

**华安新瑞利灵活配置混合型证券投资基金**  
**2017 年半年度报告摘要**  
**2017 年 6 月 30 日**

基金管理人：华安基金管理有限公司

基金托管人：中信银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一七年八月二十五日

## 1 重要提示

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                  |                  |
|-----------------|------------------|------------------|
| 基金简称            | 华安新瑞利灵活配置混合      |                  |
| 基金主代码           | 003797           |                  |
| 交易代码            | 003797           |                  |
| 基金运作方式          | 契约型开放式           |                  |
| 基金合同生效日         | 2016 年 12 月 1 日  |                  |
| 基金管理人           | 华安基金管理有限公司       |                  |
| 基金托管人           | 中信银行股份有限公司       |                  |
| 报告期末基金份额总额      | 600,041,392.61 份 |                  |
| 下属分级基金的基金简称     | 华安新瑞利灵活配置混合<br>A | 华安新瑞利灵活配置混合<br>C |
| 下属分级基金的交易代码     | 003797           | 003798           |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 600,039,600.63 份 | 1,791.98 份       |

### 2.2 基金产品说明

|        |   |
|--------|---|
| 投资目标   | 本基金在严格控制风险的前提下,通过大类资产的优化配置和高安全边界的证券精选,追求超越业绩比较基准的投资回报和资产的长期稳健增值。  |
| 投资策略   | 本基金采取相对灵活的资产配置策略,通过将基金资产在权益类、固定收益类工具之间灵活配置,并适当借用金融衍生品的投资来追求基金资产的长期稳健增值。在具体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。 |
| 业绩比较基准 | 中证 800 指数收益率×50%+中债综合全价指数收益率×50%  |
| 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           | 中信银行股份有限公司            |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名   | 钱鲲                   | 方韡                    |
|             | 联系电话 | 021-38969999         | 4006800000            |
|             | 电子邮箱 | qiankun@huaan.com.cn | fangwei@citicbank.com |
| 客户服务电话      |      | 4008850099           | 95558                 |
| 传真          |      | 021-68863414         | 010-85230024          |

## 2.4 信息披露方式

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

## 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期（2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日） |               |
|---------------|--------------------------------------|---------------|
|               | 华安新瑞利灵活配置混合 A                        | 华安新瑞利灵活配置混合 C |
| 本期已实现收益       | 11,134,655.37                        | 92.00         |
| 本期利润          | 17,784,435.42                        | 151.80        |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0296                               | 0.0313        |
| 本期基金份额净值增长率   | 2.95%                                | 2.91%         |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2017 年 6 月 30 日)                |               |
|               | 华安新瑞利灵活配置混合 A                        | 华安新瑞利灵活配置混合 C |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.0209                               | 0.0204        |
| 期末基金资产净值      | 619,267,584.34                       | 1,848.49      |
| 期末基金份额净值      | 1.0320                               | 1.0315        |

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华安新瑞利灵活配置混合 A

| 阶段       | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③    | ②—④    |
|----------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去 1 个月  | 0.76%    | 0.06%       | 3.00%      | 0.32%         | -2.24% | -0.26% |
| 过去 3 个月  | 1.88%    | 0.06%       | 1.10%      | 0.34%         | 0.78%  | -0.28% |
| 过去 6 个月  | 2.95%    | 0.05%       | 2.42%      | 0.31%         | 0.53%  | -0.26% |
| 自基金成立起至今 | 3.20%    | 0.05%       | -1.44%     | 0.34%         | 4.64%  | -0.29% |

华安新瑞利灵活配置混合 C

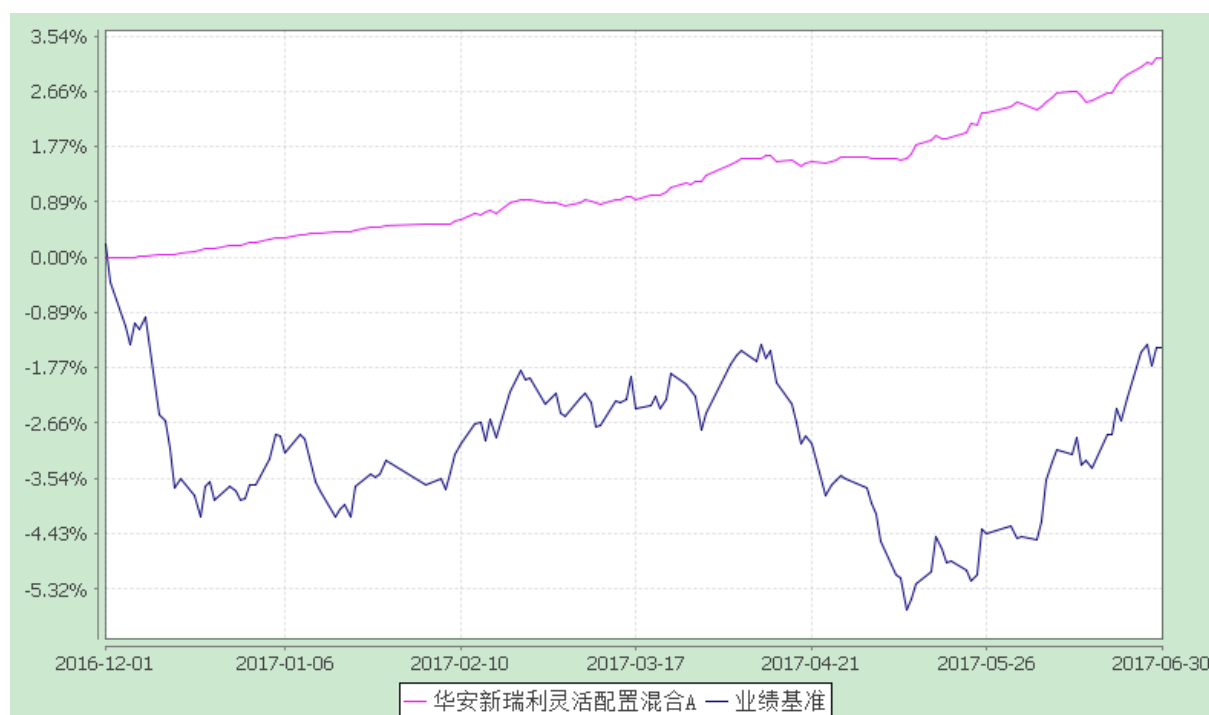
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③ | ②—④ |
|----|----------|-------------|------------|---------------|-----|-----|
|----|----------|-------------|------------|---------------|-----|-----|

|          |       |       |        |       |        |        |
|----------|-------|-------|--------|-------|--------|--------|
| 过去 1 个月  | 0.76% | 0.06% | 3.00%  | 0.32% | -2.24% | -0.26% |
| 过去 3 个月  | 1.87% | 0.06% | 1.10%  | 0.34% | 0.77%  | -0.28% |
| 过去 6 个月  | 2.91% | 0.05% | 2.42%  | 0.31% | 0.49%  | -0.26% |
| 自基金成立起至今 | 3.15% | 0.05% | -1.44% | 0.34% | 4.59%  | -0.29% |

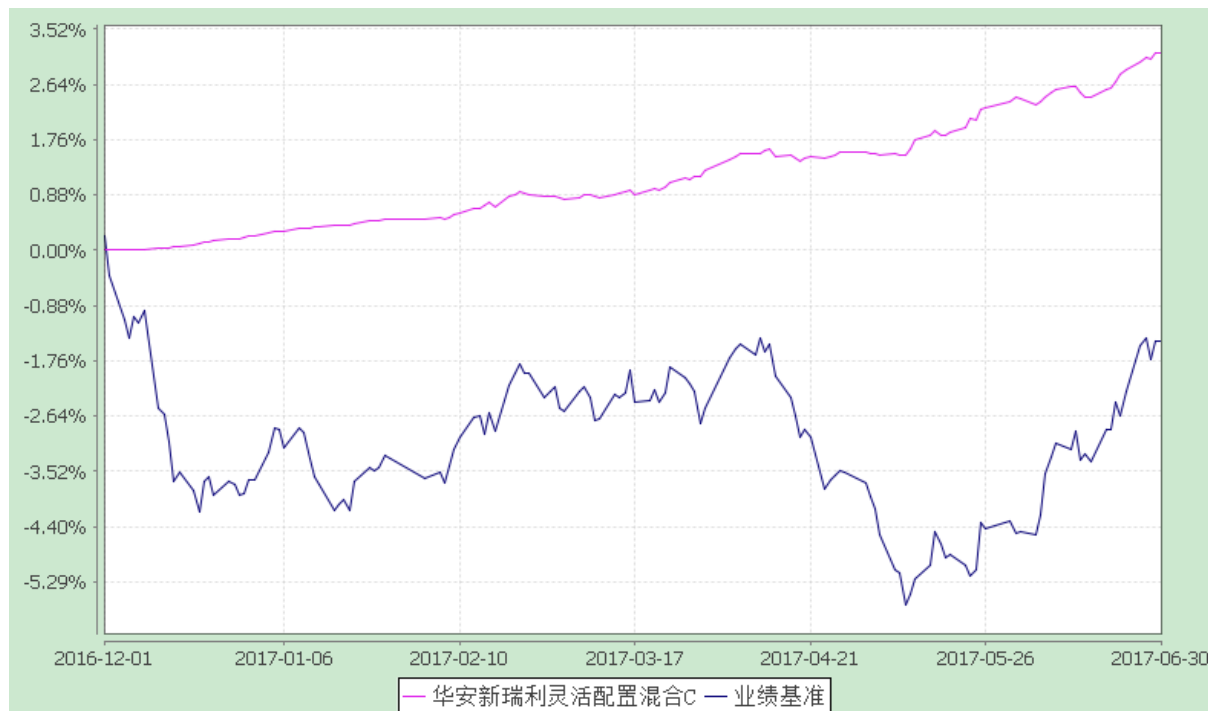
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华安新瑞利灵活配置混合型证券投资基金  
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
 (2016 年 12 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日)

华安新瑞利灵活配置混合 A



华安新瑞利灵活配置混合 C



#### 4 管理人报告

##### 4.1 基金管理人及基金经理情况

###### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

华安基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1998]20 号文批准于 1998 年 6 月设立，是国内首批基金管理公司之一，注册资本 1.5 亿元人民币，公司总部设在上海陆家嘴金融贸易区。目前的股东为上海电气（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。公司在北京、上海、沈阳、成都、广州等地设有分公司，在香港和上海设有子公司—华安（香港）资产管理有限公司、华安未来资产管理有限公司。截至 2017 年 6 月 30 日，公司旗下共管理华安创新混合、华安 MSCI 中国 A、华安现金富利货币、华安稳定收益债券、华安黄金易 ETF、华安沪港深外延增长混合、华安全球美元收益债券等 96 只开放式基金，管理资产规模达到 1478.85 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 |        |                  |
| 石雨欣 | 本基金的基金 | 2016-12-0       | -    | 10 年   | 硕士研究生，10 年相关行业从业 |

|  |    |   |  |  |
|--|----|---|--|--|
|  | 经理 | 1 |  | <p>经验,曾任联合资信评估有限公司高级分析师。2008 年 1 月加入华安基金管理有限公司,任固定收益部信用分析师。2015 年 7 月起担任华安稳固收益债券型证券投资基金的基金经理。2015 年 7 月至 2017 年 6 月担任华安信用四季红债券型证券投资基金的基金经理。2016 年 2 月起担任华安安康保本混合型证券投资基金的基金经理。2016 年 8 月起同时担任华安聚利 18 个月定期开放债券型证券投资基金的基金经理。2016 年 12 月起,同时担任华安新恒利灵活配置混合型证券投资基金、本基金的基金经理。2017 年 1 月起,同时担任华安新安平灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。</p> |
|--|----|---|--|--|

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

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,公司制定了《华安基金管理有限公司公平交易管理制度》,将封闭式基金、开放式基金、特定客户资产管理组合及其他投资组合资产在研究分析、投资决策、交易执行等方面全部纳入公平交易管理中。控制措施包括:在研究环节,研究员在为公司管理的各类投资组合提供研究信息、投资建议过程中,使用晨会发言、邮件发送、登录在研究报告管理系统中等方式来确保各类投资组合经理可以公平享有信息获取机会。在投资环节,公司各投资组合经理根据投资组合的风格和投资策略,制定并严格执行交易决策规则,以保证各投资组合交易决策的客观性和独立性。同时严格执行投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体授权机制,投资组合经理在授权范围内自主决策,超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易环节,公司实行强制公平交易机制,确保各投资组合享有公平的交易

执行机会。(1) 交易所二级市场业务, 遵循价格优先、时间优先、比例分配、综合平衡的控制原则, 实现同一时间下达指令的投资组合在交易时机上的公平性。(2) 交易所一级市场业务, 投资组合经理按意愿独立进行业务申报, 集中交易部以投资组合名义对外进行申报。若该业务以公司名义进行申报与中签, 则按实际中签情况以价格优先、比例分配原则进行分配。若中签量过小无法合理进行比例分配, 且以公司名义获得, 则投资部门在合规监察员监督参与下, 进行公平协商分配。(3) 银行间市场业务遵循指令时间优先原则, 先到先询价的控制原则。通过内部共同的 iwind 群, 发布询价需求和结果, 做到信息公开。若是多个投资组合进行一级市场投标, 则各投资组合经理须以各投资组合名义向集中交易部下达投资意向, 交易员以此进行投标, 以确保中签结果与投资组合投标意向一一对应。若中签量过小无法合理进行比例分配, 且以公司名义获得, 则投资部门在风险管理部投资监督参与下, 进行公平协商分配。交易监控、分析与评估环节, 公司风险管理部对公司旗下的各投资组合投资境内证券市场上市交易的投资品种、进行场外的非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购、不同投资组合同日和临近交易日的反向交易以及可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控, 根据市场公认的第三方信息(如: 中债登的债券估值), 定期对各投资组合与交易对手之间议价交易的交易价格公允性进行审查, 对不同投资组合临近交易日的同向交易的交易时机和交易价差进行分析。

本报告期内, 公司公平交易制度总体执行情况良好。

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

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

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

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2017 年上半年随着房地产和基建对经济的提振以及欧美经济的复苏带动, GDP 增速始终保持在



6.9%的较高增速。工业生产保持平稳增长，工业增加值稳步回升，工业企业收入和盈利均保持良好的增长态势。上半年房地产调控不断升级，房地产销售增速有所下滑，但房地产投资增速回升，土地购置面积增速进一步上升；同时由于财政支出力度加大，基建保持了稳定的增长态势，制造业投资也有所恢复，投资总体上保持平稳增长。伴随欧美经济持续复苏，进出口出现显著恢复，出口对经济产生一定正面拉动作用。因此，上半年经济增长保持了较好的增长态势。上半年通胀总体保持温和，受食品价格的影响，CPI 前低后高，但总体上保持在 1.5%以下的温和水平；PPI 上半年随着工业品价格的波动冲高回落，二季度 PPI 已经出现明显回落趋势。货币政策调控目标从保持经济增长转为降杠杆、防风险，央行一季度通过上调公开市场利率以及 MLF 等政策性工具利率，引导金融市场资金成本抬升，从而抑制金融杠杆的扩张。二季度在监管力度进一步加强对背景下，通过公开市场操作以及调节 MLF 投放力稳定市场预期，保持资金面的稳定。上半年债券市场在经济基本面保持稳定增长以及监管升级的影响下收益率总体震荡上行，上半年中债综合全价(总值)指数下跌 2.12%。上半年股票市场受无风险利率震荡上行的影响表现为震荡行情，消费、金融等板块表现良好，中小盘股票走势偏弱。

本基金上半年在货币市场利率大幅调整过程中逢高增配高等级信用债和同业存单，货币化操作规避了市场调整的风险，债券部分取得正收益；权益部分保持一定股票仓位，并积极参与股票一级市场申购，增厚组合收益，期内基金表现超越比较基准。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2017 年 6 月 30 日，华安新瑞利 A 份额净值为 1.032 元，C 份额净值为 1.0315 元；华安新瑞利 A 份额净值增长率为 2.95%，同期业绩比较基准增长率为 2.24%，C 份额净值增长率为 2.91%，同期业绩比较基准增长率为 2.24%。

#### 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 2017 年下半年，随着财政支出力度的减弱以及地方债务整顿，基建增速下半年可能放缓，房地产调控的滞后效应可能在下半年逐步显现，同时企业去库存周期已经接近尾声，下半年经济增速有一定下滑风险。通胀水平三季度可能略有回升，但总体仍处于相对温和的水平，通胀对货币政策的压力相对可控。虽然近期 6 月份由于季节性因素，央行加大了对市场的投放力度，但从近期央行表态来看，中性的货币政策取向并未发生转变，金融防风险的进程还未结束，货币政策难言大幅放松，但基本面也不支持货币政策进一步收紧。总体上债券市场下半年的市场环境会好于上半年，债券的配置价值逐步显现。下半年经济增长可能放缓，预计下半年股票市场估值的分化将会收窄，业绩的预期差将决定股价的相对表现。

本基金下半年计划对债券继续采取短久期高等级配置为主，保持组合流动性，同时如果市场有调整，择机适当拉长久期；权益部分保持股票仓位，同时积极参与股票一级市场申购。

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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期不进行收益分配。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

### 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

作为本基金的托管人，中信银行严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对华安新瑞利灵活配置混合型基金 2017 年度基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，华安管理有限公司在华安新瑞利灵活配置混合型基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

## 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，华安基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的华安新瑞利灵活配置混合型证券投资基金 2017 年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

# 6 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：华安新瑞利灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产         | 本期末<br>2017 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2016 年 12 月 31 日 |
|------------|------------------------|--------------------------|
| <b>资产：</b> | -                      | -                        |
| 银行存款       | 5,678,196.77           | 233,424,508.04           |
| 结算备付金      | 27,405.00              | -                        |
| 存出保证金      | 27,173.69              | -                        |
| 交易性金融资产    | 610,309,763.58         | 127,019,000.00           |
| 其中：股票投资    | 65,154,123.28          | -                        |
| 基金投资       | -                      | -                        |
| 债券投资       | 545,155,640.30         | 127,019,000.00           |
| 资产支持证券投资   | -                      | -                        |
| 贵金属投资      | -                      | -                        |
| 衍生金融资产     | -                      | -                        |
| 买入返售金融资产   | -                      | 240,000,000.00           |
| 应收证券清算款    | -                      | -                        |
| 应收利息       | 3,788,085.08           | 1,389,258.74             |
| 应收股利       | -                      | -                        |
| 应收申购款      | -                      | -                        |
| 递延所得税资产    | -                      | -                        |

|                 |                        |                         |
|-----------------|------------------------|-------------------------|
| 其他资产            | -                      | -                       |
| 资产总计            | 619,830,624.12         | 601,832,766.78          |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>本期末</b>             | <b>上年度末</b>             |
|                 | <b>2017 年 6 月 30 日</b> | <b>2016 年 12 月 31 日</b> |
| <b>负债:</b>      | -                      | -                       |
| 短期借款            | -                      | -                       |
| 交易性金融负债         | -                      | -                       |
| 衍生金融负债          | -                      | -                       |
| 卖出回购金融资产款       | -                      | -                       |
| 应付证券清算款         | -                      | -                       |
| 应付赎回款           | -                      | -                       |
| 应付管理人报酬         | 303,800.95             | 295,329.64              |
| 应付托管费           | 50,633.50              | 49,221.61               |
| 应付销售服务费         | 0.52                   | -                       |
| 应付交易费用          | 23,278.43              | 3,087.25                |
| 应交税费            | -                      | -                       |
| 应付利息            | -                      | -                       |
| 应付利润            | -                      | -                       |
| 递延所得税负债         | -                      | -                       |
| 其他负债            | 183,477.89             | 30,000.00               |
| 负债合计            | 561,191.29             | 377,638.50              |
| <b>所有者权益:</b>   | -                      | -                       |
| 实收基金            | 600,041,392.61         | 600,011,815.21          |
| 未分配利润           | 19,228,040.22          | 1,443,313.07            |
| 所有者权益合计         | 619,269,432.83         | 601,455,128.28          |
| 负债和所有者权益总计      | 619,830,624.12         | 601,832,766.78          |

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，A 类份额净值 1.0320 元，C 类份额净值 1.0315 元，其中 A 类基金份额总额 600,039,600.63 份，C 类基金份额总额 1,791.98 份。

## 6.2 利润表

会计主体：华安新瑞利灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目          | 本期<br>2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日 |
|-------------|---------------------------------------|
| <b>一、收入</b> | <b>20,185,904.10</b>                  |
| 1.利息收入      | 10,956,051.04                         |
| 其中：存款利息收入   | 3,565,761.70                          |
| 债券利息收入      | 5,608,359.74                          |
| 资产支持证券利息收入  | -                                     |
| 买入返售金融资产收入  | 1,781,929.60                          |

|                            |                      |
|----------------------------|----------------------|
| 其他利息收入                     | -                    |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）           | 2,579,957.96         |
| 其中：股票投资收益                  | 1,688,846.24         |
| 基金投资收益                     | -                    |
| 债券投资收益                     | 104,256.14           |
| 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                       | 786,855.58           |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）      | 6,649,839.85         |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）          | -                    |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）          | 55.25                |
| <b>减：二、费用</b>              | <b>2,401,316.88</b>  |
| 1. 管理人报酬                   | 1,809,514.01         |
| 2. 托管费                     | 301,585.68           |
| 3. 销售服务费                   | 2.10                 |
| 4. 交易费用                    | 84,281.78            |
| 5. 利息支出                    | -                    |
| 其中：卖出回购金融资产支出              | -                    |
| 6. 其他费用                    | 205,933.31           |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> | <b>17,784,587.22</b> |
| 减：所得税费用                    | -                    |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   | <b>17,784,587.22</b> |

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安新瑞利灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                                | 本期<br>2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日 |               |                |
|-----------------------------------|---------------------------------------|---------------|----------------|
|                                   | 实收基金                                  | 未分配利润         | 所有者权益合计        |
| 一、期初所有者权益（基金净值）                   | 600,011,815.21                        | 1,443,313.07  | 601,455,128.28 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）          | -                                     | 17,784,587.22 | 17,784,587.22  |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列） | 29,577.40                             | 139.93        | 29,717.33      |
| 其中：1.基金申购款                        | 56,750.96                             | 705.41        | 57,456.37      |
| 2.基金赎回款                           | -27,173.56                            | -565.48       | -27,739.04     |
| 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）             | 600,041,392.61 | 19,228,040.22 | 619,269,432.83 |

注：本基金于 2016 年 12 月 1 日成立，截止本报告期末，本基金成立不满一年，无上年度可比数。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：朱学华，主管会计工作负责人：赵敏，会计机构负责人：陈林

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

华安新瑞利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〔2016〕2607 号《关于准予华安新瑞利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 2016 年 11 月 23 日到 2016 年 11 月 28 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（2016）验字第 60971571\_B23 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 2016 年 12 月 1 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 600,011,814.92 元，在募集期间产生的存款利息为人民币 0.29 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 600,011,815.21 元，折合 600,011,815.21 份基金份额，其中 A 类基金份额 600,010,111.19 份，C 类基金份额 1,704.02 份。本基金的基金管理人及注册登记机构为华安基金管理有限公司，基金托管人为中信银行股份有限公司。

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、地方政府债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、短期融资券、超短期融资券、中期票据、中小企业私募债等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

本基金将根据法律法规的规定参与融资业务。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：股票占基金资产的比例为 0-95%；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：中证 800 指数收益率×50%+中债综合全价指数收益率×50%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部颁布的《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。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

#### 6.4.4 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.4.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

##### 6.4.4.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

##### 6.4.4.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 6.4.5 税项

##### 6.4.6.1 印花税

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

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

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

#### 6.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理



人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

#### 6.4.6.3 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

#### 6.4.6.4 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

## 6.4.6 关联方关系

### 6.4.6.1 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称                | 与本基金的关系             |
|----------------------|---------------------|
| 华安基金管理有限公司(“华安基金公司”) | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |
| 中信银行股份有限公司(“中信银行”)   | 基金托管人、基金代销机构        |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

#### 6.4.7.1.1 股票交易

无。

#### 6.4.7.1.2 权证交易

无。

#### 6.4.7.1.3 债券交易

无。

#### 6.4.7.1.4 债券回购交易

无。

#### 6.4.7.1.5 应支付关联方的佣金

无。

### 6.4.7.2 关联方报酬

#### 6.4.7.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2017年1月1日至2017年6月30日 |
|-----------------|----------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 1,809,514.01               |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | -                          |

**6.4.7.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

| 项目             | 本期                   |
|----------------|----------------------|
|                | 2017年1月1日至2017年6月30日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 301,585.68           |

**6.4.7.2.3 销售服务费**

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期                   |               |      |
|----------------|----------------------|---------------|------|
|                | 2017年1月1日至2017年6月30日 |               |      |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费     |               |      |
|                | 华安新瑞利灵活配置混合 A        | 华安新瑞利灵活配置混合 C | 合计   |
| 中信银行           | -                    | 2.10          | 2.10 |
| 合计             | -                    | 2.10          | 2.10 |

**6.4.7.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

无。

**6.4.7.4 各关联方投资本基金的情况**

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

无。

**6.4.7.5 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                   |           |
|------------|----------------------|-----------|
|            | 2017年1月1日至2017年6月30日 |           |
|            | 期末余额                 | 当期利息收入    |
| 中信银行股份有限公司 | 5,678,196.77         | 40,734.23 |

**6.4.7.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

无。

**6.4.7.7 其他关联交易事项的说明**

无。

### 6.4.8 期末（2017 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

#### 6.4.8.1 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

| 6.4.8.1.1 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       | 流通受限类型 | 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 |
| 603305              | 旭升股份 | 2017-06-30 | 2017-07-10 | 网下中签   | 11.26 | 11.26  | 1,351.00 | 15,212.26 | 15,212.26 | -  |
| 603331              | 百达精工 | 2017-06-27 | 2017-07-05 | 网下中签   | 9.63  | 9.63   | 999.00   | 9,620.37  | 9,620.37  | -  |
| 603617              | 君禾股份 | 2017-06-23 | 2017-07-03 | 网下中签   | 8.93  | 8.93   | 832.00   | 7,429.76  | 7,429.76  | -  |
| 603933              | 睿能科技 | 2017-06-28 | 2017-07-06 | 网下中签   | 20.20 | 20.20  | 857.00   | 17,311.40 | 17,311.40 | -  |

#### 6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有流通受限股票

#### 6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

### 6.4.9 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

#### 6.4.9.1 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。

#### 6.4.9.2 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。

#### 6.4.9.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2017 年 8 月 23 日经本基金的基金管理人批准。

## 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|----|----|---------------|
|----|----|----|---------------|

|   |                   |                |        |
|---|-------------------|----------------|--------|
| 1 | 权益投资              | 65,154,123.28  | 10.51  |
|   | 其中：股票             | 65,154,123.28  | 10.51  |
| 2 | 固定收益投资            | 545,155,640.30 | 87.95  |
|   | 其中：债券             | 545,155,640.30 | 87.95  |
|   | 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      | 5,705,601.77   | 0.92   |
| 7 | 其他各项资产            | 3,815,258.77   | 0.62   |
| 8 | 合计                | 619,830,624.12 | 100.00 |

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别             | 公允价值（元）       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|---------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | -             | -            |
| B  | 采矿业              | 4,035,332.00  | 0.65         |
| C  | 制造业              | 7,845,963.59  | 1.27         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 9,677,795.00  | 1.56         |
| E  | 建筑业              | 2,129,600.00  | 0.34         |
| F  | 批发和零售业           | -             | -            |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 13,597,881.00 | 2.20         |
| H  | 住宿和餐饮业           | -             | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | -             | -            |
| J  | 金融业              | 27,867,551.69 | 4.50         |
| K  | 房地产业             | -             | -            |
| L  | 租赁和商务服务业         | -             | -            |
| M  | 科学研究和技术服务业       | -             | -            |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | -             | -            |

|   |               |               |       |
|---|---------------|---------------|-------|
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | -             | -     |
| P | 教育            | -             | -     |
| Q | 卫生和社会工作       | -             | -     |
| R | 文化、体育和娱乐业     | -             | -     |
| S | 综合            | -             | -     |
|   | 合计            | 65,154,123.28 | 10.52 |

### 7.2.2 报告期末按行业分类的深港通投资股票投资组合

无。

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量(股)   | 公允价值         | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|---------|--------------|--------------|
| 1  | 601318 | 中国平安 | 58,600  | 2,907,146.00 | 0.47         |
| 2  | 600009 | 上海机场 | 77,300  | 2,884,063.00 | 0.47         |
| 3  | 600036 | 招商银行 | 113,600 | 2,716,176.00 | 0.44         |
| 4  | 601398 | 工商银行 | 517,300 | 2,715,825.00 | 0.44         |
| 5  | 600519 | 贵州茅台 | 5,700   | 2,689,545.00 | 0.43         |
| 6  | 600104 | 上汽集团 | 84,100  | 2,611,305.00 | 0.42         |
| 7  | 601006 | 大秦铁路 | 302,100 | 2,534,619.00 | 0.41         |
| 8  | 600900 | 长江电力 | 163,600 | 2,516,168.00 | 0.41         |
| 9  | 600886 | 国投电力 | 308,700 | 2,438,730.00 | 0.39         |
| 10 | 600674 | 川投能源 | 241,000 | 2,366,620.00 | 0.38         |

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

### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 本期累计买入金额     | 占期初基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|--------------|----------------|
| 1  | 601398 | 工商银行 | 2,371,385.00 | 0.39           |
| 2  | 601668 | 中国建筑 | 2,219,800.00 | 0.37           |
| 3  | 600015 | 华夏银行 | 2,134,685.00 | 0.35           |
| 4  | 601288 | 农业银行 | 2,134,359.00 | 0.35           |

|    |        |        |              |      |
|----|--------|--------|--------------|------|
| 5  | 601857 | 中国石油   | 2,134,099.00 | 0.35 |
| 6  | 600028 | XD 中国石 | 2,133,883.00 | 0.35 |
| 7  | 600548 | 深高速    | 2,133,860.22 | 0.35 |
| 8  | 600016 | 民生银行   | 2,133,449.00 | 0.35 |
| 9  | 600886 | 国投电力   | 2,133,300.00 | 0.35 |
| 10 | 601169 | 北京银行   | 2,133,201.91 | 0.35 |
| 11 | 600000 | 浦发银行   | 2,132,633.00 | 0.35 |
| 12 | 600900 | 长江电力   | 2,132,518.00 | 0.35 |
| 13 | 600674 | 川投能源   | 2,132,507.00 | 0.35 |
| 14 | 601328 | 交通银行   | 2,132,263.00 | 0.35 |
| 15 | 600987 | 航民股份   | 2,132,114.85 | 0.35 |
| 16 | 601985 | 中国核电   | 2,131,948.00 | 0.35 |
| 17 | 601006 | 大秦铁路   | 2,130,436.00 | 0.35 |
| 18 | 601988 | 中国银行   | 2,129,637.00 | 0.35 |
| 19 | 601939 | 建设银行   | 2,129,394.00 | 0.35 |
| 20 | 601333 | 广深铁路   | 2,128,948.00 | 0.35 |

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 本期累计卖出金额     | 占期初基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|--------------|-----------------|
| 1  | 601888 | 中国国旅 | 2,335,899.10 | 0.39            |
| 2  | 600016 | 民生银行 | 1,806,516.00 | 0.30            |
| 3  | 601228 | 广州港  | 303,096.57   | 0.05            |
| 4  | 603833 | 欧派家居 | 242,516.20   | 0.04            |
| 5  | 601952 | 苏垦农发 | 166,475.52   | 0.03            |
| 6  | 601366 | 利群股份 | 129,363.00   | 0.02            |
| 7  | 603225 | 新凤鸣  | 127,400.45   | 0.02            |
| 8  | 603980 | 吉华集团 | 110,926.35   | 0.02            |
| 9  | 603826 | 坤彩科技 | 88,580.15    | 0.01            |
| 10 | 603113 | 金能科技 | 86,742.76    | 0.01            |
| 11 | 603920 | 世运电路 | 85,781.25    | 0.01            |
| 12 | 603906 | 龙蟠科技 | 83,817.16    | 0.01            |
| 13 | 603303 | 得邦照明 | 81,705.80    | 0.01            |
| 14 | 603385 | 惠达卫浴 | 80,711.00    | 0.01            |
| 15 | 603586 | 金麒麟  | 74,379.10    | 0.01            |
| 16 | 603050 | 科林电气 | 70,486.00    | 0.01            |
| 17 | 603803 | 瑞斯康达 | 65,954.65    | 0.01            |
| 18 | 603728 | 鸣志电器 | 65,527.90    | 0.01            |
| 19 | 603096 | 新经典  | 62,064.90    | 0.01            |
| 20 | 603081 | 大丰实业 | 61,835.08    | 0.01            |

### 7.4.3 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 | 65,007,747.38 |
| 卖出股票的收入（成交）总额 | 7,204,838.39  |

### 7.5 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      | -              | -            |
| 2  | 央行票据      | -              | -            |
| 3  | 金融债券      | 29,997,000.00  | 4.84         |
|    | 其中：政策性金融债 | 29,997,000.00  | 4.84         |
| 4  | 企业债券      | -              | -            |
| 5  | 企业短期融资券   | 29,980,000.00  | 4.84         |
| 6  | 中期票据      | -              | -            |
| 7  | 可转债（可交换债） | 2,260,640.30   | 0.37         |
| 8  | 同业存单      | 482,918,000.00 | 77.98        |
| 9  | 其他        | -              | -            |
| 10 | 合计        | 545,155,640.30 | 88.03        |

### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

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  | 111709240 | 17 浦发银行 CD240 | 1,000,000 | 98,900,000.00 | 15.97        |
| 2  | 111799443 | 17 杭州银行 CD125 | 1,000,000 | 98,870,000.00 | 15.97        |
| 3  | 111707141 | 17 招商银行 CD141 | 500,000   | 49,450,000.00 | 7.99         |
| 4  | 111799843 | 17 宁波银行 CD106 | 500,000   | 49,440,000.00 | 7.98         |



|   |        |          |         |               |      |
|---|--------|----------|---------|---------------|------|
| 5 | 150201 | 15 国开 01 | 300,000 | 29,997,000.00 | 4.84 |
|---|--------|----------|---------|---------------|------|

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证投资。

### 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

#### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。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。

### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 7.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同，本基金不能投资于国债期货。

#### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查的，也没有在报

告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

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

**7.12.3 期末其他各项资产构成**

单位：人民币元

| 序号 | 名称      | 金额           |
|----|---------|--------------|
| 1  | 存出保证金   | 27,173.69    |
| 2  | 应收证券清算款 | -            |
| 3  | 应收股利    | -            |
| 4  | 应收利息    | 3,788,085.08 |
| 5  | 应收申购款   | -            |
| 6  | 其他应收款   | -            |
| 7  | 待摊费用    | -            |
| 8  | 其他      | -            |
| 9  | 合计      | 3,815,258.77 |

**7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

**7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本期末前十名股票中不存在流通受限情况。

**7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分**

无。

**8 基金份额持有人信息**

**8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构**

份额单位：份

| 份额级别 | 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<br>额比例 | 持有份额      | 占总份<br>额比例 |
|-------------------|-----|---------------|----------------|------------|-----------|------------|
| 华安新瑞利灵活<br>配置混合 A | 14  | 42,859,971.47 | 599,998,000.00 | 99.99%     | 41,600.63 | 0.01%      |
| 华安新瑞利灵活<br>配置混合 C | 228 | 7.86          | 0.00           | 0.00%      | 1,791.98  | 100.00%    |
| 合计                | 242 | 2,479,509.89  | 599,998,000.00 | 99.99%     | 43,392.61 | 0.01%      |

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目                   | 份额级别              | 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<br>员持有本基金 | 华安新瑞利灵活配置混<br>合 A | 102.02    | 0.00%    |
|                      | 华安新瑞利灵活配置混<br>合 C | 181.00    | 10.10%   |
|                      | 合计                | 283.02    | 0.00%    |

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

本公司高级管理人员、基金投资和研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。

## 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                             | 华安新瑞利灵活配置混合 A  | 华安新瑞利灵活配置混合 C |
|--------------------------------|----------------|---------------|
| 基金合同生效日（2016 年 12 月 1 日）基金份额总额 | 600,010,111.19 | 1,704.02      |
| 本报告期期初基金份额总额                   | 600,010,111.19 | 1,704.02      |
| 本报告期基金总申购份额                    | 51,172.87      | 5,578.09      |
| 减：本报告期基金总赎回份额                  | 21,683.43      | 5,490.13      |
| 本报告期基金拆分变动份额                   | -              | -             |
| 本报告期期末基金份额总额                   | 600,039,600.63 | 1,791.98      |

## 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

## 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本基金管理人重大人事变动如下：

2017 年 8 月 9 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》，章国富先生不再担任本基金管理人的副总经理。

2、本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动如下：

本报告期内，基金托管人中信银行股份有限公司经董事会会议审议通过以下事项：任命李庆萍女士为本行董事长，任命孙德顺先生为本行行长，以上任职资格于 2016 年 7 月 20 日获中国银监会批复核准。

2016 年 8 月 6 日，基金托管人中信银行股份有限公司发布变更法定代表人的公告：“中信银行股份有限公司（“本行”）收到北京市工商行政管理局重新核发的《营业执照》，本行已完成法定代表人变更的工商登记手续，自 2016 年 8 月 1 日起，本行法定代表人由常振明先生变更为李庆萍女士。”

## 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

## 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内无基金投资策略的改变。

## 10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘为基金审计的会计师事务所。

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内无管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易          |              | 应支付该券商的佣金 |            | 备注 |
|------|--------|---------------|--------------|-----------|------------|----|
|      |        | 成交金额          | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金        | 占当期佣金总量的比例 |    |
| 兴业证券 | 2      | 70,692,377.52 | 100.00%      | 65,835.89 | 100.00%    | -  |

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领导审批

公司分管领导对相关部门提交的《新增交易单元申请审核表》及其对券商综合评估的结果进行审核，并签署审批意见。

(4) 协议签署及通知托管人

基金管理人与被选择的券商签订《证券交易单元租用协议》，并通知基金托管人。

3、报告期内基金租用券商交易单元的变更情况：

无。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易         |              | 回购交易           |              | 权证交易 |              |
|------|--------------|--------------|----------------|--------------|------|--------------|
|      | 成交金额         | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额           | 占当期回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 兴业证券 | 1,324,921.20 | 100.00%      | 799,000,000.00 | 100.00%      | -    | -            |

11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

| 投资者类别   | 报告期内持有基金份额变化情况 |                        |                |      |      | 报告期末持有基金情况     |        |
|---|----------------|------------------------|----------------|------|------|----------------|--------|
|   | 序号             | 持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间 | 期初份额           | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额           | 份额占比   |
| 机构  | 1              | 20170101-20170630      | 299,999,000.00 | -    | -    | 299,999,000.00 | 50.00% |
|   | 2              | 20170101-20170630      | 299,999,000.00 | -    | -    | 299,999,000.00 | 50.00% |
| 产品特有风险  |                |                        |                |      |      |                |        |
| 本基金报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过20%的情形。如该单一投资者大额赎回将可能导致基金份额净值波动风险、基金流动性风险等特定风险。 |                |                        |                |      |      |                |        |

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

华安基金管理有限公司

二〇一七年八月二十五日