

华安宏利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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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	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	11
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	11
5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	11
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	11
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	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	14
6.4 报表附注	15
7 投资组合报告	31
7.1 期末基金资产组合情况	31
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	32
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	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	39
8 基金份额持有人信息	40
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	40

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	41
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	41
9 开放式基金份额变动	41
10 重大事件揭示	41
10.1 基金份额持有人大会决议	41
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	41
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
11 影响投资者决策的其他重要信息	47
12 备查文件目录	47
12.1 备查文件目录	47
12.2 存放地点	47
12.3 查阅方式	48

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华安宏利混合型证券投资基金	
基金简称	华安宏利混合	
基金主代码	040005	
交易代码	040005(前端)	041005(后端)
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2006年9月6日	
基金管理人	华安基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	629,641,935.02 份	
基金合同存续期	不定期	

2.2 基金产品说明

投资目标	通过持续获取价格回归价值所带来的资本收益，以及分红所带来的红利收益，实现基金资产的稳定增值。
投资策略	本基金将采用自上而下和自下而上相结合的方法构建投资组合，并在投资流程中采用公司开发的数量分析模型进行支持，使其更为科学和客观。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×90%+同业存款利率×10%
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	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	钱鲲	田青
	联系电话	021-38969999	010-67595096
	电子邮箱	qiankun@huaan.com.cn	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		4008850099	010-67595096
传真		021-68863414	010-66275853
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	北京市西城区金融大街25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	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码		200120	100033
法定代表人		朱学华	王洪章

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	-68,298,923.45
本期利润	121,788,206.23
加权平均基金份额本期利润	0.1884
本期加权平均净值利润率	5.70%
本期基金份额净值增长率	5.80%
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	1,553,761,177.07
期末可供分配基金份额利润	2.4677
期末基金资产净值	2,183,403,112.09
期末基金份额净值	3.4677
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	342.52%

注：1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如：封闭式基金交易佣金、开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

3、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

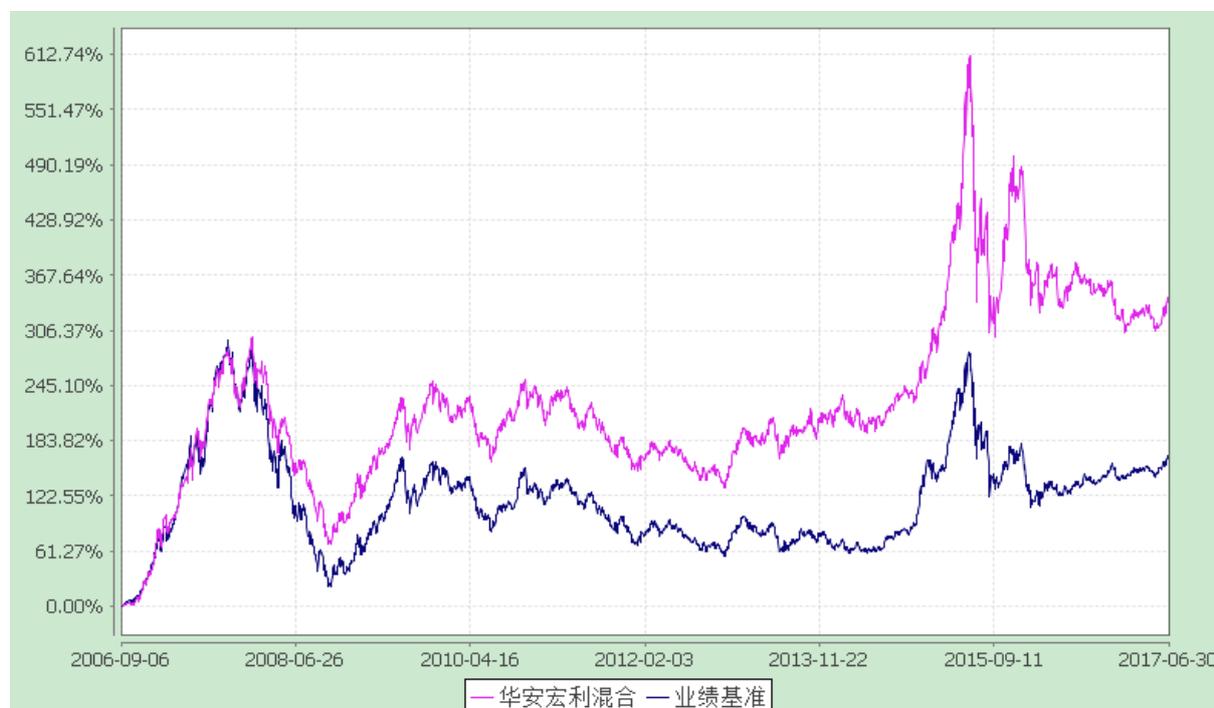
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	7.25%	0.85%	4.49%	0.61%	2.76%	0.24%
过去三个月	3.83%	0.79%	5.51%	0.56%	-1.68%	0.23%
过去六个月	5.80%	0.75%	9.74%	0.51%	-3.94%	0.24%
过去一年	-3.51%	0.79%	14.71%	0.60%	-18.22%	0.19%
过去三年	42.11%	1.83%	60.07%	1.55%	-17.96%	0.28%
自基金合同生效起至今	342.52%	1.65%	165.84%	1.65%	176.68%	0.00%

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

华安宏利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
(2006 年 9 月 6 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		
王春	本基金的基金经理	2015-10-28	-	15 年	硕士研究生，15 年证券、基金行业从业经验。曾任德恒证券研究所研究员、兴业证券研究所市场研究部主管、平安资产管理有限责任公司投资经理兼研究总监、汇丰晋信基金基金经理兼策略与金融工程总监。2015 年 5 月加入华安基金，2015 年 10 月起担任本基金的基金经理；2015 年 11 月起担任华安安益保本混合型证券投资基金的基金经理。

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 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，A 股市场震荡上升，沪深 300 指数累计涨幅 2.86%，创业板指数下跌了 7.34%。其中，家电、煤炭、食品饮料、银行等板块大幅跑赢市场；而计算机、传媒、农业、纺织服装则大幅落后市场。

本组合在报告期内主要配置在医药、家电、食品饮料、建筑、电子等行业，个股配置上主要集中于具备良好业绩的白马成长股和价值股，取得了一定的效果。

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 3.4677 元，本报告期份额净值增长率为 5.80%，同期业绩比较基准增长率为 9.74%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们认为宏观经济总体仍将维持在景气区间，持续的供给侧改革和经济去杠杆有利于市场逐步出清，也有利于经济持续温和复苏；而下半年十九大的召开和政府换届，也有望掀起新一轮改革高潮，催生新一轮的改革红利。从全球来看，预计经济温和复苏的态势仍将持续，国际经济环境仍然相对宽松。

展望下半年 A 股市场，我们判断总体风险不大，股票市场震荡上行的机会偏大，投资机会也将更加丰富。其中，在盈利持续改善，中长线资金不断入市的背景下，低估值行业龙头股预计将在下半年迎来估值切换机会。前期泥沙俱下，跌幅较大的中小创板块也将逐步进入价值区间，部分估值合理、成长性突出、行业地位显著的优质成长股也将迎来建仓机会。另外，在供给收缩、行业集中度提升的背景下，周期性行业的盈利明显改善，也具备一定的投资机会。

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

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

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

本托管人复核审查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。

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：华安宏利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
资产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	96,194,812.51	274,064,362.68
结算备付金		8,637,925.97	22,851,961.95
存出保证金		1,139,808.04	2,384,759.01
交易性金融资产	6.4.7.2	2,092,447,943.81	1,890,354,634.52
其中：股票投资		1,958,895,574.01	1,760,060,634.52
基金投资		-	-
债券投资		133,552,369.80	130,294,000.00
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		-	-
应收证券清算款		1,091,551.07	-
应收利息	6.4.7.3	2,032,480.49	3,390,689.66
应收股利		-	-
应收申购款		41,745.74	70,974.43
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		2,201,586,267.63	2,193,117,382.25
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		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		6,141,427.38	3,525,594.07
应付赎回款		2,807,980.40	769,964.29

应付管理人报酬		2,610,778.03	2,839,299.01
应付托管费		435,129.68	473,216.52
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.4	5,736,987.27	10,395,362.83
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.5	450,852.78	650,892.14
负债合计		18,183,155.54	18,654,328.86
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.6	629,641,935.02	663,452,048.72
未分配利润	6.4.7.7	1,553,761,177.07	1,511,011,004.67
所有者权益合计		2,183,403,112.09	2,174,463,053.39
负债和所有者权益总计		2,201,586,267.63	2,193,117,382.25

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 3.4677 元，基金份额总额 629,641,935.02 份。

6.2 利润表

会计主体：华安宏利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
一、收入		159,523,250.04	-597,200,685.19
1.利息收入		3,371,984.25	4,484,937.16
其中：存款利息收入	6.4.7.8	962,376.55	2,005,016.54
债券利息收入		2,261,268.10	2,479,920.62
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		148,339.60	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-33,965,419.12	-477,310,230.41
其中：股票投资收益	6.4.7.9	-48,102,247.09	-486,156,471.18
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.10	-772,456.67	-592,410.00
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	6.4.7.11	14,909,284.64	9,438,650.77
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.12	190,087,129.68	-124,434,470.11

4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.13	29,555.23	59,078.17
减：二、费用		37,735,043.81	45,476,949.54
1. 管理人报酬		15,893,382.01	18,894,334.93
2. 托管费		2,648,896.98	3,149,055.86
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.14	18,972,613.66	23,210,836.09
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.15	220,151.16	222,722.66
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		121,788,206.23	-642,677,634.73
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		121,788,206.23	-642,677,634.73

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安宏利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）	663,452,048.72	1,511,011,004.67	2,174,463,053.39
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	121,788,206.23	121,788,206.23
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）	-33,810,113.70	-79,038,033.83	-112,848,147.53
其中：1.基金申购款	13,555,835.32	31,197,968.58	44,753,803.90
2.基金赎回款	-47,365,949.02	-110,236,002.41	-157,601,951.43
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）	629,641,935.02	1,553,761,177.07	2,183,403,112.09
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	700,364,110.18	2,459,542,640.69	3,159,906,750.87

金净值)			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-642,677,634.73	-642,677,634.73
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-3,614,736.93	-9,728,506.61	-13,343,243.54
其中: 1.基金申购款	31,066,882.66	82,186,379.17	113,253,261.83
2.基金赎回款	-34,681,619.59	-91,914,885.78	-126,596,505.37
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)	696,749,373.25	1,807,136,499.35	2,503,885,872.60

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

华安宏利混合型证券投资基金(原名为华安宏利股票型证券投资基金,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”)证监基金字[2006]第 143 号《关于同意华安宏利股票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《华安宏利股票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,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 1,683,963,683.51 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(2006)第 112 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华安宏利股票型证券投资基金基金合同》于 2006 年 9 月 6 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,684,224,358.17 份基金份额,其中认购资金利息折合 260,674.66 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,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据 2014 年中国证监会令第 104 号《公开募集证券投资基金运作管理办法》,华安宏利股票型证券投资基金于 2015 年 8 月 6 日公告后更名为华安宏利混合型证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安宏利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。本基金股票投资比例范围为基金资产净值的 60%-95%，债券的投资比例为基金资产净值的 5%-40%，现金和到期日在一年以内的政府债券为基金资产净值的 5% 以上。根据《华安基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金变更业绩比较基准的公告》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起本基金的业绩比较基准由“中信标普 300 指数收益率×90%+金融同业存款利率×10%”变更为“沪深 300 指数收益率×90%+金融同业存款利率×10%”。

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 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》各项具体及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华安宏利股票型证券投资基金 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 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	96,194,812.51
定期存款	-
其他存款	-
合计	96,194,812.51

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	1,796,350,046.43	1,958,895,574.01	162,545,527.58
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	4,007,369.80	193,369.80
	银行间市场	129,843,130.00	-298,130.00
	合计	133,657,130.00	-104,760.20
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,930,007,176.43	2,092,447,943.81	162,440,767.38

6.4.7.3 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	35,844.27
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	3,498.30
应收债券利息	1,992,676.31
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	461.61
合计	2,032,480.49

6.4.7.4 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	5,736,737.27
银行间市场应付交易费用	250.00
合计	5,736,987.27

6.4.7.5 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	250,000.00
应付赎回费	1,506.62
预提账户维护费	-
预提审计费	50,580.45
预提信息披露费	148,765.71
合计	450,852.78

6.4.7.6 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	663,452,048.72	663,452,048.72
本期申购	13,555,835.32	13,555,835.32
本期赎回（以“-”号填列）	-47,365,949.02	-47,365,949.02
本期末	629,641,935.02	629,641,935.02

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.7 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	1,844,590,423.75	-333,579,419.08	1,511,011,004.67
本期利润	-68,298,923.45	190,087,129.68	121,788,206.23
本期基金份额交易产生的变动数	-93,398,318.30	14,360,284.47	-79,038,033.83
其中：基金申购款	37,295,707.41	-6,097,738.83	31,197,968.58
基金赎回款	-130,694,025.71	20,458,023.30	-110,236,002.41
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,682,893,182.00	-129,132,004.93	1,553,761,177.07

6.4.7.8 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	854,062.50
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	95,132.36
其他	13,181.69
合计	962,376.55

6.4.7.9 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	6,257,497,846.15
减：卖出股票成本总额	6,305,600,093.24
买卖股票差价收入	-48,102,247.09

6.4.7.10 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	154,965,000.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	150,772,456.67
减：应收利息总额	4,965,000.00
买卖债券差价收入	-772,456.67

6.4.7.11 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	14,909,284.64
基金投资产生的股利收益	-
合计	14,909,284.64

6.4.7.12 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	190,087,129.68
——股票投资	189,400,413.21
——债券投资	686,716.47
——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	190,087,129.68

6.4.7.13 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	29,555.23
合计	29,555.23

注：1. 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。

2. 本基金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。

6.4.7.14 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	18,971,788.66
银行间市场交易费用	825.00
合计	18,972,613.66

6.4.7.15 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	50,580.45
信息披露费	148,765.71
银行汇划费用	11,805.00
帐户维护费	9,000.00
合计	220,151.16

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
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	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	15,893,382.01	18,894,334.93
其中：支付销售机构的客户维护费	1,996,473.62	2,348,929.68

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	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
当期发生的基金应支付的托管费	2,648,896.98	3,149,055.86

注：支付基金托管人中国建设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。

6.4.10.3 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

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
中国建设银行	96,194,812.51	854,062.50	482,627,271.56	1,906,669.41

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，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

本报告期不进行收益分配。

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	-
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	-

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

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
000716	黑芝麻	2017-01-03	重大事项	8.06	2017-08-15	7.25	1,419,400.00	11,284,135.40	11,440,364.00	-
002127	南极电商	2017-06-29	重大资产重组	12.08	2017-07-06	12.61	502,100.00	6,380,351.00	6,065,368.00	-
300145	中金环境	2017-06-28	重大资产重组	16.92	-	-	65,380.00	1,056,245.50	1,106,229.60	-
300440	运达科技	2017-02-20	重大资产重组	13.12	-	-	776,786.00	11,200,308.60	10,191,432.32	-

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。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。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，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”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，将风险控制可在可承受的范围内。

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建设银行，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，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.18%(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

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约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	96,194,812.51	-	-	-	96,194,812.51
结算备付金	8,637,925.97	-	-	-	8,637,925.97
存出保证金	1,139,808.04	-	-	-	1,139,808.04
交易性金融资产	133,552,369.80	-	-	1,958,895,574.01	2,092,447,943.81
应收证券清算款	-	-	-	1,091,551.07	1,091,551.07
应收利息	-	-	-	2,032,480.49	2,032,480.49
应收申购款	-	-	-	41,745.74	41,745.74
资产总计	239,524,916.32	-	-	1,962,061,351.31	2,201,586,267.63
负债					
应付证券清算款	-	-	-	6,141,427.38	6,141,427.38
应付赎回款	-	-	-	2,807,980.40	2,807,980.40
应付管理人报酬	-	-	-	2,610,778.03	2,610,778.03
应付托管费	-	-	-	435,129.68	435,129.68
应付交易费用	-	-	-	5,736,987.27	5,736,987.27
其他负债	-	-	-	450,852.78	450,852.78
负债总计	-	-	-	18,183,155.54	18,183,155.54
利率敏感度缺口	239,524,916.32	-	-	1,943,878,195.77	2,183,403,112.09
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	274,064,362.68	-	-	-	274,064,362.68

					8
结算备付金	22,851,961.95	-	-	-	22,851,961.95
存出保证金	2,384,759.01	-	-	-	2,384,759.01
交易性金融资产	130,294,000.00	-	-	1,760,060,634.52	1,890,354,634.52
应收利息	-	-	-	3,390,689.66	3,390,689.66
应收申购款	-	-	-	70,974.43	70,974.43
资产总计	429,595,083.64	-	-	1,763,522,298.61	2,193,117,382.25
负债					
应付证券清算款	-	-	-	3,525,594.07	3,525,594.07
应付赎回款	-	-	-	769,964.29	769,964.29
应付管理人报酬	-	-	-	2,839,299.01	2,839,299.01
应付托管费	-	-	-	473,216.52	473,216.52
应付交易费用	-	-	-	10,395,362.83	10,395,362.83
其他负债	-	-	-	650,892.14	650,892.14
负债总计	-	-	-	18,654,328.86	18,654,328.86
利率敏感度缺口	429,595,083.64	-	-	1,744,867,969.75	2,174,463,053.39

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 19	减少约 9
	市场利率下降 25 个基点	增加约 19	增加约 9

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。本基金投资组合中股票投资比例范围为基金资产净值的 60-95%，债券的投资比例为基金资产净值的 5-40%，现金和到期日在一年以内的政府债券为基金资产净值的 5% 以上。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	1,958,895,574.01	89.72	1,760,060,634.52	80.94
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	1,958,895,574. 01	89.72	1,760,060,634 .52	80.94
----	----------------------	-------	----------------------	-------

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 13,204	增加约 10,857
	业绩比较基准下降 5%	减少约 13,204	减少约 10,857

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	1,958,895,574.01	88.98
	其中：股票	1,958,895,574.01	88.98
2	固定收益投资	133,552,369.80	6.07
	其中：债券	133,552,369.80	6.07
	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	104,832,738.48	4.76
7	其他各项资产	4,305,585.34	0.20
8	合计	2,201,586,267.63	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	11,400,470.94	0.52
B	采矿业	115,452,319.95	5.29
C	制造业	1,112,686,137.13	50.96
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	127,568,079.85	5.84
F	批发和零售业	133,279,543.47	6.10
G	交通运输、仓储和邮政业	24,957,326.00	1.14
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	80,629,312.11	3.69
J	金融业	231,668,394.95	10.61
K	房地产业	17,915,565.22	0.82
L	租赁和商务服务业	16,212,089.42	0.74
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	38,583,295.22	1.77

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	48,543,039.75	2.22
S	综合	-	-
	合计	1,958,895,574.01	89.72

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	000651	格力电器	3,302,658	135,970,429.86	6.23
2	600028	中国石化	16,708,015	99,078,528.95	4.54
3	002236	大华股份	3,561,489	81,237,564.09	3.72
4	600487	亨通光电	2,770,453	77,711,206.65	3.56
5	600522	中天科技	6,001,551	72,318,689.55	3.31
6	601318	中国平安	1,287,123	63,854,172.03	2.92
7	000333	美的集团	1,344,436	57,864,525.44	2.65
8	601607	上海医药	1,954,815	56,455,057.20	2.59
9	002508	老板电器	1,276,180	55,488,306.40	2.54
10	000858	五粮液	986,221	54,893,060.86	2.51
11	600056	中国医药	2,110,366	54,763,997.70	2.51
12	600703	三安光电	2,777,500	54,716,750.00	2.51
13	600030	中信证券	3,106,200	52,867,524.00	2.42
14	600036	招商银行	2,055,394	49,144,470.54	2.25
15	600887	伊利股份	2,186,515	47,206,858.85	2.16
16	600068	葛洲坝	3,899,133	43,826,254.92	2.01
17	601688	华泰证券	2,327,141	41,655,823.90	1.91
18	601668	中国建筑	3,940,155	38,140,700.40	1.75
19	601012	隆基股份	2,175,504	37,201,118.40	1.70
20	000069	华侨城 A	3,622,647	36,443,828.82	1.67
21	000895	双汇发展	1,511,895	35,907,506.25	1.64
22	600477	杭萧钢构	2,313,734	35,307,580.84	1.62
23	600373	中文传媒	1,497,625	35,209,163.75	1.61
24	000963	华东医药	693,575	34,470,677.50	1.58
25	600196	复星医药	925,570	28,683,414.30	1.31
26	000501	鄂武商 A	1,421,187	26,235,112.02	1.20
27	300418	昆仑万维	1,061,032	24,265,801.84	1.11
28	601601	中国太保	712,766	24,141,384.42	1.11
29	600104	上汽集团	696,334	21,621,170.70	0.99

30	002241	歌尔股份	1,104,657	21,297,786.96	0.98
31	600219	南山铝业	6,138,437	20,809,301.43	0.95
32	300323	华灿光电	1,434,100	19,905,308.00	0.91
33	002285	世联行	2,233,861	17,915,565.22	0.82
34	002174	游族网络	540,380	17,162,468.80	0.79
35	601899	紫金矿业	4,773,700	16,373,791.00	0.75
36	603833	欧派家居	131,532	14,450,105.52	0.66
37	000921	海信科龙	830,700	14,296,347.00	0.65
38	600309	万华化学	469,800	13,455,072.00	0.62
39	601006	大秦铁路	1,462,200	12,267,858.00	0.56
40	002624	完美世界	357,155	12,250,416.50	0.56
41	601231	环旭电子	743,210	11,675,829.10	0.53
42	000716	黑芝麻	1,419,400	11,440,364.00	0.52
43	002714	牧原股份	418,827	11,400,470.94	0.52
44	600089	特变电工	1,097,425	11,336,400.25	0.52
45	600176	中国巨石	1,023,800	11,241,324.00	0.51
46	000338	潍柴动力	848,500	11,200,200.00	0.51
47	603868	飞科电器	178,329	11,027,865.36	0.51
48	603355	莱克电气	185,272	10,888,435.44	0.50
49	002466	天齐锂业	199,062	10,819,019.70	0.50
50	002543	万和电气	439,795	10,805,763.15	0.49
51	002745	木林森	286,925	10,728,125.75	0.49
52	601111	中国国航	1,078,300	10,513,425.00	0.48
53	300061	康耐特	569,842	10,496,489.64	0.48
54	002051	中工国际	496,553	10,293,543.69	0.47
55	002668	奥马电器	521,387	10,271,323.90	0.47
56	300440	运达科技	776,786	10,191,432.32	0.47
57	601888	中国国旅	336,653	10,146,721.42	0.46
58	603898	好莱客	287,312	10,041,554.40	0.46
59	000997	新大陆	433,112	9,827,311.28	0.45
60	002640	跨境通	433,847	9,219,248.75	0.42
61	000066	中国长城	941,930	8,486,789.30	0.39
62	300144	宋城演艺	379,558	7,921,375.46	0.36
63	600153	建发股份	533,600	6,899,448.00	0.32
64	002127	南极电商	502,100	6,065,368.00	0.28
65	002195	二三四五	797,132	5,699,493.80	0.26
66	300316	晶盛机电	429,200	5,360,708.00	0.25
67	002572	索菲亚	108,000	4,428,000.00	0.20
68	601799	星宇股份	98,400	4,351,248.00	0.20
69	601801	皖新传媒	245,097	3,387,240.54	0.16
70	002507	涪陵榨菜	294,975	3,315,519.00	0.15
71	002050	三花智控	202,400	3,303,168.00	0.15
72	600563	法拉电子	64,869	3,205,177.29	0.15
73	300138	晨光生物	240,640	3,157,196.80	0.14

74	600298	安琪酵母	85,300	2,206,711.00	0.10
75	603337	杰克股份	57,000	2,205,900.00	0.10
76	600566	济川药业	57,300	2,179,119.00	0.10
77	600009	上海机场	58,300	2,175,173.00	0.10
78	000530	大冷股份	297,800	2,144,160.00	0.10
79	300070	碧水源	114,112	2,128,188.80	0.10
80	300336	新文化	131,000	2,025,260.00	0.09
81	300310	宜通世纪	90,190	1,192,311.80	0.05
82	300145	中金环境	65,380	1,106,229.60	0.05
83	000063	中兴通讯	46,500	1,103,910.00	0.05
84	002120	韵达股份	20,859	1,076,324.40	0.05
85	002614	奥佳华	58,600	1,065,348.00	0.05
86	600741	华域汽车	43,903	1,064,208.72	0.05
87	600585	海螺水泥	18,748	426,142.04	0.02
88	002460	赣锋锂业	5,683	262,838.75	0.01
89	603801	志邦股份	1,406	47,522.80	0.00
90	600519	贵州茅台	100	47,185.00	0.00
91	603043	广州酒家	1,810	45,738.70	0.00
92	300666	江丰电子	2,276	43,448.84	0.00
93	002555	三七互娱	1,195	30,556.15	0.00
94	603335	迪生力	2,230	24,864.50	0.00
95	002879	长缆科技	1,313	23,660.26	0.00
96	002881	美格智能	989	22,608.54	0.00
97	603679	华体科技	809	21,438.50	0.00
98	603938	三孚股份	1,246	20,932.80	0.00
99	002882	金龙羽	2,966	18,389.20	0.00
100	603933	睿能科技	857	17,311.40	0.00
101	603305	旭升股份	1,351	15,212.26	0.00
102	300669	沪宁股份	841	14,650.22	0.00
103	300670	大烨智能	1,259	13,760.87	0.00
104	603286	日盈电子	890	13,528.00	0.00
105	000888	峨眉山 A	888	11,277.60	0.00
106	300672	国科微	1,257	10,659.36	0.00
107	603331	百达精工	999	9,620.37	0.00
108	002812	创新股份	100	8,100.00	0.00
109	300671	富满电子	942	7,639.62	0.00
110	603617	君禾股份	832	7,429.76	0.00
111	603799	华友钴业	100	6,078.00	0.00
112	603366	日出东方	666	5,094.90	0.00
113	002456	欧菲光	250	4,542.50	0.00
114	002415	海康威视	100	3,230.00	0.00
115	002179	中航光电	100	3,119.00	0.00
116	002475	立讯精密	100	2,924.00	0.00
117	601166	兴业银行	170	2,866.20	0.00

118	600660	福耀玻璃	100	2,604.00	0.00
119	300003	乐普医疗	100	2,211.00	0.00
120	600066	宇通客车	100	2,197.00	0.00
121	002410	广联达	100	1,880.00	0.00
122	000488	晨鸣纸业	132	1,702.80	0.00
123	600690	青岛海尔	100	1,505.00	0.00
124	601988	中国银行	389	1,439.30	0.00
125	600516	方大炭素	100	1,422.00	0.00
126	600879	航天电子	100	879.00	0.00
127	600029	南方航空	100	870.00	0.00
128	002078	太阳纸业	100	735.00	0.00
129	000933	神火股份	100	729.00	0.00
130	601328	交通银行	116	714.56	0.00
131	600019	宝钢股份	100	671.00	0.00
132	600966	博汇纸业	100	519.00	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	601668	中国建筑	183,909,691.08	8.46
2	000651	格力电器	175,204,052.51	8.06
3	601318	中国平安	165,262,028.75	7.60
4	600068	葛洲坝	139,183,441.96	6.40
5	600028	中国石化	112,924,824.30	5.19
6	601601	中国太保	111,143,644.21	5.11
7	601988	中国银行	103,558,401.00	4.76
8	601328	交通银行	102,912,178.62	4.73
9	000069	华侨城 A	102,111,870.05	4.70
10	600104	上汽集团	91,961,670.43	4.23
11	601607	上海医药	87,100,505.57	4.01
12	002236	大华股份	84,677,360.08	3.89
13	601186	中国铁建	81,644,512.64	3.75
14	000858	五粮液	72,810,267.04	3.35
15	600887	伊利股份	72,782,792.08	3.35
16	600522	中天科技	68,655,744.35	3.16
17	000333	美的集团	68,019,971.50	3.13
18	000338	潍柴动力	65,936,390.92	3.03
19	002310	东方园林	65,891,310.40	3.03
20	601818	光大银行	63,711,419.46	2.93

21	002555	三七互娱	61,238,770.19	2.82
22	600487	亨通光电	60,912,601.54	2.80
23	600219	南山铝业	59,911,889.35	2.76
24	601688	华泰证券	58,739,697.77	2.70
25	002051	中工国际	56,566,832.84	2.60
26	600703	三安光电	55,666,524.42	2.56
27	002508	老板电器	55,134,499.26	2.54
28	002195	二三四五	55,039,467.97	2.53
29	000001	平安银行	53,478,072.79	2.46
30	600030	中信证券	52,938,049.00	2.43
31	000501	鄂武商 A	51,249,447.43	2.36
32	600502	安徽水利	50,778,674.42	2.34
33	600689	上海三毛	49,257,677.51	2.27
34	300197	铁汉生态	48,386,508.50	2.23
35	601800	中国交建	47,037,833.59	2.16
36	000423	东阿阿胶	46,601,920.89	2.14
37	601012	隆基股份	46,459,429.76	2.14
38	600036	招商银行	46,193,482.07	2.12
39	600873	梅花生物	45,808,590.76	2.11
40	600196	复星医药	45,641,126.91	2.10

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	601668	中国建筑	146,665,743.46	6.74
2	601988	中国银行	103,597,670.99	4.76
3	601328	交通银行	102,824,508.16	4.73
4	601318	中国平安	99,716,476.30	4.59
5	600068	葛洲坝	90,881,224.23	4.18
6	601601	中国太保	89,506,585.01	4.12
7	000651	格力电器	88,139,980.01	4.05
8	600689	上海三毛	81,197,844.47	3.73
9	600104	上汽集团	76,175,378.09	3.50
10	601818	光大银行	75,742,598.58	3.48
11	601186	中国铁建	73,787,881.10	3.39
12	000069	华侨城 A	69,694,425.02	3.21
13	002555	三七互娱	62,772,455.01	2.89
14	002310	东方园林	58,380,202.82	2.68
15	000001	平安银行	54,693,047.53	2.52

16	000338	潍柴动力	54,455,822.38	2.50
17	601333	广深铁路	49,610,056.52	2.28
18	000423	东阿阿胶	49,016,700.60	2.25
19	000858	五 粮 液	47,812,839.73	2.20
20	601800	中国交建	47,609,504.04	2.19
21	601607	上海医药	47,598,132.66	2.19
22	002195	二三四五	47,372,968.14	2.18
23	600477	杭萧钢构	45,847,177.52	2.11
24	600516	方大炭素	43,891,966.93	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	6,315,034,619.52
卖出股票的收入（成交）总额	6,257,497,846.15

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	129,545,000.00	5.93
	其中：政策性金融债	129,545,000.00	5.93
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）	4,007,369.80	0.18
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	133,552,369.80	6.12

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	5.02
2	140440	14 农发 40	200,000	20,018,000.00	0.92
3	113011	光大转债	38,140	4,007,369.80	0.18

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

本基金本报告期没有投资国债期货。

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	1,139,808.04
2	应收证券清算款	1,091,551.07
3	应收股利	-
4	应收利息	2,032,480.49
5	应收申购款	41,745.74
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,305,585.34

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
64,777	9,720.15	20,756,484.72	3.30%	608,885,450.30	96.70%

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	67,100.21	0.01%

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（2006 年 9 月 6 日）基金份额总额	1,684,224,358.17
本报告期期初基金份额总额	663,452,048.72
本报告期基金总申购份额	13,555,835.32
减：本报告期基金总赎回份额	47,365,949.02
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	629,641,935.02

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	
万联证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
财富证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
广州证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中山证券	1	-	-	-	-	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
联讯证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	1,757,663,827.62	13.99%	1,601,763.22	13.81%	-
东北证券	1	1,501,342,363.09	11.95%	1,398,198.05	12.05%	-
中信建投	1	1,169,054,900.40	9.30%	1,088,742.39	9.39%	-
广发证券	1	1,112,588,288.62	8.85%	1,036,149.54	8.93%	-
瑞银证券	1	1,043,604,502.02	8.30%	951,040.02	8.20%	-

光大证券	1	1,030,319,581.21	8.20%	938,932.18	8.09%	-
兴业证券	1	915,262,399.51	7.28%	852,384.29	7.35%	-
中金公司	1	852,801,200.35	6.79%	794,214.96	6.85%	-
天风证券	2	740,440,665.88	5.89%	674,764.90	5.82%	-
招商证券	3	571,375,615.98	4.55%	532,120.74	4.59%	-
海通证券	1	448,537,208.37	3.57%	417,722.12	3.60%	-
申万宏源	3	385,706,619.39	3.07%	351,495.82	3.03%	-
长江证券	1	375,632,202.22	2.99%	349,827.50	3.02%	-
西南证券	1	251,438,525.32	2.00%	229,136.39	1.98%	-
华安证券	1	161,158,326.51	1.28%	150,088.22	1.29%	-
中信证券	1	90,808,980.40	0.72%	84,569.80	0.73%	-
国信证券	1	82,888,992.44	0.66%	77,193.84	0.67%	-
上海证券	2	76,380,997.39	0.61%	71,132.51	0.61%	-

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
万联证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
财富证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中山证券	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
联讯证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

国信证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-

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	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
8	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
9	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
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

		司网站	
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
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	2017-04-29
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	2017-05-03
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	2017-05-04
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	2017-05-06
25	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
26	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
27	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》	2017-06-07

	并参加费率优惠的公告	报》、《中国证券报》和公司网站	
28	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
29	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
30	关于电子直销平台延长“微钱宝”账户交易费率优惠时间的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-06-27
31	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、《华安宏利混合型证券投资基金基金合同》；
- 2、《华安宏利混合型证券投资基金招募说明书》；
- 3、《华安宏利混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、中国证监会批准华安宏利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