

华安安顺灵活配置混合型证券投资基金
2016 年年度报告摘要
2016 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：二〇一七年三月二十八日

§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 2017 年 3 月 24 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 2016 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	华安安顺灵活配置
基金主代码	519909
交易代码	519909
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014 年 5 月 12 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	443,172,261.69 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过将基金资产在不同投资资产类别之间灵活配置，并结合对个股、个券的精选策略，以追求超越业绩比较基准的投资回报和资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金采取相对灵活的资产配置策略，通过将基金资产在权益类、固定收益类之间灵活配置，并适当借用金融衍生品的投资来追求基金资产的长期稳健增值。 在具体大类资产配置过程中，本基金将使用定量与定性相结合的研究方法对宏观经济、国家政策、资金面和市场情绪等可能影响证券市场的重要因素进行研究和预测，结合使用公司自主研发的多因子动态资产配置模型、基于投资时钟理论的资产配置模型等经济模型，分析和比较股票、债券等市场和不同金融工具的风险收益特征，确定合适的资产配置比例，动态优化投资组合。 在行业配置层面，本基金将运用“自上而下”的行业配置方法，通过对国内外宏观经济走势、经济结构转型的方向、国家经济与产业政策导向和经济周期调整的深入研究，采用价值理念与成长理念相结合的方法对行业进行筛选。 个股投资方面，本基金将主要采用“自下而上”的个股选择方法，在拟配置

	的行业内部通过定量与定性相结合的分析方法筛选个股。
业绩比较基准	50%×中证 800 指数收益率+50%×中国债券总指数收益率
风险收益特征	本基金为混合型基金，基金的预期风险与预期收益高于债券型基金和货币市场基金低于股票型基金，属于证券投资基金中的中高风险投资品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华安基金管理有限公司	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	95559
	电子邮箱	qiankun@huan.com.cn	luzj@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	2016 年	2015 年	2014 年 5 月 12 日(基金合同生效日)至 2014 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-38,341,484.25	1,021,398,407.14	379,022,139.16
本期利润	-55,454,324.74	750,388,442.43	719,802,274.50
加权平均基金份额本期利润	-0.1131	0.6698	0.2326
本期基金份额净值增长率	-4.16%	24.44%	20.74%

3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
期末可供分配基金份额利润	0.5091	0.5705	0.2048
期末基金资产净值	633,839,299.05	860,461,971.60	2,966,379,150.37
期末基金份额净值	1.430	1.492	1.199

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去 3 个月	3.17%	0.65%	-0.83%	0.40%	4.00%	0.25%
过去 6 个月	8.09%	0.68%	1.39%	0.41%	6.70%	0.27%
过去 1 年	-4.16%	1.54%	-7.53%	0.77%	3.37%	0.77%
自基金成立起至今	44.00%	1.83%	30.44%	0.94%	13.56%	0.89%

注：本基金业绩比较基准：50%×中证 800 指数收益率+50%×中国债券总指数收益率

根据本基金合同的有关规定：本基金的投资对象是具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票，含普通股和优先股）、权证、股指期货等权益类金融工具、债券等固定收益类金融工具（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、中小企业私募债、地方政府债券、中期票据、可转换债券（含分离交易可转债）、短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款等）及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

基金的投资组合比例为：股票等权益类资产占基金资产的比例为 0-95%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

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

华安安顺灵活配置混合型证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2014 年 5 月 12 日至 2016 年 12 月 31 日)



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

华安安顺灵活配置混合型证券投资基金
自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年没有利润分配。

§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 2016 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 ETF、华安上证龙头 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、华安信用四季红债券、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、华安月月安鑫短期理财债券、华安沪深 300 指

数分级、华安逆向策略混合、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、华安汇财通货币、华安国际龙头（DAX）ETF、华安国际龙头（DAX）ETF 联接、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、华安安康保本混合、华安安华保本混合、华安沪港深外延增长混合、华安全球美元收益债券、华安安禧保本混合、华安全球美元票息债券、华安创业板 50ETF、华安安进保本混合发起式、华安聚利 18 个月定开债、华安智增精选灵活配置混合、华安新财富灵活配置混合、华安安润灵活配置混合、华安睿享定开混合发起式、华安新希望灵活配置混合、华安鼎丰债券发起式、华安新瑞利灵活配置混合、华安新泰利灵活配置混合、华安新恒利灵活配置混合、华安事件驱动量化策略混合、华安新丰利灵活配置混合等 89 只开放式基金。管理资产规模达到 1632.85 亿元人民币。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
翁启森	本基金的基金经理，基金投资部兼全球投资部高级总监，总经理助理	2015-02-17	2016-09-21	20 年	工业工程学硕士，20 年证券、基金行业从业经历，具有中国大陆基金从业资格。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，任全球投资部总监。2010 年 9 月起担任华安香港精选股票型证券投资基金的基金经理。2011 年 5 月起同时担任华安大中华升级股票型证券投资基金的基金经理。2013 年 6 月起

					担任基金投资部兼全球投资部总监。2014 年 3 月至 2016 年 9 月担任华安宏利混合型证券投资基金的基金经理。2014 年 4 月起同时担任华安大国新经济股票型证券投资基金的基金经理。2014 年 6 月起担任基金投资部兼全球投资部高级总监。2015 年 2 月至 2016 年 9 月担任本基金的基金经理。2015 年 3 月起担任公司总经理助理。2015 年 3 月起同时担任华安物联网主题股票型证券投资基金的基金经理。2015 年 6 月至 2016 年 9 月同时担任华安宝利配置证券投资基金、华安生态优先混合型证券投资基金的基金经理。
谢振东	本基金的基金经理	2015-03-02	-	6 年	硕士研究生，6 年证券、基金行业从业经验。具有基金从业资格证书。曾任华泰联合证券行业研究员。2011 年 9 月加入华安基金，曾任投资研究部高级研究员、基金投资部基金经理助理。2015 年 3 月起同时担任本基金、华安科技动力混合型证券投资基金的基金经理。2015 年 3 月至 2016 年 9 月担任华安动态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 9 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

报告期内，本基金坚持自下而上的选股思路，持续寻找符合新消费、科技创新的相关标的。在年初遭遇资本市场的大幅调整，净值回撤较大，但基于对宏观经济稳定运行和资本市场自身韧性的信心，本基金在仓位选择和个股风格配置上都相对积极的参与了后续市场反弹，较大幅度跑赢了比较基准。期间，新消费、新科技等标的的配置对于基金净值产生了较大正面贡献。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2016 年 12 月 31 日,本基金份额净值为 1.430 元,本报告期份额净值增长率为-4.16%,同期业绩比较基准增长率为-7.53%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们从两个维度思考下一阶段 A 股市场的机会：债券收益率反弹、信用风险快速上升、房地产阶段性高位、商品波动率大幅加大、非标规模收缩都在一定程度利好权益资产（横向比较维度）；但同时，货币流动性环境边际转紧可能是不可回避的，我们也需要警惕通胀预期、汇率、海外利率、金融去杠杆等方面的制约（纵向时间轴维度）。

或许，17 年 A 股较多的投资机会将来自于行业供给侧驱动，但我们所谓的供给侧驱动不仅仅包含着行政化的去产能导致的供给侧改革，更涵盖市场化驱动的供给侧调整：在经历了多轮经济周期洗礼，众多行业的产业升级、结构调整已经到了临界点，这使得部分行业龙头因为经历了洗牌，实现远超前于行业的增速、实现了强大话语权（定价权）；而我们的目的是去寻找这些变化或者即将要发生变化的行业。

基于此，我们对于下一阶段市场谨慎乐观：17 年的股票市场可能继续呈现震荡和分化，结构性机会层出不穷，这对于自下而上选股创造了良好的环境。

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、估值政策重大变化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：基金投资部兼全球投资部高级总监、投资研究部高级总监、固定收益部总监、指数投资部高级总监、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高级总监，总经理助理，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，台湾保德信投信任基金经理。2008 年 4 月加入华安基金管理有限公司，现任华安香港精选股票、华安大中华升级股票、华安大国新经济股票、华安物联网主题股票的基金经理，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高级总监。

杨明，投资研究部高级总监，研究生学历。曾在上海银行从事信贷员、交易员及风险管理。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，现任华安策略优选混合、华安沪港深外延增长混合、华安安禧保本的基金经理，投资研究部高级总监。

贺涛，金融学硕士，固定收益部总监。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。现任华安现金富利货币、华安稳定收益债券、华安可转债、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、华安信用增强债券、华安双债添利债券、华安汇财通货币、华安年年盈定期开放式债券、华安新回报灵活配置、华安新乐享保本、华安乐惠保本、华安安华保本、华安安进保本、华安新希望混合、华安睿享定开混合的基金经理，固定收益部总监。

许之彦，指数投资部高级总监，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（LOF）、华安易富黄金 ETF 及联接、华安中证全指证券公司指数分级、华安中证银行指数分级、华安创业板 50 指数分级、华安创业板 50ETF 的基金经理，指数投资部高级总监。

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

本报告期不进行收益分配。

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

2016 年度,基金托管人在华安安顺灵活配置混合型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

2016 年度,华安基金管理有限公司在华安安顺灵活配置混合型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

2016 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安顺灵活配置混合型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 张振波签字出具了普华永道中天审字(2017)第 20246 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:华安安顺灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日:2016 年 12 月 31 日

单位:人民币元

资产	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产：	-	-
银行存款	54,416,628.52	40,182,476.40
结算备付金	44,735,044.07	33,010,447.89
存出保证金	500,480.31	990,611.13
交易性金融资产	544,679,081.63	734,773,047.09
其中：股票投资	544,679,081.63	693,008,869.09
基金投资	-	-
债券投资	-	41,764,178.00
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	560,719.59	55,022,019.05
应收利息	48,442.83	713,296.66
应收股利	-	-
应收申购款	24,044.61	50,010.55
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	644,964,441.56	864,741,908.77
负债和所有者权益	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
负债：	-	-
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	5,143,525.35	-

应付赎回款	2,761,179.72	381,645.02
应付管理人报酬	810,027.31	1,092,212.57
应付托管费	135,004.56	182,035.43
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	1,232,485.45	1,551,430.23
应交税费	58,900.00	58,900.00
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	984,020.12	1,013,713.92
负债合计	11,125,142.51	4,279,937.17
所有者权益：	-	-
实收基金	408,223,907.92	531,385,964.48
未分配利润	225,615,391.13	329,076,007.12
所有者权益合计	633,839,299.05	860,461,971.60
负债和所有者权益总计	644,964,441.56	864,741,908.77

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.430 元，基金份额总额 443,172,261.69 份。

7.2 利润表

会计主体：华安安顺灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
一、收入	-34,953,424.04	795,306,259.82
1.利息收入	2,357,771.35	6,537,737.49
其中：存款利息收入	2,187,668.03	5,080,822.17
债券利息收入	77,937.64	725,004.01
资产支持证券利息收入	-	-

买入返售金融资产收入	92,165.68	731,911.31
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	-20,291,417.55	1,054,689,852.09
其中：股票投资收益	-22,927,575.67	1,045,159,635.57
基金投资收益	-	-
债券投资收益	715,127.21	204,588.40
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	1,921,030.91	9,325,628.12
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-17,112,840.49	-271,009,964.71
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	93,062.65	5,088,634.95
减：二、费用	20,500,900.70	44,917,817.39
1. 管理人报酬	9,675,358.46	25,771,829.06
2. 托管费	1,612,559.75	4,295,304.89
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	8,825,595.39	14,424,657.49
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	387,387.10	426,025.95
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-55,454,324.74	750,388,442.43
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-55,454,324.74	750,388,442.43

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安安顺灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期		
	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）	531,385,964.48	329,076,007.12	860,461,971.60
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-55,454,324.74	-55,454,324.74
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）	-123,162,056.56	-48,006,291.25	-171,168,347.81
其中：1.基金申购款	7,557,271.62	3,135,718.85	10,692,990.47
2.基金赎回款	-130,719,328.18	-51,142,010.10	-181,861,338.28
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）	408,223,907.92	225,615,391.13	633,839,299.05
项目	上年度可比期间		
	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）	2,278,273,034.60	688,106,115.77	2,966,379,150.37
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	750,388,442.43	750,388,442.43
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-1,746,887,070.12	-1,109,418,551.08	-2,856,305,621.20

（净值减少以“-”号填列）			
其中：1.基金申购款	120,916,547.68	74,353,055.30	195,269,602.98
2.基金赎回款	-1,867,803,617.80	-1,183,771,606.38	-3,051,575,224.18
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）	531,385,964.48	329,076,007.12	860,461,971.60

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

华安安顺灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)是根据安顺证券投资基金(以下简称“原基金安顺”)基金份额持有人大会 2014 年 4 月 8 日决议通过的《关于安顺证券投资基金转型有关事项的议案》以及中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证券基金机构监管部部函[2014]66 号《关于安顺证券投资基金基金份额持有人大会决议备案的回函》，由原基金安顺转型而成。原基金安顺为契约型封闭式基金，于上海证券交易所(以下简称“上交所”)交易上市，存续期限为 15 年，至 2014 年 6 月 15 日止。本基金的基金管理人向上交所申请提前终止原基金安顺的上市交易，并获得上海证券交易所[2014]184 号文同意，原基金安顺于 2014 年 5 月 9 日进行终止上市权利登记，2014 年 5 月 12 日终止上市，并更名为华安安顺灵活配置混合型证券投资基金。原《安顺证券投资基金基金合同》失效，《华安安顺灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于同一日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。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。

原基金安顺于基金合同失效前经审计的基金资产净值为 3,172,904,977.06 元，已于本基金的基金合同生效日全部转为本基金的基金资产净值。根据《华安安顺灵活配置混合型证券投资基金招募说

明书》和《关于原安顺证券投资基金基金份额拆分结果的公告》的有关规定，本基金以 2014 年 6 月 9 日为基金份额拆分基准日对投资人持有的原基金安顺份额进行了拆分，拆分比例为 1:1.085545777，并于 2014 年 6 月 10 日进行了变更登记。

本基金自 2014 年 5 月 15 日至 2014 年 6 月 4 日期间内开放集中申购，共募集集中申购资金 1,081,514,229.95 元，其中包括折合为基金份额的集中申购资金利息 390,635.25 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2014)第 308 号审验报告予以验证。上述集中申购募集资金已按 2014 年 6 月 9 日基金份额拆分后的基金份额净值 1.0000 元折合为 1,081,514,229.95 份基金份额，其中包括集中申购资金利息折合的 390,635.25 份基金份额，并于 2014 年 6 月 10 日进行了确认登记。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安安顺灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资对象是具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票，含普通股和优先股)、权证、股指期货等权益类金融工具、债券等固定收益类金融工具(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、中小企业私募债、地方政府债券、中期票据、可转换债券(含分离交易可转债)、短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款等)及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金的投资组合比例为:股票等权益类资产占基金资产的比例为 0-95%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为：50%x 中证 800 指数收益率+50%x 中国债券总指数收益率。

本财务报表由本基金的基金管理人华安基金管理有限公司于 2017 年 3 月 24 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》、《华安安顺灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 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 2016 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 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 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

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 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、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

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	上年度可比期间
----	----	---------

	2016年1月1日至2016年12 月31日	2015年1月1日至2015年12 月31日
当期发生的基金应支付的管理费	9,675,358.46	25,771,829.06
其中：支付销售机构的客户维护费	122,389.44	431,651.26

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 2016年1月1日至2016年12 月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12 月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,612,559.75	4,295,304.89

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

无。

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

份额单位：份

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31 日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31 日
期初持有的基金份额	-	86,916,194.50
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	86,916,194.50

期末持有的基金份额	-	-
期末持有的基金份额占基金总 份额比例	-	-

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2016 年 12 月 31 日		上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金 份额占基金 总份额的比 例	持有的基金份额	持有的基金份 额占基金总份 额的比例
上海国际信托有 限公司	4,070,796.00	0.92%	4,070,796.00	0.71%

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	
	2016年1月1日至2016年12月31日		2015年1月1日至2015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	54,416,628.52	226,712.57	40,182,476.40	198,256.97

注：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。

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 2016 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(2015 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

无。

7.4.9 期末（2016 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.9.1.1 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
002838	道恩股份	2016-12-28	2017-01-06	新股中签	15.28	15.28	682.00	10,420.96	10,420.96	-
002840	华统股份	2016-12-29	2017-01-10	新股中签	6.55	6.55	1,814.00	11,881.70	11,881.70	-
300583	赛托生物	2016-12-29	2017-01-06	新股中签	40.29	40.29	1,582.00	63,738.78	63,738.78	-
300586	美联新材	2016-12-26	2017-01-04	新股中签	9.30	9.30	1,006.00	9,355.80	9,355.80	-
300587	天铁股份	2016-12-28	2017-01-05	新股中签	14.11	14.11	1,438.00	20,290.18	20,290.18	-
300588	熙菱信息	2016-12-27	2017-01-05	新股中签	4.94	4.94	1,380.00	6,817.20	6,817.20	-
300591	万里马	2016-12-30	2017-01-10	新股中签	3.07	3.07	2,397.00	7,358.79	7,358.79	-
601375	中原证券	2016-12-20	2017-01-03	新股中签	4.00	4.00	26,695.00	106,780.00	106,780.00	-
603032	德新交运	2016-12-27	2017-01-05	新股中签	5.81	5.81	1,628.00	9,458.68	9,458.68	-
603035	常熟汽饰	2016-12-27	2017-01-05	新股中签	10.44	10.44	2,316.00	24,179.04	24,179.04	-
603186	华正新材	2016-12-26	2017-01-03	新股中签	5.37	5.37	1,874.00	10,063.38	10,063.38	-
603228	景旺电子	2016-12-28	2017-01-06	新股中签	23.16	23.16	2,286.00	52,943.76	52,943.76	-
603266	天龙股份	2016-12-30	2017-01-10	新股中签	14.63	14.63	1,562.00	22,852.06	22,852.06	-
603689	皖天燃气	2016-12-30	2017-01-10	新股中签	7.87	7.87	4,818.00	37,917.66	37,917.66	-
603877	太平鸟	2016-12-29	2017-01-09	新股中签	21.30	21.30	3,180.00	67,734.00	67,734.00	-

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股

上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单 价	数量 (单位：股)	期末 成本总额	期末 估值总额	备注
300123	太阳鸟	2016-09-28	重大资产重组	15.08	2017-02-15	16.59	400,000.00	5,603,476.43	6,032,000.00	-
300473	德尔股份	2016-11-01	重大资产重组	78.12	2017-02-10	71.00	7,000.00	443,336.42	546,840.00	-
603986	兆易创新	2016-09-17	重大资产重组	177.97	2017-03-13	195.77	1,133.00	26,353.58	201,640.01	-

注：本基金截至 2016 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。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至报告期末 2016 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。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至报告期末 2016 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 2016 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 537,436,809.63 元，属于第二层次的余额为 7,242,272.00 元，无属于第三层次的余额(2015 年 12 月 31 日：第一层次 622,138,557.23 元，第二层次 109,452,089.86 元，第三层次 3,182,400.00 元)。

(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

于本期末，本基金未持有公允价值归属于第三层次的金融工具(2015 年 12 月 31 日：3,182,400.00 元)。本基金本期净转入/(转出)第三层次的金额为-4,037,800.00 元，计入损益的第三层次金融工具公允价值变动为 855,400.00 元(2015 年度：净转入第三层次 2,463,500.00 元，计入损益的第三层次金融工具公允价值变动 718,900.00 元，涉及金亚科技)。

上述第三层次资产变动如下：

交易性金融资产

股票投资

2016 年 1 月 1 日 3,182,400.00

购买 -

出售 -

转入第三层次 -

转出第三层次 -4,037,800.00

当期利得或损失总额 -

计入损益的利得或损失 855,400.00

2016 年 12 月 31 日 -

-

2016 年 12 月 31 日仍持有的资产计入 2016 年度损益的未实现利得或损失的变动
——公允价值变动损益

计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

交易性金融资产

股票投资

2015 年 1 月 1 日 -

购买 -

出售 -

转入第三层次 2,463,500.00

转出第三层次 -

当期利得或损失总额 -

计入损益的利得或损失 718,900.00

2015 年 12 月 31 日 3,182,400.00

于 2015 年 12 月 31 日仍持有的第三层次金融资产中计入 2015 年度损益的利得为-2,928,291.91 元。

使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值按照可比公司法确定。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2016 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(2015 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	544,679,081.63	84.45
	其中:股票	544,679,081.63	84.45
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	99,151,672.59	15.37
7	其他各项资产	1,133,687.34	0.18
8	合计	644,964,441.56	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	11,781,000.00	1.86
B	采矿业	18,023,798.50	2.84
C	制造业	390,256,565.36	61.57
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,023,917.66	0.79
E	建筑业	36,369,781.73	5.74
F	批发和零售业	28,596,000.00	4.51
G	交通运输、仓储和邮政业	3,416,110.68	0.54
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	973,627.70	0.15
J	金融业	3,649,780.00	0.58
K	房地产业	557,000.00	0.09
L	租赁和商务服务业	43,500,000.00	6.86
M	科学研究和技术服务业	115,500.00	0.02
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	2,416,000.00	0.38
	合计	544,679,081.63	85.93

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	600093	禾嘉股份	3,000,000	43,500,000.00	6.86

2	600143	金发科技	4,000,000	31,120,000.00	4.91
3	001696	宗申动力	2,400,000	22,560,000.00	3.56
4	600867	通化东宝	1,000,000	21,930,000.00	3.46
5	600998	九州通	1,000,000	20,740,000.00	3.27
6	300121	阳谷华泰	1,060,000	19,323,800.00	3.05
7	300129	泰胜风能	2,200,000	19,250,000.00	3.04
8	002564	天沃科技	1,900,000	19,000,000.00	3.00
9	300285	国瓷材料	440,000	17,208,400.00	2.71
10	002371	七星电子	550,069	14,631,835.40	2.31

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	002048	宁波华翔	64,153,568.45	7.46
2	600104	上汽集团	49,258,147.64	5.72
3	600028	中国石化	39,231,342.00	4.56
4	601933	永辉超市	37,419,899.92	4.35
5	000848	承德露露	37,284,104.91	4.33
6	601668	中国建筑	34,033,365.00	3.96
7	300121	阳谷华泰	31,647,003.54	3.68
8	300183	东软载波	31,044,003.26	3.61
9	600867	通化东宝	29,754,502.92	3.46
10	600143	金发科技	29,596,735.15	3.44
11	002366	台海核电	28,759,300.16	3.34
12	600525	长园集团	28,360,049.44	3.30
13	601633	长城汽车	28,175,948.46	3.27
14	000423	东阿阿胶	27,984,811.86	3.25
15	600751	天海投资	26,711,393.74	3.10
16	300285	国瓷材料	26,587,374.03	3.09
17	600093	禾嘉股份	26,287,377.42	3.06
18	002321	华英农业	26,152,357.52	3.04
19	600418	江淮汽车	26,087,945.78	3.03
20	001696	宗申动力	26,087,220.07	3.03
21	600489	中金黄金	26,000,323.88	3.02
22	600998	九州通	25,642,893.21	2.98
23	600219	南山铝业	24,410,299.39	2.84
24	600477	杭萧钢构	23,876,248.54	2.77
25	600297	广汇汽车	23,336,426.33	2.71

26	600198	大唐电信	22,504,040.80	2.62
27	000333	美的集团	22,321,443.12	2.59
28	002155	湖南黄金	22,033,748.87	2.56
29	300100	双林股份	21,568,453.00	2.51
30	002450	康得新	21,362,205.45	2.48
31	000886	海南高速	20,975,139.69	2.44
32	000403	ST 生化	20,899,912.76	2.43
33	002070	众和股份	20,819,648.42	2.42
34	300129	泰胜风能	20,674,028.03	2.40
35	002013	中航机电	20,300,478.62	2.36
36	300159	新研股份	20,101,351.48	2.34
37	600535	天士力	20,011,007.63	2.33
38	000550	江铃汽车	19,612,039.05	2.28
39	002564	天沃科技	19,578,490.00	2.28
40	600585	海螺水泥	19,212,273.68	2.23
41	002120	韵达股份	18,978,055.06	2.21
42	001979	招商蛇口	18,924,243.56	2.20
43	000697	炼石有色	18,805,887.00	2.19
44	601998	中信银行	18,798,980.55	2.18
45	002371	北方华创	18,598,101.01	2.16
46	002375	亚厦股份	18,221,229.74	2.12
47	600967	北方创业	17,500,297.21	2.03
48	600303	曙光股份	17,468,996.49	2.03
49	600067	冠城大通	17,233,872.18	2.00

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	002048	宁波华翔	51,680,546.77	6.01
2	600104	上汽集团	50,213,473.49	5.84
3	002450	康得新	39,144,639.81	4.55
4	600028	中国石化	38,785,539.95	4.51
5	600525	长园集团	38,099,718.14	4.43
6	300183	东软载波	35,813,739.43	4.16
7	601333	广深铁路	34,981,580.00	4.07
8	002152	广电运通	34,717,079.08	4.03
9	002159	三特索道	34,448,569.00	4.00
10	000034	神州数码	34,364,553.18	3.99

11	601933	永辉超市	31,754,178.81	3.69
12	002369	卓翼科技	30,679,063.28	3.57
13	002701	奥瑞金	30,107,636.35	3.50
14	000423	东阿阿胶	29,950,292.04	3.48
15	601633	长城汽车	29,615,684.41	3.44
16	601668	中国建筑	29,542,614.04	3.43
17	600751	天海投资	28,598,583.16	3.32
18	002070	众和股份	27,555,228.47	3.20
19	600418	江淮汽车	27,366,890.16	3.18
20	600483	福能股份	26,933,478.47	3.13
21	600198	大唐电信	25,712,686.50	2.99
22	600297	广汇汽车	24,792,057.29	2.88
23	600219	南山铝业	24,590,519.50	2.86
24	000848	承德露露	24,501,815.09	2.85
25	000403	ST 生化	24,391,807.62	2.83
26	600303	曙光股份	23,939,687.56	2.78
27	300336	新文化	23,925,671.95	2.78
28	600083	博信股份	23,394,575.06	2.72
29	002120	韵达股份	22,690,086.52	2.64
30	002456	欧菲光	22,502,573.78	2.62
31	300100	双林股份	22,182,465.92	2.58
32	600535	天士力	21,981,057.58	2.55
33	002366	台海核电	21,823,938.45	2.54
34	000886	海南高速	21,577,573.82	2.51
35	000567	海德股份	21,533,917.66	2.50
36	000333	美的集团	21,365,972.07	2.48
37	002594	比亚迪	21,071,845.60	2.45
38	002510	天汽模	20,837,746.47	2.42
39	002013	中航机电	20,453,723.84	2.38
40	601998	中信银行	19,984,883.87	2.32
41	600967	北方创业	19,979,966.70	2.32
42	000550	江铃汽车	19,906,828.15	2.31
43	600585	海螺水泥	19,075,269.00	2.22
44	002693	双成药业	18,873,557.34	2.19
45	001979	招商蛇口	18,730,403.17	2.18
46	600489	中金黄金	18,673,752.84	2.17
47	000697	炼石有色	18,407,653.89	2.14
48	300240	飞力达	17,397,841.00	2.02
49	300159	新研股份	17,221,705.59	2.00

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	2,835,853,792.00
卖出股票的收入（成交）总额	2,944,243,646.00

注：本项“买入股票的成本（成交）总额”和“卖出股票的收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券投资。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

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	500,480.31
2	应收证券清算款	560,719.59
3	应收股利	-
4	应收利息	48,442.83
5	应收申购款	24,044.61
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,133,687.34

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
2,889	153,399.88	19,370,581.09	4.37%	423,801,680.60	95.63%

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	101.89	0.00%

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

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2014 年 5 月 12 日)基金份额总额	3,000,000,000.00
本报告期期初基金份额总额	576,856,554.69
本报告期基金总申购份额	8,203,835.90
减：本报告期基金总赎回份额	141,888,128.90
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	443,172,261.69

§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：

2016 年 9 月 21 日，基金管理人发布了华安安顺灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告，翁启森先生不再担任本基金的基金经理，谢振东先生继续管理本基金。

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：

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为基金审计的会计师事务所。

报告年度支付给聘任会计师事务所的报酬情况：64000.00 元。

目前的审计机构已提供审计服务的连续年限：自基金合同生效日起至今。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内无管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

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	
国泰君安	2	-	-	-	-	-
南方证券	2	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	3	2,216,082,655.57	38.38%	2,063,840.99	38.44%	-
中金公司	2	725,745,919.23	12.57%	675,885.41	12.59%	-
高华证券	2	630,076,298.10	10.91%	586,789.68	10.93%	-
中信建投	3	626,160,357.50	10.84%	583,143.80	10.86%	-
申万宏源	2	583,068,436.43	10.10%	534,670.62	9.96%	-
中信证券	3	525,272,332.30	9.10%	489,185.88	9.11%	-
海通证券	1	441,073,288.14	7.64%	410,770.32	7.65%	-
招商证券	3	26,522,601.64	0.46%	24,700.53	0.46%	-

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、报告期内基金租用券商交易单元的变更情况：

无。

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

东方证券	44,125,062.53	99.04%	-	-	-	-
中信建投	429,673.93	0.96%	-	-	-	-

§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

二〇一七年三月二十八日