

华安沪港深通精选灵活配置混合型证券投资基金
2017 年年度报告摘要
2017 年 12 月 31 日

基金管理人：华安基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一八年三月二十七日

§1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本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 2018 年 3 月 22 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自 2017 年 2 月 16 日起至 12 月 31 日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	华安沪港深通精选灵活配置混合
基金主代码	001581
交易代码	001581
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 2 月 16 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	120,472,440.16 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制投资组合风险的前提下,通过大类资产的优化配置和高安全边际的证券精选,追求超越业绩比较基准的投资回报和资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金采取相对灵活的资产配置策略。在大类资产配置过程中,本基金将使用定量与定性相结合的研究方法对宏观经济、国家政策、资金面和市场情绪等可能影响证券市场的重要因素进行研究和预测,结合使用公司自主研发的多因子动态资产配置模型、基于投资时钟理论的资产配置模型等经济模型,分析和比较股票、债券等市场和不同金融工具的风险收益特征,确定合适的资产配置比例,动态优化投资组合。在本合同约定的投资比例范围内,本基金将根据宏观经济、估值水平、资金面、市场情绪等因素,制定并适时调整国内 A 股和香港(港股通标的股票)两地股票配置比例及投资策略。
业绩比较基准	30%×中证 800 指数收益率+30%×恒生综合指数收益率+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

	金将投资港股通标的股票, 还将面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。
--	---

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

2.4 信息披露方式

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

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2017 年 2 月 16 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日
本期已实现收益	43,092,521.44
本期利润	52,565,080.56
加权平均基金份额本期利润	0.2465
本期基金份额净值增长率	32.10%
3.1.2 期末数据和指标	2017 年末
期末可供分配基金份额利润	0.3001
期末基金资产净值	159,170,567.41

期末基金份额净值	1.321
----------	-------

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）。

4、本基金于 2017 年 2 月 16 日成立。截止本报告期末，本基金成立不足一年。

5、合同生效日当年的主要会计数据和财务指标按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

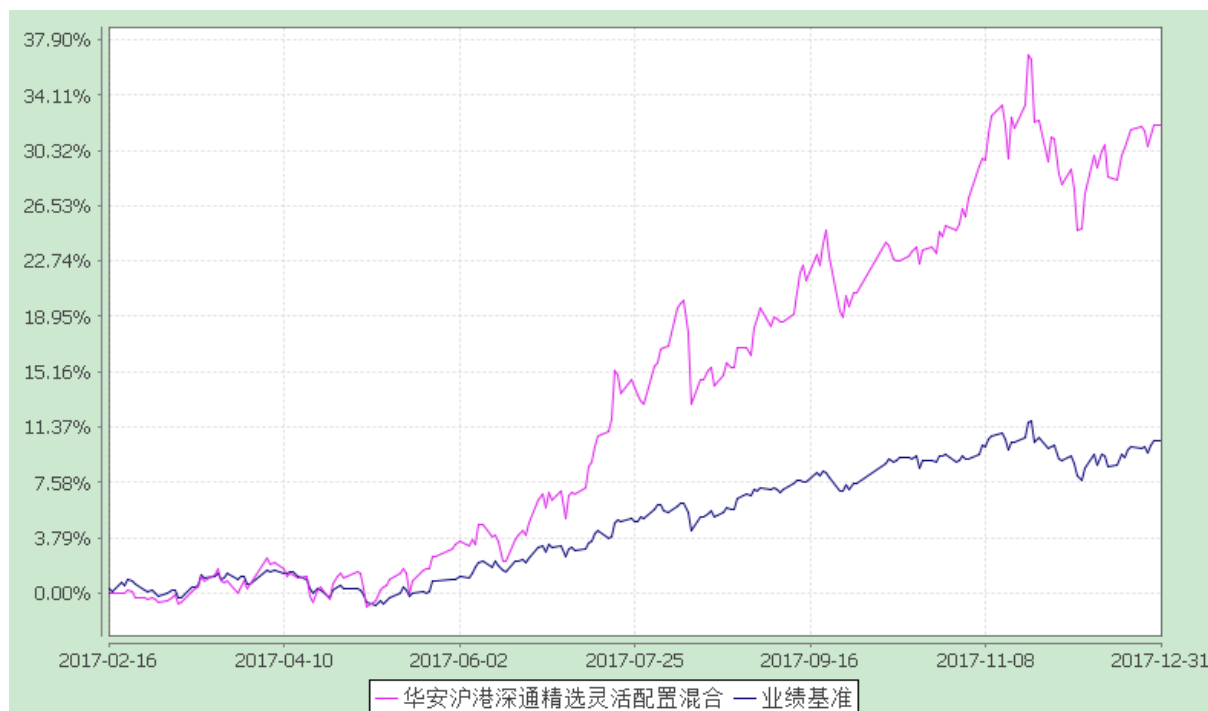
3.2 基金净值表现

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
过去三个月	9.54%	1.15%	2.47%	0.44%	7.07%	0.71%
过去六个月	24.15%	1.14%	6.77%	0.39%	17.38%	0.75%
自基金合同生效起至今	32.10%	0.95%	10.40%	0.37%	21.70%	0.58%

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

华安沪港深通精选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的历史走势对比图
 (2017 年 2 月 16 日至 2017 年 12 月 31 日)

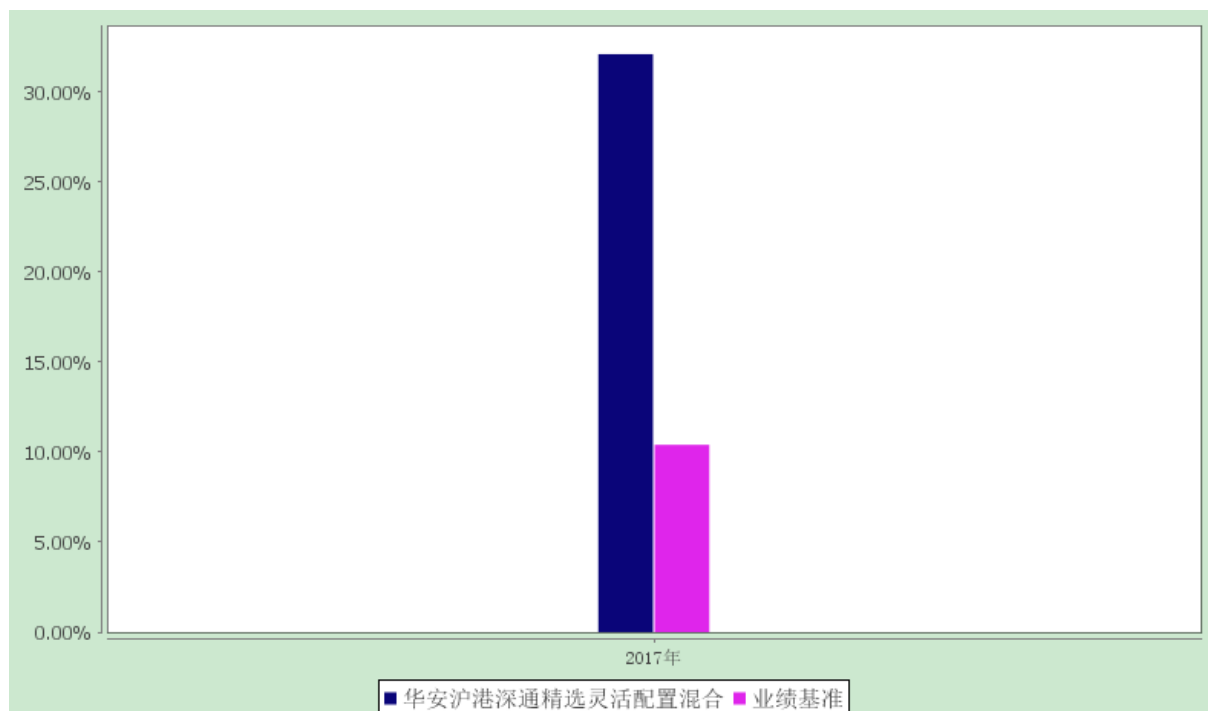


注：本基金成立日期为 2017 年 2 月 16 日，根据《华安沪港深通精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》，本基金建仓期为 6 个月。基金管理人已自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华安沪港深通精选灵活配置混合型证券投资基金

自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



注：合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

无。

§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。目前的股东为国泰君安投资管理股份有限公司、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创新投资有限公司。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 12 月 31 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 98 只开放式基金，管理资产规模达到 1851.32 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		
苏圻涵	本基金的基金经理、全球投资部助理总监	2017-02-16	-	13 年	博士研究生, 13 年证券、基金从业经历, 持有基金从业执业证书。2004 年 6 月加入华安基金管理有限公司, 曾先后于研究发展部、战略策划部工作, 担任行业研究员和产品经理职务。目前任职于全球投资部, 担任基金经理职务。2010 年 9 月起担任华安香港精选股票型证券投资基金的基金经理。2011 年 5 月起同时担任华安大中华升级股票型证券投资基金的基金经理。2015 年 6 月至 2016 年 9 月同时担任华安国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016 年 3 月起同时担任华安沪港深外延增长灵活配置混合型证券投资基金、华安全球美元收益债券型证券投资基金的基金经理。2016 年 6 月起同时担任华安全球美元票息债券型证券投资基金的基金经理。2017 年 2 月起, 同时担任本基金的基金经理。2017 年 5 月起, 同时担任华安沪港深机会灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 6 月起, 同时担任华安文体健康主题灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 8 月起, 同时担任华安大安全主题灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。
高钥群	本基金的基金经理	2017-04-24	-	11 年	硕士研究生, 11 年证券、基金从业经验。历任 Longview Partners 资产管理公司数量分析员, 高华证券有限责任公司行业及公司研究分析员, 2011 年 2 月加入华安基金, 历任全球投资部研究员、助理投资经理。2017 年 4 月起担任本基金的基金经理。

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 公平交易制度和控制方法

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。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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）的本年度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。

4.3.3 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，因组合流动性管理或投资策略调整需要，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 1 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，发达市场中的美国经济持续复苏，欧洲近期的经济数据持续好于预期，日本央行也消除了换届带来的货币政策不确定性。在经济复苏的同时，全球通胀数据维持在较低水平，给各家央行的货币政策收紧留下了充足的空间。

随着全球经济复苏和美元弱勢的延续，2017 年新兴市场经济也比较景气。其中中国的供给侧改革初见成效，企业盈利的改善趋势延续；虽然地产、基建产业链投资增速下降，但出口和消费拉动的贡献对冲了部分影响。值得注意的是年末的中央经济工作会议强调防范风险和去杠杆。

2017 年，港股的低估值水平引发内地和国际资金继续流入香港市场。全年恒生指数上涨 36%，恒生国企指数上涨 25%，本基金自 2017 年 5 月 10 日成立以来截至 2017 年 12 月 31 日回报率 29%，

港币人民币汇率下跌 7%影响了部分人民币基金收益率；恒生指数的盈利增长预期已经从 2017 年初的低双位数上调至目前的 16%，结合目前恒生指数整体估值 2018 年 12 倍市盈率水平和中国经济增速潜在放缓展望，我们认为 2018 年的股市收益率预期应该低于 2017 年水平。

在报告期末，我们的主要仓位集中在估值和业绩增速结合看吸引的偏周期板块、银行保险、高端制造、地产龙头、消费龙头和医药。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2017 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 1.321 元，本报告期份额净值增长率为 32.10%，同期业绩比较基准增长率为 10.40%。

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 2018 年，我们认为全球经济整体增长仍将强劲，但值得关注的是全球利率上行的风险和中國去杠杆引起的波动。MSCI 中国和恒生指数的估值已经修复到历史平均水平，我们认为应降低 2018 年收益率预期，2018 年驱动因素将来自于盈利而非估值，全球央行货币政策收紧将带来较大的波动。我们将重点关注医药，消费，信息科技和部分低估值板块的机会。

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 审计报告

本报告期的基金财务会计报告经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师 蒋燕华 蔡玉芝签字出具了安永华明(2018)审字第 60971571_B52 号标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：华安沪港深通精选灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 2017 年 12 月 31 日
资产：	-
银行存款	12,710,483.44
结算备付金	5,780,957.32
存出保证金	601,417.66
交易性金融资产	145,526,006.41
其中：股票投资	145,526,006.41
基金投资	-
债券投资	-
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	3,641,827.78
应收利息	6,790.54
应收股利	45,600.00
应收申购款	616,591.89
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	168,929,675.04
负债和所有者权益	本期末 2017 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	7,979,206.26
应付赎回款	703,058.31
应付管理人报酬	187,996.00
应付托管费	31,332.69
应付销售服务费	-
应付交易费用	496,318.27
应交税费	-
应付利息	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	361,196.10
负债合计	9,759,107.63
所有者权益：	-
实收基金	120,472,440.16
未分配利润	38,698,127.25
所有者权益合计	159,170,567.41
负债和所有者权益总计	168,929,675.04

注：（1）报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.321 元，基金份额总额 120,472,440.16 份。

（2）本基金基金合同于 2017 年 2 月 16 日生效。

7.2 利润表

会计主体：华安沪港深通精选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 2 月 16 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 2 月 16 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日
一、收入	61,633,872.67

1.利息收入	772,435.31
其中：存款利息收入	453,922.53
债券利息收入	-
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	318,512.78
其他利息收入	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	50,058,435.21
其中：股票投资收益	46,517,377.81
基金投资收益	-
债券投资收益	-
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	3,541,057.40
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	9,472,559.12
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	1,330,443.03
减：二、费用	9,068,792.11
1. 管理人报酬	3,007,071.14
2. 托管费	501,178.47
3. 销售服务费	-
4. 交易费用	5,195,953.78
5. 利息支出	-
其中：卖出回购金融资产支出	-
6. 其他费用	364,588.72
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	52,565,080.56
减：所得税费用	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	52,565,080.56

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安沪港深通精选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 2 月 16 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2017 年 2 月 16 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 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）	397,870,618.87	-	397,870,618.87
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	52,565,080.56	52,565,080.56
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）	-277,398,178.71	-13,866,953.31	-291,265,132.02
其中：1.基金申购款	144,996,710.71	29,894,415.17	174,891,125.88
2.基金赎回款	-422,394,889.42	-43,761,368.48	-466,156,257.90
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）	120,472,440.16	38,698,127.25	159,170,567.41

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码（序号）从 7.1 至 7.4，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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

华安沪港深通精选灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2015]1286 号《关于准予华安沪港深通精选灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》以及机构部函[2016]2905 号《关于华安沪港深通精选灵活配置混合型证券投资基金延期募集备案的回函》的核准，由基金管理人华安基金管理有限公司自 2017 年 1 月 9 日到 2017 年 2 月 13 日止期间向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具安永华明（2017）验字第 60971571_B03 号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2017 年 2 月 16 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 397,659,110.87 元，在募集期间产生的存款利息为人民币 211,508.00 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 397,870,618.87 元，折合 397,870,618.87 份基金份额。本基金的基金管理人及注册登记机构为华安基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、港股通标的股票、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、中小企业私募债、地方政府债券、中期票据、可转换债券（含分离交易可转债）、短期融资券、资产支持证券等）、债券回购、银行存款、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

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

基金的投资组合比例为：股票占基金资产的比例为 0-95%，其中投资于国内依法发行上市的股票比例为基金资产的 0-95%，投资于港股通标的股票比例为基金资产的 0-95%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

本基金的业绩比较基准为：30%×中证 800 指数收益率+30%×恒生综合指数收益率+40%×中国债券总指数收益率。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计

准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及自 2017 年 2 月 16 日（基金合同生效日）起至 2017 年 12 月 31 日止期间经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年自 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间系自 2017 年 2 月 16 日（基金合同生效日）起至 2017 年 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票投资、债券投资和衍生工具等；

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

(1) 股票投资

买入股票于交易日确认为股票投资，股票投资成本按交易日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

卖出股票于交易日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于交易日结转；

(2) 债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

(3) 权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(4) 股指期货投资

买入或卖出股指期货投资于成交日确认为股指期货投资。股指期货初始合约价值按成交金额确认；

股指期货平仓于成交日确认衍生工具投资收益，股指期货的初始合约价值按移动加权平均法于成交日结转；

(5) 分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

(6) 回购协议

本基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意

义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 资产支持证券投资收益/(损失)于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(8) 权证收益/（损失）于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(9) 股指期货投资收益/(损失)于平仓日确认，并按平仓成交金额与其初始合约价值的差额入账；

(10) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(11) 公允价值变动收益/（损失）系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融

资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(12) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(2) 每一基金份额享有同等分配权；

(3) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(4) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在不违背法律法规及基金合同的规定、且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人经与托管人协商一致，可在中国证监会允许的条件下调整基金收益的分配原则，不需召开基金份额持有人大会。

7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，与所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

7.4.4.13 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；

(2) 能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；

(3) 能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

根据中国证券投资基金业协会中基协发[2017]6 号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）>的通知》（以下简称估值业务指引），自 2017 年 10 月 20 日起，本基金持有的流通受限股票参考估值业务指引进行估值。该会计估计变更对本基金本期末的基金资产净值及本期损益均无影响。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

7.4.6.1 印花税

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

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

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

7.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证

券投资基金) 管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税; 国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税; 存款利息收入不征收增值税;

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

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

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定, 自 2018 年 1 月 1 日起, 资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务, 按照以下规定确定销售额: 提供贷款服务, 以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额; 转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票(不包括限售股)、债券、基金、非货物期货, 可以选择按照实际买入价计算销售额, 或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价(2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票, 为停牌前最后一个交易日收盘价)、债券估值(中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值)、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

7.4.6.3 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定, 自 2004 年 1 月 1 日起, 对证券投资基金(封闭式证券投资基金, 开放式证券投资基金)管理人运用

基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

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

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

7.4.6.4 个人所得税

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

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

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

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

7.4.6.5 境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127 号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

7.4.7 关联方关系

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
上海国际信托有限公司	基金管理人的股东
国泰君安创新投资有限公司	基金管理人的股东
上海工业投资(集团)有限公司	基金管理人的股东
上海锦江国际投资管理有限公司	基金管理人的股东
国泰君安投资管理股份有限公司	基金管理人的股东
华安资产管理(香港)有限公司	基金管理人的全资子公司
华安未来资产管理(上海)有限公司	基金管理人的全资子公司

注：1. 下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

2. 经华安基金管理有限公司股东会第四十一次会议审议通过，并经中国证券监督管理委员会证监许可【2017】1809 号文核准，华安基金管理有限公司的原股东上海电气(集团)总公司已变更为国泰君安创新投资有限公司。华安基金管理有限公司已于 2017 年 10 月 17 日就上述股东变更事项进行公告。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.8.1.3 债券交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.8.1.4 债券回购交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行回购交易。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

无。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2017年2月16日（基金合同生效日）至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	3,007,071.14
其中：支付销售机构的客户维护费	1,675,066.66

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.50% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{基金管理费率} / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2017年2月16日（基金合同生效日）至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	501,178.47

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{基金托管费率} / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.8.4.2 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。

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年2月16日（基金合同生效日）至2017年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
建设银行	12,710,483.44	345,915.92

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.9 期末（2017 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.9.2 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
601600	中国铝业	2017-09-12	重大事项停牌	6.67	2018-02-26	7.28	500,000.00	4,030,000.00	3,335,000.00	

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 12 月 31 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 12 月 31 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出

回购金融资产款余额。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1 公允价值

7.4.14.1.1 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括贷款和应收款项以及其他金融负债，其因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

7.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

7.4.14.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于 2017 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币 142,191,006.41 元，属于第二层次的余额为人民币 3,335,000.00 元，无属于第三层次余额。

7.4.14.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关股票和可转换债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。

7.4.14.1.2.3 第三层次公允价值余额和本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具第三层次公允价值本期未发生变动。

7.4.14.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

7.4.14.3 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

7.4.14.4 财务报表的批准

本财务报表已于 2018 年 3 月 22 日经本基金的基金管理人批准。

§8 投资组合报告

8.1 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	145,526,006.41	86.15
	其中：股票	145,526,006.41	86.15
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	18,491,440.76	10.95
7	其他各项资产	4,912,227.87	2.91
8	合计	168,929,675.04	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-

C	制造业	34,599,785.52	21.74
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	1,509,320.00	0.95
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	4,145,344.00	2.60
J	金融业	3,102,267.02	1.95
K	房地产业	7,858,300.00	4.94
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	51,215,016.54	32.18

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
保健	8,503,862.89	5.34
必需消费品	3,625,759.63	2.28
材料	4,841,858.21	3.04
房地产	4,785,584.75	3.01
非必需消费品	20,523,588.31	12.89
工业	22,134,930.24	13.91
金融	16,487,743.80	10.36
能源	3,972,913.05	2.50
信息技术	9,434,748.99	5.93
合计	94,310,989.87	59.25

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	00700	腾讯控股	27,800	9,434,748.99	5.93
2	01055	中国南方航空股份	1,124,000	7,582,272.12	4.76
3	00670	中国东方航空股份	1,372,000	6,502,744.51	4.09
4	00966	中国太平	228,000	5,584,213.16	3.51
5	002001	新 和 成	146,000	5,556,760.00	3.49
6	603369	今世缘	312,000	4,839,120.00	3.04
7	01766	中国中车	687,000	4,800,898.62	3.02
8	02318	中国平安	69,500	4,726,088.86	2.97
9	300017	网宿科技	389,600	4,145,344.00	2.60
10	02313	申洲国际	66,000	4,104,652.46	2.58

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	00700	腾讯控股	31,743,673.85	19.94
2	000651	格力电器	28,079,707.83	17.64
3	600036	招商银行	27,836,628.25	17.49
4	600507	方大特钢	26,273,685.58	16.51
5	02601	中国太保	26,140,336.75	16.42
6	03988	中国银行	24,857,202.19	15.62
7	00175	吉利汽车	20,614,294.87	12.95
8	01398	工商银行	20,387,225.74	12.81
9	000333	美的集团	20,285,775.30	12.74
10	01336	新华保险	20,197,456.38	12.69
11	00762	中国联通	18,705,101.29	11.75
12	000858	五 粮 液	18,519,453.93	11.63
13	02318	中国平安	18,456,493.16	11.60
14	01055	中国南方航空股份	17,984,867.05	11.30
15	002475	立讯精密	17,276,022.30	10.85
16	600887	伊利股份	16,969,618.70	10.66

17	03968	招商银行	16,164,126.02	10.16
18	06030	中信证券	15,816,953.72	9.94
19	600019	宝钢股份	15,012,095.64	9.43
20	000807	云铝股份	14,772,042.04	9.28
21	02313	申洲国际	14,716,800.35	9.25
22	600516	方大炭素	14,442,217.00	9.07
23	601600	中国铝业	14,141,817.00	8.88
24	00753	中国国航	14,042,313.20	8.82
25	00522	ASM PACIFIC	13,910,195.65	8.74
26	00152	深圳国际	13,899,986.99	8.73
27	601688	华泰证券	13,731,732.00	8.63
28	00966	中国太平	13,588,675.59	8.54
29	002271	东方雨虹	13,384,445.70	8.41
30	600660	福耀玻璃	13,101,793.00	8.23
31	02328	中国财险	12,988,350.07	8.16
32	600216	浙江医药	12,975,896.82	8.15
33	02600	中国铝业	12,795,818.17	8.04
34	03993	洛阳铝业	11,891,782.02	7.47
35	02382	舜宇光学科技	11,872,652.90	7.46
36	00293	国泰航空	11,583,318.67	7.28
37	00941	中国移动	11,538,140.04	7.25
38	600009	上海机场	11,283,079.67	7.09
39	00425	敏实集团	11,030,965.21	6.93
40	01114	BRILLIANCE CHI	10,884,908.46	6.84
41	600782	新钢股份	10,766,763.03	6.76
42	600585	海螺水泥	10,628,090.00	6.68
43	00144	招商局港口	10,534,416.54	6.62
44	02689	玖龙纸业	10,524,855.27	6.61
45	600282	南钢股份	10,465,902.00	6.58
46	02388	中银香港	10,420,582.90	6.55
47	02202	万科企业	10,264,382.20	6.45
48	00598	中国外运	10,243,996.86	6.44
49	02628	中国人寿	9,956,832.22	6.26
50	01999	敏华控股	9,721,215.10	6.11
51	01293	广汇宝信	9,411,920.86	5.91
52	01766	中国中车	9,347,366.82	5.87
53	00884	旭辉控股集团	8,967,130.45	5.63
54	00902	华能国际电力股份	8,764,393.57	5.51
55	01299	友邦保险	8,656,911.15	5.44
56	01888	建滔积层板	8,537,039.32	5.36
57	02018	瑞声科技	8,516,297.32	5.35
58	00763	中兴通讯	8,321,498.63	5.23
59	000932	*ST 华菱	8,280,794.50	5.20
60	01317	枫叶教育	8,254,500.59	5.19

61	601318	中国平安	8,108,231.00	5.09
62	01800	中国交通建设	8,089,993.59	5.08
63	01171	兖州煤业股份	8,072,009.13	5.07
64	600048	保利地产	8,017,285.00	5.04
65	603589	口子窖	7,860,044.00	4.94
66	00921	海信科龙	7,854,592.73	4.93
67	002001	新 和 成	7,821,128.00	4.91
68	00027	银河娱乐	7,794,118.51	4.90
69	01919	中远海控	7,704,142.84	4.84
70	01928	金沙中国有限公司	7,686,713.98	4.83
71	00354	中国软件国际	7,663,707.73	4.81
72	600702	沱牌舍得	7,565,515.82	4.75
73	01618	中国中冶	7,374,045.49	4.63
74	01044	恒安国际	7,139,378.50	4.49
75	000933	神火股份	7,094,510.47	4.46
76	03899	中集安瑞科	7,056,805.09	4.43
77	01186	中国铁建	6,989,137.57	4.39
78	02869	绿城服务	6,981,565.58	4.39
79	01030	新城发展控股	6,712,760.79	4.22
80	00799	IGG	6,578,920.32	4.13
81	06886	HTSC	6,558,503.14	4.12
82	03323	中国建材	6,522,730.39	4.10
83	000895	双汇发展	6,483,820.25	4.07
84	601398	工商银行	6,481,200.00	4.07
85	02020	安踏体育	6,468,877.55	4.06
86	01038	长江基建集团	6,462,132.82	4.06
87	002415	海康威视	6,450,052.29	4.05
88	00817	中国金茂	6,407,349.29	4.03
89	002092	中泰化学	6,339,750.00	3.98
90	02282	美高梅中国	6,143,422.07	3.86
91	01113	长实集团	6,136,503.18	3.86
92	03898	中车时代电气	6,035,015.37	3.79
93	00665	海通国际	5,973,854.07	3.75
94	00368	中外运航运	5,870,165.74	3.69
95	00347	鞍钢股份	5,853,034.33	3.68
96	600428	中远海特	5,849,674.00	3.68
97	00670	中国东方航空股份	5,809,481.92	3.65
98	600779	水井坊	5,748,017.77	3.61
99	002456	欧菲科技	5,628,219.00	3.54
100	06881	中国银河	5,599,499.11	3.52
101	02666	环球医疗	5,324,631.97	3.35
102	01958	北京汽车	5,221,534.48	3.28
103	000717	韶钢松山	5,144,729.24	3.23
104	00874	白云山	4,992,960.07	3.14

105	002460	赣锋锂业	4,964,832.12	3.12
106	00868	信义玻璃	4,953,752.97	3.11
107	603369	今世缘	4,818,963.36	3.03
108	00388	香港交易所	4,818,958.94	3.03
109	06808	高鑫零售	4,507,995.19	2.83
110	601699	潞安环能	4,455,893.20	2.80
111	000983	西山煤电	4,438,964.00	2.79
112	00371	北控水务集团	4,415,573.95	2.77
113	000963	华东医药	4,388,270.32	2.76
114	600438	通威股份	4,383,673.00	2.75
115	00291	华润啤酒	4,358,920.75	2.74
116	300121	阳谷华泰	4,344,573.00	2.73
117	02009	金隅股份	4,338,452.46	2.73
118	600197	伊力特	4,319,176.98	2.71
119	01359	中国信达	4,292,721.96	2.70
120	02314	理文造纸	4,258,907.38	2.68
121	000338	潍柴动力	4,239,301.79	2.66
122	001979	招商蛇口	4,226,541.00	2.66
123	000915	山大华特	4,178,872.00	2.63
124	603708	家家悦	4,167,878.90	2.62
125	600066	宇通客车	4,097,040.00	2.57
126	002466	天齐锂业	4,029,412.80	2.53
127	00004	九龙仓集团	4,027,824.78	2.53
128	600309	万华化学	4,011,000.00	2.52
129	000002	万科A	3,995,831.00	2.51
130	03883	中国奥园	3,983,398.39	2.50
131	02238	广汽集团	3,955,524.63	2.49
132	300017	网宿科技	3,868,024.30	2.43
133	02005	石四药集团	3,855,098.14	2.42
134	03618	重庆农村商业银行	3,830,100.47	2.41
135	00257	中国光大国际	3,796,556.24	2.39
136	600487	亨通光电	3,750,932.88	2.36
137	01136	台泥国际集团	3,638,149.58	2.29
138	000538	云南白药	3,635,183.00	2.28
139	600114	东睦股份	3,579,466.80	2.25
140	00323	马鞍山钢铁股份	3,565,893.86	2.24
141	000100	TCL 集团	3,565,639.00	2.24
142	00998	中信银行	3,553,989.97	2.23
143	01882	海天国际	3,542,435.93	2.23
144	601988	中国银行	3,535,800.00	2.22
145	600270	外运发展	3,525,959.00	2.22
146	000898	鞍钢股份	3,520,268.68	2.21
147	601233	桐昆股份	3,519,388.00	2.21
148	01813	合景泰富	3,517,796.33	2.21

149	00981	中芯国际	3,492,409.35	2.19
150	601668	中国建筑	3,435,334.00	2.16
151	601225	陕西煤业	3,435,127.00	2.16
152	00639	首钢资源	3,312,917.96	2.08
153	002454	松芝股份	3,304,905.09	2.08
154	00564	郑煤机	3,303,915.71	2.08
155	600195	中牧股份	3,295,901.64	2.07
156	603338	浙江鼎力	3,270,818.00	2.05
157	01088	中国神华	3,206,560.20	2.01

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	00700	腾讯控股	31,621,499.48	19.87
2	000651	格力电器	28,842,491.38	18.12
3	600507	方大特钢	26,674,847.82	16.76
4	02601	中国太保	26,412,523.24	16.59
5	600036	招商银行	24,786,441.68	15.57
6	03988	中国银行	24,524,863.57	15.41
7	00175	吉利汽车	23,370,148.85	14.68
8	01336	新华保险	21,703,556.39	13.64
9	03968	招商银行	20,152,898.23	12.66
10	00762	中国联通	19,803,223.24	12.44
11	000858	五粮液	19,125,415.99	12.02
12	600516	方大炭素	17,930,909.90	11.27
13	01398	工商银行	17,483,861.96	10.98
14	000807	云铝股份	17,460,877.94	10.97
15	002475	立讯精密	17,152,569.33	10.78
16	02318	中国平安	17,138,741.41	10.77
17	000333	美的集团	16,810,811.29	10.56
18	600887	伊利股份	15,760,225.46	9.90
19	06030	中信证券	15,660,564.01	9.84
20	600019	宝钢股份	14,788,434.21	9.29
21	02689	玖龙纸业	13,857,247.79	8.71
22	601688	华泰证券	13,783,716.77	8.66
23	00152	深圳国际	13,542,289.54	8.51
24	02382	舜宇光学科技	13,342,888.86	8.38
25	600782	新钢股份	13,106,595.00	8.23
26	600216	浙江医药	12,760,336.50	8.02

27	00522	ASM PACIFIC	12,711,482.47	7.99
28	02600	中国铝业	12,693,476.51	7.97
29	01999	敏华控股	12,333,285.98	7.75
30	600660	福耀玻璃	11,997,333.00	7.54
31	03993	洛阳钼业	11,887,037.13	7.47
32	601600	中国铝业	11,466,751.64	7.20
33	00293	国泰航空	11,420,941.93	7.18
34	00753	中国国航	11,360,931.37	7.14
35	00941	中国移动	11,343,907.91	7.13
36	600009	上海机场	11,336,321.23	7.12
37	01055	中国南方航空股份	11,151,752.92	7.01
38	02313	申洲国际	10,882,814.66	6.84
39	02388	中银香港	10,870,502.24	6.83
40	600585	海螺水泥	10,578,395.98	6.65
41	02328	中国财险	10,577,035.44	6.65
42	00144	招商局港口	10,534,121.54	6.62
43	00598	中国外运	10,487,595.16	6.59
44	00884	旭辉控股集团	10,404,499.96	6.54
45	600282	南钢股份	10,210,608.28	6.41
46	01114	BRILLIANCE CHI	10,208,797.92	6.41
47	02202	万科企业	10,150,305.74	6.38
48	02628	中国人寿	9,896,943.22	6.22
49	01293	广汇宝信	9,869,356.01	6.20
50	002271	东方雨虹	9,839,120.56	6.18
51	01299	友邦保险	9,434,076.17	5.93
52	000932	*ST 华菱	9,191,760.56	5.77
53	06886	HTSC	8,996,118.37	5.65
54	00902	华能国际电力股份	8,965,888.75	5.63
55	601318	中国平安	8,734,050.00	5.49
56	00966	中国太平	8,596,245.66	5.40
57	00763	中兴通讯	8,284,632.98	5.20
58	03898	中车时代电气	8,200,750.31	5.15
59	01800	中国交通建设	8,164,866.82	5.13
60	00799	IGG	8,154,619.15	5.12
61	02869	绿城服务	8,010,806.41	5.03
62	00425	敏实集团	7,967,455.34	5.01
63	02018	瑞声科技	7,940,135.45	4.99
64	01888	建滔积层板	7,880,466.22	4.95
65	00027	银河娱乐	7,876,398.73	4.95
66	01928	金沙中国有限公司	7,696,139.90	4.84
67	00921	海信科龙	7,469,551.71	4.69
68	00354	中国软件国际	7,413,247.90	4.66
69	603589	口子窖	7,324,548.00	4.60
70	01919	中远海控	7,294,317.51	4.58

71	600702	舍得酒业	7,197,521.06	4.52
72	01186	中国铁建	6,908,476.22	4.34
73	000895	双汇发展	6,858,379.49	4.31
74	000933	神火股份	6,781,737.52	4.26
75	01030	新城发展控股	6,732,797.94	4.23
76	00119	保利置业集团	6,698,598.53	4.21
77	002092	中泰化学	6,658,672.00	4.18
78	01618	中国中冶	6,620,185.99	4.16
79	601398	工商银行	6,586,800.00	4.14
80	000717	韶钢松山	6,582,502.00	4.14
81	002415	海康威视	6,562,826.00	4.12
82	02020	安踏体育	6,552,809.20	4.12
83	03899	中集安瑞科	6,402,464.12	4.02
84	01113	长实集团	6,402,302.37	4.02
85	02238	广汽集团	6,367,173.14	4.00
86	00368	中外运航运	6,256,985.39	3.93
87	01038	长江基建集团	6,230,277.16	3.91
88	002460	赣锋锂业	6,218,391.80	3.91
89	01317	枫叶教育	6,189,145.16	3.89
90	01136	台泥国际集团	6,170,200.33	3.88
91	00665	海通国际	5,950,717.47	3.74
92	01813	合景泰富	5,943,297.02	3.73
93	00347	鞍钢股份	5,773,394.95	3.63
94	002456	欧菲科技	5,629,927.00	3.54
95	06881	中国银河	5,406,145.92	3.40
96	600428	中远海特	5,268,706.25	3.31
97	02009	金隅集团	5,088,664.09	3.20
98	06808	高鑫零售	5,071,322.03	3.19
99	02666	环球医疗	5,045,991.44	3.17
100	00981	中芯国际	4,904,683.14	3.08
101	01766	中国中车	4,823,408.69	3.03
102	00388	香港交易所	4,789,435.72	3.01
103	00874	白云山	4,693,104.41	2.95
104	600438	通威股份	4,637,936.17	2.91
105	01958	北京汽车	4,574,623.88	2.87
106	000963	华东医药	4,546,602.96	2.86
107	01728	正通汽车	4,546,571.85	2.86
108	600048	保利地产	4,509,382.00	2.83
109	600779	水井坊	4,491,132.00	2.82
110	00291	华润啤酒	4,462,002.48	2.80
111	001979	招商蛇口	4,459,017.27	2.80
112	03883	中国奥园	4,417,211.36	2.78
113	002466	天齐锂业	4,386,711.60	2.76
114	01044	恒安国际	4,369,979.60	2.75

115	300121	阳谷华泰	4,360,520.16	2.74
116	600197	伊力特	4,338,982.40	2.73
117	01171	兖州煤业股份	4,336,872.75	2.72
118	01359	中国信达	4,262,251.31	2.68
119	600066	宇通客车	4,250,565.56	2.67
120	601699	潞安环能	4,215,137.78	2.65
121	000915	山大华特	4,135,110.66	2.60
122	00371	北控水务集团	4,078,531.19	2.56
123	000338	潍柴动力	4,029,346.00	2.53
124	600309	万华化学	4,015,470.49	2.52
125	000983	西山煤电	3,984,530.00	2.50
126	000898	鞍钢股份	3,981,060.00	2.50
127	000671	阳光城	3,869,573.00	2.43
128	03618	重庆农村商业银行	3,863,853.30	2.43
129	02314	理文造纸	3,822,548.05	2.40
130	600487	亨通光电	3,811,199.73	2.39
131	000100	TCL 集团	3,760,971.00	2.36
132	01882	海天国际	3,622,850.87	2.28
133	00004	九龙仓集团	3,596,514.60	2.26
134	000538	云南白药	3,529,215.00	2.22
135	600114	东睦股份	3,513,551.55	2.21
136	00257	中国光大国际	3,509,186.31	2.20
137	601988	中国银行	3,496,427.79	2.20
138	00998	中信银行	3,472,187.29	2.18
139	600195	中牧股份	3,445,685.43	2.16
140	600270	外运发展	3,386,038.00	2.13
141	00323	马鞍山钢铁股份	3,334,796.19	2.10
142	00868	信义玻璃	3,330,368.86	2.09
143	002001	新和成	3,303,071.00	2.08
144	00639	首钢资源	3,280,284.34	2.06
145	601668	中国建筑	3,245,122.00	2.04
146	002454	松芝股份	3,214,558.90	2.02
147	601012	隆基股份	3,195,335.00	2.01
148	02196	复星医药	3,184,193.27	2.00

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	1,534,867,771.69
卖出股票的收入（成交）总额	1,445,331,702.21

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

8.6 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

本基金本报告期末未持有债券投资。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 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。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，有选择地投资于流动性好、交易活跃的股指期货合约。

本基金在进行股指期货投资时，首先将基于对证券市场总体行情的判断和组合风险收益的分析确定投资时机以及套期保值的类型（多头套期保值或空头套期保值），并根据风险资产投资（或拟投资）的总体规模和风险系数决定股指期货的投资比例；其次，本基金将在综合考虑证券市场和期货市场运行趋势以及股指期货流动性、收益性、风险特征和估值水平的基础上进行投资品种选择，以对冲风险资产组合的系统性风险和流动性风险。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

无。

8.11.2 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。

8.11.3 本期国债期货投资评价

无。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。

8.12.2 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。

8.12.3 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	601,417.66
2	应收证券清算款	3,641,827.78
3	应收股利	45,600.00
4	应收利息	6,790.54
5	应收申购款	616,591.89
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,912,227.87

8.12.4 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。

8.12.5 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未持有存在流通受限情况的股票。

§9 基金份额持有人信息

9.1 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
4,975	24,215.57	0.00	0.00%	120,472,440.16	100.00%

9.2 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	108,286.29	0.09%

9.3 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。

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2017 年 2 月 16 日)基金份额总额	397,870,618.87
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	144,996,710.71
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	422,394,889.42
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	120,472,440.16

§11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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：

(1)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)2018 年 2 月 13 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》,翁启森先生、姚国平先生、谷媛媛女士新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:

2017 年 9 月 1 日,中国建设银行发布公告,聘任纪伟为中国建设银行资产托管业务部总经理。

11.3 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。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内无基金投资策略的改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘为基金审计的会计师事务所。

报告年度应支付给聘任会计师事务所的报酬为人民币 60,000.00 元。

目前的审计机构已提供审计服务的连续年限:自基金合同生效日起至今。

11.6 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证券监管部门稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	
广州证券	2	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
中山证券	1	-	-	-	-	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-

联讯证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	3	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
财富证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	865,646,260.13	29.05%	610,163.97	25.91%	-
国泰君安	1	545,105,525.88	18.29%	484,251.91	20.56%	-
华泰证券	1	505,491,263.73	16.96%	362,309.28	15.38%	-
中信证券	1	410,953,874.17	13.79%	290,396.43	12.33%	-
东北证券	1	394,166,172.51	13.23%	367,085.75	15.59%	-
招商证券	3	129,677,265.44	4.35%	120,768.22	5.13%	-
广发证券	1	67,704,989.12	2.27%	63,053.59	2.68%	-
兴业证券	1	36,242,254.08	1.22%	33,753.01	1.43%	-
长江证券	2	13,837,799.69	0.46%	12,887.32	0.55%	-
中泰证券	1	6,523,912.16	0.22%	5,945.26	0.25%	-
天风证券	2	4,850,156.99	0.16%	4,419.96	0.19%	-

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

基金管理人或被选择的券商签订《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 11 月完成租用托管在建行的长江证券深圳 000510 交易单元。

11.7.2 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
中信证券	-	-	390,000,000.00	19.83%	-	-
东北证券	-	-	30,000,000.00	1.53%	-	-
招商证券	-	-	406,800,000.00	20.68%	-	-
兴业证券	-	-	1,140,000,000.00	57.96%	-	-

华安基金管理有限公司

二〇一八年三月二十七日