

华安升级主题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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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	华安升级主题混合
基金主代码	040020
交易代码	040020
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 4 月 22 日
基金管理人	华安基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	728,317,546.40 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金重点投资于受益于产业结构升级、消费升级和技术升级的行业，分享中国经济结构转型过程中的投资收益。在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金将采用“自上而下”与“自下而上”相结合的主动投资管理策略。即：采取“自上而下”的方式选择行业，挖掘并投资于集中代表整个经济发展趋势的行业或主题； 根据上述“自上而下”策略选择行业的基础上，采取“自下而上”的方法，运用基本面分析和实地调研相结合的研究方法选择个股。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×80%+中国债券总指数收益率×20%
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	中国建设银行股份有限公司
信息披露	姓名	钱鲲	田青

负责人	联系电话	021-38969999	010-67595096
	电子邮箱	qiankun@huaan.com.cn	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		4008850099	010-67595096
传真		021-68863414	010-66275853

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告摘要的管理人互联网网址	www.huaan.com.cn
基金年度报告备置地点	上海市世纪大道 8 号上海国金中心二期 31、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	55,391,237.01	261,928,135.53	161,625,666.71
本期利润	21,817,137.91	239,137,788.99	34,733,583.32
加权平均基金份额本期利润	0.0357	0.9809	0.0704
本期基金份额净值增长率	-5.22%	53.22%	8.54%
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	0.1192	0.7134	0.1177
期末基金资产净值	815,125,654.43	298,683,345.44	315,401,135.98
期末基金份额净值	1.119	1.713	1.118

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

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

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

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	-3.87%	0.94%	0.88%	0.58%	-4.75%	0.36%
过去六个月	-0.44%	0.90%	3.69%	0.61%	-4.13%	0.29%
过去一年	-5.22%	2.05%	-9.39%	1.12%	4.17%	0.93%
过去三年	57.62%	2.27%	35.71%	1.43%	21.91%	0.84%
过去五年	100.19%	1.95%	33.64%	1.30%	66.55%	0.65%
自基金合同生效起至今	62.35%	1.86%	1.05%	1.27%	61.30%	0.59%

注：本基金业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×80%＋中国债券总指数收益率×20%

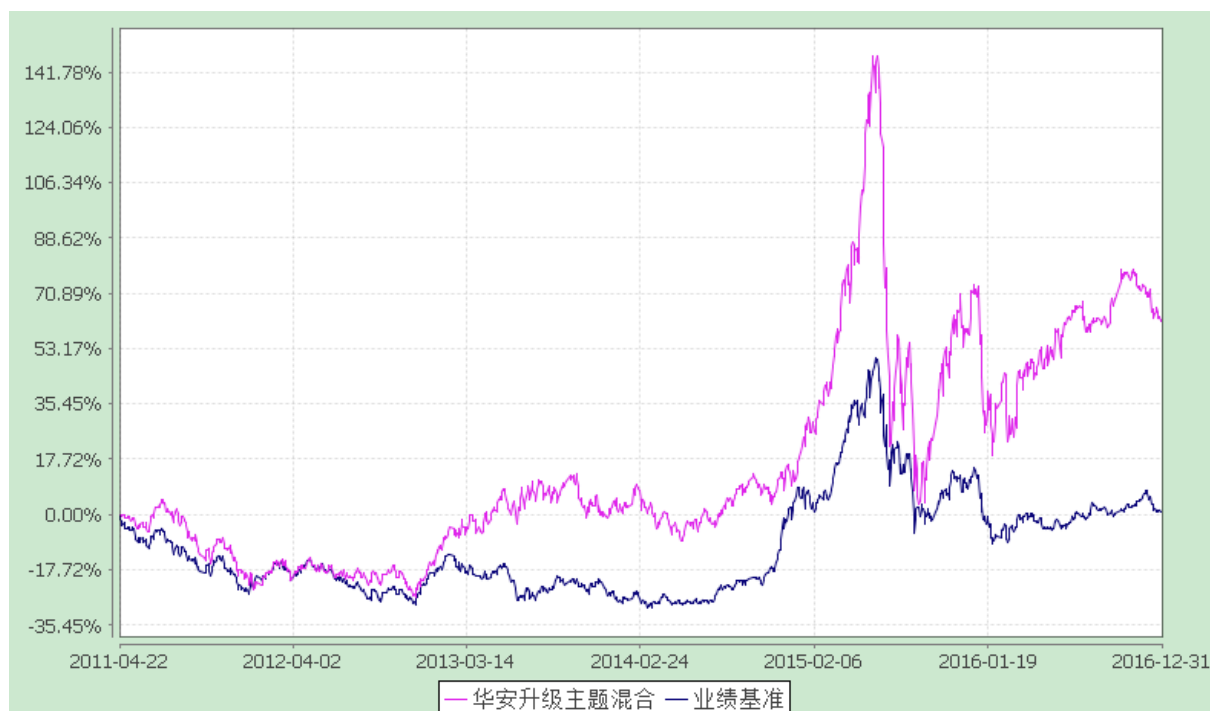
根据基金合同的规定：本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括 A 股股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、权证、货币市场工具和资产支持证券以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金股票投资占基金资产的比例范围为 60%～95%，其中投资于战略性新兴行业、消费升级行业 and 传统行业中的技术升级相关行业的比例不低于股票投资的 80%；债券、权证、现金、货币市场工具和资产支持证券占基金资产的比例范围为 5～40%，其中权证投资占基金资产净值的比例范围为 0～3%；现金或者到期日在 1 年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

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

华安升级主题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

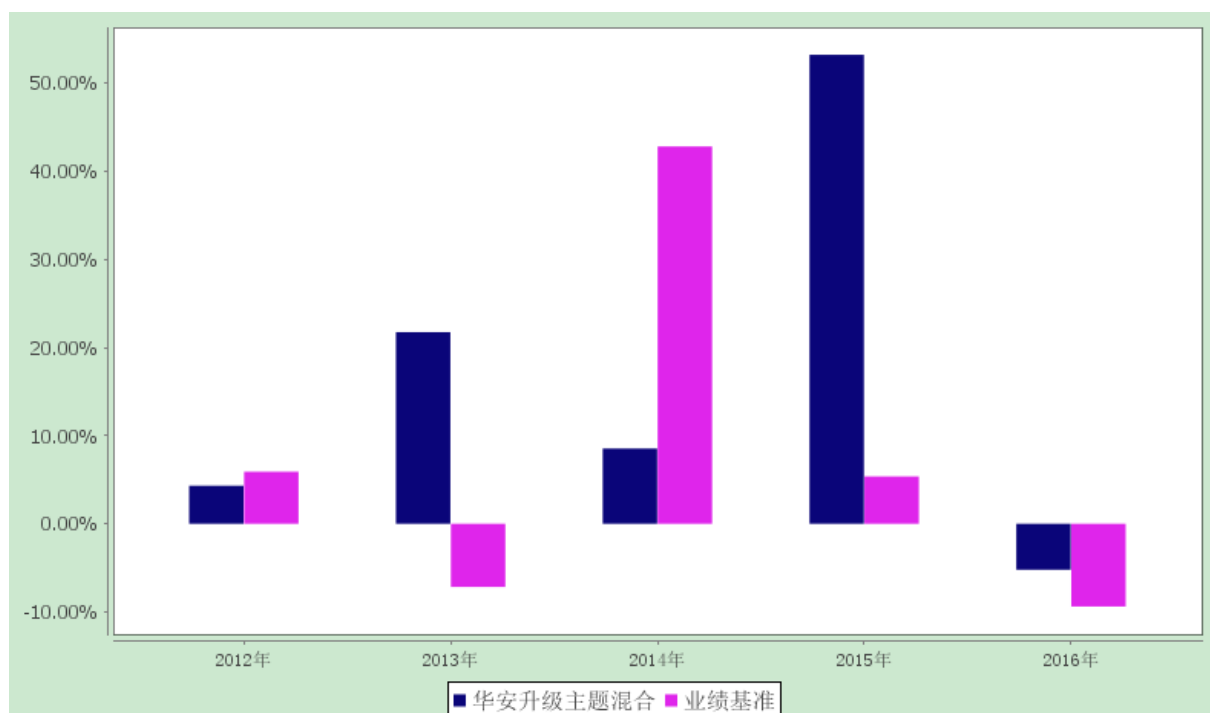
(2011 年 4 月 22 日至 2016 年 12 月 31 日)



3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华安升级主题混合型证券投资基金

过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金 份额分红数	现金形式发放总 额	再投资形式发放总 额	年度利润分配合 计	备注
2016 年	5.000	1,442,604,849.13	35,290,262.98	1,477,895,112.11	-
2015 年	-	-	-	-	-
2014 年	-	-	-	-	-
合计	5.000	1,442,604,849.13	35,290,262.98	1,477,895,112.11	-

§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 臻	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、华安安信消费服务混合型证券投资基金的基金经理；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安信消费服务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。

华安升级主题 2016 年收益率-5.22%，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 1.119 元，本报告期份额净值增长率为-5.22%，同期业绩比较基准增长率为-9.39%。

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。华安升级主题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

本报告期内共实施一次分红，分红方案为：5.00 元/10 份。权益登记日及除息日：2016 年 6 月 24 日；现金红利发放日：2016 年 6 月 27 日。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金实施利润分配的金额为 1,477,895,112.11 元。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§6 审计报告

本报告期的基金财务会计报告经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 20216 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：华安升级主题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	上年度末
----	-----	------

	2016 年 12 月 31 日	2015 年 12 月 31 日
资 产:	-	-
银行存款	93,777,422.61	19,532,070.98
结算备付金	10,102,517.67	3,669,188.37
存出保证金	1,050,533.90	479,001.17
交易性金融资产	754,811,084.58	273,448,517.32
其中: 股票投资	754,811,084.58	273,448,517.32
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	68,825.99	5,031,702.99
应收利息	22,901.60	6,155.11
应收股利	-	-
应收申购款	81,087.21	51,608.14
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	859,914,373.56	302,218,244.08
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	-	-
应付赎回款	38,631,986.24	966,722.60

应付管理人报酬	1,160,705.45	377,660.93
应付托管费	193,450.91	62,943.49
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	4,289,122.28	1,768,204.59
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	513,454.25	359,367.03
负债合计	44,788,719.13	3,534,898.64
所有者权益：	-	-
实收基金	728,317,546.40	174,319,163.98
未分配利润	86,808,108.03	124,364,181.46
所有者权益合计	815,125,654.43	298,683,345.44
负债和所有者权益总计	859,914,373.56	302,218,244.08

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.119 元，基金份额总额 728,317,546.40 份。

7.2 利润表

会计主体：华安升级主题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	58,151,020.68	254,805,274.66
1.利息收入	1,310,096.58	274,896.23
其中：存款利息收入	1,307,750.52	274,896.23
债券利息收入	2,346.06	-
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）	86,650,424.56	276,295,778.72
其中：股票投资收益	83,831,829.35	275,268,388.05
基金投资收益	-	-
债券投资收益	1,100,658.50	-
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	1,717,936.71	1,027,390.67
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-33,574,099.10	-22,790,346.54
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	3,764,598.64	1,024,946.25
减：二、费用	36,333,882.77	15,667,485.67
1. 管理人报酬	10,943,550.43	5,824,539.60
2. 托管费	1,823,925.18	970,756.66
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	23,174,353.35	8,487,611.47
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	392,053.81	384,577.94
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	21,817,137.91	239,137,788.99
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	21,817,137.91	239,137,788.99

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安升级主题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）	174,319,163.98	124,364,181.46	298,683,345.44
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	21,817,137.91	21,817,137.91
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）	553,998,382.42	1,418,521,900.77	1,972,520,283.19
其中：1.基金申购款	3,218,644,083.11	1,781,188,888.49	4,999,832,971.60
2.基金赎回款	-2,664,645,700.69	-362,666,987.72	-3,027,312,688.41
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）	-	-1,477,895,112.11	-1,477,895,112.11
五、期末所有者权益（基金净值）	728,317,546.40	86,808,108.03	815,125,654.43
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）	282,189,475.30	33,211,660.68	315,401,135.98
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	239,137,788.99	239,137,788.99
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	-107,870,311.32	-147,985,268.21	-255,855,579.53

列)			
其中：1.基金申购款	515,112,583.03	330,381,559.82	845,494,142.85
2.基金赎回款	-622,982,894.35	-478,366,828.03	-1,101,349,722.38
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）	174,319,163.98	124,364,181.46	298,683,345.44

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

华安升级主题混合型证券投资基金(原名为华安升级主题股票型证券投资基金，以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2011]317 号《关于核准华安升级主题股票型证券投资基金募集的批复》核准，由华安基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安升级主题股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 4,118,599,416.41 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(2011)第 134 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华安升级主题股票型证券投资基金基金合同》于 2011 年 4 月 22 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 4,119,090,620.47 份基金份额，其中认购资金利息折合 491,204.06 份基金份额。本基金的基金管理人为华安基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

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》，华安升级主题股票型证券投资基金于 2015 年 8 月 6 日公告后更名为华安升级主题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《华安升级主题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股票、债券、货币市场工具、权证、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。本基金股票资产的投资比例占基金资产的 60%-95%,其中投资于战略性新兴产业、消费升级行业 and 传统

行业中的技术升级相关行业的比例不低于股票投资的 80%;债券、权证、现金、货币市场工具和资产支持证券的投资比例占基金资产的 5%-40%;权证的投资比例占基金资产净值的 0-3%;现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为: 80%×沪深 300 指数收益率+20%×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》、《华安升级主题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、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司(“建设银行”)	基金托管人、基金代销机构
上海国际信托有限公司	基金管理人的股东
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 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管理费	10,943,550.43	5,824,539.60
其中：支付销售机构的客户维护费	1,488,935.51	2,148,066.40

注：支付基金管理人华安基金管理有限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 X 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	1,823,925.18	970,756.66
----------------	--------------	------------

注：支付基金托管人中国建设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 X 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 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	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
中国建设银行	93,777,422.61	1,193,907.56	19,532,070.98	233,965.87

注：本基金的银行存款由基金托管人建设银行保管，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	证券	成功	可流	流通受	认购	期末估	数量(单位:	期末	期末	备注

代码	名称	认购日	通日	限类型	价格	值单价	股)	成本总额	估值总额	
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	3,117.00	72,189.72	72,189.72	-
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	股票	停牌	停牌	期末估值	复牌	复牌开	数量	期末	期末	备注
----	----	----	----	------	----	-----	----	----	----	----

代码	名称	日期	原因	单价	日期	盘单价	(单位: 股)	成本总额	估值总额	
300323	华灿光电	2016-04-18	重大事项停牌	8.76	2017-01-09	8.65	316,500.00	2,710,476.53	2,772,540.00	
603986	兆易创新	2016-09-19	重大事项停牌	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 751,355,866.62 元, 属于第二层次的余额为 3,455,217.96 元, 无属于第三层次的余额(2015 年 12 月 31 日: 第一层次 225,821,899.66 元, 第二层次 47,626,617.66 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	754,811,084.58	87.78
	其中：股票	754,811,084.58	87.78
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	103,879,940.28	12.08
7	其他各项资产	1,223,348.70	0.14

8	合计	859,914,373.56	100.00
---	----	----------------	--------

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	17,570,881.85	2.16
C	制造业	575,600,462.60	70.61
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,660,777.66	1.55
E	建筑业	118,924.74	0.01
F	批发和零售业	76,936,603.80	9.44
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	62,621,497.15	7.68
J	金融业	106,780.00	0.01
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	9,185,698.10	1.13
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	754,811,084.58	92.60

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	002120	新海股份	1,545,371	77,886,698.40	9.56
2	002640	跨境通	4,204,186	76,936,603.80	9.44
3	002468	申通快递	2,394,512	72,362,152.64	8.88
4	600867	通化东宝	3,097,828	67,935,368.04	8.33
5	002456	欧菲光	1,879,368	64,424,735.04	7.90
6	000661	长春高新	530,839	59,374,342.15	7.28
7	002511	中顺洁柔	2,633,221	52,401,097.90	6.43
8	603866	桃李面包	601,343	26,398,957.70	3.24
9	000980	金马股份	1,821,579	26,285,384.97	3.22
10	300287	飞利信	2,066,462	24,590,897.80	3.02

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	600867	通化东宝	116,172,371.33	38.89
2	000750	国海证券	112,629,125.75	37.71
3	002468	申通快递	96,006,857.31	32.14
4	600276	恒瑞医药	95,633,454.87	32.02
5	601818	光大银行	94,140,847.75	31.52
6	000937	冀中能源	89,980,706.57	30.13
7	002456	欧菲光	86,204,287.55	28.86
8	000728	国元证券	86,029,345.84	28.80
9	300287	飞利信	85,531,778.36	28.64
10	002640	跨境通	82,166,154.36	27.51
11	002511	中顺洁柔	82,164,831.52	27.51
12	600521	华海药业	78,101,294.29	26.15
13	002120	韵达股份	77,730,168.22	26.02
14	600056	中国医药	77,559,258.90	25.97
15	000915	山大华特	74,511,871.27	24.95
16	000686	东北证券	72,878,331.47	24.40
17	000661	长春高新	72,427,610.47	24.25
18	300271	华宇软件	68,126,150.83	22.81
19	002712	思美传媒	67,014,049.98	22.44
20	300017	网宿科技	66,249,765.16	22.18
21	600233	圆通速递	64,157,880.25	21.48
22	002035	华帝股份	63,795,108.36	21.36

23	002325	洪涛股份	63,454,046.86	21.24
24	002508	老板电器	62,071,050.45	20.78
25	603866	桃李面包	61,004,733.40	20.42
26	300145	中金环境	60,072,532.47	20.11
27	601169	北京银行	58,370,297.59	19.54
28	600029	南方航空	58,029,183.92	19.43
29	000983	西山煤电	56,149,701.83	18.80
30	002519	银河电子	54,517,089.89	18.25
31	600807	天业股份	53,810,888.83	18.02
32	000630	铜陵有色	53,318,972.00	17.85
33	000980	金马股份	52,819,663.48	17.68
34	002191	劲嘉股份	51,135,895.55	17.12
35	002007	华兰生物	51,072,212.44	17.10
36	601333	广深铁路	50,736,117.09	16.99
37	300326	凯利泰	49,818,141.70	16.68
38	600566	济川药业	48,860,183.36	16.36
39	002408	齐翔腾达	47,608,317.55	15.94
40	601555	东吴证券	47,357,427.25	15.86
41	000021	深科技	46,533,955.11	15.58
42	300379	东方通	45,962,883.86	15.39
43	002361	神剑股份	45,066,571.85	15.09
44	000965	天保基建	44,763,015.13	14.99
45	601857	中国石油	44,483,276.60	14.89
46	002352	鼎泰新材	44,474,795.36	14.89
47	000650	仁和药业	44,143,457.10	14.78
48	600151	航天机电	43,684,898.44	14.63
49	601669	中国电建	41,957,409.00	14.05
50	000810	创维数字	41,736,633.51	13.97
51	601166	兴业银行	41,583,968.04	13.92
52	300177	中海达	40,959,630.14	13.71
53	002727	一心堂	39,981,124.18	13.39
54	601699	潞安环能	39,459,549.58	13.21
55	600436	片仔癀	39,288,252.22	13.15
56	600198	大唐电信	38,781,450.22	12.98
57	002368	太极股份	38,360,315.70	12.84
58	603128	华贸物流	37,927,863.43	12.70
59	002643	万润股份	37,881,582.15	12.68
60	600348	阳泉煤业	37,084,475.75	12.42
61	000401	冀东水泥	36,113,301.86	12.09
62	600066	宇通客车	35,419,840.13	11.86
63	600999	招商证券	34,687,904.31	11.61
64	600988	赤峰黄金	34,095,369.61	11.42
65	002036	联创电子	32,705,946.04	10.95
66	600054	黄山旅游	32,594,534.59	10.91

67	601288	农业银行	31,865,904.00	10.67
68	002439	启明星辰	31,514,258.56	10.55
69	000895	双汇发展	31,259,424.64	10.47
70	600150	中国船舶	31,211,790.70	10.45
71	002372	伟星新材	30,945,893.55	10.36
72	300369	绿盟科技	30,446,968.26	10.19
73	600711	盛屯矿业	30,320,832.00	10.15
74	601668	中国建筑	29,998,975.49	10.04
75	600409	三友化工	29,670,621.00	9.93
76	300244	迪安诊断	29,487,301.23	9.87
77	002648	卫星石化	29,405,807.43	9.85
78	600211	西藏药业	29,397,818.95	9.84
79	300365	恒华科技	28,584,719.04	9.57
80	002371	七星电子	28,058,949.42	9.39
81	000969	安泰科技	27,940,006.44	9.35
82	002736	国信证券	27,921,333.11	9.35
83	600990	四创电子	27,915,532.74	9.35
84	601118	海南橡胶	27,825,489.54	9.32
85	002155	湖南黄金	27,768,712.22	9.30
86	600998	九州通	27,595,071.59	9.24
87	000948	南天信息	27,512,189.77	9.21
88	002048	宁波华翔	27,397,285.68	9.17
89	002078	太阳纸业	26,672,871.64	8.93
90	300297	蓝盾股份	26,593,084.93	8.90
91	600755	厦门国贸	26,449,034.98	8.86
92	600376	首开股份	26,409,687.42	8.84
93	600038	中直股份	25,579,754.71	8.56
94	000404	华意压缩	24,949,996.18	8.35
95	601088	中国神华	24,939,619.10	8.35
96	300041	回天新材	24,666,252.46	8.26
97	300353	东土科技	24,543,378.07	8.22
98	002570	贝因美	24,445,407.06	8.18
99	600756	浪潮软件	24,102,602.31	8.07
100	300088	长信科技	23,993,972.59	8.03
101	601788	光大证券	23,653,414.00	7.92
102	000558	莱茵体育	23,452,020.95	7.85
103	002581	未名医药	23,217,710.86	7.77
104	002338	奥普光电	23,173,241.95	7.76
105	600879	航天电子	22,984,877.04	7.70
106	600343	航天动力	22,690,212.50	7.60
107	300237	美晨科技	22,557,960.61	7.55
108	002234	民和股份	22,454,413.64	7.52
109	002445	中南文化	22,358,636.47	7.49
110	000968	*ST 煤气	22,299,554.93	7.47

111	600015	华夏银行	21,834,942.70	7.31
112	601601	中国太保	21,598,301.21	7.23
113	600089	特变电工	21,360,488.30	7.15
114	002004	华邦健康	21,050,363.70	7.05
115	300098	高新兴	20,929,080.27	7.01
116	000639	西王食品	20,889,865.18	6.99
117	000596	古井贡酒	20,842,151.89	6.98
118	600497	驰宏锌锗	20,823,530.99	6.97
119	002726	龙大肉食	20,774,993.18	6.96
120	603067	振华股份	20,753,220.08	6.95
121	002099	海翔药业	20,593,599.48	6.89
122	002655	共达电声	20,544,127.29	6.88
123	000603	盛达矿业	20,428,525.70	6.84
124	002603	以岭药业	19,996,726.16	6.69
125	300449	汉邦高科	19,981,742.63	6.69
126	600416	湘电股份	19,981,301.44	6.69
127	000065	北方国际	19,878,898.17	6.66
128	002502	骅威文化	19,777,619.95	6.62
129	600667	太极实业	19,726,127.00	6.60
130	600826	兰生股份	19,524,341.21	6.54
131	600114	东睦股份	19,455,592.11	6.51
132	300025	华星创业	19,318,396.98	6.47
133	000423	东阿阿胶	18,973,611.42	6.35
134	300498	温氏股份	18,956,159.77	6.35
135	603658	安图生物	18,830,193.88	6.30
136	600358	国旅联合	18,750,721.78	6.28
137	002574	明牌珠宝	18,735,688.35	6.27
138	000998	隆平高科	18,396,225.90	6.16
139	601186	中国铁建	18,268,978.00	6.12
140	601198	东兴证券	18,189,815.58	6.09
141	000795	英洛华	18,125,772.61	6.07
142	600303	曙光股份	18,122,228.22	6.07
143	601666	平煤股份	18,011,848.67	6.03
144	300148	天舟文化	17,974,336.06	6.02
145	300336	新文化	17,864,004.07	5.98
146	002548	金新农	17,493,318.36	5.86
147	600359	新农开发	17,467,630.00	5.85
148	000957	中通客车	17,352,161.35	5.81
149	600547	山东黄金	17,325,642.50	5.80
150	600340	华夏幸福	17,047,623.80	5.71
151	002458	益生股份	17,042,865.21	5.71
152	000587	金洲慈航	17,042,352.94	5.71
153	600648	外高桥	16,687,478.90	5.59
154	600567	山鹰纸业	16,640,675.00	5.57

155	600170	上海建工	16,592,419.24	5.56
156	600511	国药股份	16,485,021.22	5.52
157	600108	亚盛集团	15,934,765.00	5.34
158	002714	牧原股份	15,672,884.73	5.25
159	600576	万家文化	15,665,770.74	5.24
160	601636	旗滨集团	15,443,016.00	5.17
161	600848	上海临港	15,239,473.89	5.10
162	000063	中兴通讯	14,996,582.24	5.02
163	601233	桐昆股份	14,821,383.70	4.96
164	600258	首旅酒店	14,725,634.47	4.93
165	002452	长高集团	14,522,088.04	4.86
166	601799	星宇股份	14,100,282.78	4.72
167	600664	哈药股份	14,007,816.55	4.69
168	600535	天士力	13,842,851.25	4.63
169	002077	大港股份	13,829,903.30	4.63
170	000662	天夏智慧	13,814,509.90	4.63
171	600138	中青旅	13,752,792.85	4.60
172	000655	金岭矿业	13,679,594.72	4.58
173	601997	贵阳银行	13,619,782.77	4.56
174	002127	南极电商	13,579,300.32	4.55
175	300310	宜通世纪	13,486,136.43	4.52
176	002311	海大集团	13,388,218.09	4.48
177	300196	长海股份	13,278,321.31	4.45
178	002247	帝龙文化	13,253,949.43	4.44
179	002635	安洁科技	13,211,970.48	4.42
180	000060	中金岭南	13,178,520.36	4.41
181	000066	长城电脑	13,006,191.65	4.35
182	600519	贵州茅台	13,003,284.91	4.35
183	601898	中煤能源	12,797,867.00	4.28
184	002690	美亚光电	12,742,697.28	4.27
185	000402	金融街	12,627,686.38	4.23
186	600104	上汽集团	12,581,925.47	4.21
187	603611	诺力股份	12,372,317.96	4.14
188	600027	华电国际	12,289,280.48	4.11
189	603799	华友钴业	12,238,309.35	4.10
190	600856	中天能源	12,182,120.26	4.08
191	603868	飞科电器	11,828,704.41	3.96
192	300429	强力新材	11,735,514.51	3.93
193	002626	金达威	11,544,422.87	3.87
194	300278	华昌达	11,522,459.15	3.86
195	300144	宋城演艺	11,505,640.48	3.85
196	600362	江西铜业	11,499,787.80	3.85
197	002329	皇氏集团	11,451,410.52	3.83
198	600115	东方航空	11,448,536.00	3.83

199	000783	长江证券	11,410,000.00	3.82
200	600363	联创光电	11,348,224.71	3.80
201	600735	新华锦	11,331,878.60	3.79
202	002674	兴业科技	11,319,806.18	3.79
203	002673	西部证券	11,203,916.00	3.75
204	300230	永利股份	11,193,965.64	3.75
205	002169	智光电气	10,997,525.72	3.68
206	002188	巴士在线	10,957,298.88	3.67
207	002716	金贵银业	10,927,565.73	3.66
208	002609	捷顺科技	10,905,772.93	3.65
209	002605	姚记扑克	10,727,294.73	3.59
210	603589	口子窖	10,657,080.11	3.57
211	300406	九强生物	10,654,933.12	3.57
212	600763	通策医疗	10,628,309.00	3.56
213	600221	海南航空	10,554,469.75	3.53
214	600183	生益科技	10,402,364.65	3.48
215	002709	天赐材料	10,383,403.10	3.48
216	600050	中国联通	10,366,256.00	3.47
217	000933	*ST 神火	10,275,820.53	3.44
218	000863	三湘印象	10,258,858.76	3.43
219	000429	粤高速 A	10,151,631.14	3.40
220	002056	横店东磁	10,091,723.00	3.38
221	002343	慈文传媒	10,082,424.20	3.38
222	000910	大亚圣象	10,074,158.84	3.37
223	601009	南京银行	10,027,741.00	3.36
224	002025	航天电器	9,997,552.42	3.35
225	603636	南威软件	9,997,063.04	3.35
226	002335	科华恒盛	9,991,317.84	3.35
227	002094	青岛金王	9,805,367.98	3.28
228	600057	象屿股份	9,800,316.81	3.28
229	600061	国投安信	9,762,487.20	3.27
230	300242	明家联合	9,635,064.51	3.23
231	600172	黄河旋风	9,578,994.57	3.21
232	600110	诺德股份	9,563,148.00	3.20
233	300097	智云股份	9,547,222.17	3.20
234	603899	晨光文具	9,438,106.86	3.16
235	002087	新野纺织	9,339,670.74	3.13
236	000816	智慧农业	9,298,886.28	3.11
237	000488	晨鸣纸业	9,230,696.28	3.09
238	002601	佰利联	9,223,000.50	3.09
239	000733	振华科技	9,183,384.78	3.07
240	002589	瑞康医药	9,145,457.55	3.06
241	600266	北京城建	9,143,095.97	3.06
242	600873	梅花生物	9,132,926.03	3.06

243	000418	小天鹅 A	9,119,536.69	3.05
244	000960	锡业股份	9,090,677.60	3.04
245	300221	银禧科技	9,083,475.02	3.04
246	600273	嘉化能源	9,011,269.79	3.02
247	300531	优博讯	8,891,394.00	2.98
248	300263	隆华节能	8,769,126.43	2.94
249	002364	中恒电气	8,657,390.00	2.90
250	300014	亿纬锂能	8,637,930.88	2.89
251	002510	天汽模	8,617,132.06	2.89
252	000903	云内动力	8,368,642.12	2.80
253	002466	天齐锂业	8,315,949.00	2.78
254	300468	四方精创	8,315,525.00	2.78
255	600705	中航资本	8,241,214.16	2.76
256	300202	聚龙股份	8,172,221.00	2.74
257	600489	中金黄金	8,147,539.04	2.73
258	002369	卓翼科技	8,135,411.00	2.72
259	603188	亚邦股份	8,084,182.23	2.71
260	300010	立思辰	8,068,084.49	2.70
261	600589	广东榕泰	8,017,525.00	2.68
262	000890	法尔胜	7,978,583.00	2.67
263	600485	信威集团	7,909,923.45	2.65
264	300116	坚瑞沃能	7,870,756.00	2.64
265	002533	金杯电工	7,856,431.21	2.63
266	300358	楚天科技	7,760,452.96	2.60
267	300018	中元股份	7,672,137.50	2.57
268	000636	风华高科	7,611,892.98	2.55
269	002520	日发精机	7,600,629.06	2.54
270	300166	东方国信	7,481,809.03	2.50
271	000400	许继电气	7,439,700.48	2.49
272	600797	浙大网新	7,242,641.58	2.42
273	601069	西部黄金	7,138,002.45	2.39
274	002026	山东威达	7,125,795.66	2.39
275	601789	宁波建工	7,098,337.00	2.38
276	002268	卫士通	6,960,400.24	2.33
277	300031	宝通科技	6,929,402.61	2.32
278	002537	海立美达	6,901,588.69	2.31
279	600891	秋林集团	6,778,022.00	2.27
280	000876	新希望	6,777,254.04	2.27
281	600203	福日电子	6,774,974.00	2.27
282	300342	天银机电	6,764,443.90	2.26
283	600048	保利地产	6,755,236.98	2.26
284	000612	焦作万方	6,655,541.85	2.23
285	600678	四川金顶	6,635,294.07	2.22
286	002340	格林美	6,628,485.39	2.22

287	600158	中体产业	6,571,557.77	2.20
288	601390	中国中铁	6,558,192.00	2.20
289	000831	*ST 五稀	6,549,466.36	2.19
290	600563	法拉电子	6,512,157.94	2.18
291	000722	湖南发展	6,464,164.56	2.16
292	600406	国电南瑞	6,401,343.12	2.14
293	300294	博雅生物	6,234,004.70	2.09
294	600291	西水股份	6,209,741.61	2.08
295	000526	紫光学大	6,183,230.50	2.07
296	600720	祁连山	6,131,553.28	2.05
297	002560	通达股份	6,096,144.84	2.04
298	601229	上海银行	6,059,626.00	2.03
299	000597	东北制药	6,053,634.00	2.03
300	600074	保千里	6,046,614.98	2.02
301	002688	金河生物	6,034,997.00	2.02
302	300316	晶盛机电	6,033,564.11	2.02
303	002006	精功科技	6,010,244.00	2.01

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

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000750	国海证券	114,765,602.27	38.42
2	601818	光大银行	95,774,325.31	32.07
3	600276	恒瑞医药	95,345,155.10	31.92
4	000937	冀中能源	87,836,309.44	29.41
5	000728	国元证券	85,188,737.67	28.52
6	600521	华海药业	80,693,069.87	27.02
7	600233	圆通速递	80,222,059.26	26.86
8	600056	中国医药	76,914,644.12	25.75
9	000915	山大华特	75,084,637.94	25.14
10	000686	东北证券	73,261,726.54	24.53
11	002325	洪涛股份	68,166,110.58	22.82
12	300271	华宇软件	66,929,681.13	22.41
13	002508	老板电器	64,893,736.54	21.73
14	002035	华帝股份	64,629,802.23	21.64
15	600807	天业股份	63,076,276.24	21.12
16	300017	网宿科技	62,881,317.29	21.05
17	601169	北京银行	60,957,908.38	20.41

18	300145	中金环境	60,923,388.14	20.40
19	300287	飞利信	59,725,884.68	20.00
20	002007	华兰生物	59,101,328.98	19.79
21	600029	南方航空	57,858,681.49	19.37
22	002519	银河电子	56,141,960.02	18.80
23	002712	思美传媒	55,430,382.44	18.56
24	000983	西山煤电	54,917,197.71	18.39
25	002191	劲嘉股份	53,040,785.65	17.76
26	601333	广深铁路	52,383,560.42	17.54
27	000630	铜陵有色	52,289,152.24	17.51
28	600566	济川药业	50,989,649.93	17.07
29	002511	中顺洁柔	50,408,307.55	16.88
30	000021	深科技	50,155,723.98	16.79
31	300379	东方通	48,734,130.00	16.32
32	300326	凯利泰	48,565,447.29	16.26
33	002408	齐翔腾达	48,483,767.66	16.23
34	601555	东吴证券	48,355,503.46	16.19
35	600867	通化东宝	47,754,060.94	15.99
36	000650	仁和药业	45,524,138.58	15.24
37	000810	创维数字	44,557,687.12	14.92
38	000965	天保基建	43,879,111.87	14.69
39	601857	中国石油	43,838,024.20	14.68
40	002352	鼎泰新材	43,407,557.09	14.53
41	600151	航天机电	43,053,341.57	14.41
42	002361	神剑股份	42,807,425.76	14.33
43	601166	兴业银行	42,209,849.49	14.13
44	601669	中国电建	41,444,982.09	13.88
45	002727	一心堂	40,704,875.57	13.63
46	603128	华贸物流	40,315,421.74	13.50
47	002643	万润股份	38,976,593.28	13.05
48	603866	桃李面包	38,809,501.51	12.99
49	300177	中海达	38,697,929.71	12.96
50	600436	片仔癀	38,419,305.12	12.86
51	300098	高新兴	37,012,103.69	12.39
52	600348	阳泉煤业	36,063,622.56	12.07
53	002368	太极股份	34,505,267.45	11.55
54	600198	大唐电信	34,493,133.78	11.55
55	002036	联创电子	34,204,833.45	11.45
56	600066	宇通客车	34,167,578.65	11.44
57	600999	招商证券	34,071,228.66	11.41
58	600988	赤峰黄金	32,224,607.97	10.79
59	000895	双汇发展	32,038,410.62	10.73
60	600150	中国船舶	31,905,720.84	10.68
61	601288	农业银行	31,562,752.00	10.57

62	002372	伟星新材	31,391,127.75	10.51
63	600054	黄山旅游	30,598,611.49	10.24
64	601668	中国建筑	30,590,632.09	10.24
65	002502	骅威文化	30,573,120.26	10.24
66	300369	绿盟科技	30,432,699.96	10.19
67	600711	盛屯矿业	30,402,237.18	10.18
68	000980	金马股份	30,296,166.67	10.14
69	300244	迪安诊断	29,220,511.84	9.78
70	002371	七星电子	29,182,154.11	9.77
71	300310	宜通世纪	29,172,668.34	9.77
72	002736	国信证券	28,817,093.63	9.65
73	601118	海南橡胶	28,749,094.33	9.63
74	600409	三友化工	28,213,177.20	9.45
75	002648	卫星石化	27,716,170.95	9.28
76	000948	南天信息	27,654,780.73	9.26
77	300297	蓝盾股份	27,480,249.03	9.20
78	600990	四创电子	27,242,566.40	9.12
79	002155	湖南黄金	27,204,508.65	9.11
80	002048	宁波华翔	27,045,501.68	9.05
81	300088	长信科技	26,882,546.35	9.00
82	600755	厦门国贸	26,802,624.92	8.97
83	600376	首开股份	26,583,079.55	8.90
84	600879	航天电子	26,219,773.01	8.78
85	600998	九州通	26,138,126.64	8.75
86	002078	太阳纸业	25,804,240.85	8.64
87	000969	安泰科技	25,617,152.20	8.58
88	002445	中南文化	25,365,279.95	8.49
89	300041	回天新材	25,146,860.90	8.42
90	601699	潞安环能	24,905,804.04	8.34
91	000404	华意压缩	24,354,464.99	8.15
92	002655	共达电声	24,205,967.55	8.10
93	601088	中国神华	23,947,303.44	8.02
94	600756	浪潮软件	23,801,573.59	7.97
95	000558	莱茵体育	23,521,944.70	7.88
96	002234	民和股份	23,338,013.73	7.81
97	600497	驰宏锌锗	23,294,724.53	7.80
98	002338	奥普光电	23,222,965.36	7.78
99	601788	光大证券	23,160,402.74	7.75
100	000401	冀东水泥	23,012,276.28	7.70
101	300237	美晨科技	22,951,639.36	7.68
102	300365	恒华科技	22,688,709.70	7.60
103	603067	振华股份	22,677,721.25	7.59
104	600015	华夏银行	22,650,746.82	7.58
105	000639	西王食品	22,534,573.64	7.54

106	600303	曙光股份	22,038,022.73	7.38
107	600343	航天动力	21,746,074.12	7.28
108	600089	特变电工	21,509,507.40	7.20
109	300449	汉邦高科	21,450,022.01	7.18
110	601601	中国太保	21,388,262.91	7.16
111	600667	太极实业	21,344,406.49	7.15
112	600358	国旅联合	21,224,069.93	7.11
113	002726	龙大肉食	21,140,628.26	7.08
114	000065	北方国际	20,905,048.78	7.00
115	603658	安图生物	20,890,350.02	6.99
116	600416	湘电股份	20,777,745.90	6.96
117	300353	东土科技	20,777,139.36	6.96
118	002004	华邦健康	20,663,428.50	6.92
119	002099	海翔药业	20,613,439.79	6.90
120	000957	中通客车	20,455,670.64	6.85
121	002603	以岭药业	20,272,228.24	6.79
122	600826	兰生股份	19,985,986.81	6.69
123	000596	古井贡酒	19,957,859.19	6.68
124	600114	东睦股份	19,527,692.44	6.54
125	300498	温氏股份	19,047,054.07	6.38
126	000968	*ST 煤气	18,900,601.88	6.33
127	000423	东阿阿胶	18,834,694.84	6.31
128	601198	东兴证券	18,463,290.90	6.18
129	002456	欧菲光	18,385,622.56	6.16
130	601186	中国铁建	18,289,259.75	6.12
131	600359	新农开发	18,175,458.11	6.09
132	601636	旗滨集团	18,089,161.95	6.06
133	600547	山东黄金	18,036,817.39	6.04
134	000998	隆平高科	17,984,397.92	6.02
135	000603	盛达矿业	17,902,692.37	5.99
136	002439	启明星辰	17,880,122.35	5.99
137	300148	天舟文化	17,826,096.68	5.97
138	002329	皇氏集团	17,704,725.98	5.93
139	600340	华夏幸福	17,685,554.04	5.92
140	002548	金新农	17,678,474.39	5.92
141	000795	英洛华	17,618,069.06	5.90
142	601666	平煤股份	17,489,433.00	5.86
143	000587	金洲慈航	17,399,316.63	5.83
144	300336	新文化	17,371,649.02	5.82
145	600170	上海建工	17,278,235.56	5.78
146	002494	华斯股份	17,152,755.15	5.74
147	600648	外高桥	16,862,694.56	5.65
148	002574	明牌珠宝	16,769,186.99	5.61
149	600576	万家文化	16,680,856.89	5.58

150	002458	益生股份	16,479,147.97	5.52
151	600567	山鹰纸业	16,476,742.83	5.52
152	600511	国药股份	16,023,846.33	5.36
153	600108	亚盛集团	15,949,421.60	5.34
154	002714	牧原股份	15,894,418.62	5.32
155	600258	首旅酒店	15,740,157.29	5.27
156	601799	星宇股份	14,994,190.59	5.02
157	000063	中兴通讯	14,973,162.13	5.01
158	002452	长高集团	14,930,863.06	5.00
159	600535	天士力	14,888,516.31	4.98
160	600848	上海临港	14,735,784.74	4.93
161	002716	金贵银业	14,642,502.00	4.90
162	002077	大港股份	14,632,558.90	4.90
163	601233	桐昆股份	14,618,604.89	4.89
164	603799	华友钴业	14,589,765.08	4.88
165	300342	天银机电	14,172,634.26	4.75
166	002311	海大集团	13,960,613.09	4.67
167	600138	中青旅	13,833,262.11	4.63
168	002690	美亚光电	13,768,260.66	4.61
169	600211	西藏药业	13,747,197.65	4.60
170	002127	南极电商	13,476,604.17	4.51
171	002635	安洁科技	13,451,965.50	4.50
172	601997	贵阳银行	13,276,921.86	4.45
173	000402	金融街	13,186,962.38	4.42
174	000662	天夏智慧	13,128,328.23	4.40
175	002581	未名医药	13,117,256.99	4.39
176	600519	贵州茅台	13,115,820.21	4.39
177	000655	金岭矿业	13,038,646.30	4.37
178	601898	中煤能源	12,997,810.00	4.35
179	002709	天赐材料	12,891,471.17	4.32
180	002247	帝龙文化	12,764,160.78	4.27
181	000060	中金岭南	12,516,815.16	4.19
182	300196	长海股份	12,492,189.32	4.18
183	600027	华电国际	12,443,326.34	4.17
184	600104	上汽集团	12,376,858.44	4.14
185	002468	申通快递	12,285,680.50	4.11
186	000066	长城电脑	12,176,283.00	4.08
187	603868	飞科电器	11,973,905.88	4.01
188	300429	强力新材	11,887,090.00	3.98
189	603611	诺力股份	11,786,520.73	3.95
190	002343	慈文传媒	11,577,185.55	3.88
191	002626	金达威	11,554,610.50	3.87
192	300278	华昌达	11,429,646.40	3.83
193	300144	宋城演艺	11,340,939.23	3.80

194	000783	长江证券	11,188,620.75	3.75
195	300242	明家联合	11,167,142.69	3.74
196	300531	优博讯	11,124,861.45	3.72
197	600115	东方航空	11,026,497.00	3.69
198	002674	兴业科技	11,022,303.24	3.69
199	000661	长春高新	10,923,663.36	3.66
200	600183	生益科技	10,912,565.49	3.65
201	300230	永利股份	10,845,139.34	3.63
202	300406	九强生物	10,803,524.76	3.62
203	002094	青岛金王	10,677,988.56	3.58
204	603589	口子窖	10,512,599.81	3.52
205	002673	西部证券	10,508,488.51	3.52
206	000933	*ST 神火	10,502,740.00	3.52
207	002609	捷顺科技	10,488,024.18	3.51
208	000910	大亚圣象	10,457,572.98	3.50
209	002169	智光电气	10,440,230.35	3.50
210	600735	新华锦	10,384,833.15	3.48
211	002188	巴士在线	10,374,177.38	3.47
212	600362	江西铜业	10,348,908.90	3.46
213	002612	朗姿股份	10,292,611.05	3.45
214	300063	天龙集团	10,217,260.20	3.42
215	603636	南威软件	10,190,164.00	3.41
216	002335	科华恒盛	10,176,153.80	3.41
217	600363	联创光电	10,157,962.79	3.40
218	000418	小天鹅 A	10,068,214.30	3.37
219	600221	海南航空	9,990,523.00	3.34
220	600763	通策医疗	9,964,874.80	3.34
221	002025	航天电器	9,963,011.88	3.34
222	600050	中国联通	9,914,159.00	3.32
223	002056	横店东磁	9,895,195.08	3.31
224	601009	南京银行	9,716,836.11	3.25
225	600057	象屿股份	9,712,536.60	3.25
226	603899	晨光文具	9,624,170.96	3.22
227	300097	智云股份	9,567,112.41	3.20
228	002589	瑞康医药	9,565,207.08	3.20
229	600061	国投安信	9,448,121.91	3.16
230	000816	智慧农业	9,362,536.59	3.13
231	000733	振华科技	9,349,323.32	3.13
232	000429	粤高速 A	9,344,622.06	3.13
233	002601	佰利联	9,245,926.00	3.10
234	600266	北京城建	9,231,997.14	3.09
235	002087	新野纺织	9,056,267.85	3.03
236	000863	三湘印象	9,055,017.75	3.03
237	000488	晨鸣纸业	9,050,845.04	3.03

238	300014	亿纬锂能	9,006,894.31	3.02
239	000960	锡业股份	9,004,855.87	3.01
240	300358	楚天科技	8,963,986.19	3.00
241	002466	天齐锂业	8,941,691.52	2.99
242	300202	聚龙股份	8,913,314.52	2.98
243	600873	梅花生物	8,911,121.59	2.98
244	600110	诺德股份	8,889,248.25	2.98
245	000713	丰乐种业	8,875,186.29	2.97
246	002364	中恒电气	8,829,548.86	2.96
247	002137	麦达数字	8,816,846.38	2.95
248	002605	姚记扑克	8,755,247.61	2.93
249	300263	隆华节能	8,726,454.81	2.92
250	002070	众和股份	8,645,456.18	2.89
251	300221	银禧科技	8,620,721.64	2.89
252	300468	四方精创	8,547,798.40	2.86
253	600172	黄河旋风	8,470,564.63	2.84
254	002033	丽江旅游	8,433,600.49	2.82
255	600273	嘉化能源	8,402,462.49	2.81
256	300031	宝通科技	8,398,470.20	2.81
257	000890	法尔胜	8,345,954.28	2.79
258	600489	中金黄金	8,314,641.05	2.78
259	600797	浙大网新	8,274,854.76	2.77
260	002510	天汽模	8,273,380.21	2.77
261	002570	贝因美	8,192,247.83	2.74
262	600678	四川金顶	8,129,970.30	2.72
263	600589	广东榕泰	8,020,302.66	2.69
264	603268	松发股份	7,906,097.85	2.65
265	600705	中航资本	7,868,209.92	2.63
266	002196	方正电机	7,850,601.12	2.63
267	300116	坚瑞沃能	7,812,099.98	2.62
268	002533	金杯电工	7,747,271.40	2.59
269	603188	亚邦股份	7,730,597.01	2.59
270	002587	奥拓电子	7,704,248.30	2.58
271	000903	云内动力	7,674,697.00	2.57
272	002537	海立美达	7,540,355.12	2.52
273	002520	日发精机	7,504,086.48	2.51
274	002369	卓翼科技	7,437,858.40	2.49
275	300018	中元股份	7,304,124.00	2.45
276	300166	东方国信	7,185,831.69	2.41
277	600158	中体产业	7,079,956.61	2.37
278	600485	信威集团	7,072,300.56	2.37
279	002026	山东威达	6,970,754.31	2.33
280	600203	福日电子	6,961,256.00	2.33
281	300316	晶盛机电	6,951,736.36	2.33

282	000636	风华高科	6,793,361.82	2.27
283	600360	华微电子	6,704,599.76	2.24
284	601069	西部黄金	6,635,673.66	2.22
285	300010	立思辰	6,591,140.47	2.21
286	600074	保千里	6,586,182.26	2.21
287	600563	法拉电子	6,583,407.36	2.20
288	002340	格林美	6,578,000.17	2.20
289	600291	西水股份	6,561,652.85	2.20
290	002289	*ST 宇顺	6,560,112.74	2.20
291	300279	和晶科技	6,554,321.25	2.19
292	600048	保利地产	6,545,310.01	2.19
293	002284	亚太股份	6,521,040.64	2.18
294	000722	湖南发展	6,481,091.47	2.17
295	601390	中国中铁	6,469,195.99	2.17
296	600891	秋林集团	6,445,464.17	2.16
297	000876	新 希 望	6,426,194.64	2.15
298	000831	*ST 五稀	6,302,088.91	2.11
299	000597	东北制药	6,294,650.00	2.11
300	002688	金河生物	6,287,668.98	2.11
301	000990	诚志股份	6,210,389.01	2.08
302	000748	长城信息	6,171,535.04	2.07
303	300395	菲利华	6,157,633.97	2.06
304	002192	融捷股份	6,124,941.90	2.05
305	000612	焦作万方	6,110,249.30	2.05
306	603066	音飞储存	6,089,218.83	2.04
307	601789	宁波建工	6,024,400.75	2.02
308	300294	博雅生物	6,011,949.97	2.01

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

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	7,973,087,465.55
卖出股票的收入（成交）总额	7,541,982,628.54

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。

8.6 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。

8.7 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。

8.8 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。

8.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.9.1 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。

8.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.10.1 本期国债期货投资政策

无。

8.10.2 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。

8.10.3 本期国债期货投资评价

无。

8.11 投资组合报告附注

8.11.1 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。

8.11.2 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。

8.11.3 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	1,050,533.90

2	应收证券清算款	68,825.99
3	应收股利	-
4	应收利息	22,901.60
5	应收申购款	81,087.21
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,223,348.70

8.11.4 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。

8.11.5 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 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
10,287	70,799.80	510,179,122.89	70.05%	218,138,423.51	29.95%

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	52,303.25	0.01%

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(2011 年 4 月 22 日)基金份额总额	4,119,090,620.47
本报告期期初基金份额总额	174,319,163.98
本报告期基金总申购份额	3,218,644,083.11
减：本报告期基金总赎回份额	2,664,645,700.69
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	728,317,546.40

注：总申购份额含转换入份额。总赎回份额含转换出份额。

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本基金管理人重大人事变动如下：

2016 年 9 月 21 日，基金管理人发布了华安升级主题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的基金经理，饶晓鹏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。

报告年度应支付给聘任会计师事务所的报酬为人民币 68,000.00 元。

目前的审计机构已提供审计服务的连续年限：自基金合同生效日起至今。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内无管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

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	
国泰君安证券股份有限公司	1	2,017,900,024.59	13.01%	1,838,917.06	12.90%	-
方正证券股份有限公司	1	1,952,830,491.98	12.59%	1,779,615.65	12.48%	-
光大证券股份有限公司	1	1,551,107,578.04	10.00%	1,413,527.15	9.92%	-
广发证券股份有限公司	1	1,517,848,796.24	9.79%	1,413,567.03	9.92%	-
西南证券股份有限公司	1	1,271,540,912.48	8.20%	1,158,757.01	8.13%	-
申万宏源证券有限公司	3	1,095,468,281.37	7.06%	998,303.99	7.00%	-
上海证券有限责任公司	2	865,152,662.68	5.58%	788,415.21	5.53%	-
兴业证券股份有限公司	1	842,759,139.73	5.43%	784,862.63	5.51%	-
长江证券股份有限公司	1	791,147,648.57	5.10%	736,795.92	5.17%	-
海通证券股份有限公司	1	753,985,119.01	4.86%	702,185.81	4.93%	-
新时代证券有限责任公司	1	398,829,757.24	2.57%	371,429.36	2.61%	-
中信建投证券股份有限公司	1	382,415,928.83	2.47%	356,143.39	2.50%	-
华泰证券股份有限公司	1	378,948,755.72	2.44%	352,915.78	2.48%	-
东北证券股份有限公司	1	314,580,111.89	2.03%	292,965.97	2.05%	-
瑞银证券有限责任公司	1	298,540,425.34	1.92%	272,060.51	1.91%	-
天风证券有限责	2	238,079,834.39	1.54%	216,963.13	1.52%	-

任公司						
国盛证券有限责 任公司	1	207,097,478.72	1.34%	192,870.48	1.35%	-
中国银河证券股 份有限公司	1	164,816,212.08	1.06%	153,493.74	1.08%	-
中国国际金融有 限公司	1	130,014,698.25	0.84%	121,082.80	0.85%	-
广州证券有限责 任公司	2	75,902,787.63	0.49%	70,240.84	0.49%	-
招商证券股份有 限公司	3	74,509,865.06	0.48%	69,390.47	0.49%	-
国信证券股份有 限公司	1	73,886,445.05	0.48%	68,809.74	0.48%	-
湘财证券有限责 任公司	1	68,912,215.53	0.44%	62,799.82	0.44%	-
中信证券股份有 限公司	1	43,115,956.07	0.28%	40,153.69	0.28%	-
中泰证券股份有 限公司	1	-	-	-	-	-
万联证券有限责 任公司	1	-	-	-	-	-
华安证券有限责 任公司	1	-	-	-	-	-
中银国际证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
财达证券有限责 任公司	1	-	-	-	-	-
财富证券有限责 任公司	1	-	-	-	-	-
联讯证券有限责 任公司	1	-	-	-	-	-
中山证券有限责 任公司	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 2 月完成退租托管在建设银行的德邦证券上海 33187 交易单元

2016 年 3 月完成退租托管在建设银行的长城证券上海 27450 交易单元

2016 年 5 月完成租用托管在建设银行的申万宏源证券深圳 000793 交易单元

2016 年 9 月完成租用托管在建设银行的天津证券深圳 001624 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
天风证券有限责任公司	6,058,504.56	100.00%	-	-	-	-

华安基金管理有限公司

二〇一七年三月二十八日