

**华安创新证券投资基金**  
**2015 年年度报告摘要**  
**2015 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：二〇一六年三月二十八日

## §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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 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 2015 年 1 月 1 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 | 3,521,336,892.67 份 |            |
| 基金合同存续期    | 不定期                |            |

### 2.2 基金产品说明

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

|        |                                                                                                       |
|--------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|        | <p>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 | <p>基金整体业绩比较基准=75%×中信标普 300 指数收益率+25%×中信标普国债指数收益率</p>                                                  |
| 风险收益特征 | -                                                                                                     |

## 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<br>负责人 | 姓名   | 钱鲲                  | 汤嵩彦                 |
|             | 联系电话 | 021-38969999        | 95559               |
|             | 电子邮箱 | qiankun@huan.com.cn | tangsy@bankcomm.com |
| 客户服务电话      |      | 4008850099          | 95559               |
| 传真          |      | 021-68863414        | 021-62701216        |

## 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.huan.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 |

## §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 | 2015 年           | 2014 年         | 2013 年         |
|---------------|------------------|----------------|----------------|
| 本期已实现收益       | 1,333,539,938.24 | 473,294,514.50 | 342,277,146.26 |
| 本期利润          | 1,274,917,525.15 | 651,537,492.22 | 267,969,793.78 |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.2811           | 0.0895         | 0.0320         |
| 本期基金份额净值增长率   | 27.74%           | 14.62%         | 5.20%          |

| 3.1.2 期末数据和指标 | 2015 年末          | 2014 年末          | 2013 年末          |
|---------------|------------------|------------------|------------------|
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.6328           | 0.3491           | 0.2901           |
| 期末基金资产净值      | 3,142,267,270.25 | 4,523,321,150.73 | 4,882,609,806.79 |
| 期末基金份额净值      | 0.892            | 0.707            | 0.627            |

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 3 个月  | 22.19%   | 1.61%       | 13.11%     | 1.25%         | 9.08%   | 0.36%  |
| 过去 6 个月  | -4.29%   | 2.38%       | -11.58%    | 1.97%         | 7.29%   | 0.41%  |
| 过去 1 年   | 27.74%   | 2.00%       | 6.26%      | 1.83%         | 21.48%  | 0.17%  |
| 过去 3 年   | 54.04%   | 1.40%       | 40.81%     | 1.32%         | 13.23%  | 0.08%  |
| 过去 5 年   | 18.40%   | 1.25%       | 20.17%     | 1.19%         | -1.77%  | 0.06%  |
| 自基金成立起至今 | 404.00%  | 1.22%       | 136.82%    | 1.32%         | 267.18% | -0.10% |

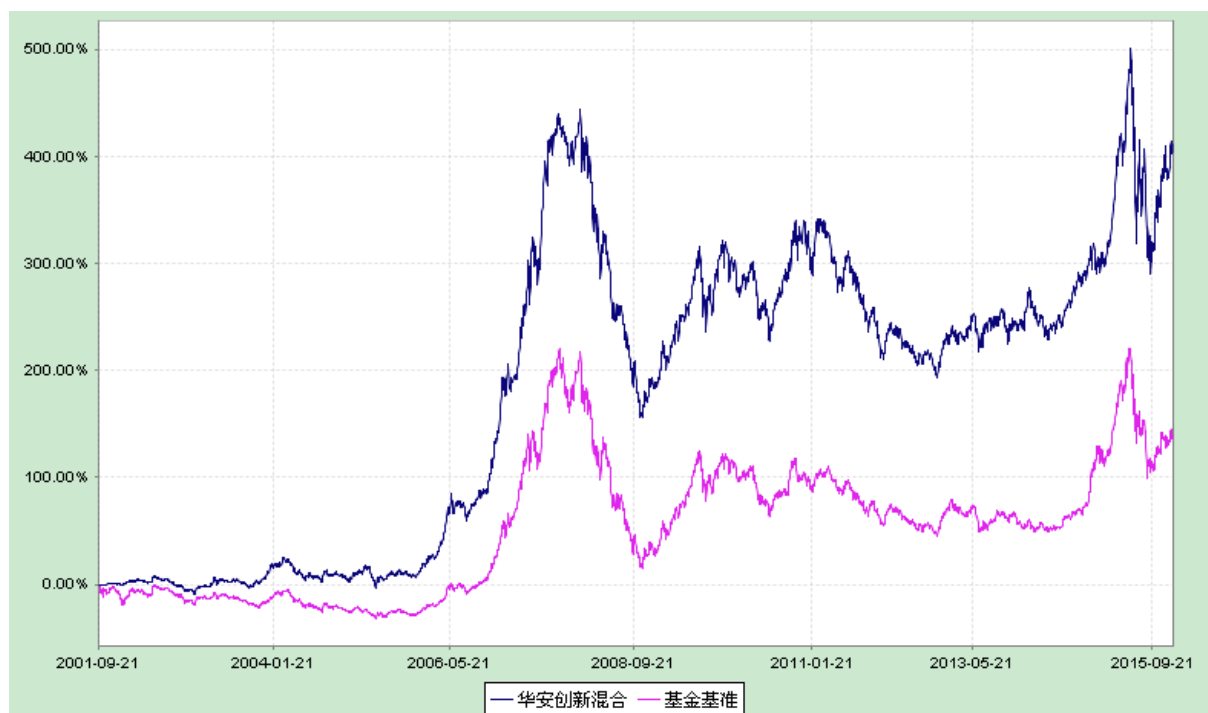
注：本基金的业绩比较基准为中信标普 300 指数收益率×75%+中信标普国债指数收益率×25%。

根据本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%。

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

华安创新证券投资基金

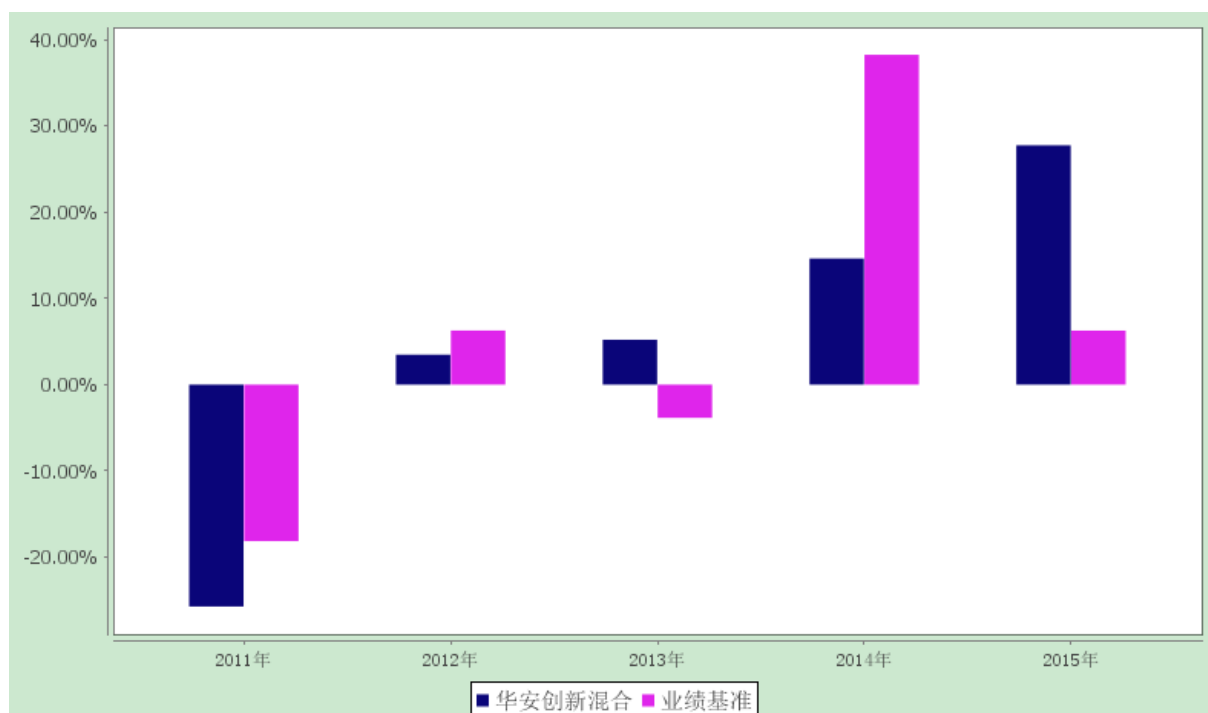
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图  
(2001 年 9 月 21 日至 2015 年 12 月 31 日)



### 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<br>份额分红数 | 现金形式发放总<br>额  | 再投资形式发放总<br>额 | 年度利润分配合<br>计   | 备注 |
|--------|-----------------|---------------|---------------|----------------|----|
| 2015 年 | 0.100           | 32,115,266.24 | 26,485,993.04 | 58,601,259.28  | -  |
| 2014 年 | 0.100           | 42,428,922.61 | 34,925,530.30 | 77,354,452.91  | -  |
| 2013 年 | -               | -             | -             | -              | -  |
| 合计     | 0.200           | 74,544,188.85 | 61,411,523.34 | 135,955,712.19 | -  |

## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

华安基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1998]20 号文批准于 1998 年 6 月设立，是国内首批基金管理公司之一，注册资本 1.5 亿元人民币，公司总部设在上海陆家嘴金融贸易区。目前的股东为上海电气（集团）总公司、上海国际信托有限公司、上海工业投资（集团）有限公司、上海锦江国际投资管理有限公司和国泰君安投资管理股份有限公司。

截至 2015 年 12 月 31 日，公司旗下共管理华安创新混合、华安中国 A 股增强指数、华安现金富利货币、华安宝利配置混合、华安宏利混合、华安中小盘成长混合、华安策略优选混合、华安核心优选混合、华安稳定收益债券、华安动态灵活混合、华安强化收益债券、华安行业轮动混合、华安上证 180ETF、华安上证 180ETF 联接、华安上证龙头企业 ETF、华安上证龙头企业 ETF 联接、华安升级主题混合、华安稳固收益债券、华安可转债、华安深证 300 指数（LOF）、华安科技动力混合、华安四季红债券、华安香港精选股票、华安大中华升级股票、华安标普石油指数基金（QDII-LOF）、华安月月鑫短期理财债券、华安季季鑫短期理财债券、华安月安鑫短期理财债券、华安沪深 300 指数分级、华安逆向策略、华安日日鑫货币、华安安心收益债券、华安信用增强债券、华安纯债、华安保本混合、华安双债添利债券、华安安信消费混合、华安纳斯达克 100 指数、华安黄金易 ETF、华安黄金 ETF 联接、华安沪深 300 量化增强、华安年年红债券、华安生态优先混合、华安中证细分地产 ETF、华安中证细分医药 ETF、华安大国新经济股票、华安新活力混合、华安安顺灵活配置混合、华安财汇通货币、华安国际龙头（DAX）ETF、华安国际龙头（DAX）ETF 联接、华安高分红指数增强、华安中证细分医药 ETF 联接、华安安享灵活配置混合、华安年年盈定期开放债券、华安物联网主题股票、华安新丝路主题股票、华安新动力灵活配置混合、华安智能装备主题股票、华安媒体互联网混合、华安新机遇保本混合、华安新优选灵活配置混合、华安新回报灵活配置混合、华安中证全指证券指数分级、华安中证银行指数分级、华安国企改革主题混合、华安添颐养老混合发起式、华安创业板 50 指数分级、华安新乐享保本混合、华安安益保本混合、华安乐惠保本混合等

71 只开放式基金。管理资产规模达到 1558.45 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 |        |                                                                                                                                                                                                                  |
| 杨鑫鑫 | 本基金的基金经理 | 2014-12-31      | -    | 7 年    | 硕士研究生，具有基金从业资格，7 年基金行业从业资格。2008 年 7 月应届进入华安基金管理有限公司，先后担任研究发展部行业研究员、基金投资部基金经理助理。2013 年 6 月起担任华安核心优选混合型证券投资基金的基金经理。2014 年 12 月起担任本基金的基金经理。2015 年 3 月起担任华安新动力灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2015 年 4 月起担任华安新丝路主题股票型证券投资基金的基金经理。 |
| 廖发达 | 本基金的基金经理 | 2015-08-06      | -    | 14 年   | 博士研究生，14 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。                                                                                               |

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有关法律法规及《华安创新混合证券投资基金基金合同》、《华安创新混合证券投资基金招募说明书》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，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。原因是各投资组合分别按照其交易策略交易时，虽相关投资组合买卖数量极少，但由于个股流动性较差，交易量稀少，致使成交较少的单边交易量仍然超过该证券当日成交量的 5%。从同向交易统计检验和实际检查的结果来看，未发现异常。

#### 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

2015 年是市场大幅波动的一年。上半年在创新、转型和杠杆驱动下，市场快速、大幅上涨；但在 6 月中旬之后的 3 个月内，市场出现了两轮惨烈下跌；四季度随着去杠杆进入尾声并叠加“十三五”规划，市场出现了强劲反弹。从全年来看，以创业板和中小板为代表的成长股表现显著强于沪深 300 和上证 50 指数为代表的传统蓝筹股和周期股。2015 年创业板和中小板分别上涨 84.4% 和 53.7%，而沪深 300 指数和上证 50 分别上涨 5.58% 和下跌 6.23%。

组合投资上，本基金立足行业和上市公司基本面分析，上半年主要配置了业绩确定性增长的白马股和白马成长股，组合风格整体偏稳健。6 月中旬，本基金进行了较大幅度的降仓，规避了一定的系统性风险。四季度，本基金加配了景气上升的文体娱教卫等新型消费股和云计算、大数据等细分行业个股，取得了一定的超额收益。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2015 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 0.892 元，本报告期份额净值增长率为 27.74%，同期业绩比较基准增长率为 6.26%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

目前，中国经济正处于增速换挡、经济转型的重要时期。一方面，为化解过剩产能，保持经济的持续、稳定增长，中央提出了“供给侧改革”；在货币政策方面，国家加大了信贷对实体经济的支持力度，货币政策总体适度宽松，为供给侧改革和经济增长创造了良好条件。在产业政策措施上，

国家在地产、基建、汽车等重要产业开始频频出手，出台政策，托底经济的态度越来越坚决。随着政策效应的逐步显现，投资、消费需求有望逐步企稳、回升，工业品与消费品的全面通缩状况将逐步淡化，以往的去库存有望逐步转向适度的库存回补。另一方面，随着居民收入的持续、快速增长，居民在文化传媒、旅游休闲、体育、教育等自主消费方面持续、快速增长，并成为了经济增长中的亮点。

市场层面，在经历了 2014 年蓝筹股的大幅上涨和 2015 年以创业板和中小板为代表的中小创的牛市之后，市场整体估值水平以及对上市公司盈利预期都处在相对高位，而过去几年 IPO 上市、增发的大量股份已陆续进入可流通状态。与此同时，2016 年美联储进入加息周期，国际大宗商品、国际经济金融环境及地缘政治等方面存在较大不确定性。

2016 年，本基金将采取相对谨慎的投资策略，立足行业、公司基本面，一方面配置行业景气上升、业绩确定性增长、估值合理的新兴消费龙头个股，另一方面配置供给侧改革受益行业个股。在投资操作上，以绝对收益为导向，通过组合的动态调整，力争在控制回撤的前提下，实现基金业绩的持续、稳健增长。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

##### 1、估值政策及重大变化

无。

##### 2、估值政策重大对基金资产净值及当期损益的影响

无。

##### 3、有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历的描述

###### （1）公司方面

公司建立基金估值委员会，组成人员包括：总经理助理（分管投资研究）、基金投资部总监、研究发展部总监、固定收益部总监、指数投资部总监、基金运营部总经理及相关负责人员。

主要职责包括：证券发行机构发生了严重影响证券价格的重大事件时，负责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；同时将采用确定的方法以及采用该方法对相关证券估值后与基金的托管银行进行沟通。

相关人员专业胜任能力及工作经历：

翁启森，基金投资部兼全球投资部总监，工业工程学硕士。曾在台湾 JP 证券任金融产业分析师

及投资经理，台湾摩根富林明投信投资管理部任基金经理，台湾中信证券投资总监助理，台湾保德信投信基金经理。2008 年 4 月加入华安基金管理有限公司，现华安香港精选、华安大中华升级基金、华安宏利股票型基金、华安大国新经济股票型基金的基金经理，华安基金管理有限公司总经理助理、基金投资部兼全球投资部总监。

赵 敏：研究生学历。曾在上海社会科学院人口与发展研究所工作，历任华安基金管理有限公司综合管理部总经理、电子商务部总经理、上海营销总部总经理，现任华安基金管理有限公司总经理助理。

杨 明，投资研究部总监，研究生学历，12 年金融、证券、基金从业经验，曾在上海银行工作。2004 年 10 月进入华安基金管理有限公司，担任研究发展部宏观研究员，现任华安优选的基金经理，投资研究部总监。

贺 涛，金融学硕士，固定收益部副总监。曾任长城证券有限责任公司债券研究员，华安基金管理有限公司债券研究员、债券投资风险管理员、固定收益投资经理。现任华安稳定收益债券基金、华安可转债基金、华安信用增强债券基金、华安双债添利债券基金、华安月月鑫短期理财、华安季季鑫短期理财、华安月安鑫短期理财、华安汇财通货币、华安年年红的基金经理，固定收益部副总监。

许之彦，指数投资部总监，理学博士，CQF(国际数量金融工程师)。曾在广发证券和中山大学经济管理学院博士后流动站从事金融工程工作，2005 年加入华安基金管理有限公司，曾任研究发展部数量策略分析师，现任华安上证 180ETF 及华安上证 180ETF 联接、华安深证 300 指数证券投资基金（LOF）、华安易富黄金 ETF 及联接基金的基金经理，指数投资部总监。

陈 林，基金运营部总经理，工商管理硕士，高级会计师，CPA 中国注册会计师协会非执业会员。曾在安永大华会计师事务所工作，2004 年 11 月加入华安基金管理有限公司，曾任财务核算部副总监、公司财务部总经理，现任基金运营部总经理。

## （2）托管银行

托管银行根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任，并且认真核查公司采用的估值政策和程序。

## （3）会计师事务所

对相关估值模型、假设及参数的适当性出具审核意见和报告。

4、基金经理参与或决定估值的程度

本基金的基金经理未参与基金的估值。

5、参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间无任何重大利益冲突。

6、已签约的任何定价服务的性质与程度等信息

无。

**4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

本基金的基金管理人于 2016 年 1 月 19 日发布 2015 年度第二次分红公告：每 10 份基金份额派发红利 0.10 元。权益登记日及除息日：2016 年 1 月 21 日；现金红利发放日：2016 年 1 月 22 日。

**4.8 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。

**4.9 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**

2015 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**

2015 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。

本报告期内本基金进行了 1 次收益分配，分配金额为 58,601,259.28 元。

**5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见**

2015 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

本报告期的基金财务会计报告经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计，注册会计师单峰 周祎签字出具了普华永道中天审字(2016)第 20861 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：华安创新证券投资基金

报告截止日：2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资产       | 本期末<br>2015 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2014 年 12 月 31 日 |
|----------|-------------------------|--------------------------|
| 资 产：     | -                       | -                        |
| 银行存款     | 274,883.45              | 203,542,652.41           |
| 结算备付金    | 201,318,269.45          | 271,836,658.43           |
| 存出保证金    | 4,143,048.71            | 1,263,732.24             |
| 交易性金融资产  | 2,920,290,689.24        | 3,889,237,032.93         |
| 其中：股票投资  | 2,231,996,089.24        | 2,898,512,712.93         |
| 基金投资     | -                       | -                        |
| 债券投资     | 688,294,600.00          | 990,724,320.00           |
| 资产支持证券投资 | -                       | -                        |
| 贵金属投资    | -                       | -                        |
| 衍生金融资产   | -                       | -                        |
| 买入返售金融资产 | -                       | 100,086,470.13           |
| 应收证券清算款  | 28,052,931.27           | 148,373,670.47           |
| 应收利息     | 14,934,533.89           | 20,927,234.99            |

|                   |                                 |                                  |
|-------------------|---------------------------------|----------------------------------|
| 应收股利              | -                               | -                                |
| 应收申购款             | 86,001.38                       | 405,317.61                       |
| 递延所得税资产           | -                               | -                                |
| 其他资产              | -                               | -                                |
| <b>资产总计</b>       | <b>3,169,100,357.39</b>         | <b>4,635,672,769.21</b>          |
| <b>负债和所有者权益</b>   | <b>本期末<br/>2015 年 12 月 31 日</b> | <b>上年度末<br/>2014 年 12 月 31 日</b> |
| 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           | -                               | 88,098,158.96                    |
| 应付赎回款             | 3,503,742.99                    | 11,088,759.81                    |
| 应付管理人报酬           | 3,961,223.79                    | 6,041,460.54                     |
| 应付托管费             | 660,204.01                      | 1,006,910.08                     |
| 应付销售服务费           | -                               | -                                |
| 应付交易费用            | 17,435,575.88                   | 4,736,398.66                     |
| 应交税费              | -                               | -                                |
| 应付利息              | -                               | -                                |
| 应付利润              | -                               | -                                |
| 递延所得税负债           | -                               | -                                |
| 其他负债              | 1,272,340.47                    | 1,379,930.43                     |
| <b>负债合计</b>       | <b>26,833,087.14</b>            | <b>112,351,618.48</b>            |
| <b>所有者权益:</b>     | -                               | -                                |
| 实收基金              | 819,426,223.49                  | 1,489,803,837.02                 |
| 未分配利润             | 2,322,841,046.76                | 3,033,517,313.71                 |
| <b>所有者权益合计</b>    | <b>3,142,267,270.25</b>         | <b>4,523,321,150.73</b>          |
| <b>负债和所有者权益总计</b> | <b>3,169,100,357.39</b>         | <b>4,635,672,769.21</b>          |

注：报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.892 元，基金份额总额 3,521,336,892.67 份。

## 7.2 利润表

会计主体：华安创新证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目                    | 本期<br>2015 年 1 月 1 日至 2015<br>年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2014 年 1 月 1 日至 2014 年<br>12 月 31 日 |
|-----------------------|-------------------------------------------|------------------------------------------------|
| <b>一、收入</b>           | <b>1,411,087,275.72</b>                   | <b>763,548,932.20</b>                          |
| 1.利息收入                | 39,541,098.12                             | 49,279,058.50                                  |
| 其中：存款利息收入             | 4,501,720.63                              | 4,845,523.56                                   |
| 债券利息收入                | 34,376,853.57                             | 42,220,314.69                                  |
| 资产支持证券利息收入            | -                                         | -                                              |
| 买入返售金融资产收入            | 662,523.92                                | 2,213,220.25                                   |
| 其他利息收入                | -                                         | -                                              |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）      | 1,429,806,182.71                          | 535,153,895.68                                 |
| 其中：股票投资收益             | 1,401,300,867.82                          | 512,005,250.93                                 |
| 基金投资收益                | -                                         | -                                              |
| 债券投资收益                | 944,969.74                                | -1,433,798.77                                  |
| 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                  | 27,560,345.15                             | 24,582,443.52                                  |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | -58,622,413.09                            | 178,242,977.72                                 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）     | -                                         | -                                              |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）     | 362,407.98                                | 873,000.30                                     |
| <b>减：二、费用</b>         | <b>136,169,750.57</b>                     | <b>112,011,439.98</b>                          |

|                            |                         |                       |
|----------------------------|-------------------------|-----------------------|
| 1. 管理人报酬                   | 56,085,454.24           | 70,897,883.38         |
| 2. 托管费                     | 9,347,575.73            | 11,816,313.99         |
| 3. 销售服务费                   | -                       | -                     |
| 4. 交易费用                    | 70,287,694.31           | 28,832,079.76         |
| 5. 利息支出                    | -                       | -                     |
| 其中：卖出回购金融资产支出              | -                       | -                     |
| 6. 其他费用                    | 449,026.29              | 465,162.85            |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> | <b>1,274,917,525.15</b> | <b>651,537,492.22</b> |
| 减：所得税费用                    | -                       | -                     |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   | <b>1,274,917,525.15</b> | <b>651,537,492.22</b> |

### 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：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目                                | 本期<br>2015 年 1 月 1 日至 2015 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）                   | 1,489,803,837.02                       | 3,033,517,313.71  | 4,523,321,150.73  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）          | -                                      | 1,274,917,525.15  | 1,274,917,525.15  |
| 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） | -670,377,613.53                        | -1,926,992,532.82 | -2,597,370,146.35 |
| 其中：1.基金申购款                        | 40,662,933.77                          | 109,527,047.39    | 150,189,981.16    |
| 2.基金赎回款                           | -711,040,547.30                        | -2,036,519,580.21 | -2,747,560,127.51 |
| 四、本期向基金份额持                        | -                                      | -58,601,259.28    | -58,601,259.28    |

|                                        |                                  |                  |                   |
|----------------------------------------|----------------------------------|------------------|-------------------|
| 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）                        | 819,426,223.49                   | 2,322,841,046.76 | 3,142,267,270.25  |
| 项目                                     | 上年度可比期间                          |                  |                   |
|                                        | 2014 年 1 月 1 日至 2014 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）                        | 1,812,758,729.89                 | 3,069,851,076.90 | 4,882,609,806.79  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                                | 651,537,492.22   | 651,537,492.22    |
| 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）      | -322,954,892.87                  | -610,516,802.50  | -933,471,695.37   |
| 其中：1.基金申购款                             | 63,291,649.77                    | 108,763,861.30   | 172,055,511.07    |
| 2.基金赎回款                                | -386,246,542.64                  | -719,280,663.80  | -1,105,527,206.44 |
| 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） | -                                | -77,354,452.91   | -77,354,452.91    |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 1,489,803,837.02                 | 3,033,517,313.71 | 4,523,321,150.73  |

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：章国富，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 2016 年 3 月 23 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。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2015 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 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年度 的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

### 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

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)，鉴于其交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息，本基金本报告期改为采用中证指数有限公司根据《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》所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### 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[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入,应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得,持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的,暂减按 50%计入应纳税所得额;持股期限超过 1 年的,于 2015 年 9 月 8 日前暂减按 25%计入应纳税所得额,自 2015 年 9 月 8 日起,暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。

#### 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 |
| 交通银行股份有限公司(“交通银行”)   | 基金托管人、基金销售机构        |
| 上海国际信托有限公司           | 基金管理人的股东            |
| 上海电气(集团)总公司          | 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            |

注: 下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 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

无。

##### 7.4.8.1.2 权证交易

无。

### 7.4.8.1.3 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<br>2015年1月1日至2015年12<br>月31日 | 上年度可比期间<br>2014年1月1日至2014年12<br>月31日 |
|-----------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 56,085,454.24                   | 70,897,883.38                        |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 6,082,165.78                    | 8,080,881.64                         |

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：

日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.5%/当年天数。

#### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2015年1月1日至2015年12<br>月31日 | 上年度可比期间<br>2014年1月1日至2014年12<br>月31日 |
|----------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 9,347,575.73                    | 11,816,313.99                        |

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：

日托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

### 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

单位：人民币元

| 本期<br>2015年1月1日至2015年12月31日 |        |       |       |
|-----------------------------|--------|-------|-------|
| 银行间市场                       | 债券交易金额 | 基金逆回购 | 基金正回购 |

| 交易的各关联方名称                        | 基金买入   | 基金卖出 | 交易金额  | 利息收入 | 交易金额  | 利息支出 |
|----------------------------------|--------|------|-------|------|-------|------|
| -                                | -      | -    | -     | -    | -     | -    |
| 上年度可比期间<br>2014年1月1日至2014年12月31日 |        |      |       |      |       |      |
| 银行间市场<br>交易的各关联方名称               | 债券交易金额 |      | 基金逆回购 |      | 基金正回购 |      |
|                                  | 基金买入   | 基金卖出 | 交易金额  | 利息收入 | 交易金额  | 利息支出 |
| 交通银行                             | -      | -    | -     | -    | -     | -    |

#### 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

本基金的管理人在本报告期内及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

##### 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                    |            | 上年度可比期间               |            |
|-------|-----------------------|------------|-----------------------|------------|
|       | 2015年1月1日至2015年12月31日 |            | 2014年1月1日至2014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  | 274,883.45            | 657,172.66 | 203,542,652.41        | 930,610.98 |

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 2015 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(2014 年 12 月 31 日：同)。

##### 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。

##### 7.4.8.7 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。

#### 7.4.9 期末（2015 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.9.1 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<br>代码 | 股票<br>名称 | 停牌<br>日期   | 停牌<br>原因 | 期末估<br>值单价 | 复牌<br>日期   | 复牌<br>开<br>盘单<br>价 | 数量<br>(单位：股) | 期末<br>成本总额    | 期末<br>估值总额    | 备注 |
|----------|----------|------------|----------|------------|------------|--------------------|--------------|---------------|---------------|----|
| 600502   | 安徽水利     | 2015-10-20 | 重大资产事项   | 13.67      | -          | -                  | 2,020,231.00 | 23,989,290.88 | 27,616,557.77 |    |
| 601018   | 宁波港      | 2015-08-04 | 重大资产重组   | 8.16       | 2016-02-22 | 7.34               | 3,462,600.00 | 29,872,307.96 | 28,254,816.00 |    |
| 002612   | 朗姿股份     | 2015-12-22 | 重大事项     | 75.46      | -          | -                  | 770,300.00   | 37,580,727.32 | 58,126,838.00 |    |
| 300365   | 恒华科技     | 2015-11-16 | 重大资产重组   | 42.87      | 2016-01-27 | 38.58              | 170,340.00   | 7,673,071.12  | 7,302,475.80  |    |
| 002502   | 骅威股份     | 2015-08-20 | 重大资产重组   | 31.99      | 2016-01-14 | 23.35              | 1,485,200.00 | 36,161,139.36 | 47,511,548.00 |    |
| 600749   | 西藏旅游     | 2015-11-30 | 重大资产重组   | 25.14      | -          | -                  | 1,649,231.00 | 33,070,697.90 | 41,461,667.34 |    |
| 600729   | 重庆百货     | 2015-07-24 | 重大资产重组   | 29.26      | 2016-01-04 | 29.90              | 1,316,362.00 | 40,256,704.44 | 38,516,752.12 |    |
| 600960   | 渤海活塞     | 2015-10-30 | 重大资产重组   | 12.08      | 2016-03-04 | 9.81               | 2,042,664.00 | 21,293,113.15 | 24,675,381.12 |    |

注：本基金截至 2015 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。

##### 7.4.9.2 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.9.2.1 银行间市场债券正回购

截至报告期末 2015 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。

###### 7.4.9.2.2 交易所市场债券正回购

截至报告期末 2015 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。

#### 7.4.10 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 2015 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 1,958,530,053.09 元，属于第二层次的余额为 961,760,636.15 元，无属于第三层次的余额(2014 年 12 月 31 日：第一层次 2,491,805,162.48 元，第二层次 1,397,431,870.45 元，无属于第三层次的余额)。

(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。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)，本基金于 2015 年 3 月 30 日起改为采用中证指数有限公司根据《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》所独立提供的估值结果确定公允价值(附注 7.4.5.2)，并将相关债券的公允价值从第一层次调整至第二层次。

(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 2015 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(2014 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) 除公允价值外,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              | 2,231,996,089.24 | 70.43         |
|    | 其中:股票             | 2,231,996,089.24 | 70.43         |
| 2  | 固定收益投资            | 688,294,600.00   | 21.72         |
|    | 其中:债券             | 688,294,600.00   | 21.72         |
|    | 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      | 201,593,152.90   | 6.36          |
| 7  | 其他各项资产            | 47,216,515.25    | 1.49          |

|   |    |                  |        |
|---|----|------------------|--------|
| 8 | 合计 | 3,169,100,357.39 | 100.00 |
|---|----|------------------|--------|

## 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

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<br>比例（%） |
|----|------------------|------------------|------------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | 37,202,000.00    | 1.18             |
| B  | 采矿业              | -                | -                |
| C  | 制造业              | 1,253,820,692.53 | 39.90            |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 25,542,088.00    | 0.81             |
| E  | 建筑业              | 86,990,799.25    | 2.77             |
| F  | 批发和零售业           | 52,752,158.19    | 1.68             |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 128,324,025.37   | 4.08             |
| H  | 住宿和餐饮业           | -                | -                |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 116,610,486.64   | 3.71             |
| J  | 金融业              | 137,843,654.78   | 4.39             |
| K  | 房地产业             | 52,555,283.60    | 1.67             |
| L  | 租赁和商务服务业         | 32,813,999.82    | 1.04             |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 76,786,526.80    | 2.44             |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 145,974,321.34   | 4.65             |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | -                | -                |
| P  | 教育               | -                | -                |
| Q  | 卫生和社会工作          | 14,323,866.92    | 0.46             |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | 70,456,186.00    | 2.24             |
| S  | 综合               | -                | -                |
|    | 合计               | 2,231,996,089.24 | 71.03            |

## 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<br>比例(%) |
|----|--------|------|-----------|----------------|------------------|
| 1  | 002329 | 皇氏集团 | 4,043,534 | 112,814,598.60 | 3.59             |
| 2  | 300083 | 劲胜精密 | 1,664,032 | 78,741,994.24  | 2.51             |
| 3  | 300384 | 三联虹普 | 911,954   | 76,786,526.80  | 2.44             |
| 4  | 002612 | 朗姿股份 | 770,300   | 58,126,838.00  | 1.85             |
| 5  | 002196 | 方正电机 | 1,782,611 | 54,690,505.48  | 1.74             |
| 6  | 002033 | 丽江旅游 | 3,029,355 | 53,316,648.00  | 1.70             |
| 7  | 600556 | 慧球科技 | 1,916,750 | 51,886,422.50  | 1.65             |
| 8  | 600422 | 昆药集团 | 1,256,453 | 50,031,958.46  | 1.59             |
| 9  | 002502 | 骅威股份 | 1,485,200 | 47,511,548.00  | 1.51             |
| 10 | 002444 | 巨星科技 | 2,239,736 | 46,362,535.20  | 1.48             |

#### 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<br>产净值比例<br>(%) |
|----|--------|------|----------------|------------------------|
| 1  | 002152 | 广电运通 | 181,191,122.30 | 4.01                   |
| 2  | 600422 | 昆药集团 | 176,656,078.89 | 3.91                   |
| 3  | 002142 | 宁波银行 | 162,246,907.83 | 3.59                   |
| 4  | 601801 | 皖新传媒 | 156,334,669.71 | 3.46                   |
| 5  | 600138 | 中青旅  | 153,702,760.52 | 3.40                   |
| 6  | 600325 | 华发股份 | 149,565,973.50 | 3.31                   |
| 7  | 600483 | 福能股份 | 148,133,776.02 | 3.27                   |
| 8  | 000060 | 中金岭南 | 145,116,469.72 | 3.21                   |
| 9  | 600259 | 广晟有色 | 142,896,916.30 | 3.16                   |
| 10 | 000877 | 天山股份 | 138,204,427.17 | 3.06                   |
| 11 | 000925 | 众合科技 | 133,947,293.83 | 2.96                   |
| 12 | 600970 | 中材国际 | 133,309,434.14 | 2.95                   |
| 13 | 000800 | 一汽轿车 | 131,761,581.11 | 2.91                   |
| 14 | 002089 | 新海宜  | 131,574,953.54 | 2.91                   |
| 15 | 603308 | 应流股份 | 128,832,539.02 | 2.85                   |
| 16 | 000528 | 柳工   | 128,501,292.34 | 2.84                   |
| 17 | 601333 | 广深铁路 | 127,695,724.23 | 2.82                   |
| 18 | 002373 | 千方科技 | 122,479,987.20 | 2.71                   |
| 19 | 601601 | 中国太保 | 121,499,139.23 | 2.69                   |
| 20 | 002051 | 中工国际 | 121,202,182.64 | 2.68                   |
| 21 | 600081 | 东风科技 | 120,417,074.39 | 2.66                   |

|    |        |      |                |      |
|----|--------|------|----------------|------|
| 22 | 300296 | 利亚德  | 118,010,594.79 | 2.61 |
| 23 | 600037 | 歌华有线 | 115,153,655.10 | 2.55 |
| 24 | 600362 | 江西铜业 | 113,317,606.64 | 2.51 |
| 25 | 002456 | 欧菲光  | 109,906,494.84 | 2.43 |
| 26 | 300113 | 顺网科技 | 105,014,362.80 | 2.32 |
| 27 | 000998 | 隆平高科 | 103,864,998.76 | 2.30 |
| 28 | 300075 | 数字政通 | 101,731,754.14 | 2.25 |
| 29 | 600029 | 南方航空 | 100,947,334.11 | 2.23 |
| 30 | 002329 | 皇氏集团 | 99,695,098.12  | 2.20 |
| 31 | 601888 | 中国国旅 | 98,418,140.35  | 2.18 |
| 32 | 000728 | 国元证券 | 97,699,982.03  | 2.16 |
| 33 | 601009 | 南京银行 | 96,510,078.04  | 2.13 |
| 34 | 601336 | 新华保险 | 94,209,828.26  | 2.08 |
| 35 | 000018 | 神州长城 | 93,029,025.87  | 2.06 |
| 36 | 002284 | 亚太股份 | 92,581,204.66  | 2.05 |
| 37 | 300133 | 华策影视 | 91,691,548.74  | 2.03 |
| 38 | 000733 | 振华科技 | 91,188,700.99  | 2.02 |
| 39 | 300083 | 劲胜精密 | 90,955,553.56  | 2.01 |

#### 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<br>(%) |
|----|--------|-------|----------------|--------------------|
| 1  | 000069 | 华侨城 A | 339,198,400.42 | 7.50               |
| 2  | 601166 | 兴业银行  | 337,025,450.11 | 7.45               |
| 3  | 002375 | 亚厦股份  | 270,522,981.93 | 5.98               |
| 4  | 300145 | 南方泵业  | 244,814,497.59 | 5.41               |
| 5  | 000060 | 中金岭南  | 243,331,835.22 | 5.38               |
| 6  | 600050 | 中国联通  | 237,715,035.79 | 5.26               |
| 7  | 600028 | 中国石化  | 216,553,274.38 | 4.79               |
| 8  | 002041 | 登海种业  | 202,815,428.50 | 4.48               |
| 9  | 600585 | 海螺水泥  | 195,879,784.05 | 4.33               |
| 10 | 300133 | 华策影视  | 194,861,937.59 | 4.31               |
| 11 | 600422 | 昆药集团  | 191,328,366.94 | 4.23               |
| 12 | 002283 | 天润曲轴  | 181,211,037.65 | 4.01               |
| 13 | 601801 | 皖新传媒  | 169,970,041.11 | 3.76               |
| 14 | 600600 | 青岛啤酒  | 169,196,685.30 | 3.74               |
| 15 | 600085 | 同仁堂   | 168,162,825.70 | 3.72               |
| 16 | 000895 | 双汇发展  | 162,728,120.91 | 3.60               |
| 17 | 002152 | 广电运通  | 160,355,040.37 | 3.55               |

|    |        |       |                |      |
|----|--------|-------|----------------|------|
| 18 | 600963 | 岳阳林纸  | 158,897,320.57 | 3.51 |
| 19 | 000877 | 天山股份  | 149,644,883.82 | 3.31 |
| 20 | 000528 | 柳 工   | 148,827,887.22 | 3.29 |
| 21 | 600276 | 恒瑞医药  | 139,371,893.89 | 3.08 |
| 22 | 002142 | 宁波银行  | 139,018,288.14 | 3.07 |
| 23 | 600483 | 福能股份  | 136,680,766.47 | 3.02 |
| 24 | 600970 | 中材国际  | 135,516,463.83 | 3.00 |
| 25 | 002437 | 誉衡药业  | 132,855,643.76 | 2.94 |
| 26 | 600704 | 物产中大  | 132,258,065.99 | 2.92 |
| 27 | 002271 | 东方雨虹  | 129,477,820.27 | 2.86 |
| 28 | 600325 | 华发股份  | 128,624,096.68 | 2.84 |
| 29 | 000800 | 一汽轿车  | 126,501,572.52 | 2.80 |
| 30 | 601601 | 中国太保  | 121,384,494.58 | 2.68 |
| 31 | 600138 | 中青旅   | 120,430,862.21 | 2.66 |
| 32 | 002089 | 新 海 宜 | 120,142,421.11 | 2.66 |
| 33 | 000925 | 众合科技  | 119,358,679.95 | 2.64 |
| 34 | 300296 | 利亚德   | 117,557,832.83 | 2.60 |
| 35 | 002444 | 巨星科技  | 117,076,992.46 | 2.59 |
| 36 | 600259 | 广晟有色  | 115,983,394.96 | 2.56 |
| 37 | 002373 | 千方科技  | 115,509,686.57 | 2.55 |
| 38 | 600489 | 中金黄金  | 114,742,494.85 | 2.54 |
| 39 | 600958 | 东方证券  | 111,261,408.31 | 2.46 |
| 40 | 600362 | 江西铜业  | 111,008,091.80 | 2.45 |
| 41 | 600750 | 江中药业  | 110,038,706.62 | 2.43 |
| 42 | 300085 | 银之杰   | 109,173,404.49 | 2.41 |
| 43 | 600660 | 福耀玻璃  | 108,106,923.49 | 2.39 |
| 44 | 601333 | 广深铁路  | 105,431,685.35 | 2.33 |
| 45 | 000018 | 神州长城  | 102,105,859.35 | 2.26 |
| 46 | 603308 | 应流股份  | 101,483,887.45 | 2.24 |
| 47 | 600037 | 歌华有线  | 99,531,762.58  | 2.20 |
| 48 | 000728 | 国元证券  | 97,455,504.20  | 2.15 |
| 49 | 600270 | 外运发展  | 95,396,992.66  | 2.11 |
| 50 | 600496 | 精工钢构  | 94,151,931.48  | 2.08 |
| 51 | 000501 | 鄂武商 A | 92,254,166.89  | 2.04 |
| 52 | 000400 | 许继电气  | 91,843,859.84  | 2.03 |
| 53 | 002254 | 泰和新材  | 91,548,062.27  | 2.02 |
| 54 | 600820 | 隧道股份  | 91,486,729.75  | 2.02 |
| 55 | 601888 | 中国国旅  | 90,747,590.99  | 2.01 |
| 56 | 300075 | 数字政通  | 90,661,076.05  | 2.00 |

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。

#### 8.4.3 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 | 21,791,822,749.42 |
| 卖出股票的收入（成交）总额 | 23,795,589,700.78 |

## 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      | 50,254,600.00  | 1.60         |
| 2  | 央行票据      | -              | -            |
| 3  | 金融债券      | 627,813,000.00 | 19.98        |
|    | 其中：政策性金融债 | 627,813,000.00 | 19.98        |
| 4  | 企业债券      | -              | -            |
| 5  | 企业短期融资券   | -              | -            |
| 6  | 中期票据      | 10,227,000.00  | 0.33         |
| 7  | 可转债       | -              | -            |
| 8  | 同业存单      | -              | -            |
| 9  | 其他        | -              | -            |
| 10 | 合计        | 688,294,600.00 | 21.90        |

## 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  | 140311 | 14 进出 11 | 1,300,000 | 130,546,000.00 | 4.15         |
| 2  | 150211 | 15 国开 11 | 1,000,000 | 100,290,000.00 | 3.19         |
| 3  | 080218 | 08 国开 18 | 600,000   | 61,410,000.00  | 1.95         |
| 4  | 080216 | 08 国开 16 | 500,000   | 52,995,000.00  | 1.69         |
| 5  | 100405 | 10 农发 05 | 500,000   | 50,505,000.00  | 1.61         |

## 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不存在被监管部门立案调查的，在本报告编制日前一年内也不存在受到公开谴责、处罚的情况。

8.12.2 本基金投资前十名股票中，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 | 4,143,048.71 |

|   |         |               |
|---|---------|---------------|
| 2 | 应收证券清算款 | 28,052,931.27 |
| 3 | 应收股利    | -             |
| 4 | 应收利息    | 14,934,533.89 |
| 5 | 应收申购款   | 86,001.38     |
| 6 | 其他应收款   | -             |
| 7 | 待摊费用    | -             |
| 8 | 其他      | -             |
| 9 | 合计      | 47,216,515.25 |

#### 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值   | 占基金资产净值比例(%) | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|---------------|--------------|----------|
| 1  | 002612 | 朗姿股份 | 58,126,838.00 | 1.85         | 重大事项停牌   |
| 2  | 002502 | 骅威股份 | 47,511,548.00 | 1.51         | 资产重组停牌   |

### §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 |
| 183,626  | 19,176.68 | 153,157,999.67 | 4.35%  | 3,368,178,893.00 | 95.65% |

## 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 | 138,002.27 | 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

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

注：本公司高级管理人员、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 10 万份至 50 万份（含）；

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                   | 6,402,185,352.21 |
| 本报告期基金总申购份额                    | 174,759,803.29   |
| 减：本报告期基金总赎回份额                  | 3,055,608,262.83 |
| 本报告期基金拆分变动份额                   | -                |
| 本报告期期末基金份额总额                   | 3,521,336,892.67 |

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）2015 年 3 月 7 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，尚志民先生不再担任本基金管理人的副总经理。

(2) 2015 年 6 月 30 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, 秦军先生不再担任本基金管理人的副总经理。

(3) 2015 年 7 月 11 日, 基金管理人发布了华安基金管理有限公司高级管理人员变更公告, 童威先生新任本基金管理人的总经理。

(4) 2015 年 8 月 6 日, 基金管理人发布了华安创新证券投资基金基金经理变更公告, 增聘廖发达先生为本基金的基金经理, 与杨鑫鑫先生共同管理本基金。

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:

本报告期内, 交通银行股份有限公司(以下简称“本行”) 因工作需要, 刘树军先生不再担任本行资产托管业务中心总裁, 任命袁庆伟女士为本行资产托管业务中心总裁。

袁庆伟女士的基金行业高级管理人员任职资格已在中国证券投资基金业协会备案。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内基金管理人无涉及本基金财产的诉讼事项。报告期内无涉及本基金财产的诉讼事项。本报告期内无涉及基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

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 102,000 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

报告期内无管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。本报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

### 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<br>单元<br>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<br>票成交总<br>额的比例 | 佣金           | 占当期佣<br>金总量的<br>比例 |    |
| 中国国际金融 | 1              | 5,337,963,030.44 | 11.71%               | 4,962,923.27 | 11.79%             | -  |

|                  |   |                  |        |              |        |   |
|------------------|---|------------------|--------|--------------|--------|---|
| 有限公司             |   |                  |        |              |        |   |
| 国信证券股份<br>有限公司   | 1 | 575,957,003.05   | 1.26%  | 524,351.65   | 1.25%  | - |
| 国泰君安证券<br>股份有限公司 | 2 | 4,131,310,638.14 | 9.06%  | 3,846,447.92 | 9.14%  | - |
| 申银万国证券<br>股份有限公司 | 2 | 5,272,321,304.99 | 11.57% | 4,892,221.54 | 11.63% | - |
| 招商证券股份<br>有限公司   | 1 | 3,231,765,918.60 | 7.09%  | 2,971,908.17 | 7.06%  | - |
| 方正证券股份<br>有限公司   | 1 | 1,126,529,598.15 | 2.47%  | 1,027,591.54 | 2.44%  | - |
| 东方证券股份<br>有限公司   | 1 | 4,702,812,616.10 | 10.32% | 4,341,236.10 | 10.32% | - |
| 海通证券股份<br>有限公司   | 1 | 7,069,057,518.13 | 15.51% | 6,521,847.78 | 15.50% | - |
| 中国银河证券<br>股份有限公司 | 1 | 1,563,256,390.14 | 3.43%  | 1,442,321.91 | 3.43%  | - |
| 平安证券有限<br>责任公司   | 1 | 1,259,513,573.09 | 2.76%  | 1,157,823.49 | 2.75%  | - |
| 国联证券股份<br>有限公司   | 1 | 434,192,342.66   | 0.95%  | 399,117.45   | 0.95%  | - |
| 广发证券股份<br>有限公司   | 1 | 1,746,840,077.82 | 3.83%  | 1,614,154.25 | 3.84%  | - |
| 华泰联合证券<br>有限责任公司 | 1 | 2,637,842,414.97 | 5.79%  | 2,415,027.60 | 5.74%  | - |
| 川财证券有限<br>责任公司   | 1 | 4,111,953,376.61 | 9.02%  | 3,792,808.86 | 9.01%  | - |
| 山西证券股份<br>有限公司   | 1 | -                | -      | -            | -      | - |
| 安信证券股份<br>有限公司   | 1 | 2,380,505,286.04 | 5.22%  | 2,169,360.85 | 5.16%  | - |

注：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副总经理审批

公司分管副总经理对相关部门提交的《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、报告期内无基金租用券商交易单元的变更情况。

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 |
| 中国国际金融有限公司   | 3,004,964.60 | 50.59%       | -    | -            | -    | -            |
| 国泰君安证券股份有限公司 | 2,298,274.60 | 38.69%       | -    | -            | -    | -            |
| 申银万国证券股份有限公司 | 637,156.80   | 10.73%       | -    | -            | -    | -            |

§12 影响投资者决策的其他重要信息

无。

华安基金管理有限公司

二〇一六年三月二十八日