

**华安智能装备主题股票型证券投资基金**  
**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：中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业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       | 华安智能装备主题股票         |
| 基金主代码      | 001072             |
| 交易代码       | 001072             |
| 基金运作方式     | 契约型开放式             |
| 基金合同生效日    | 2015 年 4 月 24 日    |
| 基金管理人      | 华安基金管理有限公司         |
| 基金托管人      | 中国农业银行股份有限公司       |
| 报告期末基金份额总额 | 1,494,149,307.29 份 |
| 基金合同存续期    | 不定期                |

### 2.2 基金产品说明

|        |                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
|--------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标   | 本基金重点投资于与智能装备相关的子行业或企业，在严格控制风险的前提下，力争把握该主题投资机会实现基金资产的长期稳健增值。                                                                                                                                                                                                                      |
| 投资策略   | 本基金采取相对稳定的资产配置策略，一般情况下将保持股票配置比例的相对稳定，避免因过于主动的仓位调整带来额外的风险。在大类资产配置过程中，本基金将使用定量与定性相结合的研究方法对宏观经济、国家政策、资金面和市场情绪等可能影响证券市场的重要因素进行研究和预测，结合使用公司自主研发的多因子动态资产配置模型、基于投资时钟理论的资产配置模型等经济模型，分析和比较股票、债券等市场和不同金融工具的风险收益特征，确定合适的资产配置比例，动态优化投资组合。个股选择方面主要通过对智能装备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 | 80%×中证 800 指数收益率+20%×中国债券总指数收益率。                                                                                                                                                                                                                                                  |
| 风险收益特征 | 本基金为股票型基金，基金的风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金，属于证券投资基金中的较高风险投资品种。                                                                                                                                                                                                                      |

## 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           | 中国农业银行股份有限公司       |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名   | 钱鲲                   | 林葛                 |
|             | 联系电话 | 021-38969999         | 010-66060069       |
|             | 电子邮箱 | qiankun@huaan.com.cn | tgxxpl@abchina.com |
| 客户服务电话      |      | 4008850099           | 95599              |
| 传真          |      | 021-68863414         | 010-68121816       |

## 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 4 月 24 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------------|--------------------------------------------|
| 本期已实现收益       | 61,895,377.91    | -178,361,474.76                            |
| 本期利润          | -264,582,968.71  | 103,956,095.32                             |
| 加权平均基金份额本期利润  | -0.1510          | 0.0387                                     |
| 本期基金份额净值增长率   | -15.53%          | 10.10%                                     |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2016 年末          | 2015 年末                                    |
| 期末可供分配基金份额利润  | -0.0698          | -0.0349                                    |
| 期末基金资产净值      | 1,389,820,397.76 | 1,927,334,952.56                           |
| 期末基金份额净值      | 0.930            | 1.101                                      |

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    | -3.13%   | 0.93%       | 0.21%      | 0.58%         | -3.34%  | 0.35% |
| 过去六个月    | -10.14%  | 0.95%       | 3.04%      | 0.63%         | -13.18% | 0.32% |
| 过去一年     | -15.53%  | 2.02%       | -10.98%    | 1.22%         | -4.55%  | 0.80% |
| 自基金成立起至今 | -7.00%   | 2.45%       | -22.67%    | 1.70%         | 15.67%  | 0.75% |

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。

### 3.2.2 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

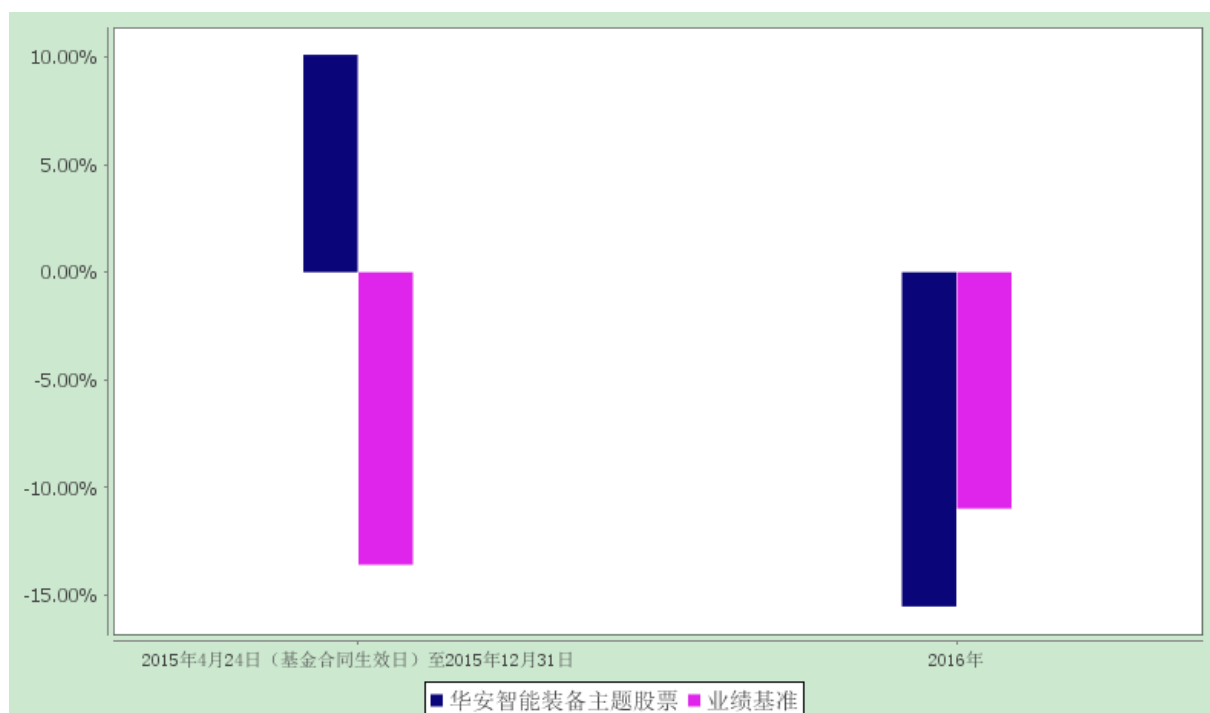
华安智能装备主题股票型证券投资基金  
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图  
 (2015 年 4 月 24 日至 2016 年 12 月 31 日)



### 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

华安智能装备主题股票型证券投资基金

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       |        |                                                                                                                                                                                             |
| 崔莹 | 本基金的基金经理 | 2015-06-18      | 2016-09-21 | 8 年    | 硕士，8 年从业经历。曾任齐鲁证券有限责任公司项目经理、太平洋保险集团总部资产负债匹配专员、中国中投证券行业分析师。2014 年 3 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 月同时担任本基金、华安媒体互联网混合型证券投资基金的基金经理。2015 年 6 月起担任华安逆向策略混合型证券投资基金的基金经理。 |
| 李欣 | 本基金的基金经理 | 2015-07-09      | -          | 7 年    | 硕士研究生，7 年证券、基金从业经验。曾任华泰联合证券有限责任公司研究员，2012 年 5 月加入华安基金，现任基金投资部基金经理。2015 年 7 月起担任本基金的基金经理。                                                                                                    |

注：此处的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日，即以公告日为准。证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守有关法律法规及《华安智能装备主题股票型证券投资基金基金合同》、《华安智能装备主题股票型证券投资基金招募说明书》等有关基金法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。除因 2015 年 11 月 12 日在买入广东华声电器股份有限公司（证券代码：002670）股票时操作失误，致使该股票价格出现异动，被中国证监会对此出具警示函以外，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 A 股市场出现了较大的波动和分化。市场年初出现熔断和大幅下跌, 随后进入震荡向上区间, 全年来看市场主要指数呈现负收益。成长、消费、周期等各种风格的行业和股票均有表现, 市场热点切换较快。

在年初的熔断和大跌中, 本基金净值承受了较大幅度的回撤; 上半年通过对新能源汽车、半导体等成长性行业的研究和投资, 业绩较快速回升; 下半年在市场风格切换至周期和价值股后, 本基金配置亦有调整, 但相对于上半年而言, 相对排名有所回落。

本基金认为, 传统行业的供给侧改革和新兴行业的创新发展是驱动我国经济升级换挡的双引擎, 智能装备相关行业在我国产业升级的进程中扮演重要角色。新兴产业覆盖面较广, 其中新能源车、半导体等产业在 2016 年出现了较大的投资机会, 本基金在全面研究的基础上进行了投资, 取得了一定的投资成效。新能源汽车对提升我国能源安全、改善环境质量、促进先进制造产业链发展有着重要的作用; 相对于传统汽车行业, 我国在新能源车产业链上更加具有机会实现弯道超车、建立全球产业竞争力。本基金在 2016 年上半年, 在新能源车的上中下游, 在材料、电芯、整车、充电设备等各个产业环节进行了配置, 取得了投资效果。半导体作为信息产业和工业自动化的基础器件, 其国产化进程关系到我国的信息安全和产业安全, 相关的设计、制造、材料等产业具有较好的发展机遇和投资价值, 本基金在对行业和上市公司较为全面充分的研究的基础上, 进行了投资, 取得了投资成效。

供给侧改革有效的改变了传统行业产能过剩、效率不高、污染较重的问题, 给钢铁、煤炭等行

业带来了行业整体经营效率的提升，改变了其供需格局，相关行业和上市公司也出现了较好的投资机遇，本基金基于研究，选择优质标的进行了投资。

2016 年同样也是消费领域出现产品升级、商业模式变化、竞争格局优化的一年，不论是白酒等传统消费品，还是教育、旅游等新兴消费，以及快递等受益于消费模式变化的行业，都出现了较好的投资机遇，本基金有选择性的进行了投资。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止至 2016 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 0.930 元，本报告期份额净值增长率为-15.53%，同期业绩比较基准增长率为-10.98%。

#### 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，本基金认为，国内经济在深化供给侧改革、推进一带一路等政策的推动下，在防控金融风险、推动资金脱虚向实等金融政策的指引下，将呈现出较为平稳的发展态势。相比之下，海外因素将具有较大的不确定性，给我国经济带来一些风险和干扰。

从需求角度看，叠加一带一路等政策，基建带来的固定资产投资增速有望维持在较高水平；房地产需求方面，虽然一二线城市受到限购限贷的影响，但城镇化进程仍然推动三四线城市的需求，预计全年地产投资略有增长；从消费角度看，全面二胎政策带来人口出生率拐点，改变了我国消费和经济发展长期增速预期，对于母婴、医疗健康、教育等领域的消费产生较大的拉动作用。

从供给角度看，坚定看好供给侧改革。供给侧改革的影响范围从钢铁、煤炭等传统行业向农业、中游制造业扩展。供给侧改革对相关行业的供需对比、营运效率等方面产生持续而深远的影响，有利于其盈利长期稳定在合理水平。

从金融政策角度看，金融服务实体经济、金融脱虚向实是政策主基调，我们预计以降风险、去杠杆为主要目标的监管风格仍会持续强化。内生式成长相对于外延式成长的价值更加凸显，对成长股市场偏好产生影响。

美国的贸易保护政策和法国等欧洲国家的政治经济格局潜在变化对全球经济带来了一定的不确定性，对我国的外贸、货币环境造成了一定的风险和干扰。美联储加息时点和市场对加息概率的预期变化是后续观测的重要变量。

本基金认为，2017 年我国宏观经济有较为坚实的基本面，虽然面临来自海外的不确定因素，但仍将呈现出稳定、较快的发展速度，带来较好的投资机会。

#### 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

在托管本基金的过程中,本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定,对本基金基金管理人—华安基金管理有限公司 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日基金的投资运作,进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督,认真履行了托管人的义务,没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为,华安基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上,不存在损害基金份额持有人利益的行为;在报告期内,严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 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

本托管人认为,华安基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定,基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整,未发现有损害基金持有人利益的行为。

## §6 审计报告

本报告期的基金财务会计报告经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)审计,注册会计师 蒋燕华 丁鹏飞签字出具了安永华明(2017)审字第 60971571\_B23 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:华安智能装备主题股票型证券投资基金

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        | 148,675,365.72          | 169,834,567.78           |
| 结算备付金       | 8,548,628.00            | 15,561,561.20            |
| 存出保证金       | 2,208,756.30            | 5,146,363.71             |
| 交易性金融资产     | 1,269,181,449.88        | 1,777,422,861.42         |
| 其中: 股票投资    | 1,268,562,525.64        | 1,777,422,861.42         |
| 基金投资        | -                       | -                        |
| 债券投资        | 618,924.24              | -                        |
| 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     | -                       | -                        |
| 应收利息        | 44,482.93               | 65,462.76                |
| 应收股利        | -                       | -                        |
| 应收申购款       | 149,796.05              | 5,327,019.57             |
| 递延所得税资产     | -                       | -                        |
| 其他资产        | -                       | -                        |
| <b>资产总计</b> | <b>1,428,808,478.88</b> | <b>1,973,357,836.44</b>  |
| 负债和所有者权益    | 本期末<br>2016 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>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     | 11,100,599.44           | 4,587,337.07             |

|                   |                         |                         |
|-------------------|-------------------------|-------------------------|
| 应付赎回款             | 19,690,370.45           | 28,418,656.62           |
| 应付管理人报酬           | 1,847,459.58            | 2,785,125.48            |
| 应付托管费             | 307,909.95              | 464,187.61              |
| 应付销售服务费           | -                       | -                       |
| 应付交易费用            | 5,532,538.30            | 9,302,225.45            |
| 应交税费              | -                       | -                       |
| 应付利息              | -                       | -                       |
| 应付利润              | -                       | -                       |
| 递延所得税负债           | -                       | -                       |
| 其他负债              | 509,203.40              | 465,351.65              |
| <b>负债合计</b>       | <b>38,988,081.12</b>    | <b>46,022,883.88</b>    |
| <b>所有者权益：</b>     | <b>-</b>                | <b>-</b>                |
| 实收基金              | 1,494,149,307.29        | 1,751,001,345.80        |
| 未分配利润             | -104,328,909.53         | 176,333,606.76          |
| <b>所有者权益合计</b>    | <b>1,389,820,397.76</b> | <b>1,927,334,952.56</b> |
| <b>负债和所有者权益总计</b> | <b>1,428,808,478.88</b> | <b>1,973,357,836.44</b> |

注：1.报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.930 元，基金份额总额 1,494,149,307.29 份。

2.本基金合同于 2015 年 4 月 24 日生效，上年度可比期间自 2015 年 4 月 24 日至 2015 年 12 月 31 日。

## 7.2 利润表

会计主体：华安智能装备主题股票型证券投资基金

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 4 月 24 日（基金合<br>同生效日）至 2015 年 12 月<br>31 日 |
|------|-------------------------------------------|--------------------------------------------------------------|
| 一、收入 | -193,345,134.99                           | 169,730,033.74                                               |

|                            |                        |                       |
|----------------------------|------------------------|-----------------------|
| 1.利息收入                     | 1,563,169.51           | 6,275,446.85          |
| 其中：存款利息收入                  | 1,562,419.48           | 3,567,589.25          |
| 债券利息收入                     | 750.03                 | -                     |
| 资产支持证券利息收入                 | -                      | -                     |
| 买入返售金融资产收入                 | -                      | 2,707,857.60          |
| 其他利息收入                     | -                      | -                     |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）           | 125,801,431.81         | -128,046,620.22       |
| 其中：股票投资收益                  | 120,552,820.39         | -130,769,794.92       |
| 基金投资收益                     | -                      | -                     |
| 债券投资收益                     | -                      | -                     |
| 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                       | 5,248,611.42           | 2,723,174.70          |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）      | -326,478,346.62        | 282,317,570.08        |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）          | -                      | -                     |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）          | 5,768,610.31           | 9,183,637.03          |
| <b>减：二、费用</b>              | <b>71,237,833.72</b>   | <b>65,773,938.42</b>  |
| 1. 管理人报酬                   | 24,559,228.64          | 25,347,559.57         |
| 2. 托管费                     | 4,093,204.86           | 4,224,593.37          |
| 3. 销售服务费                   | -                      | -                     |
| 4. 交易费用                    | 42,133,098.76          | 35,828,650.59         |
| 5. 利息支出                    | -                      | -                     |
| 其中：卖出回购金融资产支出              | -                      | -                     |
| 6. 其他费用                    | 452,301.46             | 373,134.89            |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> | <b>-264,582,968.71</b> | <b>103,956,095.32</b> |
| 减：所得税费用                    | -                      | -                     |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   | <b>-264,582,968.71</b> | <b>103,956,095.32</b> |

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安智能装备主题股票型证券投资基金

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）                        | 1,751,001,345.80                           | 176,333,606.76  | 1,927,334,952.56  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                                          | -264,582,968.71 | -264,582,968.71   |
| 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）      | -256,852,038.51                            | -16,079,547.58  | -272,931,586.09   |
| 其中：1.基金申购款                             | 888,652,413.76                             | -63,598,352.79  | 825,054,060.97    |
| 2.基金赎回款                                | -1,145,504,452.27                          | 47,518,805.21   | -1,097,985,647.06 |
| 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）                        | 1,494,149,307.29                           | -104,328,909.53 | 1,389,820,397.76  |
| 项目                                     | 上年度可比期间                                    |                 |                   |
|                                        | 2015 年 4 月 24 日（基金合同生效日）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）                        | 3,237,720,619.07                           | -               | 3,237,720,619.07  |

|                                        |                   |                |                   |
|----------------------------------------|-------------------|----------------|-------------------|
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                 | 103,956,095.32 | 103,956,095.32    |
| 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）      | -1,486,719,273.27 | 72,377,511.44  | -1,414,341,761.83 |
| 其中：1.基金申购款                             | 771,678,569.64    | -24,704,567.19 | 746,974,002.45    |
| 2.基金赎回款                                | -2,258,397,842.91 | 97,082,078.63  | -2,161,315,764.28 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | -                 | -              | -                 |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 1,751,001,345.80  | 176,333,606.76 | 1,927,334,952.56  |

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

华安智能装备主题股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)，系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[2015]207 号《关于准予华安智能装备主题股票型证券投资基金注册的批复》的核准，由基金管理人华安基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于 2015 年 4 月 24 日生效，首次设立募集规模为 3,237,720,619.07 份基金份额。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及注册登记机构为华安基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

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）、股指期货、债券、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

相关规定)。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

本基金的投资组合比例为:股票资产投资比例为基金资产的 80%-95%,其中,投资于智能装备相关的股票资产的比例不低于非现金基金资产的 80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

本基金业绩比较基准: 80%×中证 800 指数收益率+20%×中国债券总指数收益率。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)编制,同时,对于在具体会计核算和信息披露方面,也参考了中国证券投资基金业协会修订的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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>》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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于 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和净值变动情况。

#### 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

本基金本报告期无会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

## 7.4.6 税项

### 7.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

### 7.4.6.2 营业税、增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等

增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》的规定，2017 年 7 月 1 日（含）以后，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在 2017 年 7 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

#### 7.4.6.3 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

#### 7.4.6.4 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《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》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按 25% 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；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《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》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

#### 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 |
| 中国农业银行股份有限公司(“农业银行”) | 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

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

###### 7.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

###### 7.4.8.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

###### 7.4.8.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行回购交易。

###### 7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

#### 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4月24日（基金合同<br>生效日）至2015年12月31<br>日 |
|-----------------|---------------------------------|----------------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 24,559,228.64                   | 25,347,559.57                                      |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 10,718,507.10                   | 11,477,849.02                                      |

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.50%的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

##### 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4月24日（基金合同<br>生效日）至2015年12月31<br>日 |
|----------------|---------------------------------|----------------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 4,093,204.86                    | 4,224,593.37                                       |

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25%的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。

若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日。

### 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

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

### 7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

#### 7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

#### 7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资本基金。

### 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4月24日（基金合同生效日）<br>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       |
| 农业银行  | 148,675,365.72              | 1,320,621.97 | 169,834,567.78                                 | 3,316,789.57 |

### 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。

### 7.4.9 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 |
| 601375              | 中原证券 | 2016-12-20 | 2017-01-03 | 认购新发   | 4.00 | 4.00   | 26,695.00 | 106,780.00 | 106,780.00 | -  |

|        |      |            |            | 证券     |       |       |          |           |           |   |
|--------|------|------------|------------|--------|-------|-------|----------|-----------|-----------|---|
| 603032 | 德新交运 | 2016-12-27 | 2017-01-05 | 认购新发证券 | 5.81  | 5.81  | 1,628.00 | 9,458.68  | 9,458.68  | - |
| 603035 | 常熟汽饰 | 2016-12-27 | 2017-01-05 | 认购新发证券 | 10.44 | 10.44 | 2,316.00 | 24,179.04 | 24,179.04 | - |
| 603186 | 华正新材 | 2016-12-26 | 2017-01-03 | 认购新发证券 | 5.37  | 5.37  | 1,874.00 | 10,063.38 | 10,063.38 | - |
| 603228 | 景旺电子 | 2016-12-28 | 2017-01-06 | 认购新发证券 | 23.16 | 23.16 | 3,491.00 | 80,851.56 | 80,851.56 | - |
| 603266 | 天龙股份 | 2016-12-30 | 2017-01-10 | 认购新发证券 | 14.63 | 14.63 | 1,562.00 | 22,852.06 | 22,852.06 | - |
| 603689 | 皖天燃气 | 2016-12-30 | 2017-01-10 | 认购新发证券 | 7.87  | 7.87  | 4,818.00 | 37,917.66 | 37,917.66 | - |
| 603877 | 太平鸟  | 2016-12-29 | 2017-01-09 | 认购新发证券 | 21.30 | 21.30 | 3,180.00 | 67,734.00 | 67,734.00 | - |
| 002838 | 道恩股份 | 2016-12-28 | 2017-01-06 | 认购新发证券 | 15.28 | 15.28 | 682.00   | 10,420.96 | 10,420.96 | - |
| 002840 | 华统股份 | 2016-12-29 | 2017-01-10 | 认购新发证券 | 6.55  | 6.55  | 1,814.00 | 11,881.70 | 11,881.70 | - |
| 300583 | 赛托生物 | 2016-12-29 | 2017-01-06 | 认购新发证券 | 40.29 | 40.29 | 1,582.00 | 63,738.78 | 63,738.78 | - |
| 300586 | 美联新材 | 2016-12-26 | 2017-01-04 | 认购新发证券 | 9.30  | 9.30  | 1,006.00 | 9,355.80  | 9,355.80  | - |
| 300587 | 天铁股份 | 2016-12-28 | 2017-01-05 | 认购新发证券 | 14.11 | 14.11 | 1,438.00 | 20,290.18 | 20,290.18 | - |
| 300588 | 熙菱信息 | 2016-12-27 | 2017-01-05 | 认购新发证券 | 4.94  | 4.94  | 1,380.00 | 6,817.20  | 6,817.20  | - |
| 300591 | 万里马  | 2016-12-30 | 2017-01-10 | 认购新发证券 | 3.07  | 3.07  | 2,397.00 | 7,358.79  | 7,358.79  | - |

#### 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<br>值单价 | 复牌<br>日期   | 复牌<br>开<br>盘单<br>价 | 数量<br>(单位：股) | 期末<br>成本总额    | 期末<br>估值总额    | 备注 |
|----------|----------|------------|----------|------------|------------|--------------------|--------------|---------------|---------------|----|
| 603986   | 兆易创新     | 2016-09-19 | 筹划重大事项   | 177.97     | 2017-03-13 | 195.77             | 1,133.00     | 26,353.58     | 201,640.01    | -  |
| 002635   | 安洁科技     | 2016-11-08 | 筹划重大事项   | 36.40      | 2017-02-08 | 33.50              | 401,700.00   | 14,652,992.01 | 14,621,880.00 | -  |
| 300223   | 北京君正     | 2016-12-19 | 筹划重大事项   | 48.40      | -          | -                  | 782,903.00   | 25,146,341.89 | 37,892,505.20 | -  |
| 300537   | 广信材料     | 2016-10-12 | 筹划重大事项   | 48.79      | 2017-01-13 | 43.91              | 1,024.00     | 9,410.56      | 49,960.96     | -  |

#### 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

截至本报告期末 2016 年 12 月 31 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

##### 7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 12 月 31 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 7.4.14.1 公允价值

##### 7.4.14.1.1 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贷款和应收款项以及其他金融负债，其因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

##### 7.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

##### 7.4.14.1.2.1 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

第一层次的余额为人民币 1,215,925,763.92 元，属于第二层次的余额为人民币 53,255,685.96 元，无属于第三层次余额。

于 2015 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币 1,621,579,521.10 元，属于第二层次的余额为人民币 155,843,340.32 元，无属于第三层次余额。

#### 7.4.14.1.2.2 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可转换债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别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不将相关股票和可转换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，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。

#### 7.4.14.1.2.3 第三层次公允价值余额和本期变动金额

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工具第三层次公允价值本期未发生变动。

#### 7.4.14.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

#### 7.4.14.3 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

#### 7.4.14.4 财务报表的批准

本财务报表已于 2017 年 3 月 24 日经本基金的基金管理人批准。

## §8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产 |
|----|----|----|--------|
|----|----|----|--------|

|   |                   |                  | 的比例 (%) |
|---|-------------------|------------------|---------|
| 1 | 权益投资              | 1,268,562,525.64 | 88.78   |
|   | 其中：股票             | 1,268,562,525.64 | 88.78   |
| 2 | 固定收益投资            | 618,924.24       | 0.04    |
|   | 其中：债券             | 618,924.24       | 0.04    |
|   | 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      | 157,223,993.72   | 11.00   |
| 7 | 其他各项资产            | 2,403,035.28     | 0.17    |
| 8 | 合计                | 1,428,808,478.88 | 100.00  |

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别             | 公允价值（元）        | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------------------|----------------|---------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | 9,821,369.00   | 0.71          |
| B  | 采矿业              | 53,368,940.44  | 3.84          |
| C  | 制造业              | 752,726,820.89 | 54.16         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 37,917.66      | 0.00          |
| E  | 建筑业              | 108,679,874.63 | 7.82          |
| F  | 批发和零售业           | 43,515,592.60  | 3.13          |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 8,298,401.68   | 0.60          |
| H  | 住宿和餐饮业           | -              | -             |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 48,380,283.50  | 3.48          |

|   |               |                  |       |
|---|---------------|------------------|-------|
| J | 金融业           | 169,671,058.50   | 12.21 |
| K | 房地产业          | 47,639,906.74    | 3.43  |
| L | 租赁和商务服务业      | 14,733,450.00    | 1.06  |
| 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            | 11,688,910.00    | 0.84  |
|   | 合计            | 1,268,562,525.64 | 91.28 |

### 8.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

无。

### 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  | 002120 | 新海股份 | 2,190,960 | 110,424,384.00 | 7.95             |
| 2  | 300227 | 光韵达  | 2,449,259 | 60,986,549.10  | 4.39             |
| 3  | 300458 | 全志科技 | 465,858   | 42,593,396.94  | 3.06             |
| 4  | 000065 | 北方国际 | 1,430,168 | 38,757,552.80  | 2.79             |
| 5  | 300223 | 北京君正 | 782,903   | 37,892,505.20  | 2.73             |
| 6  | 601328 | 交通银行 | 6,506,550 | 37,542,793.50  | 2.70             |
| 7  | 002236 | 大华股份 | 2,526,231 | 34,558,840.08  | 2.49             |
| 8  | 002341 | 新纶科技 | 1,461,009 | 30,812,679.81  | 2.22             |
| 9  | 000651 | 格力电器 | 1,185,082 | 29,176,718.84  | 2.10             |
| 10 | 002371 | 七星电子 | 1,046,563 | 27,838,575.80  | 2.00             |

### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称  | 本期累计买入金额       | 占期初基金资产净值比例<br>(%) |
|----|--------|-------|----------------|--------------------|
| 1  | 002456 | 欧菲光   | 233,313,307.79 | 12.11              |
| 2  | 002371 | 七星电子  | 203,033,093.67 | 10.53              |
| 3  | 600898 | 三联商社  | 128,604,477.35 | 6.67               |
| 4  | 300322 | 硕贝德   | 122,697,378.87 | 6.37               |
| 5  | 600198 | 大唐电信  | 120,110,124.51 | 6.23               |
| 6  | 002120 | 韵达股份  | 115,692,557.30 | 6.00               |
| 7  | 002045 | 国光电器  | 113,410,003.78 | 5.88               |
| 8  | 002535 | 林州重机  | 110,751,720.23 | 5.75               |
| 9  | 300310 | 宜通世纪  | 110,384,579.66 | 5.73               |
| 10 | 002236 | 大华股份  | 110,192,942.05 | 5.72               |
| 11 | 601668 | 中国建筑  | 109,452,486.30 | 5.68               |
| 12 | 300183 | 东软载波  | 107,295,050.80 | 5.57               |
| 13 | 000779 | 三毛派神  | 105,701,878.53 | 5.48               |
| 14 | 300458 | 全志科技  | 100,871,642.90 | 5.23               |
| 15 | 300037 | 新宙邦   | 94,309,130.65  | 4.89               |
| 16 | 002475 | 立讯精密  | 93,786,669.44  | 4.87               |
| 17 | 002070 | 众和股份  | 93,375,360.56  | 4.84               |
| 18 | 002008 | 大族激光  | 90,551,381.77  | 4.70               |
| 19 | 300433 | 蓝思科技  | 88,954,121.71  | 4.62               |
| 20 | 600885 | 宏发股份  | 88,736,386.46  | 4.60               |
| 21 | 002036 | 联创电子  | 86,895,242.81  | 4.51               |
| 22 | 600884 | 杉杉股份  | 85,685,451.31  | 4.45               |
| 23 | 300231 | 银信科技  | 85,139,176.17  | 4.42               |
| 24 | 300316 | 晶盛机电  | 83,672,285.21  | 4.34               |
| 25 | 600525 | 长园集团  | 83,239,029.35  | 4.32               |
| 26 | 600459 | 贵研铂业  | 82,733,776.58  | 4.29               |
| 27 | 603026 | 石大胜华  | 82,447,416.94  | 4.28               |
| 28 | 600303 | 曙光股份  | 80,998,992.73  | 4.20               |
| 29 | 002185 | 华天科技  | 80,989,683.38  | 4.20               |
| 30 | 002245 | 澳洋顺昌  | 79,728,847.15  | 4.14               |
| 31 | 300365 | 恒华科技  | 78,692,477.49  | 4.08               |
| 32 | 002594 | 比亚迪   | 78,483,794.16  | 4.07               |
| 33 | 000050 | 深天马 A | 77,693,004.59  | 4.03               |
| 34 | 000049 | 德赛电池  | 74,999,612.76  | 3.89               |
| 35 | 002077 | 大港股份  | 74,538,813.01  | 3.87               |
| 36 | 600219 | 南山铝业  | 73,676,145.93  | 3.82               |
| 37 | 600869 | 智慧能源  | 73,365,297.46  | 3.81               |
| 38 | 000063 | 中兴通讯  | 71,917,802.43  | 3.73               |
| 39 | 002222 | 福晶科技  | 71,020,720.75  | 3.68               |

|    |        |        |               |      |
|----|--------|--------|---------------|------|
| 40 | 000625 | 长安汽车   | 66,712,309.03 | 3.46 |
| 41 | 002325 | 洪涛股份   | 66,605,656.86 | 3.46 |
| 42 | 600895 | 张江高科   | 65,318,760.27 | 3.39 |
| 43 | 600584 | 长电科技   | 64,145,047.57 | 3.33 |
| 44 | 000606 | *ST 易桥 | 63,564,034.76 | 3.30 |
| 45 | 002449 | 国星光电   | 63,383,438.87 | 3.29 |
| 46 | 600547 | 山东黄金   | 62,609,316.38 | 3.25 |
| 47 | 002643 | 万润股份   | 61,878,525.95 | 3.21 |
| 48 | 600489 | 中金黄金   | 61,829,044.57 | 3.21 |
| 49 | 300319 | 麦捷科技   | 61,570,723.70 | 3.19 |
| 50 | 600048 | 保利地产   | 61,284,801.23 | 3.18 |
| 51 | 000065 | 北方国际   | 61,253,770.33 | 3.18 |
| 52 | 300227 | 光韵达    | 60,917,205.71 | 3.16 |
| 53 | 300400 | 劲拓股份   | 60,232,168.55 | 3.13 |
| 54 | 002362 | 汉王科技   | 59,221,069.09 | 3.07 |
| 55 | 300097 | 智云股份   | 59,090,513.50 | 3.07 |
| 56 | 300115 | 长盈精密   | 56,625,943.18 | 2.94 |
| 57 | 002281 | 光迅科技   | 55,266,632.09 | 2.87 |
| 58 | 002452 | 长高集团   | 54,658,847.39 | 2.84 |
| 59 | 000333 | 美的集团   | 54,162,361.27 | 2.81 |
| 60 | 300327 | 中颖电子   | 54,041,557.31 | 2.80 |
| 61 | 000630 | 铜陵有色   | 53,389,364.43 | 2.77 |
| 62 | 600666 | 奥瑞德    | 52,795,674.25 | 2.74 |
| 63 | 600240 | 华业资本   | 52,467,413.42 | 2.72 |
| 64 | 600114 | 东睦股份   | 51,286,284.38 | 2.66 |
| 65 | 601636 | 旗滨集团   | 50,760,589.48 | 2.63 |
| 66 | 000060 | 中金岭南   | 50,245,735.94 | 2.61 |
| 67 | 000970 | 中科三环   | 50,035,090.72 | 2.60 |
| 68 | 002049 | 紫光国芯   | 49,383,797.39 | 2.56 |
| 69 | 600183 | 生益科技   | 49,120,776.80 | 2.55 |
| 70 | 300302 | 同有科技   | 49,101,071.60 | 2.55 |
| 71 | 002384 | 东山精密   | 48,477,732.19 | 2.52 |
| 72 | 601618 | 中国中冶   | 48,440,829.00 | 2.51 |
| 73 | 600000 | 浦发银行   | 48,373,564.67 | 2.51 |
| 74 | 600038 | 中直股份   | 47,743,036.80 | 2.48 |
| 75 | 600360 | 华微电子   | 47,070,813.60 | 2.44 |
| 76 | 300102 | 乾照光电   | 46,996,736.38 | 2.44 |
| 77 | 600782 | 新钢股份   | 46,763,735.28 | 2.43 |
| 78 | 002709 | 天赐材料   | 46,699,944.21 | 2.42 |
| 79 | 300223 | 北京君正   | 46,047,538.15 | 2.39 |
| 80 | 600136 | 当代明诚   | 44,914,214.37 | 2.33 |
| 81 | 002410 | 广联达    | 44,269,810.48 | 2.30 |
| 82 | 603799 | 华友钴业   | 44,098,747.77 | 2.29 |
| 83 | 001979 | 招商蛇口   | 44,049,300.68 | 2.29 |

|    |        |      |               |      |
|----|--------|------|---------------|------|
| 84 | 600576 | 万家文化 | 42,966,005.39 | 2.23 |
| 85 | 603869 | 北部湾旅 | 42,757,643.19 | 2.22 |
| 86 | 000651 | 格力电器 | 42,261,610.21 | 2.19 |
| 87 | 000413 | 东旭光电 | 42,075,780.08 | 2.18 |
| 88 | 300469 | 信息发展 | 41,565,003.60 | 2.16 |
| 89 | 002341 | 新纶科技 | 40,893,377.09 | 2.12 |
| 90 | 002640 | 跨境通  | 40,499,479.66 | 2.10 |
| 91 | 601328 | 交通银行 | 40,118,507.50 | 2.08 |
| 92 | 002023 | 海特高新 | 39,884,515.84 | 2.07 |
| 93 | 300202 | 聚龙股份 | 39,641,735.04 | 2.06 |
| 94 | 002055 | 得润电子 | 39,633,325.34 | 2.06 |
| 95 | 600232 | 金鹰股份 | 39,373,056.79 | 2.04 |
| 96 | 000886 | 海南高速 | 39,146,986.49 | 2.03 |
| 97 | 600207 | 安彩高科 | 39,128,907.11 | 2.03 |
| 98 | 600741 | 华域汽车 | 38,676,093.72 | 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<br>(%) |
|----|--------|------|----------------|--------------------|
| 1  | 002456 | 欧菲光  | 270,131,098.07 | 14.02              |
| 2  | 002371 | 七星电子 | 210,603,217.02 | 10.93              |
| 3  | 300083 | 劲胜精密 | 144,728,543.17 | 7.51               |
| 4  | 600198 | 大唐电信 | 136,668,410.69 | 7.09               |
| 5  | 300322 | 硕贝德  | 125,043,298.23 | 6.49               |
| 6  | 600898 | 三联商社 | 118,559,709.77 | 6.15               |
| 7  | 002045 | 国光电器 | 117,615,295.92 | 6.10               |
| 8  | 300183 | 东软载波 | 114,578,181.55 | 5.94               |
| 9  | 002070 | 众和股份 | 113,411,101.91 | 5.88               |
| 10 | 601668 | 中国建筑 | 109,614,658.88 | 5.69               |
| 11 | 300316 | 晶盛机电 | 98,946,883.02  | 5.13               |
| 12 | 002077 | 大港股份 | 97,807,871.22  | 5.07               |
| 13 | 300037 | 新宙邦  | 95,107,965.16  | 4.93               |
| 14 | 000779 | 三毛派神 | 94,598,466.57  | 4.91               |
| 15 | 002236 | 大华股份 | 93,650,531.83  | 4.86               |
| 16 | 600869 | 智慧能源 | 91,813,105.44  | 4.76               |
| 17 | 300310 | 宜通世纪 | 91,576,596.49  | 4.75               |
| 18 | 300458 | 全志科技 | 90,908,839.92  | 4.72               |
| 19 | 300433 | 蓝思科技 | 89,901,352.44  | 4.66               |

|    |        |        |               |      |
|----|--------|--------|---------------|------|
| 20 | 600459 | 贵研铂业   | 87,789,355.47 | 4.55 |
| 21 | 002008 | 大族激光   | 87,655,581.99 | 4.55 |
| 22 | 002036 | 联创电子   | 86,816,703.03 | 4.50 |
| 23 | 600207 | 安彩高科   | 84,956,768.77 | 4.41 |
| 24 | 000050 | 深天马 A  | 83,010,543.24 | 4.31 |
| 25 | 600884 | 杉杉股份   | 82,569,069.10 | 4.28 |
| 26 | 002475 | 立讯精密   | 81,561,594.75 | 4.23 |
| 27 | 600885 | 宏发股份   | 80,926,289.20 | 4.20 |
| 28 | 002245 | 澳洋顺昌   | 80,517,902.61 | 4.18 |
| 29 | 002594 | 比亚迪    | 79,792,832.55 | 4.14 |
| 30 | 300231 | 银信科技   | 79,190,854.87 | 4.11 |
| 31 | 002535 | 林州重机   | 78,647,624.53 | 4.08 |
| 32 | 600219 | 南山铝业   | 78,286,149.09 | 4.06 |
| 33 | 603026 | 石大胜华   | 77,868,608.00 | 4.04 |
| 34 | 000049 | 德赛电池   | 77,638,524.31 | 4.03 |
| 35 | 300113 | 顺网科技   | 76,437,387.28 | 3.97 |
| 36 | 600525 | 长园集团   | 76,277,885.25 | 3.96 |
| 37 | 600303 | 曙光股份   | 75,090,559.53 | 3.90 |
| 38 | 000063 | 中兴通讯   | 72,864,573.53 | 3.78 |
| 39 | 002222 | 福晶科技   | 71,887,598.90 | 3.73 |
| 40 | 300346 | 南大光电   | 71,504,588.54 | 3.71 |
| 41 | 300327 | 中颖电子   | 69,961,663.52 | 3.63 |
| 42 | 002449 | 国星光电   | 69,680,883.87 | 3.62 |
| 43 | 600360 | 华微电子   | 69,637,192.41 | 3.61 |
| 44 | 002196 | 方正电机   | 68,975,082.39 | 3.58 |
| 45 | 600584 | 长电科技   | 68,893,715.42 | 3.57 |
| 46 | 300097 | 智云股份   | 68,273,821.52 | 3.54 |
| 47 | 000625 | 长安汽车   | 68,218,680.31 | 3.54 |
| 48 | 002643 | 万润股份   | 67,075,891.77 | 3.48 |
| 49 | 600547 | 山东黄金   | 66,417,531.12 | 3.45 |
| 50 | 600895 | 张江高科   | 64,851,182.09 | 3.36 |
| 51 | 300319 | 麦捷科技   | 63,750,070.10 | 3.31 |
| 52 | 002362 | 汉王科技   | 62,034,827.61 | 3.22 |
| 53 | 000606 | *ST 易桥 | 61,392,720.56 | 3.19 |
| 54 | 300365 | 恒华科技   | 61,283,625.81 | 3.18 |
| 55 | 002612 | 朗姿股份   | 60,973,531.14 | 3.16 |
| 56 | 300236 | 上海新阳   | 60,530,530.65 | 3.14 |
| 57 | 600460 | 士兰微    | 60,526,201.62 | 3.14 |
| 58 | 300367 | 东方网力   | 60,299,738.73 | 3.13 |
| 59 | 002185 | 华天科技   | 59,844,873.07 | 3.11 |
| 60 | 000630 | 铜陵有色   | 59,331,023.14 | 3.08 |
| 61 | 600048 | 保利地产   | 58,538,233.09 | 3.04 |
| 62 | 002281 | 光迅科技   | 57,187,971.45 | 2.97 |
| 63 | 300115 | 长盈精密   | 54,694,611.55 | 2.84 |

|     |        |       |               |      |
|-----|--------|-------|---------------|------|
| 64  | 002049 | 紫光国芯  | 54,385,675.77 | 2.82 |
| 65  | 601636 | 旗滨集团  | 53,254,819.16 | 2.76 |
| 66  | 600666 | 奥瑞德   | 52,657,395.68 | 2.73 |
| 67  | 600556 | ST 慧球 | 52,395,402.04 | 2.72 |
| 68  | 002709 | 天赐材料  | 51,311,128.58 | 2.66 |
| 69  | 601618 | 中国中冶  | 50,275,569.00 | 2.61 |
| 70  | 300400 | 劲拓股份  | 49,834,108.34 | 2.59 |
| 71  | 603799 | 华友钴业  | 49,298,095.29 | 2.56 |
| 72  | 600183 | 生益科技  | 48,770,362.00 | 2.53 |
| 73  | 000060 | 中金岭南  | 48,484,654.23 | 2.52 |
| 74  | 000333 | 美的集团  | 48,317,339.85 | 2.51 |
| 75  | 000970 | 中科三环  | 48,141,805.86 | 2.50 |
| 76  | 600038 | 中直股份  | 48,129,569.30 | 2.50 |
| 77  | 000413 | 东旭光电  | 46,844,693.44 | 2.43 |
| 78  | 300302 | 同有科技  | 46,331,035.81 | 2.40 |
| 79  | 300102 | 乾照光电  | 45,329,121.71 | 2.35 |
| 80  | 600232 | 金鹰股份  | 45,305,589.47 | 2.35 |
| 81  | 001979 | 招商蛇口  | 44,875,692.36 | 2.33 |
| 82  | 002384 | 东山精密  | 44,374,981.16 | 2.30 |
| 83  | 300469 | 信息发展  | 43,900,998.24 | 2.28 |
| 84  | 002179 | 中航光电  | 42,540,510.83 | 2.21 |
| 85  | 300202 | 聚龙股份  | 42,033,105.06 | 2.18 |
| 86  | 603869 | 北部湾旅  | 41,985,401.29 | 2.18 |
| 87  | 002410 | 广联达   | 41,458,748.82 | 2.15 |
| 88  | 002452 | 长高集团  | 41,120,833.20 | 2.13 |
| 89  | 600000 | 浦发银行  | 41,108,884.00 | 2.13 |
| 90  | 002340 | 格林美   | 40,888,829.06 | 2.12 |
| 91  | 002325 | 洪涛股份  | 40,589,074.97 | 2.11 |
| 92  | 002329 | 皇氏集团  | 40,474,220.69 | 2.10 |
| 93  | 300041 | 回天新材  | 40,461,881.36 | 2.10 |
| 94  | 600741 | 华域汽车  | 40,311,728.19 | 2.09 |
| 95  | 300036 | 超图软件  | 40,302,528.79 | 2.09 |
| 96  | 600576 | 万家文化  | 39,881,798.25 | 2.07 |
| 97  | 002023 | 海特高新  | 39,835,580.52 | 2.07 |
| 98  | 300241 | 瑞丰光电  | 38,810,256.02 | 2.01 |
| 99  | 600240 | 华业资本  | 38,699,754.86 | 2.01 |
| 100 | 600831 | 广电网络  | 38,653,711.21 | 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 | 13,782,693,919.55 |
|---------------|-------------------|

|               |                   |
|---------------|-------------------|
| 卖出股票的收入（成交）总额 | 14,085,558,204.86 |
|---------------|-------------------|

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种      | 公允价值       | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | -          | -            |
| 2  | 央行票据      | -          | -            |
| 3  | 金融债券      | -          | -            |
|    | 其中：政策性金融债 | -          | -            |
| 4  | 企业债券      | -          | -            |
| 5  | 企业短期融资券   | -          | -            |
| 6  | 中期票据      | -          | -            |
| 7  | 可转债（可交换债） | 618,924.24 | 0.04         |
| 8  | 同业存单      | -          | -            |
| 9  | 其他        | -          | -            |
| 10 | 合计        | 618,924.24 | 0.04         |

## 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码   | 债券名称 | 数量(张) | 公允价值       | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|-------|------------|--------------|
| 1  | 128013 | 洪涛转债 | 5,484 | 618,924.24 | 0.04         |

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

## 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证投资。

## 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。若本基金投资股指期货，本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。

本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。

本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。

法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的，本基金将按法律法规的规定执行。

## 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

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 8.11.3 本期国债期货投资评价

无。

## 8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查的，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

8.12.2 本基金投资的前十名股票中，不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称      | 金额           |
|----|---------|--------------|
| 1  | 存出保证金   | 2,208,756.30 |
| 2  | 应收证券清算款 | -            |
| 3  | 应收股利    | -            |
| 4  | 应收利息    | 44,482.93    |
| 5  | 应收申购款   | 149,796.05   |
| 6  | 其他应收款   | -            |
| 7  | 待摊费用    | -            |
| 8  | 其他      | -            |
| 9  | 合计      | 2,403,035.28 |

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值   | 占基金资产净值比例(%) | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|---------------|--------------|----------|
| 1  | 300223 | 北京君正 | 37,892,505.20 | 2.73         | 筹划重大事项   |

## §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 | 持有份额  | 占总份额 |

|        |           |              |       |                  |        |
|--------|-----------|--------------|-------|------------------|--------|
|        |           |              | 比例    |                  | 比例     |
| 37,140 | 40,230.19 | 4,865,280.11 | 0.33% | 1,489,284,027.18 | 99.67% |

## 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 | 35,254.05 | 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(2015 年 4 月 24 日)基金份额总额 | 3,237,720,619.07 |
| 本报告期期初基金份额总额                   | 1,751,001,345.80 |
| 本报告期基金总申购份额                    | 888,652,413.76   |
| 减：本报告期基金总赎回份额                  | 1,145,504,452.27 |
| 本报告期基金拆分变动份额                   | -                |
| 本报告期期末基金份额总额                   | 1,494,149,307.29 |

## §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智能装备主题股票型证券投资基金基金经理变更公告，崔莹先生不再担任本基金基金经理，李欣先生继续担任本基金基金经理。

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：

本基金托管人的专门基金托管部门本报告期内未发生重大人事变动。

### 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情况：100,000.00 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<br>单元<br>数量 | 股票交易             |              | 应支付该券商的佣金    |            | 备注 |
|--------------|----------------|------------------|--------------|--------------|------------|----|
|              |                | 成交金额             | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金           | 占当期佣金总量的比例 |    |
| 安信证券股份有限公司   | 1              | 7,166,211,485.56 | 25.72%       | 6,530,576.48 | 25.53%     | -  |
| 长江证券股份有限公司   | 1              | 7,031,044,346.86 | 25.24%       | 6,407,399.61 | 25.05%     | -  |
| 中信建投证券有限责任公司 | 1              | 5,593,058,682.15 | 20.08%       | 5,208,826.85 | 20.37%     | -  |
| 招商证券股份有限公司   | 2              | 4,559,832,133.12 | 16.37%       | 4,203,311.29 | 16.43%     | -  |
| 中信证券股份有限公司   | 2              | 3,510,552,191.34 | 12.60%       | 3,225,941.86 | 12.61%     | -  |

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 3 月完成租用托管在农业银行租用长江证券深圳 000869 交易单元。

## §12 影响投资者决策的其他重要信息

无。

二〇一七年三月二十八日