

华安乐惠保本混合型证券投资基金
2017 年第 1 季度报告
2017 年 3 月 31 日

基金管理人：华安基金管理有限公司

基金托管人：中国民生银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一七年四月二十四日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 4 月 20 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

§2 基金产品概况

| | |
|------------|--|
| 基金简称 | 华安乐惠保本混合 |
| 基金主代码 | 002238 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2015 年 12 月 30 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 3,573,973,974.33 份 |
| 投资目标 | 通过运用投资组合保险技术，有效控制本金损失的风险，在本金安全的基础上力争实现基金资产的稳定增值。 |
| 投资策略 | 本基金采用基于 VaR 的风险乘数全程可变的 CPPI 策略(恒定比例组合保险策略)。基金管理人主要通过数量分析，根据市场的波动来调整和修正安全垫放大倍数（即风险乘数），动态调整固定收益类资产与权益类资产的投资比例，以确保基金在一段时间以后其价值不低于事先设定的某一目标价值，从而实现投资组合的保本增值目标。同时，本基金将通过对宏观经济、国家政策等可能影响证券市场 |

| | | |
|-----------------|--|--------------------|
| | 的重要因素的研究和预测，分析和比较不同证券子市场和不同金融工具的收益及风险特征，确定具体的投资券种选择，积极寻找各种可能的套利和价值增长机会。 | |
| 业绩比较基准 | 人民币两年期银行定期存款收益率（税后） | |
| 风险收益特征 | 本基金为保本混合型基金，属于证券投资基金中的低风险品种。 投资者投资于保本基金并不等于将资金作为存款放在银行或存款类金融机构，保本基金在极端情况下仍然存在本金损失的风险。 | |
| 基金管理人 | 华安基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 中国民生银行股份有限公司 | |
| 基金保证人 | 中国投融资担保股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 华安乐惠保本混合 A | 华安乐惠保本混合 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 002238 | 002239 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 2,305,879,377.93 份 | 1,268,094,596.40 份 |

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期 (2017 年 1 月 1 日-2017 年 3 月 31 日) | |
|----------------|---|------------------|
| | 华安乐惠保本混合 A | 华安乐惠保本混合 C |
| 1.本期已实现收益 | 2,418,219.31 | 372,674.81 |
| 2.本期利润 | 16,433,159.99 | 8,052,479.47 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0071 | 0.0064 |
| 4.期末基金资产净值 | 2,362,150,866.71 | 1,294,181,137.09 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.024 | 1.021 |

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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

1、华安乐惠保本混合 A：

| 阶段 | 净值增长率 ① | 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 | 0.69% | 0.05% | 0.52% | 0.01% | 0.17% | 0.04% |

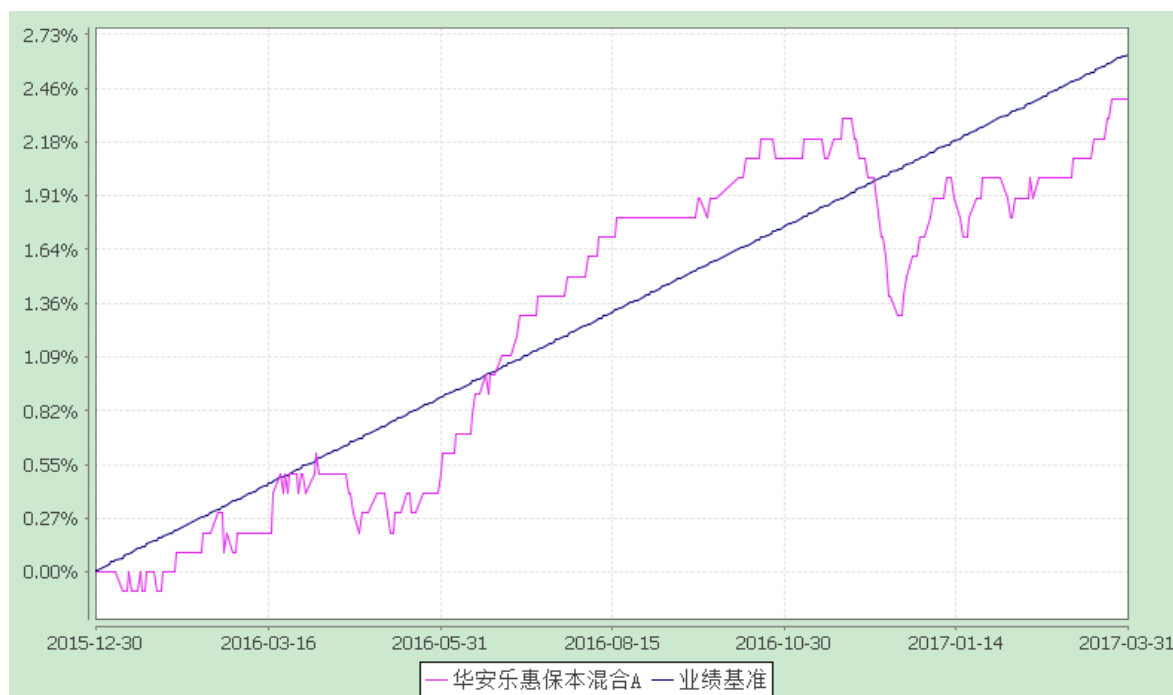
2、华安乐惠保本混合 C：

| 阶段 | 净值增长率 ① | 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 | 0.69% | 0.07% | 0.52% | 0.01% | 0.17% | 0.06% |

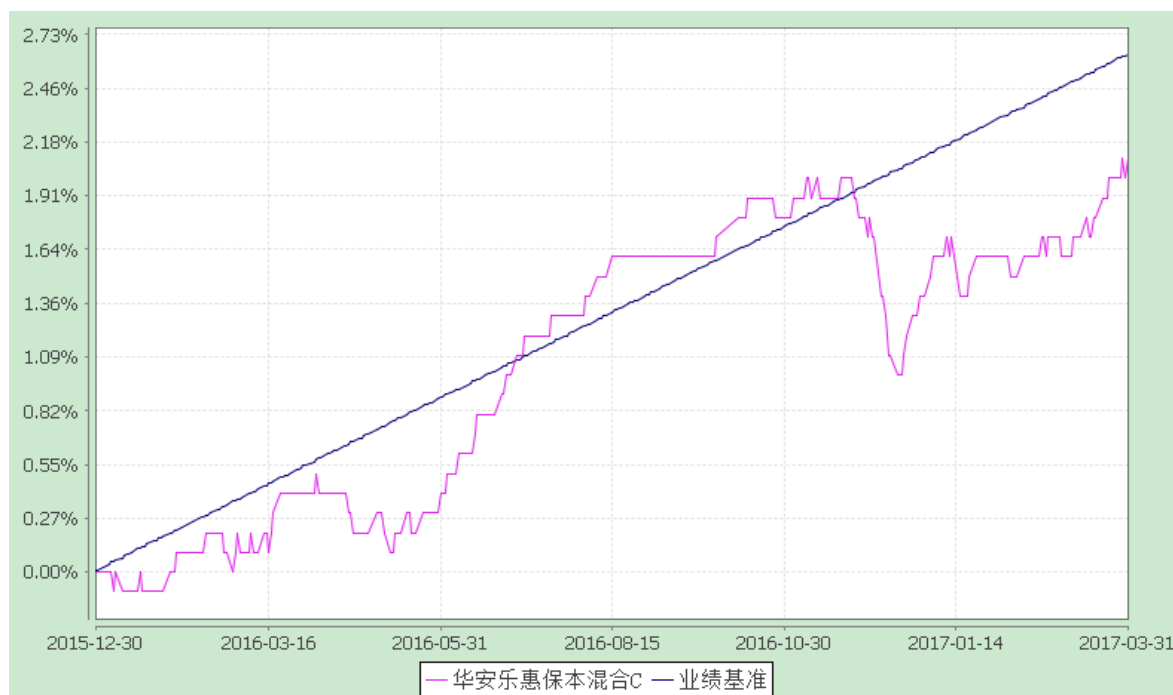
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华安乐惠保本混合型证券投资基金
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 12 月 30 日至 2017 年 3 月 31 日)

1. 华安乐惠保本混合 A：



2. 华安乐惠保本混合 C:



§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期 | 证券从业 | 说明 |
|----|----|------------|------|----|
|----|----|------------|------|----|

| | | 限 | | 年限 | |
|-----|--------------------|------------|------|------|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 郑可成 | 本基金的基金经理，固定收益部助理总监 | 2015-12-30 | - | 15 年 | <p>硕士研究生，15 年证券基金从业经历。2001 年 7 月至 2004 年 12 月在闽发证券有限责任公司担任研究员，从事债券研究及投资，2005 年 1 月至 2005 年 9 月在福建儒林投资顾问有限公司任研究员，2005 年 10 月至 2009 年 7 月在益民基金管理有限公司任基金经理，2009 年 8 月至今任职于华安基金管理有限公司固定收益部。2010 年 12 月起担任华安稳固收益债券型证券投资基金的基金经理。2012 年 9 月起同时担任华安安心收益债券型证券投资基金的基金经理。2012 年 11 月起同时担任华安日日鑫货币市场基金的基金经理。2012 年 12 月起同时担任华安信用增强债券型证券投资基金的基金经理。2013 年 5 月起同时担任华安保本混合型证券投资基金的基金经理。2014 年 8 月起同时担任华安七日鑫短期理财债券型证券投资基金、华安年年红定期开放债券型证券投资基金的基金经理。2015 年 3 月起担任华安新动力灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2015 年 5 月起同时担任华安新机遇保本混合型证券投资基金的基金经理。2015 年 6 月起同时担任华安添颐养老混合型发起式证券投资基金的基金经理；2015 年 11 月起，同时担任华安安益保本混合型证券投资基金基金的基金经理；2015 年 12 月起，同时担任本基金的基金经理。2016 年 2 月起，同时担任华安安康保本混合型证券投资基金的基金经理。2016 年 4 月起，同时担任华安安禧保本混合型证券投资基金的基金经理。2016 年 10 月起，同时担任华安润灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 2 月起，同时担</p> |

| | | | | | |
|----|------------------|------------|---|------|---|
| | | | | | 任华安安享灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 3 月起,同时担任华安现金宝货币市场基金的基金经理。 |
| 贺涛 | 本基金的基金经理、固定收益部总监 | 2015-12-30 | - | 19 年 | 金融学硕士(金融工程方向),19 年证券、基金从业经历。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。2008 年 4 月起担任华安稳定收益债券型证券投资基金的基金经理。2011 年 6 月起同时担任华安可转换债券债券型证券投资基金的基金经理。2012 年 12 月起同时担任华安信用增强债券型证券投资基金的基金经理。2013 年 6 月起同时担任华安双债添利债券型证券投资基金的基金经理、固定收益部助理总监。2013 年 8 月起担任固定收益部副总监。2013 年 10 月起同时担任华安现金富利投资基金、华安月月鑫短期理财债券型证券投资基金、华安季季鑫短期理财债券型证券投资基金、华安月安鑫短期理财债券型证券投资基金的基金经理。2014 年 7 月起同时担任华安汇财通货币市场基金的基金经理。2015 年 2 月起担任华安年年盈定期开放债券型证券投资基金的基金经理。2015 年 5 月起担任固定收益部总监。2015 年 5 月起担任华安新回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2015 年 9 月起担任华安新乐享保本混合型证券投资基金基金的基金经理;2015 年 12 月起,同时担任本基金的基金经理。2016 年 2 月起,同时担任华安安华保本混合型证券投资基金的基金经理。2016 年 7 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。2016 年 11 月起,同时担任华安睿享定期开放混合型发起式证券投资基金、华安新希望 |

| | | | | | |
|-----|----------|------------|---|------|---|
| | | | | | 灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 2 月起，同时担任华安新活力灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。 |
| 胡宜斌 | 本基金的基金经理 | 2016-01-06 | - | 5 年 | 硕士研究生，5 年证券、基金行业从业经验。曾任杭州核新同花顺股份有限公司产品经理、长江证券股份有限公司研究员、上投摩根基金管理有限公司研究员，2015 年 5 月加入华安基金，担任基金投资部基金经理助理。2015 年 11 月起担任本基金的基金经理。2016 年 1 月起担任本基金的基金经理。2016 年 11 月起，同时担任华安睿享定期开放混合型发起式证券投资基金的基金经理。 |
| 王嘉 | 本基金的基金经理 | 2016-02-03 | - | 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。2016 年 2 月起担任本基金、华安安康保本混合型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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了《华安基金管理有限公司公平交易管理制度》，将封闭式基金、开放式基金、特定客户资产管理组合及其他投资组合资产在研究分析、投资决策、交易执行等方面全部纳入公平交易管理中。控制措施包括：在研究环节，研究员在为公司管理的各类投资组合提供研究信息、投资建议过程中，使用晨会发言、发送邮件、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，则投资部门在风控部门的监督参与下，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；风险管理部根据市场公认的第三方信息（如：中债登的债券估值），定期对各投资组合与交易对手之间议价交易的交易价格公允性进行审查，对不同投资组合临近交易日的同向交易的交易时机和交易价差进行分析。本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

析系统，对相关同向交易指标进行持续监控，并定期对组合间的同向交易行为进行了重点分析。本报告期内，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，出现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的次数为 0 次，未出现异常交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2017 年 1 季度，美欧经济持续复苏，美联储如期加息，市场反应较为平静。国内经济保持近年来较高增速，同时通胀水平低于预期，企业利润开始向好。在此背景下，央行持续在公开市场上回笼货币，市场资金虽有季节性波动，但没有出现交易风险，债券收益率窄幅波动。权益市场呈现结构性行情，指数总体上涨。

本基金保持了债券的基本配置，适度降低了基金的杠杆，保持组合的低久期。在权益投资上保持较积极的态度，参与结构化行情，取得了正收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2017 年 3 月 31 日，华安乐惠保本混合 A 份额净值为 1.024 元，C 份额净值为 1.021 元；华安乐惠保本混合 A 份额净值增长率为 0.69%，C 份额净值增长率为 0.69%，同期业绩比较基准增长率为 0.52%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望二季度，我们判断宏观经济仍将保持温和复苏态势，企业盈利继续保持改善势头，积极的财政政策和稳健的货币政策有利于资本市场的稳定。外部环境逐渐稳定和明朗，欧美经济的复苏有利于继续带动全球的经济热度。权益市场总体风险不大，仍将演绎结构性行情。其中，供给侧改革和区域经济振兴仍将是政策的着力点和市场的关注点。债券市场仍将面临半年末的资金面以及信用风险事件的考验，但当前的收益率水平已经有配置价值。

本基金将继续保持低久期、低杠杆的债券组合，配置对象以高等级信用债为主。权益方面将根据市场热点主题和趋势进行自下而上的投资，同时积极参与网下新股申购，主动获取绝对回报。

本基金将秉承稳健、专业的投资理念，勤勉尽责地维护持有人的利益。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产的比例(%) |
|----|-------------------|------------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | 140,314,617.18 | 3.83 |
| | 其中：股票 | 140,314,617.18 | 3.83 |
| 2 | 固定收益投资 | 1,638,048,746.30 | 44.74 |
| | 其中：债券 | 1,638,048,746.30 | 44.74 |
| | 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 | 580,002,750.00 | 15.84 |
| | 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 | 1,282,512,907.73 | 35.03 |
| 7 | 其他各项资产 | 20,003,279.35 | 0.55 |
| 8 | 合计 | 3,660,882,300.56 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|----------------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 102,914,272.12 | 2.81 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | 307,027.03 | 0.01 |
| F | 批发和零售业 | 31,341,049.60 | 0.86 |

| | | | |
|---|-----------------|----------------|------|
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 204,846.02 | 0.01 |
| J | 金融业 | 422,666.40 | 0.01 |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | 5,055,476.04 | 0.14 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 16,930.16 | 0.00 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | - |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 52,349.81 | 0.00 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 140,314,617.18 | 3.84 |

5.3 报告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

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量(股) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|-----------|---------------|--------------|
| 1 | 002366 | 台海核电 | 917,173 | 46,207,175.74 | 1.26 |
| 2 | 600693 | 东百集团 | 2,352,192 | 31,284,153.60 | 0.86 |
| 3 | 300285 | 国瓷材料 | 709,351 | 28,395,320.53 | 0.78 |
| 4 | 002694 | 顾地科技 | 510,305 | 18,524,071.50 | 0.51 |
| 5 | 600688 | 上海石化 | 973,200 | 6,228,480.00 | 0.17 |
| 6 | 600093 | 禾嘉股份 | 370,908 | 5,055,476.04 | 0.14 |
| 7 | 002839 | 张家港行 | 14,352 | 422,666.40 | 0.01 |
| 8 | 300616 | 尚品宅配 | 1,858 | 286,132.00 | 0.01 |
| 9 | 603986 | 兆易创新 | 1,133 | 238,043.30 | 0.01 |
| 10 | 300625 | 三雄极光 | 3,934 | 217,038.78 | 0.01 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------|---------|--------------|
| 1 | 国家债券 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |

| | | | |
|----|-----------|------------------|-------|
| 3 | 金融债券 | 320,456,000.00 | 8.76 |
| | 其中：政策性金融债 | 320,456,000.00 | 8.76 |
| 4 | 企业债券 | 57,726,000.00 | 1.58 |
| 5 | 企业短期融资券 | 549,513,000.00 | 15.03 |
| 6 | 中期票据 | 100,840,000.00 | 2.76 |
| 7 | 可转债（可交换债） | 27,023,746.30 | 0.74 |
| 8 | 同业存单 | 582,490,000.00 | 15.93 |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 1,638,048,746.30 | 44.80 |

5.5 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债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|---------------|-----------|----------------|--------------|
| 1 | 160211 | 16 国开 11 | 1,700,000 | 169,898,000.00 | 4.65 |
| 2 | 011698669 | 16 首旅 SCP008 | 1,000,000 | 100,160,000.00 | 2.74 |
| 3 | 011698616 | 16 南航股 SCP010 | 1,000,000 | 99,750,000.00 | 2.73 |
| 4 | 011611010 | 16 大唐集 SCP010 | 1,000,000 | 99,720,000.00 | 2.73 |
| 5 | 111711121 | 17 平安银行 CD121 | 1,000,000 | 98,910,000.00 | 2.71 |

5.6 报告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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证投资。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。若本基金投资股指期货，本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。

本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。

本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。

法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的，本基金将按法律法规的规定执行。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同，本基金不能投资于国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 2016 年 6 月 3 日，顾地科技股份有限公司收到了中国证监会湖北监管局《行政处罚事先告知书》（鄂处罚字【2016】1 号）原因为涉嫌违反证券法律法规，被中国证监会给予警告，并处以三十万元的罚款；对广东顾地给予警告，并处以六十万元的罚款；对相关责任人也给予警告以及相应的罚款处罚。本报告期内，本基金投资的前十名其他证券的发行主体没有被监管部门立案调查的，也没有在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|----|-------|------------|
| 1 | 存出保证金 | 171,722.41 |

| | | |
|---|---------|---------------|
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 19,831,556.94 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 20,003,279.35 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|--------------|--------------|
| 1 | 128013 | 洪涛转债 | 181,615.00 | 0.00 |
| 2 | 113010 | 江南转债 | 732,421.20 | 0.02 |
| 3 | 127003 | 海印转债 | 944,919.00 | 0.03 |
| 4 | 110034 | 九州转债 | 1,465,662.20 | 0.04 |
| 5 | 128010 | 顺昌转债 | 3,032,505.90 | 0.08 |
| 6 | 113009 | 广汽转债 | 8,589,623.00 | 0.23 |

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|----------------|--------------|----------|
| 1 | 002839 | 张家港行 | 422,666.40 | 0.01 | 股票交易异常波动 |

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 华安乐惠保本混合A | 华安乐惠保本混合C |
|--------------|------------------|------------------|
| 本报告期期初基金份额总额 | 2,305,879,377.93 | 1,268,094,596.40 |

| | | |
|--------------|------------------|------------------|
| 报告期基金总申购份额 | - | - |
| 减：报告期基金总赎回份额 | - | - |
| 报告期基金拆分变动份额 | - | - |
| 本报告期末基金份额总额 | 2,305,879,377.93 | 1,268,094,596.40 |

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

无

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

- 1、《华安乐惠保本混合型证券投资基金基金合同》
- 2、《华安乐惠保本混合型证券投资基金招募说明书》
- 3、《华安乐惠保本混合型证券投资基金托管协议》

8.2 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>。

8.3 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
二〇一七年四月二十四日