷材料	729,603	28,534,773.33	1.19

### 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	000983	西山煤电	244,093,460.79	7.77
2	000060	中金岭南	223,234,076.08	7.10
3	002371	北方华创	196,207,421.59	6.24

4	300458	全志科技	180,697,086.92	5.75
5	002456	欧菲光	175,257,940.30	5.58
6	002325	洪涛股份	169,571,440.17	5.40
7	002007	华兰生物	163,661,493.90	5.21
8	002051	中工国际	156,267,735.53	4.97
9	002458	益生股份	154,220,391.87	4.91
10	600489	中金黄金	146,834,364.93	4.67
11	300017	网宿科技	143,345,906.81	4.56
12	002508	老板电器	142,234,050.18	4.53
13	000858	五 粮 液	140,702,381.23	4.48
14	000998	隆平高科	138,638,096.85	4.41
15	600114	东睦股份	131,538,588.36	4.19
16	601169	北京银行	131,382,406.28	4.18
17	002450	康得新	124,568,959.06	3.96
18	000333	美的集团	123,280,603.37	3.92
19	601336	新华保险	123,256,766.40	3.92
20	002535	林州重机	121,725,240.50	3.87
21	601555	东吴证券	121,301,136.32	3.86
22	300011	鼎汉技术	120,983,843.25	3.85
23	000937	冀中能源	120,354,925.68	3.83
24	600525	长园集团	120,163,594.48	3.82
25	000848	承德露露	119,834,213.65	3.81
26	002111	威海广泰	119,562,698.76	3.80
27	600240	华业资本	119,181,369.86	3.79
28	002142	宁波银行	116,849,875.26	3.72
29	600697	欧亚集团	115,878,943.34	3.69
30	600219	南山铝业	114,712,854.21	3.65
31	002123	梦网荣信	114,423,289.96	3.64
32	000568	泸州老窖	114,083,383.15	3.63
33	002234	民和股份	113,513,807.50	3.61
34	601688	华泰证券	113,079,089.90	3.60
35	601333	广深铁路	112,368,899.51	3.58
36	002245	澳洋顺昌	110,716,922.35	3.52
37	000402	金 融 街	110,097,887.37	3.50
38	600068	葛洲坝	109,703,223.53	3.49
39	300196	长海股份	108,354,120.82	3.45
40	002299	圣农发展	107,714,397.86	3.43
41	600198	大唐电信	106,898,861.41	3.40
42	600376	首开股份	106,852,458.61	3.40
43	601601	中国太保	106,738,333.98	3.40
44	300231	银信科技	106,650,182.99	3.39
45	300294	博雅生物	106,582,524.31	3.39
46	002554	惠博普	105,847,552.08	3.37
47	002172	澳洋科技	105,110,045.09	3.35

48	600048	保利地产	103,913,828.77	3.31
49	600500	中化国际	103,242,086.67	3.29
50	601186	中国铁建	102,532,762.38	3.26
51	600079	人福医药	102,469,806.54	3.26
52	601111	中国国航	101,727,072.80	3.24
53	600093	禾嘉股份	101,620,273.55	3.23
54	000630	铜陵有色	101,541,766.20	3.23
55	000558	莱茵体育	99,682,720.37	3.17
56	002444	巨星科技	99,091,107.04	3.15
57	600826	兰生股份	99,084,413.49	3.15
58	600547	山东黄金	98,158,921.94	3.12
59	000903	云内动力	97,743,802.50	3.11
60	002609	捷顺科技	97,253,563.03	3.10
61	002185	华天科技	95,228,162.15	3.03
62	600259	广晟有色	94,119,808.35	3.00
63	600869	智慧能源	94,008,049.77	2.99
64	600804	鹏博士	94,003,999.96	2.99
65	300014	亿纬锂能	93,990,199.03	2.99
66	002045	国光电器	92,259,725.28	2.94
67	300144	宋城演艺	92,087,233.71	2.93
68	600595	中孚实业	91,428,740.08	2.91
69	600348	阳泉煤业	91,035,289.64	2.90
70	600026	中远海能	90,709,445.96	2.89
71	600085	同仁堂	90,577,097.71	2.88
72	000065	北方国际	90,501,029.94	2.88
73	000928	中钢国际	90,016,306.18	2.86
74	603799	华友钴业	89,942,968.77	2.86
75	000513	丽珠集团	89,209,745.84	2.84
76	000661	长春高新	88,907,207.25	2.83
77	600233	圆通速递	88,412,429.35	2.81
78	600651	飞乐音响	87,658,635.92	2.79
79	601939	建设银行	87,205,080.20	2.78
80	600884	杉杉股份	87,115,976.55	2.77
81	002296	辉煌科技	86,846,541.88	2.76
82	000501	鄂武商A	86,519,036.21	2.75
83	000603	盛达矿业	86,291,104.14	2.75
84	002640	跨境通	86,258,995.29	2.75
85	002580	圣阳股份	86,200,189.38	2.74
86	600340	华夏幸福	85,631,790.91	2.73
87	601699	潞安环能	84,443,671.91	2.69
88	600739	辽宁成大	84,054,642.95	2.67
89	600467	好当家	83,379,163.08	2.65
90	002183	怡亚通	83,201,479.68	2.65
91	600108	亚盛集团	83,040,960.74	2.64

92	002385	大北农	82,591,231.57	2.63
93	002048	宁波华翔	82,398,468.79	2.62
94	600195	中牧股份	82,364,134.60	2.62
95	601766	中国中车	82,026,758.64	2.61
96	600872	中炬高新	81,745,630.97	2.60
97	601818	光大银行	81,621,152.93	2.60
98	600820	隧道股份	81,271,773.87	2.59
99	600428	中远海特	80,645,773.06	2.57
100	600109	国金证券	80,498,699.33	2.56
101	000599	青岛双星	80,387,724.22	2.56
102	002410	广联达	80,200,809.64	2.55
103	600487	亨通光电	79,619,311.11	2.53
104	600867	通化东宝	79,474,859.85	2.53
105	600028	中国石化	79,317,809.08	2.52
106	000831	*ST 五稀	78,602,052.40	2.50
107	600360	华微电子	77,830,275.73	2.48
108	002120	韵达股份	77,405,068.15	2.46
109	601628	中国人寿	77,328,400.13	2.46
110	300075	数字政通	76,199,821.93	2.42
111	600497	驰宏锌锗	75,926,678.74	2.42
112	002311	海大集团	75,913,754.05	2.42
113	600598	北大荒	75,802,408.88	2.41
114	002502	骅威文化	75,470,084.84	2.40
115	000977	浪潮信息	75,281,319.18	2.40
116	300097	智云股份	75,142,232.57	2.39
117	000050	深天马 A	74,643,866.72	2.38
118	600192	长城电工	73,613,994.69	2.34
119	000970	中科三环	73,464,444.88	2.34
120	300098	高新兴	73,323,691.40	2.33
121	002475	立讯精密	73,319,154.87	2.33
122	600366	宁波韵升	72,892,864.39	2.32
123	000703	恒逸石化	71,969,510.34	2.29
124	600576	万家文化	71,789,955.27	2.28
125	600115	东方航空	71,621,197.84	2.28
126	601021	春秋航空	71,506,543.58	2.28
127	002070	众和股份	71,031,608.74	2.26
128	002445	中南文化	70,832,818.42	2.25
129	002078	太阳纸业	70,637,927.23	2.25
130	600096	云天化	70,512,252.50	2.24
131	300310	宜通世纪	69,925,191.16	2.23
132	600517	置信电气	69,637,541.10	2.22
133	002452	长高集团	69,116,396.95	2.20
134	600406	国电南瑞	68,882,080.75	2.19
135	600285	羚锐制药	68,789,339.65	2.19

136	000783	长江证券	68,356,080.24	2.18
137	600970	中材国际	68,340,583.65	2.17
138	002155	湖南黄金	68,150,791.59	2.17
139	002519	银河电子	68,104,538.67	2.17
140	600395	盘江股份	67,935,919.31	2.16
141	001979	招商蛇口	67,254,119.99	2.14
142	300336	新文化	67,144,891.60	2.14
143	601233	桐昆股份	66,762,607.47	2.12
144	600291	西水股份	66,759,103.21	2.12
145	002050	三花智控	66,654,892.07	2.12
146	601098	中南传媒	66,648,249.55	2.12
147	002036	联创电子	66,439,286.35	2.11
148	000915	山大华特	66,131,138.24	2.10
149	600694	大商股份	66,056,267.30	2.10
150	300183	东软载波	65,225,672.66	2.08
151	000758	中色股份	65,202,190.94	2.08
152	002196	方正电机	65,134,318.95	2.07
153	600833	第一医药	64,822,667.22	2.06
154	600662	强生控股	64,817,008.16	2.06
155	600138	中青旅	64,758,905.18	2.06
156	000606	神州易桥	64,444,536.52	2.05
157	600038	中直股份	64,311,662.14	2.05
158	000963	华东医药	64,264,127.40	2.05
159	603609	禾丰牧业	64,141,750.58	2.04
160	300353	东土科技	64,038,040.46	2.04
161	300351	永贵电器	64,007,090.48	2.04
162	600436	片仔癀	63,811,857.69	2.03
163	600061	国投安信	63,702,061.68	2.03
164	300136	信维通信	62,939,776.48	2.00

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	000983	西山煤电	251,067,689.60	7.99
2	000060	中金岭南	218,231,431.39	6.95
3	300458	全志科技	209,651,975.68	6.67
4	002456	欧菲光	207,364,898.07	6.60
5	002371	北方华创	180,892,858.59	5.76



6	002007	华兰生物	173,677,788.94	5.53
7	002325	洪涛股份	170,604,411.29	5.43
8	002051	中工国际	165,715,461.51	5.27
9	600489	中金黄金	157,867,370.28	5.02
10	002458	益生股份	153,104,676.73	4.87
11	002508	老板电器	148,822,183.73	4.74
12	000858	五 粮 液	143,925,043.72	4.58
13	002142	宁波银行	140,293,170.28	4.46
14	300017	网宿科技	138,436,049.78	4.41
15	601169	北京银行	133,720,725.56	4.26
16	002444	巨星科技	130,390,092.85	4.15
17	002123	梦网荣信	128,856,359.41	4.10
18	000558	莱茵体育	127,617,814.36	4.06
19	002111	威海广泰	123,809,617.35	3.94
20	002245	澳洋顺昌	122,697,294.12	3.90
21	000333	美的集团	122,403,850.11	3.90
22	601333	广深铁路	121,728,924.16	3.87
23	002502	骅威文化	121,185,089.19	3.86
24	600525	长园集团	119,839,124.72	3.81
25	000937	冀中能源	118,302,825.68	3.76
26	300294	博雅生物	117,746,142.12	3.75
27	002535	林州重机	116,641,286.16	3.71
28	300196	长海股份	115,456,533.23	3.67
29	600219	南山铝业	115,198,932.38	3.67
30	002196	方正电机	114,701,891.78	3.65
31	600198	大唐电信	114,395,387.45	3.64
32	000848	承德露露	114,338,471.00	3.64
33	000402	金 融 街	114,050,865.82	3.63
34	600869	智慧能源	113,123,138.29	3.60
35	002329	皇氏集团	113,003,054.15	3.60
36	600240	华业资本	111,930,422.97	3.56
37	002234	民和股份	111,895,698.99	3.56
38	002299	圣农发展	110,732,250.61	3.52
39	002450	康得新	110,270,578.31	3.51
40	000568	泸州老窖	109,937,959.38	3.50
41	600697	欧亚集团	109,754,903.94	3.49
42	600068	葛洲坝	109,207,006.44	3.48
43	600026	中远海能	108,083,364.09	3.44
44	601555	东吴证券	106,540,264.97	3.39
45	002172	澳洋科技	106,199,216.51	3.38
46	601336	新华保险	105,783,313.83	3.37
47	601111	中国国航	105,492,509.52	3.36
48	300083	劲胜精密	105,313,407.94	3.35
49	601601	中国太保	104,227,655.27	3.32

50	600079	人福医药	103,768,280.66	3.30
51	600048	保利地产	102,360,836.42	3.26
52	600114	东睦股份	101,871,639.11	3.24
53	600376	首开股份	101,740,958.74	3.24
54	600500	中化国际	101,681,098.91	3.24
55	601688	华泰证券	100,434,913.07	3.20
56	601186	中国铁建	98,409,739.59	3.13
57	002045	国光电器	97,013,277.01	3.09
58	002609	捷顺科技	96,599,662.57	3.07
59	600826	兰生股份	95,914,260.23	3.05
60	600547	山东黄金	95,508,451.94	3.04
61	000903	云内动力	95,015,143.84	3.02
62	600233	圆通速递	94,554,448.84	3.01
63	002554	惠博普	94,137,616.42	3.00
64	300014	亿纬锂能	93,534,750.21	2.98
65	603799	华友钴业	92,621,842.08	2.95
66	002120	韵达股份	91,972,268.11	2.93
67	600348	阳泉煤业	91,506,123.06	2.91
68	002185	华天科技	91,405,703.75	2.91
69	600138	中青旅	91,394,532.62	2.91
70	000998	隆平高科	90,630,394.22	2.88
71	300231	银信科技	90,294,310.69	2.87
72	002640	跨境通	90,159,268.00	2.87
73	002580	圣阳股份	89,422,143.08	2.85
74	600804	鹏博士	89,298,902.02	2.84
75	300144	宋城演艺	88,565,306.56	2.82
76	000661	长春高新	88,432,055.19	2.81
77	600360	华微电子	88,425,711.36	2.81
78	000501	鄂武商 A	88,094,029.31	2.80
79	600595	中孚实业	86,667,095.60	2.76
80	600884	杉杉股份	86,479,874.41	2.75
81	600259	广晟有色	85,957,507.41	2.74
82	601021	春秋航空	85,673,711.55	2.73
83	600467	好当家	85,069,614.98	2.71
84	600108	亚盛集团	84,864,173.65	2.70
85	000603	盛达矿业	84,302,853.21	2.68
86	002296	辉煌科技	84,227,945.01	2.68
87	000513	丽珠集团	83,967,247.70	2.67
88	600340	华夏幸福	83,819,286.62	2.67
89	600651	飞乐音响	83,771,448.14	2.67
90	600739	辽宁成大	83,394,179.21	2.65
91	600085	同仁堂	83,173,826.60	2.65
92	002048	宁波华翔	82,989,414.13	2.64
93	002410	广联达	82,568,591.31	2.63

94	002070	众和股份	82,401,545.44	2.62
95	000599	青岛双星	82,394,011.91	2.62
96	600487	亨通光电	81,430,578.16	2.59
97	600872	中炬高新	81,176,290.37	2.58
98	601699	潞安环能	80,374,525.62	2.56
99	002385	大北农	80,006,978.15	2.55
100	300097	智云股份	79,902,015.42	2.54
101	600195	中牧股份	79,890,232.24	2.54
102	000050	深天马 A	79,729,747.78	2.54
103	002183	怡亚通	78,601,378.12	2.50
104	002311	海大集团	77,994,863.96	2.48
105	600497	驰宏锌锗	77,950,835.83	2.48
106	600366	宁波韵升	77,528,536.19	2.47
107	600576	万家文化	77,151,756.57	2.46
108	000831	*ST 五稀	76,475,814.34	2.43
109	300011	鼎汉技术	76,231,834.60	2.43
110	600192	长城电工	76,163,792.00	2.42
111	000733	振华科技	76,066,759.30	2.42
112	000977	浪潮信息	76,020,128.80	2.42
113	601009	南京银行	74,850,114.93	2.38
114	300075	数字政通	74,405,520.00	2.37
115	300098	高新兴	74,017,197.26	2.36
116	000065	北方国际	73,738,557.36	2.35
117	600831	广电网络	73,539,357.58	2.34
118	002452	长高集团	72,649,884.43	2.31
119	600115	东方航空	70,872,886.36	2.26
120	000970	中科三环	70,798,017.43	2.25
121	300183	东软载波	70,765,112.04	2.25
122	000783	长江证券	70,290,489.13	2.24
123	002475	立讯精密	69,814,550.35	2.22
124	002519	银河电子	69,655,787.82	2.22
125	000703	恒逸石化	69,262,580.42	2.20
126	600285	羚锐制药	69,261,167.13	2.20
127	002078	太阳纸业	69,226,181.77	2.20
128	002445	中南文化	68,814,776.41	2.19
129	000670	*ST 盈方	68,166,834.34	2.17
130	000630	铜陵有色	67,870,259.39	2.16
131	600395	盘江股份	67,701,438.61	2.15
132	601628	中国人寿	67,478,664.49	2.15
133	600517	置信电气	67,375,581.39	2.14
134	300136	信维通信	67,367,159.57	2.14
135	002155	湖南黄金	67,145,303.04	2.14
136	000915	山大华特	67,090,499.05	2.14
137	603609	禾丰牧业	66,735,065.26	2.12

138	001979	招商蛇口	66,569,535.89	2.12
139	002050	三花智控	66,381,520.73	2.11
140	601766	中国中车	66,118,994.68	2.10
141	601233	桐昆股份	65,912,169.29	2.10
142	300316	晶盛机电	65,890,501.35	2.10
143	600406	国电南瑞	65,496,344.12	2.08
144	002036	联创电子	65,056,823.05	2.07
145	002355	兴民智通	64,847,067.64	2.06
146	300207	欣旺达	64,463,552.65	2.05
147	300310	宜通世纪	63,925,944.53	2.03
148	600061	国投安信	63,856,495.99	2.03
149	600970	中材国际	63,140,037.35	2.01
150	000758	中色股份	63,008,612.50	2.01
151	002281	光迅科技	62,977,846.42	2.00
152	600662	强生控股	62,938,368.60	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	32,859,816,370.08
卖出股票的收入（成交）总额	33,109,482,858.82

注：本项的“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	19,728,240.00	0.82
2	央行票据	-	-
3	金融债券	541,699,000.00	22.60
	其中：政策性金融债	541,699,000.00	22.60
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-

6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	561,427,240.00	23.43

**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**

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	160204	16 国开 04	1,500,000	149,955,000.00	6.26
2	160209	16 国开 09	1,500,000	149,850,000.00	6.25
3	080218	08 国开 18	600,000	60,006,000.00	2.50
4	080216	08 国开 16	500,000	51,210,000.00	2.14
5	100405	10 农发 05	500,000	50,030,000.00	2.09

**8.7 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。

**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投资。

**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投资。

**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**

无。

**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没有被监管部门立案调查的，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

8.12.2 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。

### 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	2,897,326.67
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	10,606,946.01
5	应收申购款	32,061.06
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	13,536,333.74

### 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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§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
173,849	19,306.90	153,592,876.21	4.58%	3,202,892,805.82	95.42%

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	886.71	0.00%

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

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2001 年 9 月 21 日)基金份额总额	5,000,001,124.00
本报告期期初基金份额总额	3,521,336,892.67
本报告期基金总申购份额	57,239,232.58
减：本报告期基金总赎回份额	222,090,443.22
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	3,356,485,682.03

注：申购含转换转入份额，赎回含转换转出份额。

## §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：

2016 年 9 月 21 日，基金管理人发布了华安创新证券投资基金基金经理变更公告，杨鑫鑫先生不再担任本基金的基金经理，廖发达先生继续管理本基金。

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：

无。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

### 11.4 基金投资策略的改变

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 102,000 元。

目前的审计机构已提供审计服务的连续年限：自成立日起至今。

### 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

本报告期内无管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 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	
华龙证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	14,792,256,500.93	22.43%	13,776,027.01	22.47%	-



国泰君安	2	12,015,274,315.83	18.22%	11,189,821.47	18.25%	-
中金公司	1	7,284,513,879.87	11.04%	6,784,055.35	11.06%	-
平安证券	1	4,962,314,973.10	7.52%	4,621,411.07	7.54%	-
海通证券	1	4,343,962,397.50	6.59%	4,045,538.25	6.60%	-
安信证券	1	4,011,145,432.97	6.08%	3,655,362.33	5.96%	-
东方证券	1	3,524,190,711.79	5.34%	3,282,084.44	5.35%	-
华泰证券	1	3,179,177,593.66	4.82%	2,960,773.88	4.83%	-
广发证券	1	2,727,059,613.18	4.13%	2,539,709.42	4.14%	-
国信证券	1	2,294,074,637.77	3.48%	2,136,474.37	3.48%	-
川财证券	1	2,024,047,871.89	3.07%	1,884,992.03	3.07%	-
方正证券	1	1,661,934,380.02	2.52%	1,547,756.11	2.52%	-
招商证券	1	931,626,688.17	1.41%	867,622.25	1.41%	-
东吴证券	1	931,383,276.36	1.41%	848,770.17	1.38%	-
国联证券	1	758,499,071.47	1.15%	706,386.32	1.15%	-
南京证券	1	519,678,933.94	0.79%	473,585.29	0.77%	-

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，最大限度地调调整体资源，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：

2016 年 5 月完成退租托管在交通银行的山西证券上海 20183 交易单元

2016 年 9 月完成租用托管在交通银行的东吴证券 001989 交易单元

2016 年 11 月完成租用托管在交通银行的南京证券 259001 交易单元

2016 年 12 月完成租用托管在交通银行的华龙证券上海 36667 交易单元

### 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
国信证券	8,048,157.50	100.00%	-	-	-	-

### §12 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

二〇一七年三月二十八日