

华安创新证券投资基金
2017 年年度报告
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：交通银行股份有限公司

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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 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。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 12 月 31 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	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明	14
4.10 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	14
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
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	14
§6 审计报告	15
6.1 审计意见	15
6.2 形成审计意见的基础	15
6.3 管理层对财务报表的责任	15
6.4 注册会计师的责任	15
§7 年度财务报表	16
7.1 资产负债表	16
7.2 利润表	18
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	20
7.4 报表附注	21
§8 投资组合报告	46
8.1 期末基金资产组合情况	46
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	47
8.3 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	47
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	49

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	59
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	59
8.7 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	59
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	60
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	60
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	60
8.12 投资组合报告附注	60
§9 基金份额持有人信息	61
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	61
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	61
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	61
§10 开放式基金份额变动	62
§11 重大事件揭示	62
11.1 基金份额持有人大会决议	62
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	62
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	62
11.4 基金投资策略的改变	62
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	62
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	63
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	63
11.8 其他重大事件	65
12 影响投资者决策的其他重要信息	69
§13 备查文件目录	69
13.1 备查文件目录	69
13.2 存放地点	69
13.3 查阅方式	70

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华安创新证券投资基金	
基金简称	华安创新混合	
基金主代码	040001	
交易代码	040001(前端)	041001(后端)
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2001 年 9 月 21 日	
基金管理人	华安基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	3,019,199,103.72 份	
基金合同存续期	不定期	

2.2 基金产品说明

投资目标	<p>基金管理人将以分散投资风险，提高基金资产的安全性，并积极追求投资收益的稳定增长为目标，以诚信原则及专业经营方式，将本基金投资于具有良好流动性的金融工具，主要包括国内依法公开发行、上市的股票、债券以及经中国证监会批准的允许基金投资的其它金融工具。</p>
投资策略	<p>本基金主要投资创新类上市公司以实现基金的投资收益，通过建立科学合理的投资组合，为投资者降低和分散投资风险，提高基金资产的安全性。这里的创新是指科技创新、管理创新和制度创新等方面。创新类上市公司包括高新技术产业创新公司和传统产业创新公司。</p> <p>高新技术产业创新公司主要集中在信息技术、生物医药和新材料等高新技术产业等领域，包括电子信息及网络技术、生物技术及新医药、光机电一体化、航空航天技术、海洋技术、新材料、新能源等领域内主业突出的上市公司。</p> <p>传统产业类型的上市公司中，如果已在或正在管理制度、营销体系、技术开发和生产体系等方面进行创新，具有较大潜在发展前景和经济效益的上市公司也属于本基金的主要投资范围。</p>

	<p>本基金在选择上市公司时主要考虑以下因素：公司创新能力强，主营业务市场空间大，财务状况良好，具有相当竞争优势等。</p> <p>本基金的投资组合将通过持有基金管理人确认的并符合法律规定的一定比例的高流动性资产，如国债和现金，从而保持基金资产良好的流动性。</p>
业绩比较基准	75%×沪深 300 指数收益率+25%×中债国债总财富指数收益率
风险收益特征	无

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华安基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	钱鲲	陆志俊
	联系电话	021-38969999	021-32169999
	电子邮箱	qiankun@huaan.com.cn	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		4008850099	95559
传真		021-68863414	021-62701216
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区 世纪大道8号国金中心二期31 —32层	上海市浦东新区银城中路188 号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区 世纪大道8号国金中心二期31 —32层	上海市浦东新区银城中路188 号
邮政编码		200120	200120
法定代表人		朱学华	牛锡明

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金年度报告正文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、32 层

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	中国上海市黄浦区湖滨路202号企业天地2号楼普华永道中心11楼
注册登记机构	华安基金管理有限公司	上海市世纪大道8号上海国金中心二期31、32层

§3 主要财务指标、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	2016 年	2015 年
本期已实现收益	47,738,886.47	-464,904,347.24	1,333,539,938.24
本期利润	107,127,205.55	-586,734,481.73	1,274,917,525.15
加权平均基金份额本期利润	0.0334	-0.1691	0.2811
本期加权平均净值利润率	4.54%	-22.79%	34.09%
本期基金份额净值增长率	4.48%	-18.89%	27.74%
3.1.2 期末数据和指标	2017 年末	2016 年末	2015 年末
期末可供分配利润	1,524,058,094.22	1,615,607,823.81	2,228,397,023.15
期末可供分配基金份额利润	0.5048	0.4813	0.6328
期末基金资产净值	2,253,020,644.14	2,396,671,293.59	3,142,267,270.25
期末基金份额净值	0.746	0.714	0.892
3.1.3 累计期末指标	2017 年末	2016 年末	2015 年末
基金份额累计净值增长率	327.12%	308.79%	404.00%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

3.2 基金净值表现

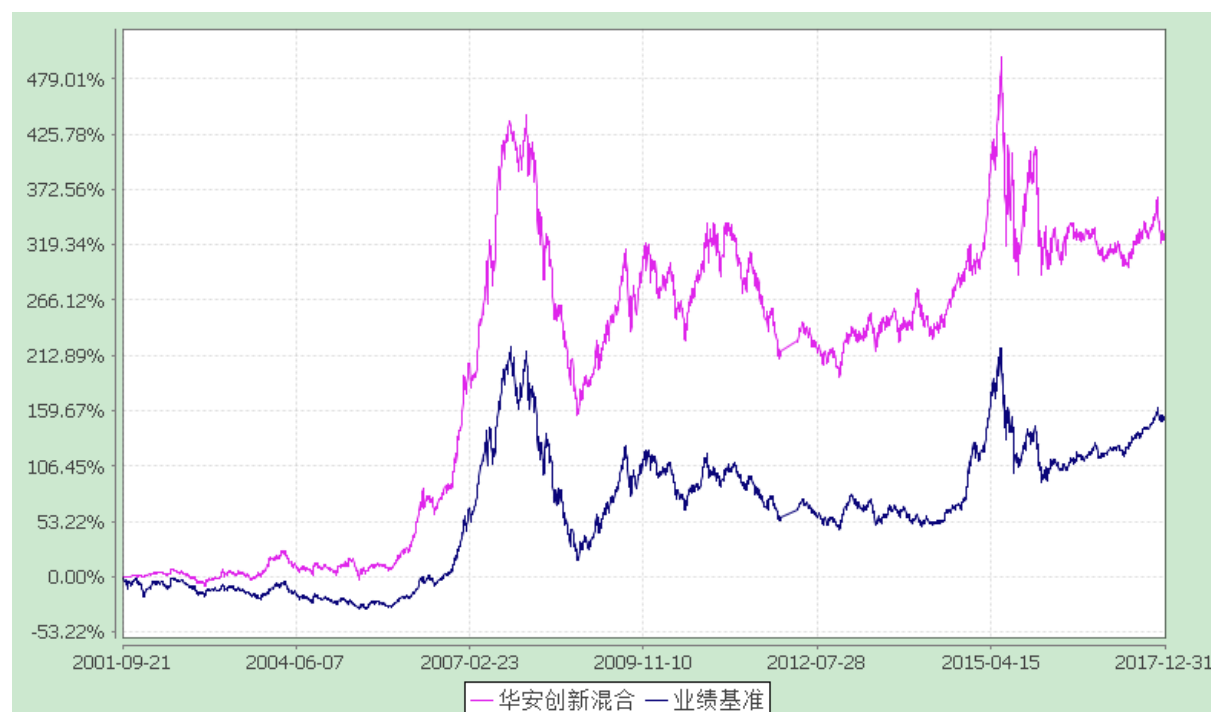
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.53%	0.92%	3.74%	0.60%	-4.27%	0.32%
过去六个月	2.75%	0.80%	7.39%	0.52%	-4.64%	0.28%
过去一年	4.48%	0.71%	15.87%	0.48%	-11.39%	0.23%
过去三年	8.26%	1.43%	12.79%	1.25%	-4.53%	0.18%
过去五年	30.54%	1.27%	49.97%	1.14%	-19.43%	0.13%
自基金合同生效起至今	327.12%	1.20%	152.76%	1.27%	174.36%	-0.07%

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

华安创新证券投资基金

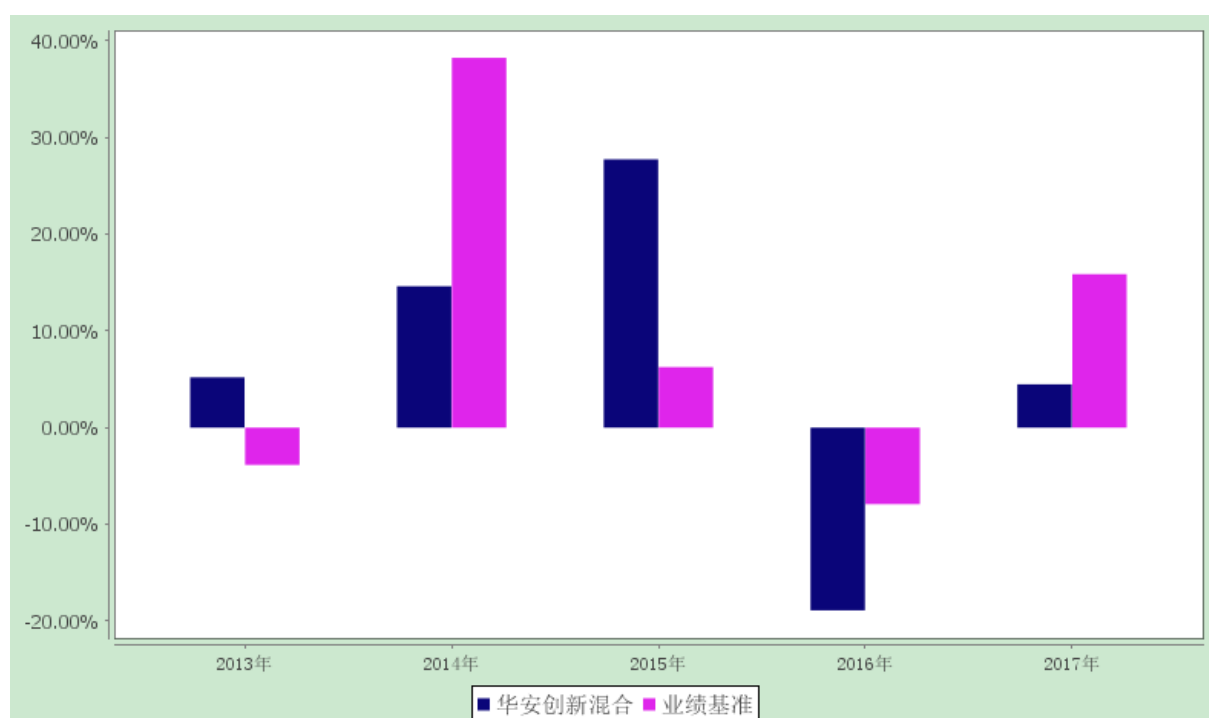
自基金合同生效以来份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2001 年 9 月 21 日至 2017 年 12 月 31 日)



3.2.3 过去五年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

华安创新证券投资基金

过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2016年	0.100	19,037,703.41	16,106,719.70	35,144,423.11	-
2015年	0.100	32,115,266.24	26,485,993.04	58,601,259.28	-
合计	0.200	51,152,969.65	42,592,712.74	93,745,682.39	-

§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		
廖发达	本基金的基金经理	2015-08-06	-	16 年	博士研究生，16 年金融行业从业经验，曾任上海证大投资管理有限公司副经理、金鹰基金研究员、中国人寿资产管理研究员、太平洋资产管理投资经理。2015 年 6 月加入华安基金管理有限公司，2015 年 8 月起担任本基金的基金经理。2016 年 2 月起担任华安安华保本混合型证券投资基金的基金经理。2016 年 8 月起同时担任华安安进保本混合型发起式证券投资基金的基金经理。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。

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，价值周期风格显著战胜中小盘成长股，上证 50 指数上涨 25.1%，深证 100R 上涨 28.4%，而创业板指数下跌 10.7%，上证 50 相对创业板指数的超额收益达 35.8%。从行业看，食品饮料、保险、家电、银行、钢铁等行业表现居前，而纺织服装、综合、传媒、计算机、国防军工、证券等行业表现居后。

组合投资方面，报告期内，本基金在资产配置上保持中性仓位；在行业风格上，提高业绩确定性增长、业绩估值匹配性好的家电、食品、保险、消费电子股的配置，减持了部分估值高、流动性差的个股。自上而下与自下而上相结合筛选个股，并进行了一定的行业轮动和波段操作。

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 0.746 元，本报告期份额净值增长率为 4.48%，同期业绩比较基准增长率为 15.87%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2017 年是三四线地产超预期，供给侧改革成效显著、经济持续复苏的一年，也是金融去杠杆，利率震荡上行的一年。随着沪港通、深港通的开通，A 股市场与港股市场在联动性、投资理念上的相互影响显著增强。中国后工业化时代的环保硬约束、供给侧改革、寡头定价权等使得行业龙头的竞争力和盈利能力显著提升。微信时代信息快速传递和机构配置的流动性要求等使得龙头股溢价效应逐步显现。

2018 年，经济将继续保持总体平稳，结构分化，行业集中度提高的趋势。各行业的细分行业龙头都将在中长期胜出。具体为：环保督查、排污许可证等环保约束将使部分周期行业龙头公司显著受益。业绩稳健增长、估值合理的优质消费、成长龙头公司将有望继续获得超额收益。具有消费属性的保险龙头、息差有望见底回升的中大型银行有望获得一定稳健收益。

下阶段，本基金将以行业景气和公司基本面为出发点，采取成长与价值融合、自上而下与自下而上相结合策略，积极寻找结构性机会。在操作上，以绝对收益为思路，通过组合的动态调整，在控制回撤

风险的条件下，实现基金业绩的持续、稳健增长。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，公司合规监察稽核部从维护基金份额持有人利益、保障基金的合规运作出发，重点在法律事务、合规管理、内部稽核、信息披露、反洗钱、员工行为规范等方面开展工作，深化员工的合规意识，推动公司的合规文化和内部风险控制机制的完善与优化。

监察稽核工作重点集中于以下几个方面：

(1) 继续深化“主动合规”的管理理念，强化全体员工的合规意识和风险控制意识，通过定期组织员工进行职业道德规范、反洗钱、防范利益冲突、客户信息保密、销售适用性等方面的合规培训和内部审计，推动公司建立良好的内控环境和合规文化。

(2) 强化内控建设，持续进行投资管理人员合规培训，坚守“三条底线”；

(3) 做好在新基金产品开发、新投资品种、及其他创新业务中法律、合规及风险控制方面的支持，坚持定期对投资、研究、交易、核算、销售等相关业务活动的日常合规性检查。

(4) 推动落实公司投资、运营业务操作流程标准化，细化各相关部门在各业务环节的操作流程及工作职责，降低操作风险发生的概率。

(5) 按照法规的要求，做好旗下各只基金的信息披露工作，做到信息披露的真实、完整、准确、及时。

(6) 有计划地对公司投资研究、基金销售、后台运营等相关业务部门进行了多次全面或专项稽核，强化对公司制度执行和风控措施的落实。

本基金管理人承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范和控制各种风险，保障基金份额持有人的合法权益

4.7 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。

4.8 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。

4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2017 年度，基金托管人在华安创新证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

2017 年度，华安基金管理有限公司在华安创新证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配，符合基金合同的规定。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

2017 年度，由华安基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关华安创新证券投资基金的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§6 审计报告

普华永道中天审字(2018)第 20808 号

华安创新证券投资基金全体基金份额持有人：

我们审计了华安创新证券投资基金(以下简称“华安创新基金”)的财务报表,包括 2017 年 12 月 31 日的资产负债表,2017 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

6.1 审计意见

我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了华安创新基金 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年度的经营成果和基金净值变动情况。

6.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。

按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于华安创新基金,并履行了职业道德方面的其他责任。

6.3 管理层对财务报表的责任

华安创新基金的基金管理人华安基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估华安创新基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算华安创新基金、终止运营或别无其他现实的选择。

基金管理人治理层负责监督华安创新基金的财务报告过程。

6.4 注册会计师的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在

某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对导致对华安创新基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致华安创新基金不能持续经营。

(五) 评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露)，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙) 中国注册会计师

单峰 魏佳亮

中国上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼

2018 年 3 月 22 日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：华安创新证券投资基金

报告截止日：2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	7.4.7.1	11,566,651.20	78,350,787.52
结算备付金		86,215,791.51	188,105,844.36
存出保证金		2,274,760.01	2,897,326.67
交易性金融资产	7.4.7.2	2,146,212,476.14	2,077,947,818.59
其中：股票投资		1,599,885,076.14	1,516,520,578.59
基金投资		-	-
债券投资		546,327,400.00	561,427,240.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	100,000,270.00
应收证券清算款		39,717,105.88	-
应收利息	7.4.7.5	11,531,923.47	10,606,946.01
应收股利		-	-
应收申购款		42,153.48	32,061.06
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		2,297,560,861.69	2,457,941,054.21
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 12 月 31 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-

应付证券清算款		24,393,925.33	40,513,451.63
应付赎回款		1,673,565.62	789,087.55
应付管理人报酬		2,894,472.65	3,110,662.10
应付托管费		482,412.12	518,443.71
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	14,075,732.44	15,316,023.05
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	1,020,109.39	1,022,092.58
负债合计		44,540,217.55	61,269,760.62
所有者权益：		-	-
实收基金	7.4.7.9	702,577,106.46	781,063,469.78
未分配利润	7.4.7.10	1,550,443,537.68	1,615,607,823.81
所有者权益合计		2,253,020,644.14	2,396,671,293.59
负债和所有者权益总计		2,297,560,861.69	2,457,941,054.21

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.746 元，基金份额总额 3,019,199,103.72 份。

7.2 利润表

会计主体：华安创新证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
一、收入		246,121,354.56	-440,911,136.21
1.利息收入		22,093,923.40	24,339,551.03
其中：存款利息收入	7.4.7.11	3,265,218.21	3,682,491.60

债券利息收入		18,572,439.49	20,550,089.55
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		256,265.70	106,969.88
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		164,591,311.75	-343,477,894.21
其中：股票投资收益	7.4.7.12	143,740,329.71	-350,791,581.83
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	2,707,177.59	1,052,595.60
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	18,143,804.45	6,261,092.02
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	59,388,319.08	-121,830,134.49
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	47,800.33	57,341.46
减：二、费用		138,994,149.01	145,823,345.52
1. 管理人报酬		35,396,706.63	38,652,946.44
2. 托管费		5,899,451.19	6,442,157.75
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	97,254,762.20	100,284,608.13
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.20	443,228.99	443,633.20
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		107,127,205.55	-586,734,481.73
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		107,127,205.55	-586,734,481.73

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安创新证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 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）	781,063,469.78	1,615,607,823.81	2,396,671,293.59
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	107,127,205.55	107,127,205.55
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）	-78,486,363.32	-172,291,491.68	-250,777,855.00
其中：1.基金申购款	6,058,607.59	13,154,050.02	19,212,657.61
2.基金赎回款	-84,544,970.91	-185,445,541.70	-269,990,512.61
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）	702,577,106.46	1,550,443,537.68	2,253,020,644.14
项目	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 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）	819,426,223.49	2,322,841,046.76	3,142,267,270.25

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-586,734,481.73	-586,734,481.73
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）	-38,362,753.71	-85,354,318.11	-123,717,071.82
其中：1.基金申购款	13,318,159.56	29,063,994.20	42,382,153.76
2.基金赎回款	-51,680,913.27	-114,418,312.31	-166,099,225.58
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-35,144,423.11	-35,144,423.11
五、期末所有者权益（基金净值）	781,063,469.78	1,615,607,823.81	2,396,671,293.59

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

华安创新证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2001]第 33 号《关于同意华安创新证券投资基金设立的批复》核准,由华安基金管理有限公司依照《证券投资基金管理暂行办法》及其实施细则、《开放式证券投资基金试点办法》等有关规定和《华安创新证券投资基金基金契约》(后更名为《华安创新证券投资基金基金合同》)发起,并于 2001 年 9 月 21 日募集成立。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 5,000,001,124.00 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道验字(2001)第 84 号验资报告予以验证。本基金的基金管理人为华安基金管理有限公司,基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《华安创新证券投资基金招募说明书》和《华安创新证券投资基金基金份额拆分公告》的有关规定,本基金于 2007 年 10 月 26 日进行了基金份额拆分,拆分比例为 1:4.297369516,并于 2007 年 10 月 29 日进行了份额变更登记。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安创新证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为国内依法公开发行、上市的股票、债券及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。本基金的股票、债券投资比例不低于基金资产总值的 80%;投资于国家债券的比例不低于基金资产净值的 20%。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×75% + 中信标普国债指数收益率×25%”变更为“中信标普 300 指数收益率×75%+中债国债总财富指数收益率×25%”。

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 2018 年 3 月 22 日批准报出。

7.4.2 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》、各项具体会计准则及相关规定(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(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华安创新证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 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 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资和债券投资分类为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公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

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

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金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；或者(3) 该金融资产已转移，虽然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，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和债券投资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其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，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) 当金融工具不存在活跃市场，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。采用估值技术时，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，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。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认列。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认列。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平准金和未实现平准金。已实现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损益占基金净值比例计算的金额。未实现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损益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认列，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

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同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

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按红利发放日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。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) 本基金的基金管理人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) 本基金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。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中央国债登记结算有限责任公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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政策的补充通知》、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。对证券投资基金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，对国债、地方政府债以及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，股票的股息、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，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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
活期存款	11,566,651.20	78,350,787.52
定期存款	-	-
其他存款	-	-
合计	11,566,651.20	78,350,787.52

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末		
		2017 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		1,547,960,634.89	1,599,885,076.14	51,924,441.25
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	7,668,400.00	7,668,400.00	-
	银行间市场	543,059,280.00	538,659,000.00	-4,400,280.00
	合计	550,727,680.00	546,327,400.00	-4,400,280.00
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		2,098,688,314.89	2,146,212,476.14	47,524,161.25
项目		上年度末		
		2016 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		1,529,288,168.50	1,516,520,578.59	-12,767,589.91
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	8,540,591.25	8,798,240.00	257,648.75
	银行间市场	551,983,216.67	552,629,000.00	645,783.33
	合计	560,523,807.92	561,427,240.00	903,432.08
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		2,089,811,976.42	2,077,947,818.59	-11,864,157.83

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
合计	-	-
项目	上年度末 2016 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所买入返售证券	-	-
银行间买入返售证券	100,000,270.00	-
合计	100,000,270.00	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	2,868.28	16,152.38
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	59,881.54	80,884.95
应收债券利息	11,468,150.05	10,475,882.44
应收买入返售证券利息	-	32,722.44
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	1,023.60	1,303.80
合计	11,531,923.47	10,606,946.01

7.4.7.6 其他资产

无余额。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2017 年 12 月 31 日	2016 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	14,075,732.44	15,313,805.30
银行间市场应付交易费用	-	2,217.75
合计	14,075,732.44	15,316,023.05

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2017 年 12 月 31 日	2016 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	500,000.00	500,000.00
应付赎回费	109.39	92.58
预提账户维护费	-	-
预提审计费	-	-
预提信息披露费	-	-
预提费用	520,000.00	522,000.00
其他应付款	-	-
合计	1,020,109.39	1,022,092.58

7.4.7.9 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 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	3,356,485,682.03	781,063,469.78
本期申购	26,035,478.51	6,058,607.59
本期赎回（以“-”号填列）	-363,322,056.82	-84,544,970.91

本期末	3,019,199,103.72	702,577,106.46
-----	------------------	----------------

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,644,612,463.08	-29,004,639.27	1,615,607,823.81
本期利润	47,738,886.47	59,388,319.08	107,127,205.55
本期基金份额交易产生的变动数	-168,293,255.33	-3,998,236.35	-172,291,491.68
其中：基金申购款	12,906,553.80	247,496.22	13,154,050.02
基金赎回款	-181,199,809.13	-4,245,732.57	-185,445,541.70
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,524,058,094.22	26,385,443.46	1,550,443,537.68

7.4.7.11 存款利息收入

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12月31日	2016年1月1日至2016年12月31日
活期存款利息收入	230,287.75	346,173.39
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	2,994,398.82	3,285,293.12
其他	40,531.64	51,025.09
合计	3,265,218.21	3,682,491.60

7.4.7.12 股票投资收益

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12月31日	2016年1月1日至2016年12月31日

		月 31 日
卖出股票成交总额	32,125,405,193.54	33,109,482,858.82
减：卖出股票成本总额	31,981,664,863.83	33,460,274,440.65
买卖股票差价收入	143,740,329.71	-350,791,581.83

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

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12月31日	2016年1月1日至2016年12月31日
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	2,707,177.59	1,052,595.60
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	2,707,177.59	1,052,595.60

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

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12月31日	2016年1月1日至2016年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	913,281,915.45	567,805,460.97
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	885,496,127.92	547,175,195.59
减：应收利息总额	25,078,609.94	19,577,669.78
买卖债券差价收入	2,707,177.59	1,052,595.60

7.4.7.14 贵金属投资收益

无。

7.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具收益。

7.4.7.16 股利收益

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12月31日	2016年1月1日至2016年12月31日
股票投资产生的股利收益	18,143,804.45	6,261,092.02
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	18,143,804.45	6,261,092.02

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年12月31日	2016年1月1日至2016年12月31日
1.交易性金融资产	59,388,319.08	-121,830,134.49
——股票投资	64,692,031.16	-115,017,440.08
——债券投资	-5,303,712.08	-6,812,694.41
——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	59,388,319.08	-121,830,134.49

7.4.7.18 其他收入

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12月31日	2016年1月1日至2016年12月31日
基金赎回费收入	47,800.33	57,341.46
其他收入_其他	-	-
印花税手续费返还	-	-
其他	-	-
基金转出费收入	-	-

合计	47,800.33	57,341.46
----	-----------	-----------

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，赎回费在扣除不超过赎回总金额的 0.1% 的基金注册与过户登记费后的余额列入基金资产。

7.4.7.19 交易费用

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12月31日	2016年1月1日至2016年12月31日
交易所市场交易费用	97,249,837.20	100,281,733.13
银行间市场交易费用	4,925.00	2,875.00
交易基金产生的费用	-	-
其中：申购费	-	-
赎回费	-	-
合计	97,254,762.20	100,284,608.13

7.4.7.20 其他费用

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12月31日	2016年1月1日至2016年12月31日
审计费用	100,000.00	102,000.00
信息披露费	300,000.00	300,000.00
银行汇划费用	5,628.99	4,033.20
帐户维护费	36,400.00	36,400.00
其他费用	1,200.00	1,200.00
合计	443,228.99	443,633.20

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

7.4.9 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
交通银行股份有限公司 (“交通银行”)	基金托管人、基金代销机构
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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易**7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易****7.4.10.1.1 股票交易**

无。

7.4.10.1.2 权证交易

无。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

无。

7.4.10.2 关联方报酬**7.4.10.2.1 基金管理费**

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12月31日	2016年1月1日至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	35,396,706.63	38,652,946.44
其中：支付销售机构的客户维护费	3,666,604.14	4,014,062.06

注：支付基金管理人华安基金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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.5\% / \text{当年天数}。$$

7.4.10.2.2 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12月31日	2016年1月1日至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	5,899,451.19	6,442,157.75

注：支付基金托管人交通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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数}。$$

7.4.10.2.3 销售服务费

无。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 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12月31日		2016年1月1日至2016年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行	11,566,651.20	230,287.75	78,350,787.52	346,173.39

注：1. 本基金的银行存款由基金托管人 交通银行保管，按银行同业利率计息。

2. 本基金用于证券交易结算的资金通过“交通银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司，按银行同业利率计息。于 2017 年 12 月 31 日的相关余额在资产负债表中的“结算备付金”科目中单独列示(2016 年 12 月 31 日：同)。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

7.4.10.7.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

无。

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

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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
002923	润都股份	2017-12-28	2018-01-05	网下中签	17.01	17.01	954.00	16,227.54	16,227.54	-
300666	鹏鹞	2017-1	2018-0	网下	8.88	8.88	3,640.	32,323	32,323	-

4	环保	2-28	1-05	中签			00	.20	.20	
603080	新疆火炬	2017-1 2-25	2018-0 1-03	网下 中签	13.60	13.60	1,187.00	16,143.20	16,143.20	-
603161	科华控股	2017-1 2-28	2018-0 1-05	网下 中签	16.75	16.75	1,239.00	20,753.25	20,753.25	-
7.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
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
128024	宁行转债	2017-1 2-21	2018-0 1-12	新债未上市	100.00	100.00	65,089.00	6,508,900.00	6,508,900.00	-
123003	蓝思转债	2017-1 2-05	2018-0 1-17	新债未上市	100.00	100.00	11,595.00	1,159,500.00	1,159,500.00	-

7.4.12.2 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	复牌开盘价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002919	名臣健康	2017-12-28	重大事项	35.26	2018-01-02	38.79	821.00	10,311.76	28,948.46	-
300730	科创信息	2017-12-25	重大事项	41.55	2018-01-02	45.71	821.00	6,863.56	34,112.55	-
603986	兆易创新	2017-11-01	重大资产重组	153.72	2018-03-02	150.00	19,200.00	3,059,946.00	2,951,424.00	-

注：本基金截至 2017 年 12 月 31 日止持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。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至报告期末 2017 年 12 月 31 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。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至报告期末 2017 年 12 月 31 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。

7.4.13 金融工具风险及管理

本基金是一只偏股型的证券投资基金，属于中等风险品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将相对风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“相对收益高、风险适中”的风险收益目标。

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部等相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理和投资风险、绩效评估等。监察稽核部和风险管理部对公司执行总裁负责，并由督察长分管。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具，通过特定的风险量化指标、模型，形成常规的的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行交通银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相

应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2017 年 12 月 31 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 0.34%（2016 年 12 月 31 日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券。）

7.4.13.3 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。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券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上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%。

本基金所持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，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。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。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

2017 年 12 月 31 日					
资产					
银行存款	11,566,651.20	-	-	-	11,566,651.20
结算备付金	86,215,791.51	-	-	-	86,215,791.51
存出保证金	2,274,760.01	-	-	-	2,274,760.01
交易性金融资产	508,446,000.00	30,213,000.00	7,668,400.00	1,599,885,076.14	2,146,212,476.14
应收证券清算款	-	-	-	39,717,105.88	39,717,105.88
应收利息	-	-	-	11,531,923.47	11,531,923.47
应收申购款	-	-	-	42,153.48	42,153.48
资产总计	608,503,202.72	30,213,000.00	7,668,400.00	1,651,176,258.97	2,297,560,861.69
负债					
应付证券清算款	-	-	-	24,393,925.33	24,393,925.33
应付赎回款	-	-	-	1,673,565.62	1,673,565.62
应付管理人报酬	-	-	-	2,894,472.65	2,894,472.65
应付托管费	-	-	-	482,412.12	482,412.12
应付交易费用	-	-	-	14,075,732.44	14,075,732.44
其他负债	-	-	-	1,020,109.39	1,020,109.39
负债总计	-	-	-	44,540,217.55	44,540,217.55
利率敏感度缺口	608,503,202.72	30,213,000.00	7,668,400.00	1,606,636,041.42	2,253,020,644.14
上年度末 2016 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	78,350,787.52	-	-	-	78,350,787.52
结算备付金	188,105,844.36	-	-	-	188,105,844.36
存出保证金	2,897,326.67	-	-	-	2,897,326.67
交易性金融资产	398,831,240.00	151,666,000.00	10,930,000.00	1,516,520,578.59	2,077,947,818.59
买入返售金融资产	100,000,270.00	-	-	-	100,000,270.00
应收利息	-	-	-	10,606,946.01	10,606,946.01

应收申购款	-	-	-	32,061.06	32,061.06
资产总计	768,185,468.55	151,666,000.00	10,930,000.00	1,527,159,585.66	2,457,941,054.21
负债	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	40,513,451.63	40,513,451.63
应付赎回款	-	-	-	789,087.55	789,087.55
应付管理人报酬	-	-	-	3,110,662.10	3,110,662.10
应付托管费	-	-	-	518,443.71	518,443.71
应付交易费用	-	-	-	15,316,023.05	15,316,023.05
其他负债	-	-	-	1,022,092.58	1,022,092.58
负债总计	-	-	-	61,269,760.62	61,269,760.62
利率敏感度缺口	768,185,468.55	151,666,000.00	10,930,000.00	1,465,889,825.04	2,396,671,293.59

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，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。

7.4.13.4.1.2 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：人民币元）	
		本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
	市场利率上升 25 个基点	减少约 655,791.69	减少约 976,124.06
	市场利率下降 25 个基点	增加约 658,923.10	增加约 982,906.08

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中本基金投资组合中股票、债券投资比例不低于基金资产总值的 80%，投资于国家债券的比例不低于基金资产净值的 20%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 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	1,599,885,076.14	71.01	1,516,520,578.59	63.28
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
合计	1,599,885,076.14	71.01	1,516,520,578.59	63.28

7.4.13.4.3.2 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：人民币元）	
		本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	增加约 138,100,000.00	增加约 134,490,000.00

	业绩比较基准下降 5%	减少约 138,100,000.00	减少约 134,490,000.00
--	-------------	--------------------	--------------------

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：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：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 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 1,596,785,143.94 元，属于第二层次的余额为 549,427,332.20 元，无属于第三层次的余额(2016 年 12 月 31 日：第一层次 1,459,295,434.80 元，第二层次 618,652,383.79 元，无第三层次)。

(ii) 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债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会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将相关股票和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，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2017 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2016 年 12 月 31 日：同)。

(d) 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应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 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，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、国家税务总局于 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。

此外，财政部、国家税务总局于 2017 年 12 月 25 日颁布的财税[2017]90 号《关于租入固定资产进行税额抵扣等增值税政策的通知》对资管产品管理人自 2018 年 1 月 1 日起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的销售额确定做出规定。

上述税收政策对本基金 2017 年 12 月 31 日的财务状况和 2017 年度的经营成果无影响。

(3) 除公允价值和增值税外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§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	1,599,885,076.14	69.63
	其中：股票	1,599,885,076.14	69.63
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	546,327,400.00	23.78
	其中：债券	546,327,400.00	23.78
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	97,782,442.71	4.26
8	其他各项资产	53,565,942.84	2.33
9	合计	2,297,560,861.69	100.00

8.2 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

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	109,726,390.00	4.87
C	制造业	865,521,680.29	38.42
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,143.20	0.00
E	建筑业	15,224,666.00	0.68
F	批发和零售业	37,758,560.14	1.68
G	交通运输、仓储和邮政业	53,180,706.58	2.36
H	住宿和餐饮业	11,301,500.00	0.50
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,801,782.55	0.30
J	金融业	350,603,001.20	15.56
K	房地产业	81,494,846.00	3.62
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	37,084,729.12	1.65
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	31,171,071.06	1.38
S	综合	-	-
	合计	1,599,885,076.14	71.01

8.3 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	000858	五 粮 液	1,100,000	87,868,000.00	3.90
2	600036	招商银行	2,727,300	79,146,246.00	3.51
3	601318	中国平安	1,100,000	76,978,000.00	3.42
4	002142	宁波银行	4,136,920	73,678,545.20	3.27
5	000651	格力电器	1,500,000	65,550,000.00	2.91
6	601336	新华保险	800,000	56,160,000.00	2.49
7	601699	潞安环能	4,771,400	54,298,532.00	2.41
8	300316	晶盛机电	2,271,500	47,497,065.00	2.11
9	600048	保利地产	3,345,300	47,335,995.00	2.10
10	002013	中航机电	4,192,750	45,239,772.50	2.01
11	600038	中直股份	844,025	39,272,483.25	1.74
12	000425	徐工机械	8,031,800	37,187,234.00	1.65
13	300357	我武生物	724,900	35,672,329.00	1.58
14	600528	中铁工业	2,801,996	34,016,231.44	1.51
15	000001	平安银行	2,540,900	33,793,970.00	1.50
16	002343	慈文传媒	875,346	31,171,071.06	1.38
17	601398	工商银行	4,975,200	30,846,240.00	1.37
18	600482	中国动力	1,198,811	29,742,500.91	1.32
19	000002	万 科 A	955,700	29,684,042.00	1.32
20	002179	中航光电	750,566	29,557,289.08	1.31
21	300373	扬杰科技	982,900	29,457,513.00	1.31
22	002262	恩华药业	1,884,547	26,873,640.22	1.19
23	002573	清新环境	1,111,004	25,253,120.92	1.12
24	601111	中国国航	2,004,802	24,699,160.64	1.10
25	603708	家家悦	1,212,207	24,268,384.14	1.08
26	002371	北方华创	562,720	23,319,116.80	1.04
27	000717	韶钢松山	2,612,297	23,144,951.42	1.03
28	600519	贵州茅台	32,500	22,668,425.00	1.01
29	600887	伊利股份	700,000	22,533,000.00	1.00
30	600497	驰宏锌锗	3,161,300	22,445,230.00	1.00
31	600352	浙江龙盛	1,883,743	22,058,630.53	0.98
32	601012	隆基股份	602,227	21,945,151.88	0.97
33	600029	南方航空	1,836,900	21,895,848.00	0.97
34	600188	兖州煤业	1,492,700	21,674,004.00	0.96
35	000786	北新建材	946,600	21,298,500.00	0.95
36	002440	闰土股份	1,048,246	20,639,963.74	0.92
37	600183	生益科技	1,177,672	20,326,618.72	0.90
38	300463	迈克生物	838,324	20,094,626.28	0.89
39	000703	恒逸石化	800,000	17,256,000.00	0.77
40	601233	桐昆股份	700,000	15,743,000.00	0.70
41	600970	中材国际	1,539,400	15,224,666.00	0.68
42	600172	黄河旋风	1,692,760	14,845,505.20	0.66
43	600993	马应龙	658,700	13,490,176.00	0.60
44	600426	华鲁恒升	800,000	12,736,000.00	0.57

45	601636	旗滨集团	1,903,900	11,880,336.00	0.53
46	600760	中航黑豹	338,100	11,796,309.00	0.52
47	600990	四创电子	199,200	11,571,528.00	0.51
48	600028	中国石化	1,844,800	11,308,624.00	0.50
49	600754	锦江股份	350,000	11,301,500.00	0.50
50	002026	山东威达	1,389,800	11,201,788.00	0.50
51	600667	太极实业	1,236,200	11,076,352.00	0.49
52	002035	华帝股份	299,700	9,032,958.00	0.40
53	300070	碧水源	510,100	8,860,437.00	0.39
54	603338	浙江鼎力	86,500	6,802,360.00	0.30
55	300059	东方财富	522,600	6,767,670.00	0.30
56	600125	铁龙物流	607,000	6,567,740.00	0.29
57	600383	金地集团	354,300	4,474,809.00	0.20
58	603986	兆易创新	19,200	2,951,424.00	0.13
59	600031	三一重工	245,800	2,229,406.00	0.10
60	000888	峨眉山 A	188,800	2,033,376.00	0.09
61	603199	九华旅游	28,800	905,472.00	0.04
62	002920	德赛西威	4,569	178,784.97	0.01
63	300735	光弘科技	3,764	54,163.96	0.00
64	002915	中欣氟材	1,085	38,181.15	0.00
65	603477	振静股份	1,955	37,027.70	0.00
66	300730	科创信息	821	34,112.55	0.00
67	300664	鹏鹞环保	3,640	32,323.20	0.00
68	002919	名臣健康	821	28,948.46	0.00
69	002922	伊戈尔	1,245	22,248.15	0.00
70	603161	科华控股	1,239	20,753.25	0.00
71	603283	赛腾股份	1,349	19,614.46	0.00
72	603329	上海雅仕	1,183	17,957.94	0.00
73	002923	润都股份	954	16,227.54	0.00
74	603080	新疆火炬	1,187	16,143.20	0.00
75	300684	中石科技	827	11,528.38	0.00
76	603655	朗博科技	881	8,193.30	0.00

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	600036	招商银行	652,120,842.12	27.21
2	000651	格力电器	627,380,968.83	26.18

3	601318	中国平安	545,516,693.74	22.76
4	601601	中国太保	514,010,783.92	21.45
5	000858	五 粮 液	467,908,084.53	19.52
6	002236	大华股份	463,181,126.48	19.33
7	600887	伊利股份	406,490,742.05	16.96
8	000333	美的集团	350,088,136.78	14.61
9	002142	宁波银行	312,704,863.94	13.05
10	601336	新华保险	312,202,033.88	13.03
11	601688	华泰证券	310,127,120.77	12.94
12	002466	天齐锂业	306,316,811.06	12.78
13	600048	保利地产	302,844,682.66	12.64
14	000568	泸州老窖	279,140,044.77	11.65
15	600507	方大特钢	268,976,160.47	11.22
16	600153	建发股份	254,843,721.71	10.63
17	601668	中国建筑	250,366,884.11	10.45
18	002460	赣锋锂业	229,614,478.22	9.58
19	601699	潞安环能	225,485,204.96	9.41
20	002415	海康威视	217,684,505.34	9.08
21	600068	葛洲坝	216,872,523.61	9.05
22	601398	工商银行	200,371,706.78	8.36
23	601012	隆基股份	199,447,731.55	8.32
24	600438	通威股份	198,773,291.11	8.29
25	002185	华天科技	195,703,597.46	8.17
26	002475	立讯精密	190,843,340.84	7.96
27	002456	欧菲科技	190,150,011.19	7.93
28	000933	神火股份	186,027,643.43	7.76
29	600028	中国石化	185,820,827.79	7.75
30	000069	华侨城 A	177,328,609.01	7.40
31	002371	北方华创	173,940,891.15	7.26
32	600231	凌钢股份	171,865,836.12	7.17
33	600019	宝钢股份	171,273,696.95	7.15
34	002241	歌尔股份	170,741,507.52	7.12
35	600104	上汽集团	167,556,739.58	6.99
36	601939	建设银行	165,973,457.78	6.93
37	600801	华新水泥	164,769,444.97	6.87
38	600741	华域汽车	163,484,321.46	6.82
39	000063	中兴通讯	162,568,580.53	6.78
40	600585	海螺水泥	155,791,147.66	6.50
41	600428	中远海特	150,730,945.45	6.29
42	002013	中航机电	148,692,399.16	6.20
43	600525	长园集团	148,613,938.86	6.20
44	600282	南钢股份	147,923,625.55	6.17
45	002051	中工国际	145,732,018.16	6.08
46	300458	全志科技	144,707,487.65	6.04

47	300070	碧水源	143,912,723.47	6.00
48	002410	广联达	143,070,871.36	5.97
49	300450	先导智能	142,206,680.46	5.93
50	600038	中直股份	141,535,969.51	5.91
51	002035	华帝股份	137,964,389.31	5.76
52	000050	深天马 A	137,951,359.24	5.76
53	600782	新钢股份	135,726,422.45	5.66
54	000963	华东医药	133,478,171.53	5.57
55	000807	云铝股份	131,863,604.74	5.50
56	001979	招商蛇口	128,541,081.90	5.36
57	600477	杭萧钢构	127,080,809.07	5.30
58	300197	铁汉生态	127,061,704.53	5.30
59	000425	徐工机械	127,034,643.38	5.30
60	601988	中国银行	124,612,653.41	5.20
61	600990	四创电子	123,973,423.51	5.17
62	300284	苏交科	123,271,306.22	5.14
63	601818	光大银行	122,236,392.22	5.10
64	600967	内蒙一机	119,752,083.71	5.00
65	300316	晶盛机电	119,423,409.26	4.98
66	600884	杉杉股份	116,433,779.31	4.86
67	600522	中天科技	115,086,384.51	4.80
68	600879	航天电子	114,722,881.59	4.79
69	600030	中信证券	114,368,601.31	4.77
70	600009	上海机场	113,329,950.27	4.73
71	600745	闻泰科技	113,135,187.90	4.72
72	600409	三友化工	113,130,265.05	4.72
73	600498	烽火通信	112,873,229.59	4.71
74	000970	中科三环	112,448,837.83	4.69
75	600703	三安光电	111,149,388.10	4.64
76	603799	华友钴业	110,413,205.74	4.61
77	000998	隆平高科	109,602,364.10	4.57
78	000666	经纬纺机	109,585,928.32	4.57
79	002310	东方园林	107,455,835.76	4.48
80	601231	环旭电子	106,962,286.43	4.46
81	600702	舍得酒业	103,977,689.55	4.34
82	002555	三七互娱	103,096,809.94	4.30
83	002573	清新环境	103,013,124.71	4.30
84	002273	水晶光电	102,334,001.78	4.27
85	600549	厦门钨业	102,265,424.52	4.27
86	601607	上海医药	102,242,184.21	4.27
87	600309	万华化学	100,812,214.59	4.21
88	002008	大族激光	99,047,211.67	4.13
89	600183	生益科技	97,810,358.58	4.08
90	002497	雅化集团	97,663,283.73	4.07

91	300083	劲胜智能	96,614,526.82	4.03
92	000423	东阿阿胶	95,903,325.02	4.00
93	002366	台海核电	95,625,245.43	3.99
94	600963	岳阳林纸	92,884,700.99	3.88
95	600056	中国医药	91,917,777.60	3.84
96	000717	韶钢松山	91,281,913.56	3.81
97	600125	铁龙物流	91,104,185.43	3.80
98	002439	启明星辰	90,988,933.01	3.80
99	002027	分众传媒	90,926,229.04	3.79
100	601600	中国铝业	90,755,443.40	3.79
101	000932	*ST 华菱	88,317,013.79	3.68
102	600487	亨通光电	88,265,768.30	3.68
103	600110	诺德股份	87,770,780.88	3.66
104	000001	平安银行	87,081,454.35	3.63
105	000661	长春高新	87,019,981.58	3.63
106	600885	宏发股份	86,700,190.03	3.62
107	000823	超声电子	86,157,586.65	3.59
108	300588	熙菱信息	85,671,213.09	3.57
109	000937	冀中能源	85,246,441.83	3.56
110	600196	复星医药	85,149,600.18	3.55
111	600270	外运发展	84,534,644.35	3.53
112	601233	桐昆股份	83,520,150.16	3.48
113	600029	南方航空	82,727,612.68	3.45
114	600809	山西汾酒	82,587,349.01	3.45
115	600519	贵州茅台	82,270,214.15	3.43
116	600872	中炬高新	81,944,026.53	3.42
117	000768	中航飞机	79,523,575.89	3.32
118	600562	国睿科技	79,338,459.42	3.31
119	600581	八一钢铁	78,447,248.41	3.27
120	002640	跨境通	77,197,367.80	3.22
121	300136	信维通信	77,180,267.68	3.22
122	002127	南极电商	76,959,936.93	3.21
123	603708	家家悦	76,185,736.17	3.18
124	601888	中国国旅	75,512,493.36	3.15
125	600018	上港集团	75,044,296.20	3.13
126	600567	山鹰纸业	74,665,475.70	3.12
127	600660	福耀玻璃	74,561,993.20	3.11
128	300059	东方财富	74,514,175.45	3.11
129	601669	中国电建	73,525,946.80	3.07
130	601628	中国人寿	72,829,615.70	3.04
131	300274	阳光电源	72,534,556.29	3.03
132	300373	扬杰科技	71,729,374.35	2.99
133	601117	中国化学	71,410,644.97	2.98
134	600114	东睦股份	71,041,441.41	2.96

135	600690	青岛海尔	70,656,198.55	2.95
136	002396	星网锐捷	70,242,961.04	2.93
137	600340	华夏幸福	70,055,931.30	2.92
138	600511	国药股份	69,558,192.96	2.90
139	002368	太极股份	69,389,521.24	2.90
140	300236	上海新阳	68,944,290.30	2.88
141	000776	广发证券	68,807,258.09	2.87
142	600651	飞乐音响	68,163,751.97	2.84
143	000930	中粮生化	67,451,093.10	2.81
144	601333	广深铁路	66,030,067.18	2.76
145	000928	中钢国际	65,693,528.99	2.74
146	000546	金圆股份	65,610,083.57	2.74
147	600603	广汇物流	64,827,618.85	2.70
148	000786	北新建材	64,319,744.16	2.68
149	000728	国元证券	63,981,378.78	2.67
150	000905	厦门港务	62,784,193.59	2.62
151	600497	驰宏锌锗	61,990,842.97	2.59
152	300336	新文化	61,408,285.62	2.56
153	600596	新安股份	61,281,829.00	2.56
154	300357	我武生物	61,223,973.19	2.55
155	000049	德赛电池	61,214,504.33	2.55
156	300408	三环集团	60,646,480.88	2.53
157	603128	华贸物流	60,612,081.90	2.53
158	002036	联创电子	60,100,773.19	2.51
159	002078	太阳纸业	59,916,515.05	2.50
160	300188	美亚柏科	59,901,649.21	2.50
161	603660	苏州科达	59,702,669.29	2.49
162	002179	中航光电	59,280,949.03	2.47
163	000630	铜陵有色	58,879,941.47	2.46
164	002139	拓邦股份	58,766,980.18	2.45
165	601666	平煤股份	56,953,251.39	2.38
166	002450	康得新	56,919,034.11	2.37
167	600584	长电科技	56,806,184.77	2.37
168	002508	老板电器	56,651,519.06	2.36
169	600970	中材国际	56,621,003.05	2.36
170	002449	国星光电	56,083,705.26	2.34
171	601111	中国国航	56,000,029.61	2.34
172	600528	中铁工业	55,771,263.61	2.33
173	002026	山东威达	55,747,079.07	2.33
174	601186	中国铁建	55,580,972.59	2.32
175	002831	裕同科技	55,143,992.16	2.30
176	601952	苏垦农发	54,431,835.96	2.27
177	002205	国统股份	54,345,562.80	2.27
178	600115	东方航空	53,686,940.93	2.24

179	300335	迪森股份	53,155,774.08	2.22
180	600570	恒生电子	52,902,858.09	2.21
181	601229	上海银行	52,809,443.74	2.20
182	600172	黄河旋风	52,675,607.57	2.20
183	600031	三一重工	52,576,255.14	2.19
184	002304	洋河股份	52,315,695.30	2.18
185	002405	四维图新	51,995,602.90	2.17
186	600197	伊力特	51,931,912.90	2.17
187	000400	许继电气	50,391,345.89	2.10
188	600362	江西铜业	48,750,507.31	2.03
189	601006	大秦铁路	48,332,561.59	2.02
190	000402	金融街	48,220,927.34	2.01

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。

8.4.2 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	600036	招商银行	587,392,814.33	24.51
2	000651	格力电器	572,547,056.37	23.89
3	601318	中国平安	533,741,571.72	22.27
4	601601	中国太保	511,579,746.88	21.35
5	002236	大华股份	480,162,372.77	20.03
6	000858	五粮液	425,786,657.83	17.77
7	600887	伊利股份	396,980,617.94	16.56
8	000333	美的集团	374,886,411.28	15.64
9	601688	华泰证券	317,001,508.91	13.23
10	002466	天齐锂业	316,060,779.44	13.19
11	601336	新华保险	302,770,269.07	12.63
12	000568	泸州老窖	286,181,632.20	11.94
13	600048	保利地产	265,830,503.36	11.09
14	600153	建发股份	255,542,323.33	10.66
15	600507	方大特钢	253,489,068.94	10.58
16	601668	中国建筑	251,717,193.65	10.50
17	002460	赣锋锂业	240,063,609.01	10.02
18	002142	宁波银行	236,366,561.24	9.86
19	002415	海康威视	226,968,914.93	9.47
20	600068	葛洲坝	213,143,435.02	8.89
21	600019	宝钢股份	207,431,033.63	8.65
22	000933	神火股份	202,727,082.15	8.46

23	002475	立讯精密	200,445,479.13	8.36
24	600438	通威股份	199,104,576.33	8.31
25	600028	中国石化	198,804,564.69	8.30
26	002185	华天科技	197,775,764.03	8.25
27	601939	建设银行	192,514,291.62	8.03
28	002456	欧菲科技	188,656,578.39	7.87
29	601012	隆基股份	183,180,797.94	7.64
30	601398	工商银行	180,473,321.09	7.53
31	000069	华侨城 A	178,538,589.57	7.45
32	002241	歌尔股份	176,311,884.98	7.36
33	600428	中远海特	174,381,238.85	7.28
34	002371	北方华创	170,810,197.50	7.13
35	002051	中工国际	170,498,422.52	7.11
36	601818	光大银行	167,453,334.99	6.99
37	600801	华新水泥	167,225,557.60	6.98
38	601699	潞安环能	166,941,722.93	6.97
39	600104	上汽集团	166,750,606.72	6.96
40	600741	华域汽车	165,743,029.19	6.92
41	600231	凌钢股份	165,649,295.16	6.91
42	000063	中兴通讯	165,581,713.65	6.91
43	600782	新钢股份	154,702,707.88	6.45
44	600585	海螺水泥	152,490,915.34	6.36
45	300450	先导智能	151,315,061.44	6.31
46	600525	长园集团	149,951,751.56	6.26
47	000963	华东医药	148,149,020.09	6.18
48	000998	隆平高科	147,402,049.31	6.15
49	300458	全志科技	145,122,233.03	6.06
50	300070	碧水源	144,089,814.72	6.01
51	002410	广联达	142,423,153.16	5.94
52	600282	南钢股份	141,495,283.06	5.90
53	000807	云铝股份	140,173,800.90	5.85
54	000050	深天马 A	135,894,153.63	5.67
55	001979	招商蛇口	134,505,848.82	5.61
56	601988	中国银行	133,325,010.04	5.56
57	300284	苏交科	129,833,969.41	5.42
58	600477	杭萧钢构	127,274,409.34	5.31
59	600038	中直股份	126,541,977.83	5.28
60	002035	华帝股份	123,021,821.51	5.13
61	000970	中科三环	118,649,026.42	4.95
62	600009	上海机场	118,261,045.35	4.93
63	600745	闻泰科技	116,999,558.81	4.88
64	600409	三友化工	116,847,344.70	4.88
65	300197	铁汉生态	116,803,450.99	4.87
66	600967	内蒙一机	116,760,280.37	4.87

67	603799	华友钴业	116,019,385.95	4.84
68	600879	航天电子	115,124,727.07	4.80
69	600030	中信证券	114,637,969.40	4.78
70	600884	杉杉股份	113,539,977.99	4.74
71	600703	三安光电	112,617,265.51	4.70
72	600522	中天科技	109,136,056.85	4.55
73	601607	上海医药	109,106,096.14	4.55
74	600990	四创电子	108,861,488.12	4.54
75	600498	烽火通信	108,677,495.79	4.53
76	600309	万华化学	107,457,023.57	4.48
77	002555	三七互娱	105,708,991.01	4.41
78	601231	环旭电子	105,371,619.48	4.40
79	002497	雅化集团	105,021,887.36	4.38
80	600702	舍得酒业	104,875,689.96	4.38
81	000666	经纬纺机	104,537,832.25	4.36
82	002310	东方园林	103,046,486.10	4.30
83	002008	大族激光	102,609,308.80	4.28
84	000932	*ST 华菱	102,567,324.65	4.28
85	002013	中航机电	102,167,003.65	4.26
86	000423	东阿阿胶	101,937,370.00	4.25
87	600549	厦门钨业	101,754,475.33	4.25
88	002273	水晶光电	99,351,898.44	4.15
89	600114	东睦股份	98,537,515.37	4.11
90	002439	启明星辰	95,395,816.15	3.98
91	601117	中国化学	95,304,833.99	3.98
92	000630	铜陵有色	95,295,351.28	3.98
93	600963	岳阳林纸	94,389,667.02	3.94
94	000661	长春高新	94,317,434.72	3.94
95	600056	中国医药	93,364,545.40	3.90
96	000425	徐工机械	91,918,172.48	3.84
97	300083	劲胜智能	91,752,892.34	3.83
98	600125	铁龙物流	91,745,774.96	3.83
99	601600	中国铝业	91,422,982.82	3.81
100	600487	亨通光电	89,694,578.33	3.74
101	300588	熙菱信息	89,638,451.22	3.74
102	002027	分众传媒	89,248,265.96	3.72
103	600581	八一钢铁	89,066,640.49	3.72
104	600885	宏发股份	89,031,970.13	3.71
105	600196	复星医药	88,334,852.88	3.69
106	600809	山西汾酒	87,694,516.53	3.66
107	000823	超声电子	86,846,507.90	3.62
108	002366	台海核电	86,571,504.21	3.61
109	000937	冀中能源	86,020,678.64	3.59
110	600110	诺德股份	85,584,226.24	3.57

111	000928	中钢国际	85,139,489.17	3.55
112	601628	中国人寿	84,657,818.39	3.53
113	601888	中国国旅	84,053,279.86	3.51
114	600598	北大荒	82,497,589.47	3.44
115	600872	中炬高新	82,015,055.99	3.42
116	600270	外运发展	81,846,603.00	3.42
117	600562	国睿科技	80,106,759.66	3.34
118	300188	美亚柏科	79,161,964.00	3.30
119	600660	福耀玻璃	78,850,814.25	3.29
120	002640	跨境通	78,330,975.31	3.27
121	000768	中航飞机	78,167,022.84	3.26
122	002573	清新环境	76,794,799.75	3.20
123	002127	南极电商	76,678,911.02	3.20
124	600183	生益科技	76,669,405.14	3.20
125	300136	信维通信	76,046,364.64	3.17
126	600018	上港集团	74,943,743.20	3.13
127	300316	晶盛机电	73,555,269.90	3.07
128	600567	山鹰纸业	73,519,001.24	3.07
129	600690	青岛海尔	73,272,279.28	3.06
130	002396	星网锐捷	72,346,941.95	3.02
131	002368	太极股份	70,962,920.77	2.96
132	600340	华夏幸福	70,463,215.62	2.94
133	601669	中国电建	70,205,450.34	2.93
134	300274	阳光电源	69,266,464.43	2.89
135	000776	广发证券	69,002,242.41	2.88
136	600511	国药股份	68,838,126.60	2.87
137	000546	金圆股份	68,466,001.14	2.86
138	002450	康得新	67,783,063.41	2.83
139	300011	鼎汉技术	67,765,124.76	2.83
140	601233	桐昆股份	67,473,224.81	2.82
141	300236	上海新阳	67,427,856.44	2.81
142	300059	东方财富	66,915,911.10	2.79
143	601333	广深铁路	66,823,256.53	2.79
144	000930	中粮生化	64,959,023.96	2.71
145	600651	飞乐音响	64,731,625.45	2.70
146	000905	厦门港务	63,593,353.09	2.65
147	000717	韶钢松山	62,699,427.83	2.62
148	600093	易见股份	62,672,326.58	2.61
149	000728	国元证券	62,571,613.04	2.61
150	300408	三环集团	62,440,992.44	2.61
151	002139	拓邦股份	61,144,722.16	2.55
152	002405	四维图新	60,905,926.19	2.54
153	603660	苏州科达	60,565,767.21	2.53
154	002078	太阳纸业	60,035,907.19	2.50

155	000400	许继电气	59,670,796.06	2.49
156	600603	广汇物流	59,662,322.45	2.49
157	300336	新文化	59,540,972.68	2.48
158	600596	新安股份	58,759,818.54	2.45
159	601186	中国铁建	58,205,168.48	2.43
160	600029	南方航空	58,118,815.92	2.42
161	000049	德赛电池	57,917,398.41	2.42
162	002036	联创电子	57,624,738.98	2.40
163	002508	老板电器	57,511,711.46	2.40
164	600584	长电科技	57,319,212.36	2.39
165	600109	国金证券	57,079,343.25	2.38
166	002449	国星光电	56,229,662.86	2.35
167	600519	贵州茅台	55,952,682.43	2.33
168	603128	华贸物流	55,657,738.34	2.32
169	601952	苏垦农发	55,035,120.29	2.30
170	002831	裕同科技	53,756,467.95	2.24
171	002205	国统股份	53,651,140.29	2.24
172	600197	伊力特	53,580,324.81	2.24
173	000001	平安银行	53,524,595.91	2.23
174	600115	东方航空	52,923,127.70	2.21
175	601666	平煤股份	52,735,703.54	2.20
176	600570	恒生电子	51,783,129.23	2.16
177	300335	迪森股份	51,584,419.66	2.15
178	601229	上海银行	51,509,413.54	2.15
179	002304	洋河股份	50,910,629.20	2.12
180	600031	三一重工	50,257,365.00	2.10
181	002465	海格通信	50,146,226.97	2.09
182	000538	云南白药	49,665,731.14	2.07
183	603708	家家悦	49,568,656.74	2.07
184	600362	江西铜业	49,220,325.42	2.05
185	600276	恒瑞医药	49,150,316.90	2.05
186	000402	金融街	48,813,494.49	2.04
187	600787	中储股份	48,732,569.35	2.03
188	000898	鞍钢股份	48,065,460.17	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。

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	32,000,337,330.22
卖出股票的收入（成交）总额	32,125,405,193.54

注：本项的“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）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。

8.5 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	10,361,000.00	0.46
2	央行票据	-	-
3	金融债券	528,298,000.00	23.45
	其中：政策性金融债	528,298,000.00	23.45
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	0.00	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	7,668,400.00	0.34
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	546,327,400.00	24.25

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

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	1,500,000	149,700,000.00	6.64
2	080218	08 国开 18	600,000	59,412,000.00	2.64
3	080216	08 国开 16	500,000	50,075,000.00	2.22
4	170203	17 国开 03	500,000	49,965,000.00	2.22
5	150414	15 农发 14	500,000	49,795,000.00	2.21

8.7 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。

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**

本基金本报告期没有投资股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

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

本基金本报告期没有投资国债期货。

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	2,274,760.01
2	应收证券清算款	39,717,105.88
3	应收股利	-
4	应收利息	11,531,923.47

5	应收申购款	42,153.48
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	53,565,942.84

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股票中不存在流通受限情况。

§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
157,476	19,172.44	153,592,876.21	5.09%	2,865,606,227.51	94.91%

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	897.64	0.00%

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(2001年9月21日)基金份额总额	5,000,001,124.00
本报告期期初基金份额总额	3,356,485,682.03
本报告期基金总申购份额	26,035,478.51
减：本报告期基金总赎回份额	363,322,056.82
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	3,019,199,103.72

注：申购含转换转入份额，赎回含转换转出份额。

§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：

无。

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 100,000 元。

目前的审计机构已提供审计服务的连续年限：自成立日起至今。

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	
华龙证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
万和证券	1	-	-	-	-	-
申港证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	12,907,361,865.38	20.13%	12,020,623.53	20.22%	-
中金公司	1	8,615,328,744.06	13.44%	8,023,435.20	13.50%	-
安信证券	1	5,778,510,767.92	9.01%	5,265,963.67	8.86%	-
招商证券	1	4,764,715,958.62	7.43%	4,437,366.76	7.47%	-
海通证券	1	4,345,769,975.97	6.78%	4,047,222.84	6.81%	-
南京证券	1	4,215,867,358.81	6.58%	3,841,925.30	6.46%	-
国泰君安	2	4,072,768,918.20	6.35%	3,792,970.56	6.38%	-
东吴证券	1	3,838,111,704.51	5.99%	3,497,674.60	5.88%	-
东方证券	1	3,780,659,513.33	5.90%	3,520,931.76	5.92%	-
华泰证券	1	3,529,800,282.01	5.51%	3,287,309.59	5.53%	-
申万宏源	2	2,917,537,020.46	4.55%	2,717,092.67	4.57%	-
方正证券	1	1,192,292,769.57	1.86%	1,110,384.47	1.87%	-
平安证券	1	1,167,488,904.59	1.82%	1,087,282.56	1.83%	-
广发证券	1	996,769,680.63	1.55%	928,294.74	1.56%	-
银河证券	1	735,150,410.06	1.15%	684,643.85	1.15%	-
山西证券	1	605,672,745.03	0.94%	564,060.82	0.95%	-
国信证券	1	331,313,889.54	0.52%	308,553.45	0.52%	-
华金证券	1	322,947,570.32	0.50%	300,761.93	0.51%	-

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：

2017年04月完成租用托管在交通银行（创新）的山西证券交易单元38246

2017年05月完成租用托管在交通银行（创新）的华金证券交易单元38164

2017年12月完成租用托管在交通银行（创新）的申港证券交易单元40305

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
华龙证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
万和证券	-	-	-	-	-	-
申港证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	1,824,070.40	17.78%	-	-	-	-

中金公司	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	8,432,589.00	82.22%	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于旗下部分基金增加济安财富为销售机构并参加费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-01-11
2	关于旗下部分基金增加泰诚财富为销售机构并参加费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-01-18
3	关于旗下部分基金增加北京肯特瑞为销售机构并参加费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-02-08
4	关于基金电子交易平台延长工行直联结算方式费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-02-13
5	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“武钢股份”股票估值调整的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-02-14
6	关于旗下部分基金增加朝阳永续为销售机构并参加费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-02-22
7	华安基金关于参加平安银行优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-02-22
8	华安基金管理有限公司关于华安华安双债添	《上海证券报》、《证券	2017-02-22

	利债券型证券投资基金分红公告	时报》、《中国证券报》 和公司网站	
9	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“王府井”股票估值调整的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2017-02-24
10	关于旗下部分基金增加华阳众惠为销售机构并参加费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2017-03-02
11	关于旗下部分基金增加华夏财富为销售机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2017-03-21
12	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“南都电源”股票估值调整的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2017-03-21
13	关于电子直销平台延长“微钱宝”账户交易费率优惠活动时间公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2017-03-28
14	关于华安基金管理有限公司旗下基金参加广发证券申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2017-03-30
15	关于旗下部分基金参加中国工商银行股份有限公司费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2017-03-30
16	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加通华财富为销售机构并参加费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2017-04-06
17	华安基金关于参加华宝证券优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2017-04-12
18	关于华安基金管理有限公司旗下基金参加交通银行费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2017-04-22
19	关于“微钱宝”快速取现服务升级的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2017-04-25
20	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
21	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
22	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

23	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
24	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
25	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
26	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
27	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
28	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加基煜基金为销售机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-07-18
29	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加锦安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	2017-07-19
30	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加晋商银行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	2017-07-20
31	华安基金关于旗下部分基金增加财路基金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	2017-07-25
32	华安基金管理有限公司关于副总经理变更的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-08-09
33	华安基金关于参加东莞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	2017-08-18
34	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加江南农商行为销售机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-08-19
35	华安基金关于参加江南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	2017-08-30
36	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加万家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	2017-09-05
37	华安基金管理有限公司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	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》	2017-09-13

	告	和公司网站	
38	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加宜信普泽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	2017-09-15
39	华安基金关于参加长江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	2017-09-19
40	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	2017-09-27
41	关于旗下部分基金增加前海欧中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	2017-09-29
42	关于旗下部分基金增加喜鹊金融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	2017-10-17
43	华安基金管理有限公司关于公司股东变更的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2017-10-17
44	关于旗下部分基金增加泛华普益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	2017-10-21
45	关于旗下部分基金增加华羿恒信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	2017-11-01
46	关于华安基金电子直销平台开通协助投资者购买合作商户实物黄金业务的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2017-11-02
47	华安基金管理有限公司关于旗下基金参加光大证券费率优惠的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2017-11-04
48	华安基金关于参加中信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	2017-11-08
49	华安基金关于参加汇成基金优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2017-11-10
50	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“辰安科技”、“兆易创新”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	2017-11-15
51	关于旗下部分基金增加民族证券为销售机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2017-11-25
52	华安基金关于参加中金公司优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券	2017-12-16

		时报》、《中国证券报》 和公司网站	
53	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	2017-12-19
54	华安基金关于参加苏州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	2017-12-26
55	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	2017-12-29
56	华安基金关于参加东莞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	2017-12-29

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。

12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

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

13.2 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>。

13.3 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

二〇一八年三月二十七日