

华安创新证券投资基金
2017 年半年度报告
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：交通银行股份有限公司

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。

基金托管人交通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。

1.2 目录

1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
2 基金简介	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
3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	12
5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	12
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	12
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	16
7 投资组合报告	32
7.1 期末基金资产组合情况	32
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	33
7.3 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	33
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	35
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	40
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	41
7.7 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	41
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	41
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	41
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	41
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	41
7.12 投资组合报告附注	42
8 基金份额持有人信息	42
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	42

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	43
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	43
9 开放式基金份额变动	43
10 重大事件揭示	44
10.1 基金份额持有人大会决议	44
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	44
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	44
10.4 基金投资策略的改变	44
10.5 报告期内改聘会计师事务所情况	44
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	44
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	44
10.8 其他重大事件	46
11 影响投资者决策的其他重要信息	49
12 备查文件目录	49
12.1 备查文件目录	49
12.2 存放地点	49
12.3 查阅方式	50

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华安创新证券投资基金	
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	3,220,135,014.86 份	
基金合同存续期	不定期	

2.2 基金产品说明

投资目标	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。
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
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	上海市浦东新区银城中路188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	上海市浦东新区银城中路188号
邮政编码		200120	200120
法定代表人		朱学华	牛锡明

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
登载基金半年度报告正文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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
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）
本期已实现收益	-37,664,895.35
本期利润	39,160,589.58
加权平均基金份额本期利润	0.0119
本期加权平均净值利润率	1.66%
本期基金份额净值增长率	1.68%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)
期末可供分配利润	1,541,200,811.64
期末可供分配基金份额利润	0.4786
期末基金资产净值	2,337,700,358.86
期末基金份额净值	0.726

3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017年6月30日)
基金份额累计净值增长率	315.67%

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
过去一个月	3.42%	0.65%	3.89%	0.51%	-0.47%	0.14%
过去三个月	0.41%	0.66%	4.33%	0.47%	-3.92%	0.19%
过去六个月	1.68%	0.61%	7.68%	0.43%	-6.00%	0.18%
过去一年	-4.22%	0.62%	11.95%	0.51%	-16.17%	0.11%
过去三年	19.94%	1.45%	52.03%	1.30%	-32.09%	0.15%
自基金合同生效起至今	315.67%	1.21%	133.67%	1.28%	182.00%	-0.07%

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历史走势对比图

(2001年9月21日至2017年6月30日)



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		
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

					<p>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。</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，上证 50 指数上涨 11.5%，深证 100R 上涨 13.78%，而创业板指数下跌 7.34%，低估值、高分红的大盘价值股和白马成长股显著战胜高估值的题材股和中小盘成长股。从行业看，家电、食品饮料、保险、银行等行业表现居前，而国防军工、综合、农林牧渔、纺织服装、电器设备等行业表现居后。随着资本市场的日益国际化，沪港通、深港通北向资金对存量博弈的 A 股市场形成很大影响，资金大规模净流入的海康威视、美的集团、格力电器、贵州茅台等成为表现十分突出。A 股纳入 MSCI 以及沪深港通双向流动，A 股港股化趋势增强，业绩确定性增长、估值低的优质龙头股溢价效应日益明显。下半年，金砖国家首脑会议、中国人民解放军建军 90 周年、党的十九

大即将召开等，海上丝绸之路、国防军工、央企混改等也将成为市场投资主题。

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；在行业风格上，提高业绩确定性增长、业绩估值匹配性好的家电、食品、保险、消费电子股的配置，减持了部分估值高、业绩增长确定性差、流动性差的个股。自上而下与自下而上相结合筛选个股，并进行一定的波段操作。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2017 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 0.726 元，本报告期份额净值增长率为 1.68%，同期业绩比较基准增长率为 7.68%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2017 年是经济金融去杠杆、控风险、稳中求进，货币政策稳健中性的一年。随着沪港通、深港通的开通，A 股市场与港股市场在联动性、投资理念上的相互影响将显著增强。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和盈利能力显著提升。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。

供给侧改革受益的周期行业龙头将继续受益。估值低、业绩稳健增长的消费服务、建筑类个股，内生增长良好的优质成长股龙头以及新能源汽车产业链的核心环节龙头股将具有良好投资机会。

估值过高、大小非减持、可能的商誉减值等将继续成为大部分中小票上涨的制约。经过 2 年半大幅下跌，风险大部分释放、可能面临政策拐点催化的国防军工行业下半年可能有投资机会。

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

2017 上半年度，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

2017 上半年度，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。

本报告期内本基金未进行收益分配，符合基金合同的规定。

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

2017 上半年度，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半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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华安创新证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末	上年度末
----	-----	-----	------

		2017 年 6 月 30 日	2016 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	2,475,287.84	78,350,787.52
结算备付金		74,007,561.18	188,105,844.36
存出保证金		2,253,659.80	2,897,326.67
交易性金融资产	6.4.7.2	2,237,753,083.37	2,077,947,818.59
其中：股票投资		1,709,489,643.37	1,516,520,578.59
基金投资		-	-
债券投资		528,263,440.00	561,427,240.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	100,000,270.00
应收证券清算款		30,557,276.53	-
应收利息	6.7.4.5	11,201,522.44	10,606,946.01
应收股利		-	-
应收申购款		5,995.83	32,061.06
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		2,358,254,386.99	2,457,941,054.21
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
负 债：		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
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		1,695,838.01	789,087.55
应付管理人报酬		2,838,703.19	3,110,662.10
应付托管费		473,117.19	518,443.71
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	14,726,327.04	15,316,023.05
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	820,042.70	1,022,092.58
负债合计		20,554,028.13	61,269,760.62
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.9	749,335,326.13	781,063,469.78
未分配利润	6.4.7.10	1,588,365,032.73	1,615,607,823.81
所有者权益合计		2,337,700,358.86	2,396,671,293.59

负债和所有者权益总计		2,358,254,386.99	2,457,941,054.21
------------	--	-------------------------	-------------------------

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.726 元，基金份额总额 3,220,135,014.86 份。

6.2 利润表

会计主体：华安创新证券投资基金

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	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
一、收入		103,754,752.56	-364,689,409.63
1.利息收入		10,702,365.37	12,975,972.99
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,634,634.75	1,704,344.62
债券利息收入		8,811,464.92	11,271,628.37
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		256,265.70	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		16,209,816.51	-299,412,230.94
其中：股票投资收益	6.4.7.12	6,747,663.81	-302,908,129.04
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	2,073,004.79	-1,045,955.00
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益	6.4.7.14	7,389,147.91	4,541,853.10
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	76,825,484.93	-78,284,241.03
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	17,085.75	31,089.35
减：二、费用		64,594,162.98	72,964,966.18
1. 管理人报酬		17,546,971.51	19,340,933.49
2. 托管费		2,924,495.28	3,223,488.87
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.17	43,900,450.80	50,179,956.81
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.18	222,245.39	220,587.01
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		39,160,589.58	-437,654,375.81
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		39,160,589.58	-437,654,375.81

6.3 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：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 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）	781,063,469.78	1,615,607,823.81	2,396,671,293.59
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	39,160,589.58	39,160,589.58
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）	-31,728,143.65	-66,403,380.66	-98,131,524.31
其中：1.基金申购款	2,844,989.98	5,902,257.10	8,747,247.08
2.基金赎回款	-34,573,133.63	-72,305,637.76	-106,878,771.39
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）	749,335,326.13	1,588,365,032.73	2,337,700,358.86
项目	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 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）	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）	-	-437,654,375.81	-437,654,375.81
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）	-7,553,626.12	-16,909,986.67	-24,463,612.79
其中：1.基金申购款	10,755,953.32	23,387,967.68	34,143,921.00
2.基金赎回款	-18,309,579.44	-40,297,954.35	-58,607,533.79
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）	811,872,597.37	1,833,132,261.17	2,645,004,858.54

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

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 08 月 23 日批准报出。

6.4.2 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 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会公告[2010]5 号《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>》、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《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》和在财务报表附注所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2017 年上半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 2017 年 06 月 30 日的财务状况以及 2017 年上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本会计期间不存在会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本会计期间不存在差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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补充政策的通知》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。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。

(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，于 2015 年 9 月 8 日前暂减按 25% 计入应纳税所得额，自 2015 年 9 月 8 日起，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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
活期存款	2,475,287.84
定期存款	-
其他存款	-
合计	2,475,287.84

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,641,717,845.02	1,709,489,643.37	67,771,798.35
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	8,540,591.25	8,767,440.00
	银行间市场	522,533,320.00	519,496,000.00
	合计	531,073,911.25	528,263,440.00
资产支持证券	-	-	-

基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	2,172,791,756.27	2,237,753,083.37	64,961,327.10

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末（2017 年 6 月 30 日）衍生金融资产/负债余额为零。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末（2017 年 6 月 30 日）买入返售金融资产余额为零。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末（2017 年 6 月 30 日）买断式逆回购交易中取得的债券余额为零。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	1,241.73
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	54,871.27
应收债券利息	11,144,496.75
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	912.69
合计	11,201,522.44

6.4.7.6 其他资产

本期末其他资产余额为零。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	14,725,077.04
银行间市场应付交易费用	1,250.00

合计	14,726,327.04
----	---------------

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	500,000.00
应付赎回费	200.60
预提账户维护费	-
预提审计费	51,076.39
预提信息披露费	268,765.71
合计	820,042.70

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	3,356,485,682.03	781,063,469.78
本期申购	12,225,871.21	2,844,989.98
本期赎回（以“-”号填列）	-148,576,538.38	-34,573,133.63
本期末	3,220,135,014.86	749,335,326.13

注：申购含转换转入份额，赎回含转换转出份额。

6.4.7.10 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
上年度末	1,644,612,463.08	-29,004,639.27	1,615,607,823.81
本期利润	-37,664,895.35	76,825,484.93	39,160,589.58
本期基金份额交易产生的变动数	-65,746,756.09	-656,624.57	-66,403,380.66
其中：基金申购款	5,881,641.04	20,616.06	5,902,257.10
基金赎回款	-71,628,397.13	-677,240.63	-72,305,637.76
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,541,200,811.64	47,164,221.09	1,588,365,032.73

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

活期存款利息收入	144,764.25
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	20,311.20
结算备付金利息收入	1,469,559.30
其他	0.00
合计	1,634,634.75

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出股票成交总额	14,437,369,540.26
减：卖出股票成本总额	14,430,621,876.45
买卖股票差价收入	6,747,663.81

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	677,939,395.05
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	656,502,416.67
减：应收利息总额	19,363,973.59
买卖债券差价收入	2,073,004.79

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
股票投资产生的股利收益	7,389,147.91
基金投资产生的股利收益	-
合计	7,389,147.91

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
1.交易性金融资产	76,825,484.93
——股票投资	80,539,388.26
——债券投资	-3,713,903.33

——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	76,825,484.93

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
基金赎回费收入	17,085.75
合计	17,085.75

注：基金赎回费收入包括赎回费及转换费收入。

1、本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费在扣除不超过赎回总金额的 0.1% 的基金注册与过户登记费后，即当赎回费率大于 0.1%（不包括 0.1%）时，基金注册与过户登记费为赎回总金额的 0.1%；当赎回费率小于或等于 0.1% 时，基金注册与过户登记费为赎回费用的 75%，余额列入基金资产。

2、基金之间的转换费由转出基金的赎回费和申购费补差两部分构成，其中赎回费部分计算方法同上。

6.4.7.17 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
交易所市场交易费用	43,897,025.80
银行间市场交易费用	3,425.00
合计	43,900,450.80

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
审计费用	51,076.39
信息披露费	148,765.71
银行汇划费用	3,403.29
帐户维护费	18,400.00

其他费用	600.00
合计	222,245.39

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

无。

6.4.9.2 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
交通银行股份有限公司(“交通银行”)	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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期(2017年1月1日至2017年6月30日)和上年度可比期间(2016年1月1日至2016年6月30日)均无通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期(2017年1月1日至2017年6月30日)和上年度可比期间(2016年1月1日至2016年6月30日)均无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期(2017年1月1日至2017年6月30日)和上年度可比期间(2016年1月1日至2016年6月30日)均无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月 30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	17,546,971.51	19,340,933.49
其中：支付销售机构的客户维护费	1,820,553.46	2,010,934.78

注：支付基金管理人华安基金管理有限公司的基金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：

日基金管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.5% / 当年天数。

6.4.10.2.2 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	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6 月30日
当期发生的基金应支付的托管费	2,924,495.28	3,223,488.87

注：支付基金托管人交通银行的基金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：

日基金托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

无。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.4.2 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

基金管理公司主要股东及其控制的机构本报告期末和上年度末均无投资本基金的情况。

6.4.10.5 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		上年度可比期间	
	2017年1月1日至2017年6月30日		2016年1月1日至2016年6月30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	2,475,287.84	144,764.25	92,581,967.78	165,072.42

注：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。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本报告期不进行利润分配。

6.4.12 期末（2017年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 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
002879	长缆科技	2017-06-05	2017-07-07	网下中签	18.02	18.02	1,313.00	23,660.26	23,660.26	-
002882	金龙羽	2017-06-15	2017-07-17	网下中签	6.20	6.20	2,966.00	18,389.20	18,389.20	-
300670	大烨智能	2017-06-26	2017-07-03	网下中签	10.93	10.93	1,259.00	13,760.87	13,760.87	-
300671	富满电子	2017-06-27	2017-07-05	网下中签	8.11	8.11	942.00	7,639.62	7,639.62	-
300672	国科微	2017-06-30	2017-07-12	网下中签	8.48	8.48	1,257.00	10,659.36	10,659.36	-
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	-

60361 7	君禾 股份	2017-0 6-23	2017-0 7-03	网下 中签	8.93	8.93	832.00	7,429. 76	7,429. 76	-
60393 3	睿能 科技	2017-0 6-28	2017-0 7-06	网下 中签	20.20	20.20	857.00	17,311 .40	17,311 .40	-

6.4.12.2 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 价	数量 (单位：股)	期末 成本总额	期末 估值总额	备注
00201 3	中航机 电	2017-05 -12	重大事 项	10.33	2017-0 8-02	11.36	1,016,100.0 0	10,498,648.00	10,496,313.0 0	-
60079 5	国电电 力	2017-06 -05	重大资 产重组	3.60	-	-	6,459,600.0 0	22,746,885.00	23,254,560.0 0	-

注：本基金截止至 2017 年 6 月 30 日止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。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至报告期末 2017 年 6 月 30 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。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至报告期末 2017 年 6 月 30 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。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金是一只偏股型的证券投资基金，属于中等风险品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资等。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。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将相对风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“相对收益高、风险适中”的风险收益目标。

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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管理委员会，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。监察稽核部和风险管理部对公司执行总裁负责，并由督察长分管。

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。

6.4.13.2 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。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行交通银行，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。

于 2017 年 06 月 30 日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券(2016 年 12 月 31 日：未持有)。

6.4.13.3 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%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注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。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2017 年 06 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 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。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，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。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
------------------------	-------	-------	-------	-----	----

资产					
银行存款	2,475,287.84	-	-	-	2,475,287.84
结算备付金	74,007,561.18	-	-	-	74,007,561.18
存出保证金	2,253,659.80	-	-	-	2,253,659.80
交易性金融资产	497,604,440.00	20,102,000.00	10,557,000.00	1,709,489,643.37	2,237,753,083.37
应收证券清算款	-	-	-	30,557,276.53	30,557,276.53
应收利息	-	-	-	11,201,522.44	11,201,522.44
应收申购款	-	-	-	5,995.83	5,995.83
资产总计	576,340,948.82	20,102,000.00	10,557,000.00	1,751,254,438.17	2,358,254,386.99
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,695,838.01	1,695,838.01
应付管理人报酬	-	-	-	2,838,703.19	2,838,703.19
应付托管费	-	-	-	473,117.19	473,117.19
应付交易费用	-	-	-	14,726,327.04	14,726,327.04
其他负债	-	-	-	820,042.70	820,042.70
负债总计	-	-	-	20,554,028.13	20,554,028.13
利率敏感度缺口	576,340,948.82	20,102,000.00	10,557,000.00	1,730,700,410.04	2,337,700,358.86
上年度末 2016 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	78,350,787.52	-	-	-	78,350,787.52
结算备付金	188,105,844.36	-	-	-	188,105,844.36
存出保证金	2,897,326.67	-	-	-	2,897,326.67
交易性金融资产	398,831,240.00	151,666,000.00	10,930,000.00	1,516,520,578.59	2,077,947,818.59
买入返售金融资产	100,000,270.00	-	-	-	100,000,270.00
应收利息	-	-	-	10,606,946.01	10,606,946.01
应收申购款	-	-	-	32,061.06	32,061.06
资产总计	768,185,468.55	151,666,000.00	10,930,000.00	1,527,159,585.66	2,457,941,054.21

负债					
应付证券清算款	-	-	-	40,513,451.63	40,513,451.63
应付赎回款	-	-	-	789,087.55	789,087.55
应付管理人报酬	-	-	-	3,110,662.10	3,110,662.10
应付托管费	-	-	-	518,443.71	518,443.71
应付交易费用	-	-	-	15,316,023.05	15,316,023.05
其他负债	-	-	-	1,022,092.58	1,022,092.58
负债总计	-	-	-	61,269,760.62	61,269,760.62
利率敏感度缺口	768,185,468.55	151,666,000.00	10,930,000.00	1,465,889,825.04	2,396,671,293.59

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率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 2017年6月30日	上年度末 2016年12月31日
	市场利率上升 25 个基点	减少约 86	减少约 98
	市场利率下降 25 个基点	增加约 86	增加约 98

6.4.13.4.2 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。

6.4.13.4.3 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。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。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。本基金投资组合中本基金投资组合中股票、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%。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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日		上年度末 2016 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	1,709,489,643. 37	73.13	1,516,520,578 .59	63.28
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	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,709,489,643. 37	73.13	1,516,520,578 .59	63.28

6.4.13.4.3.2 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 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	增加约 13,758	增加约 13,449
	业绩比较基准下降 5%	减少约 13,758	减少约 13,449

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 增值税

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[2016]140 号《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：(1) 金融商品持有期间(含到期)取得的非保本收益(合同中未明确承诺到期本金可全部收回的投资收益)，不征收增值税；(2) 纳税人购入基金、信托、理财产品等各类资产管理产品持有至到期，不属于金融商品转让；(3) 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。上述政策自 2016 年 5 月 1 日起执行。

此外，根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》及 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，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，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。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。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

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	1,709,489,643.37	72.49
	其中：股票	1,709,489,643.37	72.49
2	固定收益投资	528,263,440.00	22.40
	其中：债券	528,263,440.00	22.40
	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	76,482,849.02	3.24

7	其他各项资产	44,018,454.60	1.87
8	合计	2,358,254,386.99	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	45,961,012.00	1.97
C	制造业	963,727,205.54	41.23
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	23,254,560.00	0.99
E	建筑业	86,706,940.00	3.71
F	批发和零售业	180,913,833.83	7.74
G	交通运输、仓储和邮政业	4,633,753.30	0.20
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	37,044,944.70	1.58
J	金融业	271,133,616.00	11.60
K	房地产业	71,814,182.00	3.07
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	12,509,800.00	0.54
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	11,789,796.00	0.50
S	综合	-	-
	合计	1,709,489,643.37	73.13

7.3 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	600153	建发股份	7,987,731	103,281,361.83	4.42

2	000651	格力电器	1,993,100	82,055,927.00	3.51
3	600036	招商银行	2,877,300	68,796,243.00	2.94
4	600477	杭萧钢构	3,845,200	58,677,752.00	2.51
5	002236	大华股份	2,505,125	57,141,901.25	2.44
6	300450	先导智能	1,083,626	56,099,318.02	2.40
7	000050	深天马 A	2,641,924	54,344,376.68	2.32
8	002185	华天科技	7,000,000	50,680,000.00	2.17
9	600048	保利地产	5,060,600	50,454,182.00	2.16
10	601607	上海医药	1,584,400	45,757,472.00	1.96
11	600030	中信证券	2,600,000	44,252,000.00	1.89
12	002466	天齐锂业	800,000	43,480,000.00	1.86
13	601601	中国太保	1,268,800	42,974,256.00	1.84
14	300083	劲胜精密	4,641,019	42,883,015.56	1.83
15	600581	八一钢铁	4,106,200	41,349,434.00	1.77
16	601398	工商银行	7,647,100	40,147,275.00	1.72
17	002139	拓邦股份	3,592,650	38,692,840.50	1.66
18	601318	中国平安	772,200	38,308,842.00	1.64
19	600056	中国医药	1,365,800	35,442,510.00	1.52
20	000400	许继电气	1,955,900	35,127,964.00	1.50
21	000858	五 粮 液	592,050	32,953,503.00	1.41
22	002640	跨境通	1,500,000	31,875,000.00	1.36
23	000786	北新建材	1,867,400	29,579,616.00	1.27
24	002410	广联达	1,506,600	28,324,080.00	1.21
25	600068	葛洲坝	2,493,700	28,029,188.00	1.20
26	600971	恒源煤电	3,152,400	25,629,012.00	1.10
27	002142	宁波银行	1,300,000	25,090,000.00	1.07
28	600114	东睦股份	1,364,600	23,880,500.00	1.02
29	000921	海信科龙	1,361,319	23,428,299.99	1.00
30	600795	国电电力	6,459,600	23,254,560.00	0.99
31	600522	中天科技	1,915,800	23,085,390.00	0.99
32	600019	宝钢股份	3,435,700	23,053,547.00	0.99
33	001979	招商蛇口	1,000,000	21,360,000.00	0.91
34	600409	三友化工	2,118,600	21,334,302.00	0.91
35	600183	生益科技	1,708,900	21,087,826.00	0.90
36	601699	潞安环能	2,600,000	20,332,000.00	0.87
37	000568	泸州老窖	400,000	20,232,000.00	0.87
38	000933	神火股份	2,716,000	19,799,640.00	0.85
39	600038	中直股份	400,800	18,344,616.00	0.78
40	600562	国睿科技	653,794	18,005,486.76	0.77
41	002126	银轮股份	1,564,700	15,740,882.00	0.67
42	002050	三花智控	948,100	15,472,992.00	0.66
43	600885	宏发股份	379,000	15,118,310.00	0.65
44	600879	航天电子	1,700,000	14,943,000.00	0.64
45	000666	经纬纺机	624,300	14,196,582.00	0.61

46	002120	韵达股份	271,444	14,006,510.40	0.60
47	600487	亨通光电	495,400	13,895,970.00	0.59
48	000807	云铝股份	1,742,100	12,577,962.00	0.54
49	000888	峨眉山 A	958,000	12,166,600.00	0.52
50	300336	新文化	762,600	11,789,796.00	0.50
51	601336	新华保险	225,000	11,565,000.00	0.49
52	002013	中航机电	1,016,100	10,496,313.00	0.45
53	300588	熙菱信息	250,452	8,713,225.08	0.37
54	002850	科达利	77,500	7,036,225.00	0.30
55	002415	海康威视	217,200	7,015,560.00	0.30
56	603660	苏州科达	115,300	4,721,535.00	0.20
57	600585	海螺水泥	206,800	4,700,564.00	0.20
58	000905	厦门港务	354,805	4,633,753.30	0.20
59	300545	联得装备	18,700	1,352,010.00	0.06
60	603199	九华旅游	8,800	343,200.00	0.01
61	603801	志邦股份	1,406	47,522.80	0.00
62	603043	广州酒家	1,810	45,738.70	0.00
63	300666	江丰电子	2,276	43,448.84	0.00
64	603335	迪生力	2,230	24,864.50	0.00
65	002879	长缆科技	1,313	23,660.26	0.00
66	002881	美格智能	989	22,608.54	0.00
67	603679	华体科技	809	21,438.50	0.00
68	603938	三孚股份	1,246	20,932.80	0.00
69	002882	金龙羽	2,966	18,389.20	0.00
70	603933	睿能科技	857	17,311.40	0.00
71	603305	旭升股份	1,351	15,212.26	0.00
72	300669	沪宁股份	841	14,650.22	0.00
73	300670	大烨智能	1,259	13,760.87	0.00
74	603286	日盈电子	890	13,528.00	0.00
75	300672	国科微	1,257	10,659.36	0.00
76	603331	百达精工	999	9,620.37	0.00
77	300671	富满电子	942	7,639.62	0.00
78	603617	君禾股份	832	7,429.76	0.00

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	000651	格力电器	319,236,947.99	13.32
2	600036	招商银行	241,147,772.42	10.06

3	601318	中国平安	233,854,726.91	9.76
4	000333	美的集团	225,865,350.26	9.42
5	000858	五粮液	223,835,655.94	9.34
6	002236	大华股份	197,350,924.18	8.23
7	601601	中国太保	159,709,205.25	6.66
8	002051	中工国际	145,732,018.16	6.08
9	002475	立讯精密	135,858,485.98	5.67
10	600153	建发股份	132,654,616.15	5.53
11	002466	天齐锂业	131,545,814.13	5.49
12	600068	葛洲坝	131,169,891.13	5.47
13	601668	中国建筑	129,569,248.34	5.41
14	001979	招商蛇口	128,541,081.90	5.36
15	000568	泸州老窖	127,255,282.80	5.31
16	002241	歌尔股份	125,835,082.73	5.25
17	300070	碧水源	118,795,468.81	4.96
18	601336	新华保险	107,758,481.11	4.50
19	002310	东方园林	107,455,835.76	4.48
20	601688	华泰证券	107,423,178.31	4.48
21	600477	杭萧钢构	103,891,241.45	4.33
22	002555	三七互娱	103,096,809.94	4.30
23	601607	上海医药	102,242,184.21	4.27
24	600028	中国石化	100,194,981.80	4.18
25	600048	保利地产	98,592,223.20	4.11
26	002456	欧菲光	97,585,712.57	4.07
27	600741	华域汽车	96,135,930.87	4.01
28	000423	东阿阿胶	95,903,325.02	4.00
29	002185	华天科技	95,528,472.49	3.99
30	300450	先导智能	95,101,245.51	3.97
31	600887	伊利股份	93,276,087.88	3.89
32	600030	中信证券	90,554,784.31	3.78
33	601398	工商银行	90,127,969.90	3.76
34	300197	铁汉生态	89,354,488.08	3.73
35	002410	广联达	86,670,955.64	3.62
36	600428	中远海特	85,932,233.31	3.59
37	002008	大族激光	84,826,046.66	3.54
38	002142	宁波银行	79,912,071.08	3.33
39	600990	四创电子	77,355,399.64	3.23
40	300136	信维通信	77,180,267.68	3.22
41	601818	光大银行	74,875,610.22	3.12
42	600660	福耀玻璃	74,561,993.20	3.11
43	601939	建设银行	74,424,870.12	3.11
44	000069	华侨城 A	74,221,162.87	3.10
45	000050	深天马 A	73,667,309.56	3.07
46	601669	中国电建	73,525,946.80	3.07

47	600549	厦门钨业	73,437,411.80	3.06
48	601628	中国人寿	72,829,615.70	3.04
49	600104	上汽集团	72,452,521.25	3.02
50	601117	中国化学	71,410,644.97	2.98
51	300083	劲胜智能	70,482,605.22	2.94
52	600879	航天电子	70,318,153.59	2.93
53	600511	国药股份	69,558,192.96	2.90
54	000930	中粮生化	67,451,093.10	2.81
55	000425	徐工机械	67,126,940.91	2.80
56	000928	中钢国际	65,693,528.99	2.74
57	600603	广汇物流	64,827,618.85	2.70
58	600270	外运发展	64,314,191.29	2.68
59	600507	方大特钢	64,096,220.27	2.67
60	600114	东睦股份	64,069,223.41	2.67
61	600522	中天科技	63,614,423.49	2.65
62	300458	全志科技	63,244,942.56	2.64
63	600885	宏发股份	62,045,489.27	2.59
64	600110	诺德股份	61,318,069.88	2.56
65	002035	华帝股份	61,286,515.08	2.56
66	000807	云铝股份	60,850,595.42	2.54
67	600019	宝钢股份	59,451,305.83	2.48
68	601988	中国银行	59,104,615.90	2.47
69	600340	华夏幸福	57,998,915.29	2.42
70	600038	中直股份	57,230,962.71	2.39
71	601699	潞安环能	57,129,147.84	2.38
72	002450	康得新	56,919,034.11	2.37
73	002508	老板电器	56,651,519.06	2.36
74	601186	中国铁建	55,580,972.59	2.32
75	002831	裕同科技	55,143,992.16	2.30
76	002205	国统股份	54,345,562.80	2.27
77	600056	中国医药	54,128,837.20	2.26
78	600884	杉杉股份	52,883,114.07	2.21
79	601229	上海银行	52,809,443.74	2.20
80	000905	厦门港务	52,217,164.59	2.18
81	000630	铜陵有色	52,034,530.47	2.17
82	600197	伊力特	51,931,912.90	2.17
83	600801	华新水泥	51,347,336.97	2.14
84	300284	苏交科	51,339,803.43	2.14
85	002415	海康威视	50,915,608.47	2.12
86	002371	北方华创	50,910,262.66	2.12
87	002573	清新环境	50,746,814.18	2.12
88	000400	许继电气	50,391,345.89	2.10
89	002027	分众传媒	49,782,237.14	2.08
90	600183	生益科技	49,159,232.72	2.05

91	600362	江西铜业	48,750,507.31	2.03
----	--------	------	---------------	------

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。

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	000651	格力电器	252,334,169.38	10.53
2	000333	美的集团	234,367,326.77	9.78
3	601318	中国平安	212,125,655.25	8.85
4	000858	五粮液	205,188,672.43	8.56
5	600036	招商银行	180,770,271.15	7.54
6	002051	中工国际	170,498,422.52	7.11
7	002236	大华股份	154,637,082.08	6.45
8	002475	立讯精密	146,829,669.41	6.13
9	601336	新华保险	142,625,337.72	5.95
10	601668	中国建筑	135,012,443.66	5.63
11	300070	碧水源	128,349,945.16	5.36
12	002241	歌尔股份	127,905,930.53	5.34
13	600028	中国石化	125,633,913.33	5.24
14	601818	光大银行	122,697,754.99	5.12
15	601601	中国太保	120,058,165.24	5.01
16	601688	华泰证券	114,849,516.48	4.79
17	001979	招商蛇口	113,014,895.73	4.72
18	600428	中远海特	108,771,806.15	4.54
19	000568	泸州老窖	107,983,499.84	4.51
20	002555	三七互娱	105,708,991.01	4.41
21	002310	东方园林	103,046,486.10	4.30
22	600068	葛洲坝	102,157,878.77	4.26
23	000423	东阿阿胶	101,937,370.00	4.25
24	601939	建设银行	99,908,929.87	4.17
25	600741	华域汽车	95,412,740.58	3.98
26	002456	欧菲光	95,403,716.44	3.98
27	601117	中国化学	95,304,833.99	3.98
28	600887	伊利股份	92,905,671.50	3.88
29	002466	天齐锂业	91,290,484.93	3.81
30	000630	铜陵有色	88,434,959.28	3.69
31	002008	大族激光	88,265,189.80	3.68
32	000928	中钢国际	85,139,489.17	3.55
33	601628	中国人寿	84,657,818.39	3.53
34	300197	铁汉生态	81,975,308.22	3.42

35	600660	福耀玻璃	78,850,814.25	3.29
36	000069	华侨城 A	78,277,738.58	3.27
37	600990	四创电子	76,319,303.19	3.18
38	300136	信维通信	76,046,364.64	3.17
39	600549	厦门钨业	74,155,186.38	3.09
40	600104	上汽集团	73,342,524.66	3.06
41	601669	中国电建	70,205,450.34	2.93
42	600019	宝钢股份	70,043,350.15	2.92
43	601988	中国银行	70,027,116.00	2.92
44	600114	东睦股份	69,073,441.23	2.88
45	600511	国药股份	68,838,126.60	2.87
46	002450	康得新	67,783,063.41	2.83
47	300011	鼎汉技术	67,765,124.76	2.83
48	000425	徐工机械	66,031,931.48	2.76
49	601607	上海医药	65,924,779.36	2.75
50	002371	北方华创	65,546,379.91	2.73
51	600038	中直股份	65,440,192.69	2.73
52	000930	中粮生化	64,959,023.96	2.71
53	000963	华东医药	63,546,385.25	2.65
54	600507	方大特钢	63,374,506.04	2.64
55	600270	外运发展	63,008,412.74	2.63
56	600093	易见股份	62,672,326.58	2.61
57	300458	全志科技	61,795,973.05	2.58
58	600598	北大荒	61,696,444.48	2.57
59	300284	苏交科	60,904,001.18	2.54
60	600110	诺德股份	60,201,052.64	2.51
61	002410	广联达	60,094,048.61	2.51
62	002035	华帝股份	59,933,596.93	2.50
63	600603	广汇物流	59,662,322.45	2.49
64	601186	中国铁建	58,205,168.48	2.43
65	600340	华夏幸福	58,062,706.54	2.42
66	002508	老板电器	57,511,711.46	2.40
67	600109	国金证券	57,079,343.25	2.38
68	002142	宁波银行	56,792,918.96	2.37
69	600879	航天电子	56,639,519.01	2.36
70	000998	隆平高科	54,896,635.11	2.29
71	002831	裕同科技	53,756,467.95	2.24
72	002205	国统股份	53,651,140.29	2.24
73	600197	伊力特	53,580,324.81	2.24
74	600801	华新水泥	53,376,804.46	2.23
75	600884	杉杉股份	52,768,816.51	2.20
76	601398	工商银行	52,129,500.00	2.18
77	601229	上海银行	51,509,413.54	2.15
78	600125	铁龙物流	51,376,928.74	2.14

79	300188	美亚柏科	50,906,172.64	2.12
80	600048	保利地产	50,638,671.94	2.11
81	002573	清新环境	50,587,947.42	2.11
82	000807	云铝股份	50,281,459.81	2.10
83	000538	云南白药	49,665,731.14	2.07
84	002497	雅化集团	49,527,516.78	2.07
85	600477	杭萧钢构	49,493,360.89	2.07
86	002460	赣锋锂业	49,407,491.73	2.06
87	600362	江西铜业	49,220,325.42	2.05
88	600885	宏发股份	48,878,390.79	2.04
89	002027	分众传媒	48,515,946.70	2.02

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。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	14,543,051,552.97
卖出股票的收入（成交）总额	14,437,369,540.26

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。

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	98,308,440.00	4.21
2	央行票据	-	-
3	金融债券	429,955,000.00	18.39
	其中：政策性金融债	429,955,000.00	18.39
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	0.00	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-

10	合计	528,263,440.00	22.60
----	----	----------------	-------

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	170204	17 国开 04	1,100,000	109,527,000.00	4.69
2	179903	17 贴现国债 03	800,000	78,984,000.00	3.38
3	080218	08 国开 18	600,000	59,664,000.00	2.55
4	080216	08 国开 16	500,000	50,595,000.00	2.16
5	120240	12 国开 40	500,000	50,055,000.00	2.14

7.7 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。

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。

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

本基金本报告期没有投资股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

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

无。

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。

7.11.3 本期国债期货投资评价

无。

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	2,253,659.80
2	应收证券清算款	30,557,276.53
3	应收股利	-
4	应收利息	11,201,522.44
5	应收申购款	5,995.83
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	44,018,454.60

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

本基金本报告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

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
167,815	19,188.60	153,592,876.21	4.77%	3,066,542,138.65	95.23%

8.2 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	895.99	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

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	-

注：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

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	3,356,485,682.03
本报告期基金总申购份额	12,225,871.21
减：本报告期基金总赎回份额	148,576,538.38
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	3,220,135,014.86

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：

无。

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

本报告期内无改聘会计师事务所的情况。

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	
华金证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
华龙证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	5,726,805,225.16	19.76%	5,333,367.73	19.83%	-
华泰证券	1	3,225,250,026.72	11.13%	3,003,681.90	11.17%	-
中金公司	1	3,148,765,189.98	10.87%	2,932,439.18	10.91%	-

国泰君安	2	2,617,665,066.58	9.03%	2,437,830.63	9.07%	-
申万宏源	2	2,496,819,848.26	8.62%	2,325,277.97	8.65%	-
南京证券	1	2,216,312,898.47	7.65%	2,019,728.77	7.51%	-
招商证券	1	1,749,059,701.00	6.04%	1,628,889.50	6.06%	-
东吴证券	1	1,641,129,344.66	5.66%	1,495,561.74	5.56%	-
海通证券	1	1,550,425,052.24	5.35%	1,443,913.01	5.37%	-
东方证券	1	1,505,236,906.21	5.19%	1,401,829.45	5.21%	-
安信证券	1	949,900,243.78	3.28%	865,645.36	3.22%	-
银河证券	1	735,150,410.06	2.54%	684,643.85	2.55%	-
平安证券	1	694,761,263.95	2.40%	647,031.72	2.41%	-
山西证券	1	387,362,183.39	1.34%	360,750.53	1.34%	-
国信证券	1	331,313,889.54	1.14%	308,553.45	1.15%	-

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，最大限度地调动物体资源，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：

2017 年 04 月完成租用托管在交通银行的山西证券交易单元 38246

2017 年 05 月完成租用托管在交通银行的华金证券交易单元 38164

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
华金证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
华龙证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	8,432,589.00	100.00%	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-

10.8 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	关于旗下部分基金增加济安财富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	2017-01-11

2	关于旗下部分基金增加泰诚财富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	2017-01-18
3	关于旗下部分基金增加北京肯特瑞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	2017-02-08
4	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	2017-02-13
5	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“武钢股份”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	2017-02-14
6	关于旗下部分基金增加朝阳永续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	2017-02-22
7	华安基金关于参加平安银行优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-02-22
8	华安基金管理有限公司关于华安华安双债添利债券型证券投资基金分红公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-02-22
9	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“王府井”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	2017-02-24
10	关于旗下部分基金增加华阳众惠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	2017-03-02
11	关于旗下部分基金增加华夏财富为销售机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-03-21
12	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“南都电源”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	2017-03-21
13	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公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-03-28
14	关于华安基金管理有限公司旗下基金参加广发证券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	2017-03-30
15	关于旗下部分基金参加中国工商银行股份有限公司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	2017-03-30
16	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加通华财富为销售机构并参加费率优惠活动	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公	2017-04-06

	的公告	司网站	
17	华安基金关于参加华宝证券优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-04-12
18	关于华安基金管理有限公司旗下基金参加交通银行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	2017-04-22
19	关于“微钱宝”快速取现服务升级的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-04-25
20	华安基金关于《深圳证券交易所分级基金业务管理指引》实施的风险提示性公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-04-25
21	华安基金关于《深圳证券交易所分级基金业务管理指引》实施的风险提示性公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-04-26
22	华安基金关于《深圳证券交易所分级基金业务管理指引》实施的风险提示性公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-04-27
23	华安基金关于《深圳证券交易所分级基金业务管理指引》实施的风险提示性公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-04-28
24	华安基金关于《深圳证券交易所分级基金业务管理指引》实施的风险提示性公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-04-29
25	华安基金关于《深圳证券交易所分级基金业务管理指引》实施的风险提示性公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-05-03
26	华安基金关于《深圳证券交易所分级基金业务管理指引》实施的风险提示性公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-05-04
27	华安基金关于《深圳证券交易所分级基金业务管理指引》实施的风险提示性公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-05-06
28	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	2017-05-10
29	关于旗下部分基金增加武汉伯嘉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	2017-05-17
30	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“东睦股份”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	2017-05-20
31	关于旗下部分基金增加中民财富为销售机构	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-06-07

	并参加费率优惠的公告	报》、《中国证券报》和公司网站	
32	华安基金关于参加上海农商行优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-06-07
33	关于旗下部分基金增加科地瑞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	2017-06-12
34	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公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-06-27
35	关于华安基金管理有限公司旗下基金参加交通银行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	2017-06-30

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。

11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 影响投资者决策的其他重要信息

无。

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准华安创新证券投资基金设立的文件；
- 2、《华安创新证券投资基金基金合同》；
- 3、《华安创新证券投资基金招募说明书》；
- 4、《华安创新证券投资基金托管协议》；
- 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。

12.2 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>。

12.3 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

二〇一七年八月二十五日