

**华安动态灵活配置混合型证券投资基金**  
**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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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

<b>1 重要提示及目录</b>	2
1.1 重要提示	2
<b>2 基金简介</b>	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>3 主要财务指标和基金净值表现</b>	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
<b>4 管理人报告</b>	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	8
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	10
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
<b>5 托管人报告</b>	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
<b>6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	13
6.1 资产负债表	13
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
<b>7 投资组合报告</b>	33
7.1 期末基金资产组合情况	33
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	34
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	35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	36
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	38
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	39
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	39
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	39
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	39
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	39
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	39
7.12 投资组合报告附注	40
<b>8 基金份额持有人信息</b>	41
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	41

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	41
<b>9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>41</b>
<b>10 重大事件揭示 .....</b>	<b>42</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	42
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 .....	42
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	42
10.4 基金投资策略的改变 .....	42
10.5 报告期内改聘会计师事务所情况 .....	42
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 .....	42
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	42
10.8 其他重大事件 .....	45
<b>11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>48</b>
<b>12 备查文件目录 .....</b>	<b>48</b>
12.1 备查文件目录 .....	48
12.2 存放地点 .....	48
12.3 查阅方式 .....	48

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华安动态灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	华安动态灵活配置混合
基金主代码	040015
交易代码	040015
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009 年 12 月 22 日
基金管理人	华安基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	157,606,420.08 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	通过对股票、债券等金融资产的动态灵活配置，在合理控制投资风险和保障基金资产流动性的基础上，追求基金资产的长期稳定增值，力求为投资者获取超额回报。
投资策略	本基金将主要运用战略资产配置的方法来确定投资组合中的资产类别和权重，辅以战术资产配置来动态优化投资组合中各类资产的配置比例。在具体投资品种选择方面，本基金将综合运用定量分析和定性分析手段，精选出具有内在价值和成长潜力的股票来构建股票投资组合。在研究分析宏观经济和利率趋势等因素的基础上，选择那些流动性较好、风险水平合理、到期收益率与信用质量相对较高的债券品种。
业绩比较基准	60%×沪深 300 指数收益率+40%×中国债券总指数收益率
风险收益特征	本基金是一只混合型基金，基金的风险与预期收益都要低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金，属于证券投资基金中的中等风险和中等收益品种。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华安基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	钱鲲	郭明
	联系电话	021-38969999	010-66105799
	电子邮箱	qiankun@huaan.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4008850099	95588
传真		021-68863414	010-66105798
注册地址		上海市世纪大道8号上海国金中心二期31层、32层	北京市西城区复兴门内大街55号

办公地址	上海市世纪大道8号上海国金中心二期31层、32层	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码	200120	100140
法定代表人	朱学华	易会满

## 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 层、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 层、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	-3,320,652.56
本期利润	-5,809,136.09
加权平均基金份额本期利润	-0.0338
本期加权平均净值利润率	-2.48%
本期基金份额净值增长率	-2.41%
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	59,145,994.00
期末可供分配基金份额利润	0.3753
期末基金资产净值	216,752,414.08
期末基金份额净值	1.375
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	112.93%

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：开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数

(为期末余额，不是当期发生数)。

### 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 1 个月	8.35%	1.23%	3.34%	0.41%	5.01%	0.82%
过去 3 个月	-1.22%	1.23%	3.24%	0.39%	-4.46%	0.84%
过去 6 个月	-2.41%	1.08%	5.48%	0.35%	-7.89%	0.73%
过去 1 年	2.30%	0.96%	8.24%	0.42%	-5.94%	0.54%
过去 3 年	100.50%	1.89%	42.89%	1.05%	57.61%	0.84%
过去 5 年	145.87%	1.66%	29.54%	0.95%	116.33%	0.71%
自基金成立起至今	112.93%	1.51%	5.93%	0.92%	107.00%	0.59%

#### 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

华安动态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

(2009 年 12 月 22 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		
蒋璐	本基金的基金经理	2015-06-16	-	9 年	硕士，9 年从业经历。曾任国泰君安证券有限公司研究员、华宝兴业基金管理有限公司研究员。2011 年 6 月加入华安基金管理有限公司，担任投资研究部行业分析师、基金经理助理。2015 年 6 月起担任本基金的基金经理；2015 年 6 月至 2016 年 9 月担任华安安信消费服务混合型证券投资基金、华安升级主题混合型证券投资基金的基金经理；2015 年 11 月起，同时担任华安新乐享保本混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 3 月起，同时担任华安睿安定期开放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



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

上半年 A 股市场整体呈现区间震荡走势，全部 A 股综合指数上涨 1.11%，其中上证综指上涨 2.86%、深圳成指上涨 3.46%、创业板指则下跌 7.34%，大盘蓝筹的市场风格偏好延续，白马龙头的表现尤为突出。期间行业分化非常剧烈，家电涨幅（+29.6%）遥遥领先，食品饮料和电子紧随其后，而农业、纺织服装、计算机、传媒和军工的行业指数跌幅均超过了 10%；主题表现也是差异巨大，白马股指数和 MSCI 概念指数的半年涨幅都超过了 30%，而最小市值、次新股、共享单车等指数的跌幅却超过了 25%。报告期内，基于对中国经济改革创新有信心和大类资产配置方向有利于股市的研判，本基金一直维持较高仓位运作，但因重仓个股较多集中在中小创，对于白马蓝筹的配置力度过低，最终使得上半年的基金单位净值表现跑输了同期业绩比较基准。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2017 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.375 元，本报告期份额净值增长率为-2.41%，同期业绩比较基准增长率为 5.48%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观经济展望：上半年全球主要经济体均处于稳健复苏的通道，中国也不例外，6 月官方制造业 PMI 更是创出了 51.7 的年内次高点，连续 11 个月保持在荣枯线上方。展望下半年，随着补库存周期接近尾声以及房地产销售的确定性下行，预期经济增速环比下行已成为市场共识，但考虑中国

经济内生的强大韧性，我们认为实际 GDP 下行幅度或有限。从货币环境来看，美联储 6 月 FOMC 会议宣布加息 25 个基点，维持 2017 年内再加息一次的预测，且预期 2017 年底前开始缩表，随后欧洲央行言论也逐渐趋于鹰派，全球主要央行边际收紧的趋势并未发生改变，中国也是一直坚持稳健中性的货币政策基调。整体而言，随着金融去杠杆的进一步深化和落实，我们预期下半年资本市场的流动性仍会维持中性偏紧的状态。

股市走势展望：预计下半年上证综指维持区间震荡格局，整体市场活跃度会有所提升，“二八现象”将有所改善，成长风格有望重新占优。虽然经济基本面存在一定的下行压力，但历史经验已多次证明，经济增速的小幅波动与 A 股走势之间并没有明显的正相关性，决定股市短期走势的核心因素仍是分母端的无风险收益率和风险偏好的变化。首先从无风险收益率角度，综合考虑经济潜在下行压力、持续低位的通胀率、偏高的中美利差等因素影响，我们判断下半年利率继续上行的空间有限，甚至不排除阶段性回落的可能。其次从风险偏好角度，虽然金融去杠杆这一监管强化的趋势在年内很难扭转，但市场担忧已在 2 季度集中体现，股市超调后我们看到监管层的态度发生了积极的变化，如《减持新规》的出台、IPO 批文的放缓、并购重组审批的加速等，这些都为短期市场风险偏好的升温提供了土壤，我们预计下半年整体的风险偏好不会有显著回落。从风格来看，预计上半年资金抱团白马蓝筹的局面会有显著变化，市场会进入去伪存真阶段，随着中报以及 3 季报业绩预告的陆续披露，部分绩优成长股将逐步显现出估值与业绩匹配的优势，届时超跌的真成长个股可能重新成为存量资金博弈的焦点。

操作思路：基于上述对于市场的预判，我们计划在下半年将本基金仓位总体控制在中性偏高水平，积极把握结构性投资机会。具体操作上通过自下而上精选估值合理的确定性成长品种作为配置核心，结合自上而下的仓位调整和主题筛选，力争取得超额收益。主题上相对看好新能源汽车、国企混改、PPP 资产证券化等板块。

#### 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**

本报告期内，本基金托管人在对华安动态灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，华安动态灵活配置混合型证券投资基金的管理人——华安基金管理有限公司在华安动态灵活配置混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，华安动态灵活配置混合型证券投资基金未进行利润分配。

#### **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**

本托管人依法对华安基金管理有限公司编制和披露的华安动态灵活配置混合型证券投资基金半年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## 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：华安动态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	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		-	-
银行存款	6.4.7.1	20,445,895.22	25,451,553.63
结算备付金		191,692.69	1,060,095.70
存出保证金		188,557.87	181,321.15
交易性金融资产	6.4.7.2	196,395,052.86	228,423,887.27
其中：股票投资		172,249,029.06	196,527,467.27
基金投资		-	-
债券投资		24,146,023.80	31,896,420.00
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	-	-
应收证券清算款		3,636,496.18	-
应收利息	6.4.7.5	40,856.84	65,541.96
应收股利		-	-
应收申购款		46,941.99	182,716.48
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
<b>资产总计</b>		<b>220,945,493.65</b>	<b>255,365,116.19</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2017 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		3,116,252.10	4,632,237.86
应付赎回款		302,610.41	651,252.29
应付管理人报酬		253,120.72	415,695.28
应付托管费		42,186.81	69,282.55
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	299,671.01	691,314.24
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	179,238.52	357,971.19
<b>负债合计</b>		<b>4,193,079.57</b>	<b>6,817,753.41</b>
<b>所有者权益：</b>		-	-
实收基金	6.4.7.9	157,606,420.08	176,407,848.72
未分配利润	6.4.7.10	59,145,994.00	72,139,514.06
<b>所有者权益合计</b>		<b>216,752,414.08</b>	<b>248,547,362.78</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>		<b>220,945,493.65</b>	<b>255,365,116.19</b>

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.375 元，基金份额总额 157,606,420.08 份。

## 6.2 利润表

会计主体：华安动态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	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
<b>一、收入</b>		<b>-2,155,483.15</b>	<b>-22,113,005.47</b>
1.利息收入		147,242.08	199,463.39
其中：存款利息收入	6.4.7.11	89,692.77	159,767.42
债券利息收入		57,549.31	39,695.97
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		122,213.23	-9,203,479.10
其中：股票投资收益	6.4.7.12	445,924.56	-7,961,331.18
基金投资收益	6.4.7.13	-	-
债券投资收益	6.4.7.14	-828,865.33	-1,586,624.58
资产支持证券投资收益	6.4.7.15	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.16	-	-
衍生工具收益	6.4.7.17	-	-
股利收益	6.4.7.18	505,154.00	344,476.66
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	-2,488,483.53	-13,159,163.83
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	63,545.07	50,174.07
<b>减：二、费用</b>		<b>3,653,652.94</b>	<b>5,349,014.10</b>
1. 管理人报酬		1,747,242.24	1,897,552.46
2. 托管费		291,207.03	316,258.76

3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.21	1,417,697.18	2,944,081.94
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.22	197,506.49	191,120.94
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-5,809,136.09</b>	<b>-27,462,019.57</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-5,809,136.09</b>	<b>-27,462,019.57</b>

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安动态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 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）	176,407,848.72	72,139,514.06	248,547,362.78
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-5,809,136.09	-5,809,136.09
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）	-18,801,428.64	-7,184,383.97	-25,985,812.61
其中：1.基金申购款	27,586,477.66	10,582,633.82	38,169,111.48
2.基金赎回款	-46,387,906.30	-17,767,017.79	-64,154,924.09
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）	157,606,420.08	59,145,994.00	216,752,414.08
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）	150,662,827.78	143,889,772.11	294,552,599.89
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-27,462,019.57	-27,462,019.57
三、本期基金份额交易产	4,659,111.19	2,456,966.20	7,116,077.39

生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）			
其中：1.基金申购款	32,716,481.81	20,339,367.48	53,055,849.29
2.基金赎回款	-28,057,370.62	-17,882,401.28	-45,939,771.90
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）	155,321,938.97	118,884,718.74	274,206,657.71

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

华安动态灵活配置混合型证券投资基金(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”)证监许可[2009]第 1115 号《关于核准华安动态灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》核准，由华安基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安动态灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 2,885,044,923.70 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2009)第 274 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华安动态灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2009 年 12 月 22 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 2,885,212,648.61 份基金份额，其中认购资金利息折合 167,724.91 份基金份额。本基金的基金管理人为华安基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安动态灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，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、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券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。本基金股票资产的投资比例占基金资产的 30%-80%；债券等固定收益类资产的投资比例占基金资产的 0%-65%；权证的投资比例占基金资产净值的 0%-3%；现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为：60%×沪深 300 指数收益率+40%×中国债券总指数收益率。

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 8 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”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华安动态灵活配置混合型证券投资基金 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 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日止期间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 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

本会计期间不存在会计估计变更。

### 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	20,445,895.22
定期存款	-
其他存款	-
合计	20,445,895.22

### 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	173,371,917.54	172,249,029.06	-1,122,888.48
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	27,469,179.92	24,146,023.80
	银行间市场	-	-
	合计	27,469,179.92	24,146,023.80
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	200,841,097.46	196,395,052.86	-4,446,044.60

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

无。

### 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	3,608.88
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	77.67
应收债券利息	37,093.97
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	76.32
合计	40,856.84

### 6.4.7.6 其他资产

无。

**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	299,671.01
银行间市场应付交易费用	-
合计	299,671.01

**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	-
应付赎回费	720.03
预提账户维护费	-
预提审计费	29,752.78
预提信息披露费	148,765.71
合计	179,238.52

**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	176,407,848.72	176,407,848.72
本期申购	27,586,477.66	27,586,477.66
本期赎回（以“-”号填列）	-46,387,906.30	-46,387,906.30
本期末	157,606,420.08	157,606,420.08

注：申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

**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	113,091,720.10	-40,952,206.04	72,139,514.06
本期利润	-3,320,652.56	-2,488,483.53	-5,809,136.09
本期基金份额交易产生的变动数	-12,359,757.74	5,175,373.77	-7,184,383.97
其中：基金申购款	17,726,955.42	-7,144,321.60	10,582,633.82
基金赎回款	-30,086,713.16	12,319,695.37	-17,767,017.79
本期已分配利润	-	-	-

本期末	97,411,309.80	-38,265,315.80	59,145,994.00
-----	---------------	----------------	---------------

#### 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	80,050.65
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	1,692.86
结算备付金利息收入	7,949.26
其他	-
合计	89,692.77

#### 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	479,885,251.79
减：卖出股票成本总额	479,439,327.23
买卖股票差价收入	445,924.56

#### 6.4.7.13 基金投资收益

无。

#### 6.4.7.14 债券投资收益

##### 6.4.7.14.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	4,842,426.35
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	5,669,358.53
减：应收利息总额	1,933.15
买卖债券差价收入	-828,865.33

##### 6.4.7.14.2 债券投资收益——赎回差价收入

无。

##### 6.4.7.14.3 债券投资收益——申购差价收入

无。

**6.4.7.15 资产支持证券投资收益**

无。

**6.4.7.16 贵金属投资收益**

无。

**6.4.7.17 衍生工具收益**

**6.4.7.17.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

无。

**6.4.7.17.2 衍生工具收益——其他投资收益**

无。

**6.4.7.18 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	505,154.00
基金投资产生的股利收益	-
合计	505,154.00

**6.4.7.19 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	-2,488,483.53
——股票投资	-407,445.86
——债券投资	-2,081,037.67
——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	-2,488,483.53

**6.4.7.20 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	63,545.07
合计	63,545.07

注：基金赎回费收入含赎回费收入和转换费收入。本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产。基金之间的转换费由赎回费和申购费补差两部分构成，其中赎回费部分的 25% 归入转出基金的基金资产。

#### 6.4.7.21 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	1,417,697.18
银行间市场交易费用	-
合计	1,417,697.18

#### 6.4.7.22 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	29,752.78
信息披露费	148,765.71
银行汇划费用	388.00
帐户维护费	18,000.00
其他费用	600.00
合计	197,506.49

#### 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
中国工商银行股份有限公司(“工商银行”)	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**

无。

**6.4.10.1.1 股票交易**

无。

**6.4.10.1.2 权证交易**

无。

**6.4.10.1.3 债券交易**

无。

**6.4.10.1.4 债券回购交易**

无。

**6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金**

无。

**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	1,747,242.24	1,897,552.46
其中：支付销售机构的客户维护费	324,047.02	357,504.07

注：支付基金管理人华安基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=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	291,207.03	316,258.76

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费 = 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

份额单位：份

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
期初持有的基金份额	-	16,608,304.50
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	-	16,608,304.50
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	10.69%

#### 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

无。

### 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
中国工商银行	20,445,895.22	80,050.65	52,314,254.52	143,809.41

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，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

无。

#### 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	-

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

代码	名称	日期	原因	值单价	日期	开 盘 单 价	(单位: 股)	成本总额	估值总额	
002409	雅克科技	2017-04-21	重大事项	20.63	-	-	900,000.00	19,591,689.67	18,567,000.00	-
002696	百洋股份	2017-06-22	资产重组	20.87	2017-07-03	21.74	350,000.00	8,661,091.70	7,304,500.00	-
300145	中金环境	2017-06-28	资产重组	16.92	-	-	119,880.00	1,940,891.00	2,028,369.60	-
300252	金信诺	2017-05-12	重大事项	21.65	2017-07-27	19.49	200,000.00	5,390,021.86	4,330,000.00	-
600375	*ST 星马	2017-03-02	资产重组	8.36	2017-08-08	7.52	500,000.00	3,934,339.00	4,180,000.00	-

### 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

本基金是一只进行主动投资的混合型证券投资基金, 基金的风险与预期收益都要低于股票型基金, 高于债券型基金和货币市场基金, 属于证券投资基金中的中等风险和中等收益品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资、权证投资及资产支持证券投资等。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以上风险控制在限定的范围之内, 本基金通过对股票、债券等金融资产的动态灵活配置, 在合理控制投资风险和保障基金资产流动性的基础上, 追求基金资产的长期稳定增值, 力求为投资者获取超额回报。

#### 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。本基金的银行存款存放在本基金的托管行 中国工商银行，因而与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。

#### 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、存出保证金和债券投资等。

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	20,445,895.22	-	-	-	20,445,895.22
结算备付金	191,692.69	-	-	-	191,692.69
存出保证金	188,557.87	-	-	-	188,557.87
交易性金融资产	196,395,052.86	-	-	-	196,395,052.86
应收利息	40,856.84	-	-	-	40,856.84
应收申购款	46,941.99	-	-	-	46,941.99
应收证券清算款	3,636,496.18	-	-	-	3,636,496.18
资产总计	220,945,493.65	-	-	-	220,945,493.65
负债					
应付证券清算款	3,116,252.10	-	-	-	3,116,252.10
应付赎回款	302,610.41	-	-	-	302,610.41
应付管理人报酬	253,120.72	-	-	-	253,120.72
应付托管费	42,186.81	-	-	-	42,186.81
应付交易费用	299,671.01	-	-	-	299,671.01
其他负债	179,238.52	-	-	-	179,238.52
负债总计	4,193,079.57	-	-	-	4,193,079.57
利率敏感度缺口	216,752,414.08	-	-	-	216,752,414.08
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	25,451,553.63	-	-	-	25,451,553.63
结算备付金	1,060,095.70	-	-	-	1,060,095.70
存出保证金	181,321.15	-	-	-	181,321.15
交易性金融资产	31,896,420.00	-	-	196,527,467.27	228,423,887.27
应收利息	-	-	-	65,541.96	65,541.96

应收申购款	-	-	-	182,716.48	182,716.48
资产总计	58,589,390.48	-	-	196,775,725.71	255,365,116.19
负债	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	4,632,237.86	4,632,237.86
应付赎回款	-	-	-	651,252.29	651,252.29
应付管理人报酬	-	-	-	415,695.28	415,695.28
应付托管费	-	-	-	69,282.55	69,282.55
应付交易费用	-	-	-	691,314.24	691,314.24
其他负债	-	-	-	357,971.19	357,971.19
负债总计	-	-	-	6,817,753.41	6,817,753.41
利率敏感度缺口	58,589,390.48	-	-	189,957,972.30	248,547,362.78

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

于 2017 年 6 月 30 日本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 11.14%(2016 年 12 月 31 日：12.83%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2016 年 12 月 31 日：同)。

#### 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。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

无。

##### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

无。

#### 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。本基金投资组合中股票资产的投资比例占基金资产的 30%-80%；债券等固定收益类资产的投资比例占基金资产的 0-65%；权证的投资比例占基金资产净值的 0-3%。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	172,249,029.06	79.47	196,527,467.27	79.07
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	172,249,029.06	79.47	196,527,467.27	79.07

#### 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 1,476	增加约 2,228
	业绩比较基准下降 5%	减少约 1,476	减少约 2,228

#### 6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

#### 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	172,249,029.06	77.96

	其中：股票	172,249,029.06	77.96
2	固定收益投资	24,146,023.80	10.93
	其中：债券	24,146,023.80	10.93
	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	20,637,587.91	9.34
7	其他各项资产	3,912,852.88	1.77
8	合计	220,945,493.65	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	7,304,500.00	3.37
B	采矿业	1,730,250.00	0.80
C	制造业	132,279,672.92	61.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	20,240,912.00	9.34
F	批发和零售业	-	-
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	3,936,847.02	1.82
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	6,756,847.12	3.12
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	172,249,029.06	79.47

### 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	002409	雅克科技	900,000	18,567,000.00	8.57
2	600477	杭萧钢构	850,000	12,971,000.00	5.98
3	002466	天齐锂业	200,000	10,870,000.00	5.01
4	600114	东睦股份	600,000	10,500,000.00	4.84
5	002850	科达利	88,800	8,062,152.00	3.72
6	002074	国轩高科	250,000	7,887,500.00	3.64
7	002460	赣锋锂业	160,000	7,400,000.00	3.41
8	002696	百洋股份	350,000	7,304,500.00	3.37
9	600093	易见股份	500,000	6,715,000.00	3.10
10	002468	申通快递	260,000	6,606,600.00	3.05
11	002497	雅化集团	600,000	5,820,000.00	2.69
12	600782	新钢股份	1,555,500	5,677,575.00	2.62
13	300197	铁汉生态	400,000	5,312,000.00	2.45
14	000920	南方汇通	400,000	4,976,000.00	2.30
15	300252	金信诺	200,000	4,330,000.00	2.00
16	300568	星源材质	100,000	4,245,000.00	1.96
17	600375	*ST 星马	500,000	4,180,000.00	1.93
18	600328	兰太实业	350,000	4,074,000.00	1.88
19	300031	宝通科技	213,660	3,929,207.40	1.81
20	600884	杉杉股份	200,000	3,294,000.00	1.52
21	002753	永东股份	166,699	3,095,600.43	1.43
22	002340	格林美	500,000	3,025,000.00	1.40
23	600516	方大炭素	200,000	2,844,000.00	1.31
24	002092	中泰化学	222,200	2,821,940.00	1.30
25	002271	东方雨虹	75,000	2,782,500.00	1.28
26	300073	当升科技	100,000	2,494,000.00	1.15
27	300410	正业科技	65,900	2,378,990.00	1.10
28	603239	浙江仙通	80,000	2,082,400.00	0.96
29	300145	中金环境	119,880	2,028,369.60	0.94
30	002310	东方园林	117,100	1,957,912.00	0.90

31	601168	西部矿业	225,000	1,730,250.00	0.80
32	600456	宝钛股份	66,000	1,354,320.00	0.62
33	600083	博信股份	50,000	660,000.00	0.30
34	002880	卫光生物	998	75,548.60	0.03
35	300666	江丰电子	2,276	43,448.84	0.02
36	300662	科锐国际	1,656	41,847.12	0.02
37	002879	长缆科技	1,313	23,660.26	0.01
38	002881	美格智能	989	22,608.54	0.01
39	002882	金龙羽	2,966	18,389.20	0.01
40	300669	沪宁股份	841	14,650.22	0.01
41	300670	大烨智能	1,259	13,760.87	0.01
42	300672	国科微	1,257	10,659.36	0.00
43	300671	富满电子	942	7,639.62	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	002460	赣锋锂业	18,916,850.21	7.61
2	002468	申通快递	16,664,381.07	6.70
3	002466	天齐锂业	11,839,913.40	4.76
4	600477	杭萧钢构	11,818,437.05	4.76
5	000630	铜陵有色	11,704,064.00	4.71
6	002497	雅化集团	11,393,556.03	4.58
7	002590	万安科技	10,620,053.00	4.27
8	300566	激智科技	10,036,186.00	4.04
9	002850	科达利	9,435,072.20	3.80
10	600122	宏图高科	9,140,063.00	3.68
11	300568	星源材质	9,132,289.14	3.67
12	002310	东方园林	8,867,164.06	3.57
13	600082	海泰发展	8,691,319.20	3.50
14	002696	百洋股份	8,661,091.70	3.48
15	002074	国轩高科	8,187,881.88	3.29
16	000920	南方汇通	8,038,475.22	3.23
17	300197	铁汉生态	7,856,223.50	3.16
18	601111	中国国航	7,534,678.00	3.03
19	300252	金信诺	7,411,280.06	2.98
20	600114	东睦股份	7,397,722.40	2.98
21	002340	格林美	7,050,495.00	2.84
22	600821	津劝业	6,675,838.10	2.69

23	600884	杉杉股份	6,260,206.26	2.52
24	000652	泰达股份	6,124,165.06	2.46
25	300078	思创医惠	5,930,859.00	2.39
26	002019	亿帆医药	5,498,697.63	2.21
27	002479	富春环保	5,456,877.27	2.20
28	300188	美亚柏科	5,321,378.88	2.14
29	603599	广信股份	5,314,764.93	2.14
30	600782	新钢股份	5,310,701.00	2.14
31	000807	云铝股份	5,129,885.71	2.06
32	600332	白云山	5,105,880.05	2.05
33	300061	康耐特	5,030,378.00	2.02
34	002775	文科园林	5,018,881.38	2.02

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	300365	恒华科技	19,711,169.31	7.93
2	300411	金盾股份	18,153,067.25	7.30
3	600093	易见股份	14,689,732.60	5.91
4	000630	铜陵有色	14,475,125.00	5.82
5	002460	赣锋锂业	12,656,471.50	5.09
6	300566	激智科技	11,986,075.16	4.82
7	600477	杭萧钢构	11,653,930.75	4.69
8	600362	江西铜业	10,500,590.52	4.22
9	002590	万安科技	10,471,559.39	4.21
10	002468	申通快递	10,205,536.83	4.11
11	600122	宏图高科	9,342,254.00	3.76
12	600083	博信股份	9,108,790.70	3.66
13	002497	雅化集团	8,249,496.00	3.32
14	300224	正海磁材	8,206,903.29	3.30
15	002196	方正电机	7,910,208.65	3.18
16	600082	海泰发展	7,908,785.00	3.18
17	300073	当升科技	7,736,732.05	3.11
18	002310	东方园林	7,677,604.78	3.09
19	300069	金利华电	7,408,596.86	2.98
20	000949	新乡化纤	7,384,983.40	2.97
21	601111	中国国航	7,350,586.98	2.96
22	600826	兰生股份	7,011,181.40	2.82
23	300014	亿纬锂能	6,464,684.80	2.60

24	300078	思创医惠	6,098,772.36	2.45
25	300188	美亚柏科	6,051,414.84	2.43
26	600821	津劝业	5,990,121.00	2.41
27	000652	泰达股份	5,865,564.28	2.36
28	002479	富春环保	5,703,516.00	2.29
29	000807	云铝股份	5,371,305.59	2.16
30	300061	康耐特	5,325,916.90	2.14
31	600332	白云山	5,183,486.00	2.09
32	002108	沧州明珠	5,175,809.50	2.08
33	002019	亿帆医药	4,985,417.50	2.01

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	455,568,334.88
卖出股票的收入（成交）总额	479,885,251.79

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	24,146,023.80	11.14
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-

10	合计	24,146,023.80	11.14
----	----	---------------	-------

### 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	113010	江南转债	176,010	18,371,923.80	8.48
2	128013	洪涛转债	57,000	5,774,100.00	2.66

### 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

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	188,557.87
2	应收证券清算款	3,636,496.18
3	应收股利	-
4	应收利息	40,856.84
5	应收申购款	46,941.99
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,912,852.88

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	128013	洪涛转债	5,774,100.00	2.66
2	113010	江南转债	18,371,923.80	8.48

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002409	雅克科技	18,567,000.00	8.57	重大事项
2	002696	百洋股份	7,304,500.00	3.37	资产重组

### 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
11,461	13,751.54	26,390,236.68	16.74%	131,216,183.40	83.26%

### 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	197,491.16	0.13%

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

## 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2009 年 12 月 22 日）基金份额总额	2,885,212,648.61
本报告期期初基金份额总额	176,407,848.72
本报告期基金总申购份额	27,586,477.66
减：本报告期基金总赎回份额	46,387,906.30
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	157,606,420.08

注：总申购份额含转换入份额。总赎回份额含转换出份额。

## 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	
中金公司	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-	-
财富里昂	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
广发华福	1	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-

中天证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
世纪证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
中投证券	2	-	-	-	-	-
宏信证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
民族证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
西藏东方财富	1	344,846,172.18	37.00%	314,258.38	36.76%	-
民生证券	1	115,439,164.25	12.39%	107,508.73	12.58%	-
恒泰证券	1	110,311,450.78	11.84%	102,732.56	12.02%	-
天风证券	1	95,568,510.27	10.25%	87,091.67	10.19%	-
安信证券	1	90,075,423.86	9.66%	82,085.78	9.60%	-
华泰证券	1	51,049,567.72	5.48%	46,521.30	5.44%	-
中泰证券	2	45,024,422.92	4.83%	41,030.65	4.80%	-
中信证券	1	32,342,676.04	3.47%	30,120.72	3.52%	-
国泰君安	1	25,712,405.65	2.76%	23,431.65	2.74%	-
银河证券	1	17,812,996.44	1.91%	16,589.32	1.94%	-
华创证券	1	3,829,277.30	0.41%	3,566.19	0.42%	-

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：

2017 年 2 月完成租用托管在工商银行的瑞银证券深圳 003414 交易单元。

**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
中金公司	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
财富里昂	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
广发华福	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
中天证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
世纪证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
宏信证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-

国信证券	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
民族证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
西藏东方财富	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	4,842,426.35	100.00%	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-

### 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	关于旗下部分基金增加海峡银行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	2017-02-15
6	关于旗下部分基金增加朝阳永续为销售机构	《上海证券报》、《证券时	2017-02-22

	并参加费率优惠活动的公告	报》、《中国证券报》和公司网站	
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	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
9	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
10	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
11	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
12	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
13	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的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-04-06
14	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
15	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
16	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
17	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
18	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
19	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
20	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“雅克科技”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	2017-04-27

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	2017-04-28
22	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“炼石有色”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	2017-04-28
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	2017-04-29
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	2017-05-03
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	2017-05-04
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	2017-05-06
27	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
28	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
29	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
30	关于旗下部分基金增加中民财富为销售机构并参加费率优惠的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-06-07
31	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
32	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
33	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
34	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](http://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。

### 11.2 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、《华安动态灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- 2、《华安动态灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》
- 3、《华安动态灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- 4、中国证监会批准华安动态灵活配置混合型证券投资基金设立的文件；
- 5、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告原件；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
- 7、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 8、华安基金管理有限公司开放式基金业务规则；

### 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