

**华安安信消费服务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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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       | 华安安信消费混合         |
| 基金主代码      | 519002           |
| 交易代码       | 519002           |
| 基金运作方式     | 契约型开放式           |
| 基金合同生效日    | 2013 年 5 月 23 日  |
| 基金管理人      | 华安基金管理有限公司       |
| 基金托管人      | 中国工商银行股份有限公司     |
| 报告期末基金份额总额 | 346,753,468.87 份 |
| 基金合同存续期    | 不定期              |

### 2.2 基金产品说明

|        |                                                                   |
|--------|-------------------------------------------------------------------|
| 投资目标   | 本基金重点投资于消费服务相关的子行业或企业，在严格控制风险的前提下，力争把握标的行业投资机会、实现基金资产的长期稳健增值。     |
| 投资策略   | 本基金采用自上而下和自下而上相结合的方法，通过对消费服务相关子行业的精选以及对行业内相关股票的深入分析，挖掘该类型企业的投资价值。 |
| 业绩比较基准 | 中证消费服务领先指数收益率                                                     |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金，基金的风险与预期收益高于债券型基金和货币市场基金、低于股票型基金，属于证券投资基金中的中高风险投资品种。    |

### 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目          |      | 基金管理人                 | 基金托管人               |
|-------------|------|-----------------------|---------------------|
| 名称          |      | 华安基金管理有限公司            | 中国工商银行股份有限公司        |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名   | 钱鲲                    | 郭明                  |
|             | 联系电话 | 021-38969999          | 010-66105799        |
|             | 电子邮箱 | qiankun@huanan.com.cn | custody@icbc.com.cn |
| 客户服务电话      |      | 4008850099            | 95588               |

|    |              |              |
|----|--------------|--------------|
| 传真 | 021-68863414 | 010-66105798 |
|----|--------------|--------------|

## 2.4 信息披露方式

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

## §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 2016 年         | 2015 年         | 2014 年         |
|---------------|----------------|----------------|----------------|
| 本期已实现收益       | 31,212,046.19  | 337,970,634.83 | 72,841,997.75  |
| 本期利润          | -18,302,995.80 | 297,829,791.34 | 17,199,109.32  |
| 加权平均基金份额本期利润  | -0.0603        | 0.8597         | 0.0222         |
| 本期基金份额净值增长率   | -2.69%         | 62.96%         | 4.69%          |
| 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  | 0.6440         | 0.6882         | 0.0427         |
| 期末基金资产净值      | 564,299,395.06 | 452,703,097.19 | 576,524,611.88 |
| 期末基金份额净值      | 1.627          | 1.672          | 1.026          |

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，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

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

4.本基金已于 2013 年 6 月 24 日对原安信证券投资基金退市时的基金份额进行了折算，基金折算比例为 1:1.016880461。

### 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      | -2.57%   | 0.90%       | 0.58%      | 0.66%         | -3.15% | 0.24% |
| 过去六个月      | 1.24%    | 0.88%       | 2.07%      | 0.75%         | -0.83% | 0.13% |
| 过去一年       | -2.69%   | 2.06%       | -11.85%    | 1.41%         | 9.16%  | 0.65% |
| 过去三年       | 66.02%   | 2.25%       | 33.38%     | 1.72%         | 32.64% | 0.53% |
| 自基金合同生效起至今 | 58.02%   | 2.10%       | 36.06%     | 1.66%         | 21.96% | 0.44% |

注：本基金业绩比较基准：中证消费服务领先指数收益率

根据本基金合同的有关规定：本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的 A 股股票等权益类证券（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票、权证等）、债券（包括中小企业私募债券等）、货币市场工具、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。

本基金的股票资产投资比例为基金资产的 60%-95%，其中，投资于消费服务相关的股票的比例不低于股票资产的 80%，权证的投资比例不超过基金资产净值的 3%。现金、债券资产及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产比例为 5%—40%，其中，持有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%。

### 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

华安安信消费服务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

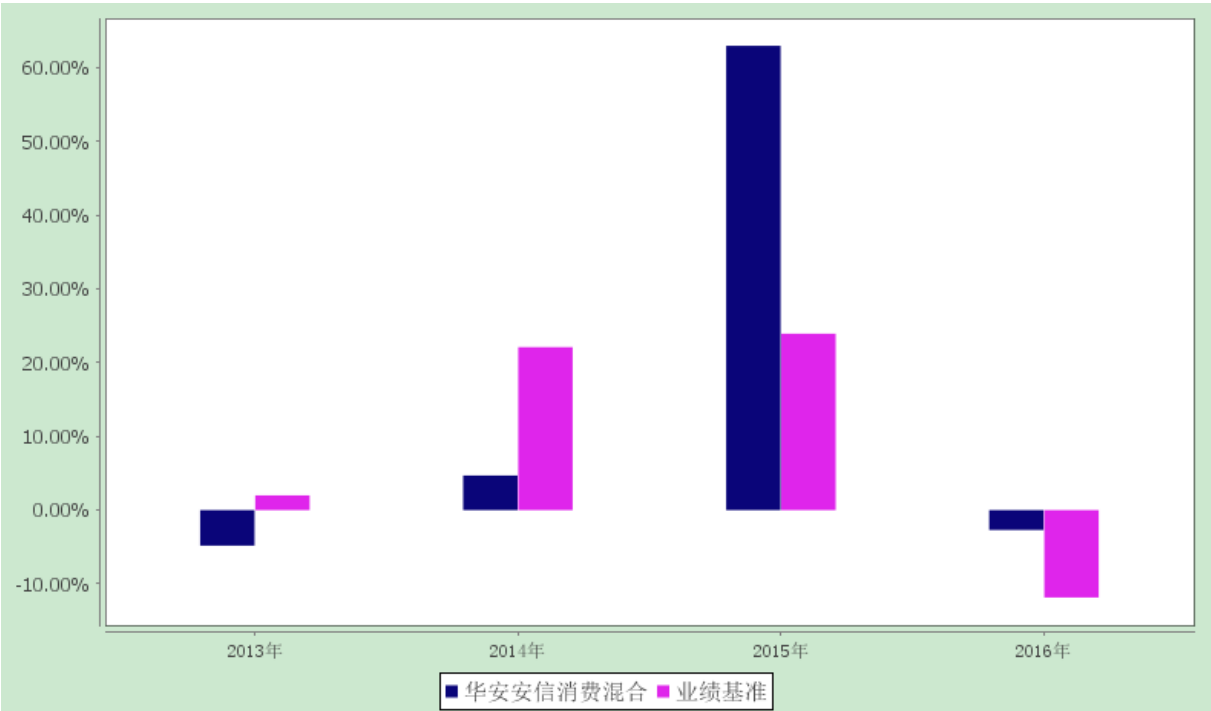
(2013 年 5 月 23 日至 2016 年 12 月 31 日)



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

华安安信消费服务混合型证券投资基金

自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



注：合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

无。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

华安基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1998]20 号文批准于 1998 年 6 月设立，是国内首批基金管理公司之一，注册资本 1.5 亿元人民币，公司总部设在上海陆家嘴金融贸易区。目前的股东为上海电气（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       |        |                                                                                                                                                                                                                         |
| 蒋  璆 | 本基金的基金经理 | 2015-06-16      | 2016-09-21 | 9 年    | 硕士，9 年从业经历。曾任国泰君安证券有限公司研究员、华宝兴业基金管理有限公司研究员。2011 年 6 月加入华安基金管理有限公司，担任投资研究部行业分析师、基金经理助理。2015 年 6 月至 2016 年 9 月担任本基金、华安升级主题混合型证券投资基金的基金经理的基金经理；2015 年 6 月起担任华安动态灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2015 年 11 月起，同时担任华安新乐享保本混合型证券投资基金的基金经理。 |
| 饶晓鹏  | 本基金的基金经理 | 2015-09-07      | -          | 9 年    | 硕士，9 年基金行业从业经验，曾任银河基金管理有限公司研究员、国联安基金基金经理。2015 年 5 月加入华安基金管理有限公司，2015 年 9 月起同时担任本基金及华安升级主题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遵规守信情况的说明

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

2016 年市场整体呈现震荡的格局。除 1-2 月市场经历大幅下跌外, 其余时间市场处于震荡上涨中, 但个股涨跌分化加剧。市场主流投资逻辑更加注重企业质地、盈利增长和估值水平。结构性机会看, 食品饮料、银行、家电表现较强, 军工、计算机、传媒等跌幅靠前。不少盈利增长逻辑驱动个股表现创历史新高。

华安安信消费服务 2016 年收益率-2.69%, 同期上证指数-12.31%, 创业板指数-27.71%。组合在市场波动中始终保持积极的风格。主要超额收益来自个股选择。我们重点家电、生活用纸等行业获得了较好的收益。

### 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 1.627 元, 本报告期份额净值增长率为-2.69%, 同期业绩比较基准增长率为-11.85%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2017 年, 经济增长和通胀应该仍在管理层的目标区间内。2016 年底的中央经济工作会议对 2017 年宏观有较强的指导意义。货币政策稳健中性、流动性基本稳定。继续推动供给侧改革为主线、适度扩大总需求、“三降一去一补”及农业供给侧改革、振兴实体经济。此外, 中央把防控金融风险放在更加重要的位置, 下决心处置一批风险点、防控资产泡沫、确保不发生系统性金融风险。

经济基本面方面，随着地产政策收紧，地产产业链景气高度或将调整。

从周期复苏的角度，各项数据均显示经济处于复苏的过程，但并非每个行业都呈现需求大幅扩张，供给侧收缩和大宗商品的推动使得部分行业呈现较高的景气度，这些特征使得本轮复苏不同于 06-07 年，09-10 年复苏周期。基本面景气度的分化使得市场结构性机会分化加剧。从成长的角度，人口结构、消费习惯迁移等消费升级的驱动因素仍将继续推动细分行业成长。创新驱动下仍有不少公司或细分行业处于高成长期。华安安信消费服务仍将深入挖掘消费升级过程中的高成长细分行业和公司，兼顾传统细分行业业绩回升的投资机会，关注部分事件驱动的主题投资机会，争取为投资者创造良好的回报。

#### 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 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

## §5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对华安安信消费服务混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，华安安信消费服务混合型证券投资基金的管理人——华安基金管理有限公司在华安安信消费服务混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，华安安信消费服务混合型证券投资基金未进行利润分配。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对华安基金管理有限公司编制和披露的华安安信消费服务混合型证券投资基金 2016 年年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## §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 20224 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：华安安信消费服务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<br>2016 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2015 年 12 月 31 日 |
|----|-------------------------|--------------------------|
|----|-------------------------|--------------------------|

|                 |                                 |                                  |
|-----------------|---------------------------------|----------------------------------|
| 资 产:            | -                               | -                                |
| 银行存款            | 49,800,148.83                   | 35,839,216.12                    |
| 结算备付金           | 5,673,311.30                    | 5,084,436.57                     |
| 存出保证金           | 478,386.98                      | 666,906.53                       |
| 交易性金融资产         | 514,747,591.49                  | 414,634,275.95                   |
| 其中: 股票投资        | 514,747,591.49                  | 414,634,275.95                   |
| 基金投资            | -                               | -                                |
| 债券投资            | -                               | -                                |
| 资产支持证券投资        | -                               | -                                |
| 贵金属投资           | -                               | -                                |
| 衍生金融资产          | -                               | -                                |
| 买入返售金融资产        | -                               | -                                |
| 应收证券清算款         | 68,941.66                       | 3,504,071.50                     |
| 应收利息            | 13,227.31                       | 9,103.67                         |
| 应收股利            | -                               | -                                |
| 应收申购款           | 6,644.48                        | 52,643.98                        |
| 递延所得税资产         | -                               | -                                |
| 其他资产            | -                               | -                                |
| <b>资产总计</b>     | <b>570,788,252.05</b>           | <b>459,790,654.32</b>            |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>本期末<br/>2016 年 12 月 31 日</b> | <b>上年度末<br/>2015 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         | -                               | 1,321,214.17                     |
| 应付赎回款           | 915,081.08                      | 444,602.20                       |
| 应付管理人报酬         | 779,305.38                      | 556,494.80                       |

|                   |                       |                       |
|-------------------|-----------------------|-----------------------|
| 应付托管费             | 129,884.22            | 92,749.14             |
| 应付销售服务费           | -                     | -                     |
| 应付交易费用            | 2,417,155.36          | 2,446,278.94          |
| 应交税费              | -                     | -                     |
| 应付利息              | -                     | -                     |
| 应付利润              | -                     | -                     |
| 递延所得税负债           | -                     | -                     |
| 其他负债              | 2,247,430.95          | 2,226,217.88          |
| <b>负债合计</b>       | <b>6,488,856.99</b>   | <b>7,087,557.13</b>   |
| <b>所有者权益：</b>     | <b>-</b>              | <b>-</b>              |
| 实收基金              | 341,000,491.48        | 266,330,425.55        |
| 未分配利润             | 223,298,903.58        | 186,372,671.64        |
| <b>所有者权益合计</b>    | <b>564,299,395.06</b> | <b>452,703,097.19</b> |
| <b>负债和所有者权益总计</b> | <b>570,788,252.05</b> | <b>459,790,654.32</b> |

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.627 元，基金份额总额 346,753,468.87 份。

## 7.2 利润表

会计主体：华安安信消费服务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<br>2016 年 1 月 1 日至 2016<br>年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2015 年 1 月 1 日至 2015 年<br>12 月 31 日 |
|-------------|-------------------------------------------|------------------------------------------------|
| <b>一、收入</b> | <b>7,554,861.20</b>                       | <b>317,503,377.07</b>                          |
| 1.利息收入      | 453,034.12                                | 542,609.17                                     |
| 其中：存款利息收入   | 451,896.39                                | 292,889.58                                     |
| 债券利息收入      | 1,137.73                                  | 249,719.59                                     |
| 资产支持证券利息收入  | -                                         | -                                              |
| 买入返售金融资产收入  | -                                         | -                                              |
| 其他利息收入      | -                                         | -                                              |

|                            |                       |                       |
|----------------------------|-----------------------|-----------------------|
| 2.投资收益（损失以“-”填列）           | 56,430,186.89         | 356,781,762.71        |
| 其中：股票投资收益                  | 54,484,984.88         | 355,594,434.15        |
| 基金投资收益                     | -                     | -                     |
| 债券投资收益                     | 533,574.27            | 62,404.80             |
| 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                       | 1,411,627.74          | 1,124,923.76          |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）      | -49,515,041.99        | -40,140,843.49        |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）          | -                     | -                     |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）          | 186,682.18            | 319,848.68            |
| <b>减：二、费用</b>              | <b>25,857,857.00</b>  | <b>19,673,585.73</b>  |
| 1. 管理人报酬                   | 7,034,137.36          | 7,470,313.09          |
| 2. 托管费                     | 1,172,356.21          | 1,245,052.13          |
| 3. 销售服务费                   | -                     | -                     |
| 4. 交易费用                    | 17,257,428.79         | 10,585,330.63         |
| 5. 利息支出                    | -                     | -                     |
| 其中：卖出回购金融资产支出              | -                     | -                     |
| 6. 其他费用                    | 393,934.64            | 372,889.88            |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> | <b>-18,302,995.80</b> | <b>297,829,791.34</b> |
| 减：所得税费用                    | -                     | -                     |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   | <b>-18,302,995.80</b> | <b>297,829,791.34</b> |

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安安信消费服务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）                        | 266,330,425.55                   | 186,372,671.64  | 452,703,097.19  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                                | -18,302,995.80  | -18,302,995.80  |
| 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）      | 74,670,065.93                    | 55,229,227.74   | 129,899,293.67  |
| 其中：1.基金申购款                             | 185,043,130.95                   | 130,037,287.92  | 315,080,418.87  |
| 2.基金赎回款                                | -110,373,065.02                  | -74,808,060.18  | -185,181,125.20 |
| 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）                        | 341,000,491.48                   | 223,298,903.58  | 564,299,395.06  |
| 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）                        | 552,525,426.40                   | 23,999,185.48   | 576,524,611.88  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                                | 297,829,791.34  | 297,829,791.34  |
| 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）      | -286,195,000.85                  | -135,456,305.18 | -421,651,306.03 |

|                                        |                 |                 |                 |
|----------------------------------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| 其中：1.基金申购款                             | 45,595,878.09   | 23,387,149.58   | 68,983,027.67   |
| 2.基金赎回款                                | -331,790,878.94 | -158,843,454.76 | -490,634,333.70 |
| 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）                        | 266,330,425.55  | 186,372,671.64  | 452,703,097.19  |

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

华安安信消费服务混合型证券投资基金(原名为华安安信消费服务股票型证券投资基金，以下简称“本基金”)由安信证券投资基金(以下简称“基金安信”)转型而成。依据中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2013]590 号核准的《安信证券投资基金基金份额持有人大会有关转换基金运作方式决议》，基金安信由封闭式基金转为开放式基金。原基金安信为契约式封闭式基金，存续期限至 2013 年 5 月 22 日止。根据上交所上证基字[2013]120 号《关于终止安信证券投资基金上市的决定》，自 2013 年 5 月 23 日起，原基金安信终止上市，原基金安信更名为华安安信消费服务股票型证券投资基金(以下简称“安信消费服务股票基金”)。《安信证券投资基金基金合同》失效的同时《华安安信消费服务股票型证券投资基金基金合同》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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

原基金安信于基金合同失效前经审计的基金资产净值为 2,085,987,601.95 元，已于安信消费服务股票基金的基金合同生效日全部转为安信消费服务股票基金的基金资产净值。根据《华安安信消费服务股票型证券投资基金招募说明书》和《关于原安信证券投资基金基金份额拆分结果的公告》的有关规定，安信消费服务股票基金于 2013 年 6 月 24 日进行了基金份额拆分，拆分比例为 1:1.016880461，并于 2013 年 6 月 25 日进行了变更登记。

安信消费服务股票基金自 2013 年 5 月 29 日至 2013 年 6 月 19 日期间内开放集中申购，共募集集中申购资金 911,286,695.29 元，其中包括折合为基金份额的集中申购资金利息 459,327.86 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2013)第 358 号审验报告予以验证。上述集中申购募集资金已按 2013 年 6 月 24 日基金份额折算后的基金份额净值 1.000 元折合为 911,286,695.29 份基金份额，其中包括集中申购资金利息折合的 459,327.86 份基金份额，并于 2013 年 6 月 25 日进行了确认登记。

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安安信消费服务混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的 A 股股票等权益类证券(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票、权证等)、债券(包括中小企业私募债券等)、货币市场工具、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。本基金的股票资产投资比例为基金资产的 60%-95%，其中，投资于消费服务相关的股票的比例不低于股票资产的 80%，权证的投资比例不超过基金资产净值的 3%。现金、债券资产及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产比例为 5%-40%，其中，持有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%。本基金的业绩比较基准为：中证消费服务领先指数收益率。

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》、《华安安信消费服务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 |
| 中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”) | 基金托管人、基金销售机构 |
| 上海国际信托有限公司(“上海国际信托”)   | 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 债券交易

无。

##### 7.4.8.1.4 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>2016年1月1日至2016年12<br>月31日 | 上年度可比期间<br>2015年1月1日至2015年12<br>月31日 |
|-----------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 7,034,137.36                    | 7,470,313.09                         |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 202,340.55                      | 140,376.03                           |

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>2016年1月1日至2016年12<br>月31日 | 上年度可比期间<br>2015年1月1日至2015年12<br>月31日 |
|----------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 1,172,356.21                    | 1,245,052.13                         |

注：支付基金托管人 中国工商银行 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 | 上年度可比期间 |
|----|----|---------|
|----|----|---------|

|                       | 2016年1月1日至2016年12月31<br>日 | 2015年1月1日至2015年12月31<br>日 |
|-----------------------|---------------------------|---------------------------|
| 期初持有的基金份额             | -                         | 29,020,212.00             |
| 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          | -                         | 29,020,212.00             |
| 期末持有的基金份额             | -                         | -                         |
| 期末持有的基金份额占基金总<br>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<br>份额占基金<br>总份额的比<br>例 | 持有的基金份额               | 持有的基金份<br>额占基金总份<br>额的比例 |
| 上海国际信托有<br>限公司 | 18,303,848.00        | 5.28%                        | 18,303,848.00         | 6.76%                    |

#### 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<br>2016年1月1日至2016年12月31日 |            | 上年度可比期间<br>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     |
| 中国工商银行 | 49,800,148.83               | 361,182.95 | 35,839,216.12                    | 246,388.02 |

注：本基金的银行存款由基金托管人 中国工商银行 保管，按银行同业利率计息。

#### 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 | 网下中签   | 15.28 | 15.28  | 682.00    | 10,420.96  | 10,420.96  | -  |
| 002840              | 华统股份 | 2016-12-29 | 2017-01-10 | 网下中签   | 6.55  | 6.55   | 1,814.00  | 11,881.70  | 11,881.70  | -  |
| 300583              | 赛托生物 | 2016-12-29 | 2017-01-06 | 网下中签   | 40.29 | 40.29  | 1,582.00  | 63,738.78  | 63,738.78  | -  |
| 300586              | 美联新材 | 2016-12-26 | 2017-01-04 | 网下中签   | 9.30  | 9.30   | 1,006.00  | 9,355.80   | 9,355.80   | -  |
| 300587              | 天铁股份 | 2016-12-28 | 2017-01-05 | 网下中签   | 14.11 | 14.11  | 1,438.00  | 20,290.18  | 20,290.18  | -  |
| 300588              | 熙菱信息 | 2016-12-27 | 2017-01-05 | 网下中签   | 4.94  | 4.94   | 1,380.00  | 6,817.20   | 6,817.20   | -  |
| 300591              | 万里马  | 2016-12-30 | 2017-01-10 | 网下中签   | 3.07  | 3.07   | 2,397.00  | 7,358.79   | 7,358.79   | -  |
| 601375              | 中原证券 | 2016-12-20 | 2017-01-03 | 网下中签   | 4.00  | 4.00   | 26,695.00 | 106,780.00 | 106,780.00 | -  |
| 603032              | 德新交运 | 2016-12-27 | 2017-01-05 | 网下中签   | 5.81  | 5.81   | 1,628.00  | 9,458.68   | 9,458.68   | -  |
| 603035              | 常熟汽饰 | 2016-12-27 | 2017-01-05 | 网下中签   | 10.44 | 10.44  | 2,316.00  | 24,179.04  | 24,179.04  | -  |
| 603186              | 华正新材 | 2016-12-26 | 2017-01-03 | 网下中签   | 5.37  | 5.37   | 1,874.00  | 10,063.38  | 10,063.38  | -  |
| 603228              | 景旺电子 | 2016-12-28 | 2017-01-06 | 网下中签   | 23.16 | 23.16  | 2,286.00  | 52,943.76  | 52,943.76  | -  |
| 603266              | 天龙股份 | 2016-12-30 | 2017-01-10 | 网下中签   | 14.63 | 14.63  | 1,562.00  | 22,852.06  | 22,852.06  | -  |
| 603689              | 皖天然气 | 2016-12-30 | 2017-01-10 | 网下中签   | 7.87  | 7.87   | 4,818.00  | 37,917.66  | 37,917.66  | -  |
| 603877              | 太平鸟  | 2016-12-29 | 2017-01-09 | 网下中签   | 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<br>代码 | 股票<br>名称 | 停牌<br>日期       | 停牌<br>原因   | 期末估值<br>单价 | 复牌<br>日期       | 复牌开<br>盘单价 | 数量<br>(单位：股) | 期末<br>成本总额   | 期末<br>估值总额   | 备注 |
|----------|----------|----------------|------------|------------|----------------|------------|--------------|--------------|--------------|----|
| 300323   | 华灿光<br>电 | 2016-04-<br>18 | 重大事项<br>停牌 | 8.76       | 2017-01-<br>09 | 8.65       | 456,100.00   | 3,907,192.06 | 3,995,436.00 |    |
| 603986   | 兆易创<br>新 | 2016-09-<br>19 | 重大事项<br>停牌 | 177.97     | 2017-03-<br>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 510,088,723.49 元，属于第二层次的余额为 4,658,868.00 元，无属于第三层次的余额(2015 年 12 月 31 日：第一层次 342,017,242.73 元，第二层次 72,617,033.22 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。

(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 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   | 514,747,591.49 | 90.18         |
|    | 其中：股票  | 514,747,591.49 | 90.18         |
| 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      | 55,473,460.13  | 9.72   |
| 7 | 其他各项资产            | 567,200.43     | 0.10   |
| 8 | 合计                | 570,788,252.05 | 100.00 |

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

| 码 | 行业类别             | 公允价值（元）        | 占基金资产净值比例（%） |
|---|------------------|----------------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业         | -              | -            |
| B | 采矿业              | 11,182,753.58  | 1.98         |
| C | 制造业              | 391,142,059.10 | 69.31        |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 10,244,397.66  | 1.82         |
| E | 建筑业              | 118,924.74     | 0.02         |
| F | 批发和零售业           | 45,255,515.70  | 8.02         |
| G | 交通运输、仓储和邮政业      | 9,458.68       | 0.00         |
| H | 住宿和餐饮业           | -              | -            |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 41,424,952.82  | 7.34         |
| J | 金融业              | 6,170,014.76   | 1.09         |
| K | 房地产业             | 1,044,320.00   | 0.19         |
| L | 租赁和商务服务业         | 8,155,194.45   | 1.45         |
| M | 科学研究和技术服务业       | -              | -            |
| N | 水利、环境和公共设施管理业    | -              | -            |
| O | 居民服务、修理和其他服务业    | -              | -            |
| P | 教育               | -              | -            |
| Q | 卫生和社会工作          | -              | -            |
| R | 文化、体育和娱乐业        | -              | -            |

|   |    |                |       |
|---|----|----------------|-------|
| S | 综合 | -              | -     |
|   | 合计 | 514,747,591.49 | 91.22 |

### 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  | 002468 | 申通快递 | 1,567,092 | 47,357,520.24 | 8.39             |
| 2  | 002120 | 新海股份 | 898,900   | 45,304,560.00 | 8.03             |
| 3  | 002640 | 跨境通  | 2,472,979 | 45,255,515.70 | 8.02             |
| 4  | 600867 | 通化东宝 | 2,038,288 | 44,699,655.84 | 7.92             |
| 5  | 002456 | 欧菲光  | 1,238,091 | 42,441,759.48 | 7.52             |
| 6  | 000661 | 长春高新 | 336,371   | 37,623,096.35 | 6.67             |
| 7  | 002511 | 中顺洁柔 | 1,661,939 | 33,072,586.10 | 5.86             |
| 8  | 603866 | 桃李面包 | 445,861   | 19,573,297.90 | 3.47             |
| 9  | 000980 | 金马股份 | 1,351,589 | 19,503,429.27 | 3.46             |
| 10 | 300287 | 飞利信  | 1,365,946 | 16,254,757.40 | 2.88             |

### 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  | 000750 | 国海证券 | 87,377,300.60 | 19.30                  |
| 2  | 600867 | 通化东宝 | 64,624,179.99 | 14.28                  |
| 3  | 002508 | 老板电器 | 58,061,939.30 | 12.83                  |
| 4  | 002468 | 申通快递 | 57,241,031.85 | 12.64                  |
| 5  | 600521 | 华海药业 | 56,421,986.00 | 12.46                  |
| 6  | 600276 | 恒瑞医药 | 54,570,754.62 | 12.05                  |
| 7  | 002325 | 洪涛股份 | 53,141,084.89 | 11.74                  |
| 8  | 002511 | 中顺洁柔 | 50,794,843.60 | 11.22                  |
| 9  | 600056 | 中国医药 | 50,446,986.01 | 11.14                  |
| 10 | 603866 | 桃李面包 | 48,535,756.26 | 10.72                  |
| 11 | 000728 | 国元证券 | 48,391,770.71 | 10.69                  |
| 12 | 002456 | 欧菲光  | 48,022,153.35 | 10.61                  |
| 13 | 000937 | 冀中能源 | 46,411,957.87 | 10.25                  |
| 14 | 002640 | 跨境通  | 45,969,017.23 | 10.15                  |

|    |        |      |               |      |
|----|--------|------|---------------|------|
| 15 | 300287 | 飞利信  | 43,803,643.66 | 9.68 |
| 16 | 002120 | 韵达股份 | 43,306,525.46 | 9.57 |
| 17 | 000661 | 长春高新 | 42,330,333.90 | 9.35 |
| 18 | 002712 | 思美传媒 | 39,462,498.64 | 8.72 |
| 19 | 601818 | 光大银行 | 38,939,067.00 | 8.60 |
| 20 | 002519 | 银河电子 | 37,479,553.04 | 8.28 |
| 21 | 000915 | 山大华特 | 37,182,087.01 | 8.21 |
| 22 | 300017 | 网宿科技 | 36,172,989.93 | 7.99 |
| 23 | 002445 | 中南文化 | 36,145,695.58 | 7.98 |
| 24 | 002155 | 湖南黄金 | 36,049,558.56 | 7.96 |
| 25 | 000980 | 金马股份 | 35,551,082.27 | 7.85 |
| 26 | 600233 | 圆通速递 | 35,312,260.38 | 7.80 |
| 27 | 601555 | 东吴证券 | 35,241,904.17 | 7.78 |
| 28 | 002643 | 万润股份 | 34,894,741.83 | 7.71 |
| 29 | 002007 | 华兰生物 | 34,393,197.26 | 7.60 |
| 30 | 601169 | 北京银行 | 34,156,581.17 | 7.55 |
| 31 | 300271 | 华宇软件 | 33,635,464.28 | 7.43 |
| 32 | 000810 | 创维数字 | 33,262,409.33 | 7.35 |
| 33 | 002035 | 华帝股份 | 32,577,717.60 | 7.20 |
| 34 | 300088 | 长信科技 | 32,490,073.98 | 7.18 |
| 35 | 000630 | 铜陵有色 | 32,326,487.92 | 7.14 |
| 36 | 002655 | 共达电声 | 32,108,167.50 | 7.09 |
| 37 | 600358 | 国旅联合 | 31,762,680.20 | 7.02 |
| 38 | 000686 | 东北证券 | 31,364,930.77 | 6.93 |
| 39 | 000983 | 西山煤电 | 31,141,131.38 | 6.88 |
| 40 | 000558 | 莱茵体育 | 31,115,725.50 | 6.87 |
| 41 | 300145 | 中金环境 | 30,052,846.27 | 6.64 |
| 42 | 002361 | 神剑股份 | 29,783,467.02 | 6.58 |
| 43 | 300098 | 高新兴  | 29,576,701.33 | 6.53 |
| 44 | 600029 | 南方航空 | 28,981,933.63 | 6.40 |
| 45 | 601333 | 广深铁路 | 28,408,834.74 | 6.28 |
| 46 | 600436 | 片仔癀  | 28,393,785.24 | 6.27 |
| 47 | 002502 | 骅威文化 | 28,159,825.16 | 6.22 |
| 48 | 000401 | 冀东水泥 | 28,081,774.53 | 6.20 |
| 49 | 000021 | 深科技  | 27,900,159.42 | 6.16 |
| 50 | 300326 | 凯利泰  | 27,043,011.93 | 5.97 |
| 51 | 002234 | 民和股份 | 27,021,517.01 | 5.97 |
| 52 | 600547 | 山东黄金 | 26,548,379.56 | 5.86 |
| 53 | 300498 | 温氏股份 | 26,198,182.13 | 5.79 |
| 54 | 002548 | 金新农  | 25,437,544.42 | 5.62 |
| 55 | 000957 | 中通客车 | 25,410,865.20 | 5.61 |
| 56 | 300148 | 天舟文化 | 24,960,292.11 | 5.51 |
| 57 | 600566 | 济川药业 | 24,929,530.91 | 5.51 |
| 58 | 000650 | 仁和药业 | 24,899,756.48 | 5.50 |

|     |        |       |               |      |
|-----|--------|-------|---------------|------|
| 59  | 300379 | 东方通   | 24,759,575.48 | 5.47 |
| 60  | 000603 | 盛达矿业  | 24,749,765.00 | 5.47 |
| 61  | 002648 | 卫星石化  | 24,728,615.54 | 5.46 |
| 62  | 600576 | 万家文化  | 23,873,728.06 | 5.27 |
| 63  | 002408 | 齐翔腾达  | 23,815,151.53 | 5.26 |
| 64  | 002247 | 帝龙文化  | 23,726,239.45 | 5.24 |
| 65  | 600303 | 曙光股份  | 23,008,601.20 | 5.08 |
| 66  | 002036 | 联创电子  | 22,897,492.30 | 5.06 |
| 67  | 300336 | 新文化   | 22,852,553.37 | 5.05 |
| 68  | 000965 | 天保基建  | 22,838,083.52 | 5.04 |
| 69  | 600054 | 黄山旅游  | 22,803,463.69 | 5.04 |
| 70  | 002352 | 鼎泰新材  | 22,468,755.18 | 4.96 |
| 71  | 002452 | 长高集团  | 22,403,936.14 | 4.95 |
| 72  | 601939 | 建设银行  | 22,345,825.50 | 4.94 |
| 73  | 601669 | 中国电建  | 22,246,295.93 | 4.91 |
| 74  | 600198 | 大唐电信  | 21,827,665.44 | 4.82 |
| 75  | 002736 | 国信证券  | 21,781,547.52 | 4.81 |
| 76  | 601699 | 潞安环能  | 21,608,112.00 | 4.77 |
| 77  | 002371 | 七星电子  | 21,446,388.00 | 4.74 |
| 78  | 601166 | 兴业银行  | 21,364,510.00 | 4.72 |
| 79  | 002191 | 劲嘉股份  | 20,928,332.38 | 4.62 |
| 80  | 002077 | 大港股份  | 20,625,904.49 | 4.56 |
| 81  | 603128 | 华贸物流  | 19,724,833.83 | 4.36 |
| 82  | 002439 | 启明星辰  | 19,647,416.26 | 4.34 |
| 83  | 002458 | 益生股份  | 19,563,660.63 | 4.32 |
| 84  | 600211 | 西藏药业  | 19,454,450.94 | 4.30 |
| 85  | 600807 | 天业股份  | 19,378,092.86 | 4.28 |
| 86  | 300310 | 宜通世纪  | 19,374,612.39 | 4.28 |
| 87  | 600826 | 兰生股份  | 19,241,445.52 | 4.25 |
| 88  | 600999 | 招商证券  | 19,188,904.26 | 4.24 |
| 89  | 002368 | 太极股份  | 19,119,809.75 | 4.22 |
| 90  | 002311 | 海大集团  | 19,058,319.24 | 4.21 |
| 91  | 002048 | 宁波华翔  | 19,052,449.16 | 4.21 |
| 92  | 002570 | 贝因美   | 18,850,444.82 | 4.16 |
| 93  | 000655 | 金岭矿业  | 18,485,849.24 | 4.08 |
| 94  | 600066 | 宇通客车  | 18,279,731.77 | 4.04 |
| 95  | 000418 | 小天鹅 A | 18,237,959.56 | 4.03 |
| 96  | 002329 | 皇氏集团  | 18,209,194.30 | 4.02 |
| 97  | 601799 | 星宇股份  | 18,026,610.69 | 3.98 |
| 98  | 000998 | 隆平高科  | 17,540,453.90 | 3.87 |
| 99  | 600114 | 东睦股份  | 17,370,906.88 | 3.84 |
| 100 | 002635 | 安洁科技  | 17,320,312.58 | 3.83 |
| 101 | 601857 | 中国石油  | 17,203,369.00 | 3.80 |
| 102 | 300177 | 中海达   | 17,072,080.02 | 3.77 |

|     |        |        |               |      |
|-----|--------|--------|---------------|------|
| 103 | 002581 | 未名医药   | 17,056,087.73 | 3.77 |
| 104 | 603799 | 华友钴业   | 16,932,375.82 | 3.74 |
| 105 | 002188 | 巴士在线   | 16,825,185.04 | 3.72 |
| 106 | 600519 | 贵州茅台   | 16,822,655.15 | 3.72 |
| 107 | 600348 | 阳泉煤业   | 16,770,078.35 | 3.70 |
| 108 | 601118 | 海南橡胶   | 16,663,605.86 | 3.68 |
| 109 | 000968 | *ST 煤气 | 16,347,142.41 | 3.61 |
| 110 | 600988 | 赤峰黄金   | 16,305,156.00 | 3.60 |
| 111 | 600667 | 太极实业   | 16,224,058.17 | 3.58 |
| 112 | 002673 | 西部证券   | 16,183,969.00 | 3.57 |
| 113 | 002025 | 航天电器   | 15,746,191.06 | 3.48 |
| 114 | 300365 | 恒华科技   | 15,679,959.53 | 3.46 |
| 115 | 601009 | 南京银行   | 15,553,670.47 | 3.44 |
| 116 | 000895 | 双汇发展   | 15,505,644.00 | 3.43 |
| 117 | 002605 | 姚记扑克   | 15,493,897.70 | 3.42 |
| 118 | 600038 | 中直股份   | 15,430,749.24 | 3.41 |
| 119 | 000795 | 英洛华    | 15,389,260.89 | 3.40 |
| 120 | 002078 | 太阳纸业   | 15,299,284.61 | 3.38 |
| 121 | 002094 | 青岛金王   | 15,019,710.21 | 3.32 |
| 122 | 601898 | 中煤能源   | 14,865,385.02 | 3.28 |
| 123 | 601088 | 中国神华   | 14,801,986.98 | 3.27 |
| 124 | 600409 | 三友化工   | 14,794,972.75 | 3.27 |
| 125 | 002372 | 伟星新材   | 14,743,553.96 | 3.26 |
| 126 | 600258 | 首旅酒店   | 14,737,656.08 | 3.26 |
| 127 | 000863 | 三湘印象   | 14,727,134.55 | 3.25 |
| 128 | 600735 | 新华锦    | 14,715,713.83 | 3.25 |
| 129 | 600172 | 黄河旋风   | 14,527,985.80 | 3.21 |
| 130 | 600998 | 九州通    | 14,350,774.69 | 3.17 |
| 131 | 600221 | 海南航空   | 14,320,731.14 | 3.16 |
| 132 | 000948 | 南天信息   | 14,230,994.17 | 3.14 |
| 133 | 002343 | 慈文传媒   | 14,221,779.62 | 3.14 |
| 134 | 300242 | 明家联合   | 13,958,095.00 | 3.08 |
| 135 | 002727 | 一心堂    | 13,951,524.20 | 3.08 |
| 136 | 601288 | 农业银行   | 13,949,268.00 | 3.08 |
| 137 | 000969 | 安泰科技   | 13,830,533.17 | 3.06 |
| 138 | 603589 | 口子窖    | 13,611,834.16 | 3.01 |
| 139 | 000587 | 金洲慈航   | 13,580,803.80 | 3.00 |
| 140 | 300244 | 迪安诊断   | 13,555,694.68 | 2.99 |
| 141 | 300353 | 东土科技   | 13,392,004.45 | 2.96 |
| 142 | 002056 | 横店东磁   | 13,376,039.62 | 2.95 |
| 143 | 000933 | *ST 神火 | 13,268,774.75 | 2.93 |
| 144 | 601788 | 光大证券   | 13,221,874.08 | 2.92 |
| 145 | 300014 | 亿纬锂能   | 13,172,842.39 | 2.91 |
| 146 | 600376 | 首开股份   | 13,082,658.56 | 2.89 |

|     |        |      |               |      |
|-----|--------|------|---------------|------|
| 147 | 600061 | 国投安信 | 13,080,553.26 | 2.89 |
| 148 | 002364 | 中恒电气 | 12,864,930.59 | 2.84 |
| 149 | 002709 | 天赐材料 | 12,690,306.94 | 2.80 |
| 150 | 600990 | 四创电子 | 12,539,456.82 | 2.77 |
| 151 | 002340 | 格林美  | 12,538,245.37 | 2.77 |
| 152 | 300097 | 智云股份 | 12,469,112.60 | 2.75 |
| 153 | 002510 | 天汽模  | 12,453,706.76 | 2.75 |
| 154 | 002466 | 天齐锂业 | 12,373,941.80 | 2.73 |
| 155 | 600879 | 航天电子 | 12,345,615.10 | 2.73 |
| 156 | 300202 | 聚龙股份 | 12,260,314.15 | 2.71 |
| 157 | 000596 | 古井贡酒 | 12,144,360.29 | 2.68 |
| 158 | 600150 | 中国船舶 | 12,136,011.06 | 2.68 |
| 159 | 603067 | 振华股份 | 12,111,082.78 | 2.68 |
| 160 | 600489 | 中金黄金 | 12,057,578.74 | 2.66 |
| 161 | 300025 | 华星创业 | 12,051,759.35 | 2.66 |
| 162 | 002714 | 牧原股份 | 12,049,163.00 | 2.66 |
| 163 | 002099 | 海翔药业 | 12,015,025.72 | 2.65 |
| 164 | 600485 | 信威集团 | 11,967,369.00 | 2.64 |
| 165 | 600497 | 驰宏锌锗 | 11,944,207.94 | 2.64 |
| 166 | 300041 | 回天新材 | 11,871,222.78 | 2.62 |
| 167 | 600015 | 华夏银行 | 11,867,631.93 | 2.62 |
| 168 | 002369 | 卓翼科技 | 11,840,345.00 | 2.62 |
| 169 | 600705 | 中航资本 | 11,822,888.00 | 2.61 |
| 170 | 600273 | 嘉化能源 | 11,807,026.41 | 2.61 |
| 171 | 300010 | 立思辰  | 11,743,028.50 | 2.59 |
| 172 | 002726 | 龙大肉食 | 11,695,302.20 | 2.58 |
| 173 | 600089 | 特变电工 | 11,638,496.49 | 2.57 |
| 174 | 002533 | 金杯电工 | 11,619,324.37 | 2.57 |
| 175 | 300297 | 蓝盾股份 | 11,603,670.26 | 2.56 |
| 176 | 600711 | 盛屯矿业 | 11,533,034.60 | 2.55 |
| 177 | 600589 | 广东榕泰 | 11,359,546.44 | 2.51 |
| 178 | 002127 | 南极电商 | 11,340,495.58 | 2.51 |
| 179 | 000639 | 西王食品 | 11,312,411.11 | 2.50 |
| 180 | 300278 | 华昌达  | 11,300,005.81 | 2.50 |
| 181 | 300358 | 楚天科技 | 11,245,460.42 | 2.48 |
| 182 | 300342 | 天银机电 | 11,070,116.00 | 2.45 |
| 183 | 000722 | 湖南发展 | 11,052,986.59 | 2.44 |
| 184 | 300369 | 绿盟科技 | 11,025,523.49 | 2.44 |
| 185 | 600340 | 华夏幸福 | 10,987,542.80 | 2.43 |
| 186 | 600797 | 浙大网新 | 10,944,623.92 | 2.42 |
| 187 | 601233 | 桐昆股份 | 10,933,925.68 | 2.42 |
| 188 | 300348 | 长亮科技 | 10,930,485.48 | 2.41 |
| 189 | 601789 | 宁波建工 | 10,837,712.06 | 2.39 |
| 190 | 600756 | 浪潮软件 | 10,759,082.06 | 2.38 |



|     |        |       |               |      |
|-----|--------|-------|---------------|------|
| 191 | 002268 | 卫 士 通 | 10,725,854.00 | 2.37 |
| 192 | 300166 | 东方国信  | 10,688,813.10 | 2.36 |
| 193 | 600027 | 华电国际  | 10,648,953.52 | 2.35 |
| 194 | 600406 | 国电南瑞  | 10,597,834.50 | 2.34 |
| 195 | 300263 | 隆华节能  | 10,575,433.49 | 2.34 |
| 196 | 600343 | 航天动力  | 10,514,507.00 | 2.32 |
| 197 | 000890 | 法 尔 胜 | 10,394,654.24 | 2.30 |
| 198 | 601069 | 西部黄金  | 10,311,287.60 | 2.28 |
| 199 | 000404 | 华意压缩  | 10,281,064.99 | 2.27 |
| 200 | 002574 | 明牌珠宝  | 10,238,966.00 | 2.26 |
| 201 | 300468 | 四方精创  | 10,221,561.60 | 2.26 |
| 202 | 601997 | 贵阳银行  | 10,215,586.81 | 2.26 |
| 203 | 000065 | 北方国际  | 10,209,053.60 | 2.26 |
| 204 | 600730 | 中国高科  | 10,067,906.30 | 2.22 |
| 205 | 002537 | 海立美达  | 10,006,573.05 | 2.21 |
| 206 | 600170 | 上海建工  | 9,960,052.60  | 2.20 |
| 207 | 601186 | 中国铁建  | 9,938,724.00  | 2.20 |
| 208 | 600856 | 中天能源  | 9,851,213.80  | 2.18 |
| 209 | 600048 | 保利地产  | 9,801,186.00  | 2.17 |
| 210 | 603658 | 安图生物  | 9,768,180.11  | 2.16 |
| 211 | 600563 | 法拉电子  | 9,758,006.16  | 2.16 |
| 212 | 300031 | 宝通科技  | 9,751,386.22  | 2.15 |
| 213 | 000876 | 新 希 望 | 9,740,018.87  | 2.15 |
| 214 | 300116 | 坚瑞沃能  | 9,723,691.00  | 2.15 |
| 215 | 000423 | 东阿阿胶  | 9,644,716.14  | 2.13 |
| 216 | 002604 | 龙力生物  | 9,450,636.14  | 2.09 |
| 217 | 002338 | 奥普光电  | 9,391,222.40  | 2.07 |
| 218 | 600891 | 秋林集团  | 9,356,180.00  | 2.07 |
| 219 | 002070 | 众和股份  | 9,197,010.83  | 2.03 |
| 220 | 600678 | 四川金顶  | 9,196,305.62  | 2.03 |
| 221 | 002169 | 智光电气  | 9,091,540.30  | 2.01 |
| 222 | 600074 | 保千里   | 9,071,624.96  | 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<br>(%) |
|----|--------|------|---------------|--------------------|
| 1  | 000750 | 国海证券 | 88,938,756.16 | 19.65              |
| 2  | 002508 | 老板电器 | 61,406,530.94 | 13.56              |

|    |        |      |               |       |
|----|--------|------|---------------|-------|
| 3  | 600521 | 华海药业 | 58,693,137.23 | 12.97 |
| 4  | 002325 | 洪涛股份 | 54,888,610.77 | 12.12 |
| 5  | 300098 | 高新兴  | 53,811,234.47 | 11.89 |
| 6  | 600276 | 恒瑞医药 | 52,601,040.29 | 11.62 |
| 7  | 600056 | 中国医药 | 50,245,888.86 | 11.10 |
| 8  | 000728 | 国元证券 | 48,029,407.05 | 10.61 |
| 9  | 002502 | 骅威文化 | 45,848,342.16 | 10.13 |
| 10 | 000937 | 冀中能源 | 45,184,810.79 | 9.98  |
| 11 | 300310 | 宜通世纪 | 42,312,949.74 | 9.35  |
| 12 | 600233 | 圆通速递 | 41,137,932.66 | 9.09  |
| 13 | 002445 | 中南文化 | 40,563,634.12 | 8.96  |
| 14 | 601818 | 光大银行 | 40,242,192.71 | 8.89  |
| 15 | 002643 | 万润股份 | 38,740,285.45 | 8.56  |
| 16 | 002655 | 共达电声 | 38,353,549.31 | 8.47  |
| 17 | 002519 | 银河电子 | 37,938,864.66 | 8.38  |
| 18 | 002007 | 华兰生物 | 37,924,193.45 | 8.38  |
| 19 | 600358 | 国旅联合 | 37,330,808.89 | 8.25  |
| 20 | 000810 | 创维数字 | 37,290,989.29 | 8.24  |
| 21 | 000915 | 山大华特 | 37,114,532.45 | 8.20  |
| 22 | 300088 | 长信科技 | 36,515,013.50 | 8.07  |
| 23 | 601555 | 东吴证券 | 35,970,518.62 | 7.95  |
| 24 | 002155 | 湖南黄金 | 35,730,071.36 | 7.89  |
| 25 | 601169 | 北京银行 | 35,350,053.85 | 7.81  |
| 26 | 300017 | 网宿科技 | 34,349,657.01 | 7.59  |
| 27 | 002035 | 华帝股份 | 33,709,993.01 | 7.45  |
| 28 | 300271 | 华宇软件 | 33,064,858.05 | 7.30  |
| 29 | 603866 | 桃李面包 | 32,711,429.64 | 7.23  |
| 30 | 002511 | 中顺洁柔 | 32,368,897.14 | 7.15  |
| 31 | 000630 | 铜陵有色 | 31,725,456.47 | 7.01  |
| 32 | 000686 | 东北证券 | 31,198,316.41 | 6.89  |
| 33 | 000558 | 莱茵体育 | 31,157,656.82 | 6.88  |
| 34 | 300145 | 中金环境 | 30,557,484.88 | 6.75  |
| 35 | 000983 | 西山煤电 | 30,380,001.33 | 6.71  |
| 36 | 601333 | 广深铁路 | 29,705,756.29 | 6.56  |
| 37 | 002712 | 思美传媒 | 29,418,473.15 | 6.50  |
| 38 | 002361 | 神剑股份 | 29,413,386.57 | 6.50  |
| 39 | 000021 | 深科技  | 29,167,062.65 | 6.44  |
| 40 | 000957 | 中通客车 | 29,051,087.51 | 6.42  |
| 41 | 600436 | 片仔癀  | 28,668,899.20 | 6.33  |
| 42 | 600303 | 曙光股份 | 28,266,508.56 | 6.24  |
| 43 | 600029 | 南方航空 | 27,719,269.90 | 6.12  |
| 44 | 002329 | 皇氏集团 | 27,599,538.00 | 6.10  |
| 45 | 600547 | 山东黄金 | 27,437,480.01 | 6.06  |
| 46 | 002234 | 民和股份 | 26,723,108.68 | 5.90  |

|    |        |       |               |      |
|----|--------|-------|---------------|------|
| 47 | 300287 | 飞利信   | 26,490,434.60 | 5.85 |
| 48 | 300498 | 温氏股份  | 26,274,587.47 | 5.80 |
| 49 | 600566 | 济川药业  | 26,226,612.17 | 5.79 |
| 50 | 300326 | 凯利泰   | 25,979,734.83 | 5.74 |
| 51 | 002548 | 金新农   | 25,539,506.14 | 5.64 |
| 52 | 300379 | 东方通   | 25,454,925.69 | 5.62 |
| 53 | 002494 | 华斯股份  | 25,395,115.55 | 5.61 |
| 54 | 600576 | 万家文化  | 25,316,726.65 | 5.59 |
| 55 | 000650 | 仁和药业  | 25,057,425.36 | 5.54 |
| 56 | 300148 | 天舟文化  | 24,833,518.93 | 5.49 |
| 57 | 002408 | 齐翔腾达  | 24,269,060.41 | 5.36 |
| 58 | 300342 | 天银机电  | 23,735,965.94 | 5.24 |
| 59 | 601939 | 建设银行  | 23,119,324.47 | 5.11 |
| 60 | 002648 | 卫星石化  | 23,003,882.06 | 5.08 |
| 61 | 002371 | 七星电子  | 23,000,085.04 | 5.08 |
| 62 | 000603 | 盛达矿业  | 22,904,452.21 | 5.06 |
| 63 | 002452 | 长高集团  | 22,898,817.47 | 5.06 |
| 64 | 300336 | 新文化   | 22,710,267.50 | 5.02 |
| 65 | 002247 | 帝龙文化  | 22,670,177.97 | 5.01 |
| 66 | 002736 | 国信证券  | 22,597,842.77 | 4.99 |
| 67 | 600807 | 天业股份  | 22,399,764.19 | 4.95 |
| 68 | 000965 | 天保基建  | 22,325,541.97 | 4.93 |
| 69 | 002191 | 劲嘉股份  | 22,152,432.45 | 4.89 |
| 70 | 002036 | 联创电子  | 22,123,757.53 | 4.89 |
| 71 | 601669 | 中国电建  | 22,022,655.80 | 4.86 |
| 72 | 600054 | 黄山旅游  | 22,019,910.95 | 4.86 |
| 73 | 002077 | 大港股份  | 21,747,967.46 | 4.80 |
| 74 | 601166 | 兴业银行  | 21,531,980.97 | 4.76 |
| 75 | 002352 | 鼎泰新材  | 20,958,428.08 | 4.63 |
| 76 | 600826 | 兰生股份  | 20,505,412.32 | 4.53 |
| 77 | 603128 | 华贸物流  | 20,481,665.67 | 4.52 |
| 78 | 002048 | 宁波华翔  | 20,342,123.46 | 4.49 |
| 79 | 603799 | 华友钴业  | 20,192,540.94 | 4.46 |
| 80 | 002311 | 海大集团  | 19,773,586.03 | 4.37 |
| 81 | 600198 | 大唐电信  | 19,684,071.42 | 4.35 |
| 82 | 002458 | 益生股份  | 19,115,893.86 | 4.22 |
| 83 | 600867 | 通化东宝  | 18,939,993.07 | 4.18 |
| 84 | 600999 | 招商证券  | 18,873,880.64 | 4.17 |
| 85 | 000418 | 小天鹅 A | 18,839,171.15 | 4.16 |
| 86 | 601799 | 星宇股份  | 18,780,027.77 | 4.15 |
| 87 | 600114 | 东睦股份  | 17,783,998.03 | 3.93 |
| 88 | 600066 | 宇通客车  | 17,668,287.28 | 3.90 |
| 89 | 002635 | 安洁科技  | 17,602,905.58 | 3.89 |
| 90 | 000655 | 金岭矿业  | 17,579,874.40 | 3.88 |

|     |        |        |               |      |
|-----|--------|--------|---------------|------|
| 91  | 600667 | 太极实业   | 17,195,134.87 | 3.80 |
| 92  | 000980 | 金马股份   | 17,155,709.37 | 3.79 |
| 93  | 002368 | 太极股份   | 17,116,675.22 | 3.78 |
| 94  | 000998 | 隆平高科   | 17,100,258.29 | 3.78 |
| 95  | 601857 | 中国石油   | 17,099,337.00 | 3.78 |
| 96  | 002137 | 麦达数字   | 17,068,840.94 | 3.77 |
| 97  | 601118 | 海南橡胶   | 16,901,227.62 | 3.73 |
| 98  | 600519 | 贵州茅台   | 16,763,491.92 | 3.70 |
| 99  | 000401 | 冀东水泥   | 16,738,965.58 | 3.70 |
| 100 | 002343 | 慈文传媒   | 16,622,217.84 | 3.67 |
| 101 | 002709 | 天赐材料   | 16,600,656.66 | 3.67 |
| 102 | 300177 | 中海达    | 16,517,176.15 | 3.65 |
| 103 | 600348 | 阳泉煤业   | 16,373,890.28 | 3.62 |
| 104 | 300242 | 明家联合   | 16,142,036.36 | 3.57 |
| 105 | 002094 | 青岛金王   | 16,131,190.88 | 3.56 |
| 106 | 000895 | 双汇发展   | 15,881,070.83 | 3.51 |
| 107 | 000795 | 英洛华    | 15,874,673.40 | 3.51 |
| 108 | 002188 | 巴士在线   | 15,714,916.11 | 3.47 |
| 109 | 600258 | 首旅酒店   | 15,707,661.40 | 3.47 |
| 110 | 300063 | 天龙集团   | 15,649,929.57 | 3.46 |
| 111 | 600988 | 赤峰黄金   | 15,455,980.34 | 3.41 |
| 112 | 002025 | 航天电器   | 15,307,360.57 | 3.38 |
| 113 | 002673 | 西部证券   | 15,155,210.36 | 3.35 |
| 114 | 601898 | 中煤能源   | 15,002,038.44 | 3.31 |
| 115 | 002372 | 伟星新材   | 14,929,617.86 | 3.30 |
| 116 | 002727 | 一心堂    | 14,908,787.98 | 3.29 |
| 117 | 002078 | 太阳纸业   | 14,876,411.67 | 3.29 |
| 118 | 002612 | 朗姿股份   | 14,765,206.06 | 3.26 |
| 119 | 000948 | 南天信息   | 14,269,703.68 | 3.15 |
| 120 | 601088 | 中国神华   | 14,229,519.16 | 3.14 |
| 121 | 600879 | 航天电子   | 14,188,114.37 | 3.13 |
| 122 | 600409 | 三友化工   | 14,139,734.73 | 3.12 |
| 123 | 000587 | 金洲慈航   | 14,042,629.16 | 3.10 |
| 124 | 601288 | 农业银行   | 13,817,256.00 | 3.05 |
| 125 | 000968 | *ST 煤气 | 13,745,857.41 | 3.04 |
| 126 | 000933 | *ST 神火 | 13,687,506.30 | 3.02 |
| 127 | 600998 | 九州通    | 13,581,922.77 | 3.00 |
| 128 | 300014 | 亿纬锂能   | 13,567,880.33 | 3.00 |
| 129 | 600221 | 海南航空   | 13,557,150.00 | 2.99 |
| 130 | 300244 | 迪安诊断   | 13,530,692.49 | 2.99 |
| 131 | 002466 | 天齐锂业   | 13,517,780.31 | 2.99 |
| 132 | 002070 | 众和股份   | 13,447,706.70 | 2.97 |
| 133 | 300202 | 聚龙股份   | 13,436,873.09 | 2.97 |
| 134 | 603589 | 口子窖    | 13,427,844.37 | 2.97 |

|     |        |        |               |      |
|-----|--------|--------|---------------|------|
| 135 | 600497 | 驰宏锌锗   | 13,300,430.92 | 2.94 |
| 136 | 603067 | 振华股份   | 13,284,443.54 | 2.93 |
| 137 | 002056 | 横店东磁   | 13,257,067.44 | 2.93 |
| 138 | 600735 | 新华锦    | 13,202,544.96 | 2.92 |
| 139 | 600376 | 首开股份   | 13,178,759.32 | 2.91 |
| 140 | 002364 | 中恒电气   | 13,092,438.89 | 2.89 |
| 141 | 000863 | 三湘印象   | 13,035,651.41 | 2.88 |
| 142 | 300358 | 楚天科技   | 12,990,770.00 | 2.87 |
| 143 | 601788 | 光大证券   | 12,971,028.96 | 2.87 |
| 144 | 600172 | 黄河旋风   | 12,842,581.26 | 2.84 |
| 145 | 000713 | 丰乐种业   | 12,702,503.16 | 2.81 |
| 146 | 000969 | 安泰科技   | 12,666,577.83 | 2.80 |
| 147 | 600061 | 国投安信   | 12,626,304.38 | 2.79 |
| 148 | 002033 | 丽江旅游   | 12,542,042.94 | 2.77 |
| 149 | 300365 | 恒华科技   | 12,532,071.90 | 2.77 |
| 150 | 002605 | 姚记扑克   | 12,484,088.13 | 2.76 |
| 151 | 600797 | 浙大网新   | 12,483,782.96 | 2.76 |
| 152 | 300097 | 智云股份   | 12,471,739.75 | 2.75 |
| 153 | 601699 | 潞安环能   | 12,452,297.62 | 2.75 |
| 154 | 002127 | 南极电商   | 12,424,765.76 | 2.74 |
| 155 | 002340 | 格林美    | 12,418,979.38 | 2.74 |
| 156 | 600015 | 华夏银行   | 12,382,588.63 | 2.74 |
| 157 | 600150 | 中国船舶   | 12,332,312.12 | 2.72 |
| 158 | 600489 | 中金黄金   | 12,319,826.20 | 2.72 |
| 159 | 603268 | 松发股份   | 12,249,447.78 | 2.71 |
| 160 | 600990 | 四创电子   | 12,191,862.03 | 2.69 |
| 161 | 002714 | 牧原股份   | 12,167,236.16 | 2.69 |
| 162 | 000639 | 西王食品   | 12,133,233.58 | 2.68 |
| 163 | 300041 | 回天新材   | 12,081,157.86 | 2.67 |
| 164 | 300297 | 蓝盾股份   | 11,989,196.24 | 2.65 |
| 165 | 002099 | 海翔药业   | 11,977,370.10 | 2.65 |
| 166 | 002510 | 天汽模    | 11,976,167.93 | 2.65 |
| 167 | 300031 | 宝通科技   | 11,963,650.51 | 2.64 |
| 168 | 002726 | 龙大肉食   | 11,896,209.45 | 2.63 |
| 169 | 300353 | 东土科技   | 11,797,618.51 | 2.61 |
| 170 | 002289 | *ST 宇顺 | 11,751,190.17 | 2.60 |
| 171 | 600089 | 特变电工   | 11,720,635.64 | 2.59 |
| 172 | 000596 | 古井贡酒   | 11,651,736.81 | 2.57 |
| 173 | 600711 | 盛屯矿业   | 11,584,435.51 | 2.56 |
| 174 | 600340 | 华夏幸福   | 11,512,109.50 | 2.54 |
| 175 | 002196 | 方正电机   | 11,476,965.11 | 2.54 |
| 176 | 002533 | 金杯电工   | 11,425,139.57 | 2.52 |
| 177 | 300348 | 长亮科技   | 11,416,062.60 | 2.52 |
| 178 | 600589 | 广东榕泰   | 11,397,730.32 | 2.52 |

|     |        |       |               |      |
|-----|--------|-------|---------------|------|
| 179 | 300278 | 华昌达   | 11,359,182.68 | 2.51 |
| 180 | 600705 | 中航资本  | 11,347,675.84 | 2.51 |
| 181 | 600678 | 四川金顶  | 11,319,837.24 | 2.50 |
| 182 | 000722 | 湖南发展  | 11,305,781.11 | 2.50 |
| 183 | 603658 | 安图生物  | 11,085,293.81 | 2.45 |
| 184 | 300369 | 绿盟科技  | 11,072,329.35 | 2.45 |
| 185 | 600273 | 嘉化能源  | 10,995,589.45 | 2.43 |
| 186 | 002537 | 海立美达  | 10,936,638.32 | 2.42 |
| 187 | 000890 | 法 尔 胜 | 10,853,384.82 | 2.40 |
| 188 | 600027 | 华电国际  | 10,844,390.50 | 2.40 |
| 189 | 601233 | 桐昆股份  | 10,832,394.35 | 2.39 |
| 190 | 600756 | 浪潮软件  | 10,821,173.40 | 2.39 |
| 191 | 002369 | 卓翼科技  | 10,746,520.38 | 2.37 |
| 192 | 000065 | 北方国际  | 10,733,238.47 | 2.37 |
| 193 | 300468 | 四方精创  | 10,608,861.30 | 2.34 |
| 194 | 600485 | 信威集团  | 10,545,340.33 | 2.33 |
| 195 | 300263 | 隆华节能  | 10,502,800.43 | 2.32 |
| 196 | 600170 | 上海建工  | 10,383,234.15 | 2.29 |
| 197 | 300166 | 东方国信  | 10,261,803.07 | 2.27 |
| 198 | 600360 | 华微电子  | 10,087,728.12 | 2.23 |
| 199 | 002284 | 亚太股份  | 10,066,263.84 | 2.22 |
| 200 | 600343 | 航天动力  | 10,063,912.92 | 2.22 |
| 201 | 000404 | 华意压缩  | 10,038,520.22 | 2.22 |
| 202 | 601186 | 中国铁建  | 9,951,173.63  | 2.20 |
| 203 | 601997 | 贵阳银行  | 9,938,747.10  | 2.20 |
| 204 | 600074 | 保千里   | 9,865,204.16  | 2.18 |
| 205 | 600563 | 法拉电子  | 9,859,243.82  | 2.18 |
| 206 | 300116 | 坚瑞沃能  | 9,671,636.10  | 2.14 |
| 207 | 002439 | 启明星辰  | 9,628,872.11  | 2.13 |
| 208 | 601069 | 西部黄金  | 9,592,861.13  | 2.12 |
| 209 | 000423 | 东阿阿胶  | 9,575,654.07  | 2.12 |
| 210 | 600146 | 商赢环球  | 9,545,105.86  | 2.11 |
| 211 | 600083 | 博信股份  | 9,537,412.42  | 2.11 |
| 212 | 600158 | 中体产业  | 9,521,513.57  | 2.10 |
| 213 | 002587 | 奥拓电子  | 9,519,379.23  | 2.10 |
| 214 | 600048 | 保利地产  | 9,480,090.21  | 2.09 |
| 215 | 002338 | 奥普光电  | 9,449,711.56  | 2.09 |
| 216 | 300010 | 立思辰   | 9,413,028.36  | 2.08 |
| 217 | 600406 | 国电南瑞  | 9,412,131.06  | 2.08 |
| 218 | 000876 | 新 希 望 | 9,239,260.54  | 2.04 |
| 219 | 601009 | 南京银行  | 9,212,977.52  | 2.04 |
| 220 | 601636 | 旗滨集团  | 9,201,248.99  | 2.03 |
| 221 | 601789 | 宁波建工  | 9,176,676.20  | 2.03 |
| 222 | 300279 | 和晶科技  | 9,165,408.00  | 2.02 |

|     |        |      |              |      |
|-----|--------|------|--------------|------|
| 223 | 002574 | 明牌珠宝 | 9,159,633.71 | 2.02 |
|-----|--------|------|--------------|------|

注：本项“卖出金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 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 | 5,789,966,587.62 |
| 卖出股票的收入（成交）总额 | 5,694,823,214.97 |

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   | 478,386.98 |
| 2  | 应收证券清算款 | 68,941.66  |
| 3  | 应收股利    | -          |
| 4  | 应收利息    | 13,227.31  |
| 5  | 应收申购款   | 6,644.48   |
| 6  | 其他应收款   | -          |
| 7  | 待摊费用    | -          |
| 8  | 其他      | -          |
| 9  | 合计      | 567,200.43 |

### 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

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<br>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<br>比例 | 持有份额           | 占总份额<br>比例 |
| 4,754    | 72,939.31     | 83,470,103.50 | 24.07%     | 263,283,365.37 | 75.93%     |

### 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 | 2,859.98  | 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(2013 年 5 月 23 日)基金份额总额 | 2,000,000,000.00 |
| 本报告期期初基金份额总额                   | 270,815,646.31   |
| 本报告期基金总申购份额                    | 188,175,092.26   |
| 减：本报告期基金总赎回份额                  | 112,237,269.70   |
| 本报告期基金拆分变动份额                   | -                |
| 本报告期期末基金份额总额                   | 346,753,468.87   |

## §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信消费服务混合型证券投资基金基金经理变更公告，蒋璆先生不再担任本基金经理，饶晓鹏先生继续担任该基金的基金经理。

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为基金审计的会计师事务所。

报告年度应支付给聘任会计师事务所的报酬为人民币 56,000.00 元。

目前的审计机构已提供审计服务的连续年限：自 2013 年 5 月 23 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 |    |
| 国信证券股份有限公司     | 2      | 5,399,710,533.41 | 47.04%       | 4,981,143.08 | 47.24%     | -  |
| 中银国际证券有限责任公司   | 1      | 2,427,925,875.82 | 21.15%       | 2,212,571.00 | 20.98%     | -  |
| 中国银河证券股份有限公司   | 1      | 2,119,324,714.37 | 18.46%       | 1,931,343.52 | 18.32%     | -  |
| 中国建设投资证券有限责任公司 | 1      | 467,359,162.81   | 4.07%        | 435,252.32   | 4.13%      | -  |
| 申万宏源证券有        | 1      | 401,005,277.98   | 3.49%        | 365,437.08   | 3.47%      | -  |

|            |   |                |       |            |       |   |
|------------|---|----------------|-------|------------|-------|---|
| 限公司        |   |                |       |            |       |   |
| 海通证券股份有限公司 | 1 | 386,517,367.33 | 3.37% | 359,962.59 | 3.41% | - |
| 上海证券有限责任公司 | 1 | 191,431,320.06 | 1.67% | 178,280.05 | 1.69% | - |
| 光大证券股份有限公司 | 1 | 86,062,261.36  | 0.75% | 80,150.23  | 0.76% | - |
| 招商证券股份有限公司 | 1 | -              | -     | -          | -     | - |

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：

2016 年 1 月完成退租国泰君安上海 21592 交易单元

#### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称       | 债券交易         |              | 回购交易 |              | 权证交易 |              |
|------------|--------------|--------------|------|--------------|------|--------------|
|            | 成交金额         | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 国信证券股份有限公司 | 2,937,912.00 | 100.00%      | -    | -            | -    | -            |

华安基金管理有限公司

二〇一七年三月二十八日