

**华安中小盘成长混合型证券投资基金**  
**2016 年年度报告**  
**2016 年 12 月 31 日**

基金管理人：华安基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一七年三月二十八日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 3 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

|                                         |    |
|-----------------------------------------|----|
| <b>§1 重要提示及目录</b>                       | 2  |
| 1.1 重要提示                                | 2  |
| <b>§2 基金简介</b>                          | 5  |
| 2.1 基金基本情况                              | 5  |
| 2.2 基金产品说明                              | 5  |
| 2.3 基金管理人和基金托管人                         | 5  |
| 2.4 信息披露方式                              | 6  |
| 2.5 其他相关资料                              | 6  |
| <b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>          | 6  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 6  |
| 3.2 基金净值表现                              | 7  |
| 3.3 过去三年基金的利润分配情况                       | 9  |
| <b>§4 管理人报告</b>                         | 9  |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 9  |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明              | 11 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 11 |
| 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             | 12 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 13 |
| 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况                 | 13 |
| 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 14 |
| 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 16 |
| 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明       | 16 |
| <b>§5 托管人报告</b>                         | 16 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 16 |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 | 16 |
| 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见       | 16 |
| <b>§6 审计报告</b>                          | 17 |
| 6.1 管理层对财务报表的责任                         | 17 |
| 6.2 注册会计师的责任                            | 17 |
| 6.3 审计意见                                | 18 |
| <b>§7 年度财务报表</b>                        | 18 |
| 7.1 资产负债表                               | 18 |
| 7.2 利润表                                 | 20 |
| 7.3 所有者权益（基金净值）变动表                      | 21 |
| 7.4 报表附注                                | 23 |
| <b>§8 投资组合报告</b>                        | 47 |
| 8.1 期末基金资产组合情况                          | 47 |
| 8.2 期末按行业分类的股票投资组合                      | 48 |
| 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细       | 49 |
| 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动                     | 51 |
| 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 53 |
| 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      | 53 |

|                                             |           |
|---------------------------------------------|-----------|
| 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 ..... | 53        |
| 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 ..... | 53        |
| 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 .....    | 53        |
| 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....             | 53        |
| 8.12 投资组合报告附注 .....                         | 54        |
| <b>§9 基金份额持有人信息 .....</b>                   | <b>54</b> |
| 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                 | 54        |
| 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....              | 55        |
| <b>§10 开放式基金份额变动 .....</b>                  | <b>55</b> |
| <b>§11 重大事件揭示 .....</b>                     | <b>55</b> |
| 11.1 基金份额持有人大会决议 .....                      | 55        |
| 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 .....      | 55        |
| 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....           | 55        |
| 11.4 基金投资策略的改变 .....                        | 56        |
| 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....                 | 56        |
| 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 .....         | 56        |
| 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....                | 56        |
| 11.8 其他重大事件 .....                           | 59        |
| <b>§12 备查文件目录 .....</b>                     | <b>64</b> |
| 12.1 备查文件目录 .....                           | 64        |
| 12.2 存放地点 .....                             | 65        |
| 12.3 查阅方式 .....                             | 65        |

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                    |            |
|------------|--------------------|------------|
| 基金名称       | 华安中小盘成长混合型证券投资基金   |            |
| 基金简称       | 华安中小盘成长混合          |            |
| 基金主代码      | 040007             |            |
| 交易代码       | 040007(前端)         | 041007(后端) |
| 基金运作方式     | 契约型开放式             |            |
| 基金合同生效日    | 2007 年 4 月 10 日    |            |
| 基金管理人      | 华安基金管理有限公司         |            |
| 基金托管人      | 中国工商银行股份有限公司       |            |
| 报告期末基金份额总额 | 1,491,311,964.05 份 |            |
| 基金合同存续期    | 不定期                |            |

### 2.2 基金产品说明

|        |                                                                                                                                      |
|--------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标   | 主要投资于具有持续成长潜力的中小盘股票，在严格控制投资风险的前提下，实现基金资产的持续增值。                                                                                       |
| 投资策略   | 主要依靠基金管理人的研究优势，将科学有效的选股方法与主动、灵活的投资操作风格贯穿于组合构建以及组合风险管理的全过程之中，在分析研判经济运行和行业景气变化的周期性、以及上市公司业绩成长性的基础上，积极把握备选股票的投资机会，为基金份额持有人获取较高的中长期资本增值。 |
| 业绩比较基准 | 40%×天相中盘成长指数+40%×天相小盘成长指数+20%×中债-国债总指数                                                                                               |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金，基金的风险与预期收益高于债券型基金和货币市场基金、低于股票型基金，属于证券投资基金中的中高风险投资品种。                                                                       |

### 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目   |    | 基金管理人      | 基金托管人        |
|------|----|------------|--------------|
| 名称   |    | 华安基金管理有限公司 | 中国工商银行股份有限公司 |
| 信息披露 | 姓名 | 钱鲲         | 郭明           |

|        |      |                          |                     |
|--------|------|--------------------------|---------------------|
| 负责人    | 联系电话 | 021-38969999             | 010-66105799        |
|        | 电子邮箱 | qiankun@huaan.com.cn     | custody@icbc.com.cn |
| 客户服务电话 |      | 4008850099               | 95588               |
| 传真     |      | 021-68863414             | 010-66105798        |
| 注册地址   |      | 上海市世纪大道8号上海国金中心二期31层、32层 | 北京市西城区复兴门内大街55号     |
| 办公地址   |      | 上海市世纪大道8号上海国金中心二期31层、32层 | 北京市西城区复兴门内大街55号     |
| 邮政编码   |      | 200120                   | 100140              |
| 法定代表人  |      | 朱学华                      | 易会满                 |

## 2.4 信息披露方式

|                     |                               |
|---------------------|-------------------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称      | 中国证券报、上海证券报、证券时报              |
| 登载基金年度报告正文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 |

## 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称                   | 办公地址                          |
|--------|----------------------|-------------------------------|
| 会计师事务所 | 普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙) | 上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼 |
| 注册登记机构 | 华安基金管理有限公司           | 上海市世纪大道 8 号上海国金中心二期 31 层、32 层 |

## §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 2016 年          | 2015 年           | 2014 年        |
|---------------|-----------------|------------------|---------------|
| 本期已实现收益       | -174,306,013.22 | 3,461,696,908.76 | 76,530,998.05 |

|                      |                  |                  |                  |
|----------------------|------------------|------------------|------------------|
| 本期利润                 | -410,783,592.10  | 2,378,173,031.88 | 1,047,556,541.90 |
| 加权平均基金份额本期利润         | -0.2509          | 0.9263           | 0.2049           |
| 本期加权平均净值利润率          | -16.82%          | 61.88%           | 22.90%           |
| 本期基金份额净值增长率          | -13.77%          | 58.88%           | 24.69%           |
| <b>3.1.2 期末数据和指标</b> | <b>2016 年末</b>   | <b>2015 年末</b>   | <b>2014 年末</b>   |
| 期末可供分配利润             | 1,653,589,863.01 | 2,248,297,105.63 | 890,096,948.80   |
| 期末可供分配基金份额利润         | 1.1088           | 1.3548           | 0.2000           |
| 期末基金资产净值             | 2,297,808,377.44 | 2,965,167,187.95 | 5,006,284,876.42 |
| 期末基金份额净值             | 1.5408           | 1.7868           | 1.1246           |
| <b>3.1.3 累计期末指标</b>  | <b>2016 年末</b>   | <b>2015 年末</b>   | <b>2014 年末</b>   |
| 基金份额累计净值增长率          | 68.17%           | 95.02%           | 22.75%           |

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、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      | 1.70%    | 0.81%       | -2.70%     | 0.70%         | 4.40%  | 0.11% |
| 过去六个月      | 4.48%    | 0.87%       | -2.45%     | 0.75%         | 6.93%  | 0.12% |
| 过去一年       | -13.77%  | 1.82%       | -17.27%    | 1.50%         | 3.50%  | 0.32% |
| 过去三年       | 70.84%   | 2.06%       | 46.38%     | 1.60%         | 24.46% | 0.46% |
| 过去五年       | 74.63%   | 1.76%       | 62.14%     | 1.43%         | 12.49% | 0.33% |
| 自基金合同生效起至今 | 68.17%   | 1.77%       | 60.94%     | 1.62%         | 7.23%  | 0.15% |

注：本基金的业绩比较基准为：天相中盘成长指数×40%+天相小盘成长指数×40%+中债-国债

总指数×20%。

根据本基金合同的有关规定，本基金的投资范围为国内依法公开发行、上市的股票、债券及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具或金融衍生工具。其中，股票投资比例为基金资产的 60-95%，股票资产中的 80%以上投资于中国 A 股市场上具有良好成长性和基本面良好的中小盘股票；债券、权证、资产支持证券、货币市场工具及国家证券监管机构允许基金投资的其他金融工具占基金资产的比例范围为 0-40%；现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例在 5%以上。

### 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

华安中小盘成长混合型证券投资基金

自基金合同生效以来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  
(2007 年 4 月 10 日至 2016 年 12 月 31 日)

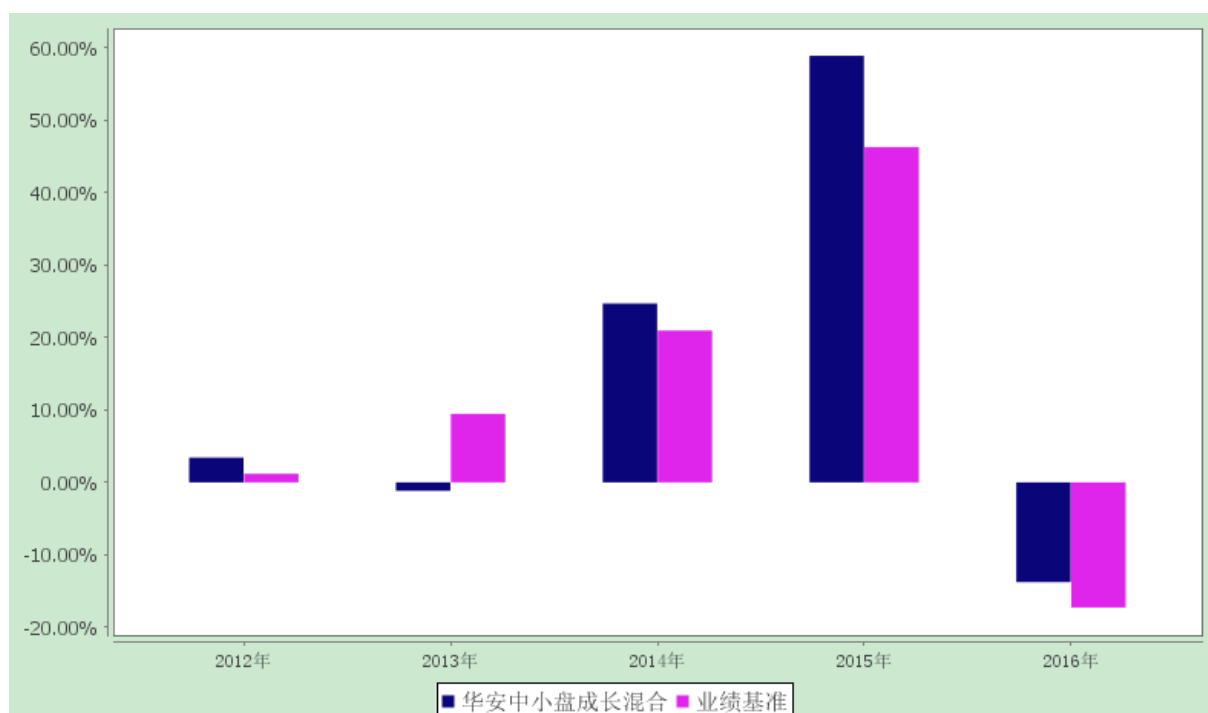


注：本基金于 2007 年 4 月 10 日转型。

### 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

华安中小盘成长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

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 |        |                                                                                                                                                                                                                                                          |
| 吴丰树 | 本基金的基金经理 | 2013-02-22      | -    | 13 年   | 硕士研究生，13 年证券、基金行业从业经历。曾在中金公司担任研究员、华宝兴业基金管理有限公司担任基金经理。2011 年 3 月份加入华安基金管理有限公司。2011 年 7 月至 2013 年 5 月担任华安核心优选混合型证券投资基金的基金经理。2012 年 10 月起同时担任华安行业轮动混合型证券投资基金的基金经理，2013 年 2 月起担任本基金的基金经理。2013 年 5 月起同时担任华安保本混合型证券投资基金的基金经理。2015 年 5 月起同时担任华安新机遇保本混合型证券投资基金的基 |

|  |  |  |  |  |      |
|--|--|--|--|--|------|
|  |  |  |  |  | 金经理。 |
|--|--|--|--|--|------|

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

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、招募说明书等有关基金法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益，不存在违法违规或未履行基金合同承诺的情形。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了《华安基金管理有限公司公平交易管理制度》，将封闭式基金、开放式基金、特定客户资产管理组合及其他投资组合资产在研究分析、投资决策、交易执行等方面全部纳入公平交易管理中。控制措施包括：在研究环节，研究员在为公司管理的各类投资组合提供研究信息、投资建议过程中，使用晨会发言、邮件发送、登录在研究报告管理系统中等方式来确保各类投资组合经理可以公平享有信息获取机会。在投资环节，公司各投资组合经理根据投资组合的风格和投资策略，制定并严格执行交易决策规则，以保证各投资组合交易决策的客观性和独立性。同时严格执行投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体授权机制，投资组合经理在授权范围内自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易环节，公司实行强制公平交易机制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。（1）交易所二级市场业务，遵循价格优先、时间优先、比例分配、综合平衡的控制原则，实现同一时间下达指令的投资组合在交易时机上的公平性。（2）交易所一级市场业务，投资组合经理按意愿独立进行业务申报，集中交易部以投资组合名义对外进行申报。若该业务以公司名义进行申报与中签，则按实际中签情况以价格优先、比例分配原则进行分配。若中签量过小无法合理进行比例分配，且以公司名义获得，则投资部门在合规监察员监督参与下，进行公平协商分配。（3）银行间市场业务遵循指令时间优先原则，先到先询价的控制原则。通过内部共同的 iwind 群，发布询价需求和结果，做到信息公开。若是多个投资组合进行一级市场投标，则各投资组合经理须以各投资组合名义向集中交易部下达投资意向，交易员以此进行投标，以确保中签结果与投资组合投标意向一一对应。若中签量过小无法合理进行比例分配，且以公司名义获得，则投资部门在风险管理部投资监督参与下，进行公平协商分配。交易监控、分析与评估环节，公司风险管理部对公司旗下的各投资组合投资境内证券市场上市交易的投资品种、进行场外的非公开发行股票申购、以公司名义

进行的债券一级市场申购、不同投资组合同日和临近交易日的反向交易以及可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控，根据市场公认的第三方信息（如：中债登的债券估值），定期对各投资组合与交易对手之间议价交易的交易价格公允性进行审查，对不同投资组合临近交易日的同向交易的交易时机和交易价差进行分析。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

本基金管理人通过统计检验的方法对管理的不同投资组合，在不同时间窗下（日内、3 日内、5 日内）的本年度同向交易价差进行了专项分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司合规监察稽核部会同基金投资、交易部门讨论制定了公募基金、专户针对股票、债券、回购等投资品种在交易所及银行间的同日反向交易控制规则，并在投资系统中进行了设置，实现了完全的系统控制。同时加强了对基金、专户间的同日反向交易的监控与隔日反向交易的检查；风险管理部开发了同向交易分析系统，对相关同向交易指标进行持续监控，并定期对组合间的同向交易行为进行了重点分析。

本报告期内，因组合流动性管理或投资策略调整需要，除指数基金以外的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的次数为 9 次，未出现异常交易。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2016 年市场先抑后扬。虽然万得全 A 指数全年下跌 13%，沪深 300 指数下跌 11%，但是市场下跌主要发生在 1 月份，之后呈现震荡上行格局。全年来看，市场结构性分化明显，价值股明显强过高估值的成长股。大盘股表现出很好的抗跌性，上证 50 指数和中证 100 指数仅分别下跌 5.5% 和 7.5%，而中证 1000 指数下跌 20%，创业板指数下跌 28%。从行业来看，以食品饮料和家电为代表的低估值消费股、以建筑建材为代表的周期股表现出色，TMT、纺织服装、农林牧渔等则跌幅较大。市场主题投资保持活跃状态，特别是次新股，涨幅巨大；PPP 相关概念股、特斯拉、京津冀一体化等涨幅居前，网络安全、征信、动漫等跌幅居前。总体来说，2016 年的市场可以说是冰火两重天。特别值得一提的是，2016 年全球发生的一系列黑天鹅事件，如特朗普当选美国总统、英国公投脱离欧盟、意大利修宪公投失败等，不仅对国际市场，对国内市场也造成较大波动。从国内来看，房地产市场

的旺销、PPP 项目的暴增、市场监管的加严、大宗商品价格的上涨、人民币汇率的贬值等等因素都对市场造成比较明显的影响。

本基金 2016 年表现尚可。对净值造成最大负面影响的原因是，我们未能躲过 1 月份的市场暴跌。从行业配置来看，虽然低配了跌幅居前的行业如 TMT、纺织服装、农林牧渔等，但未能超配涨幅最大的建筑建材、食品饮料和家电，更没有参与次新股的投资。部分重仓个股的选择也存在一定问题，全年表现欠佳，对净值造成拖累。不过，我们在有色金属和化工上的超配则相对较为成功。

#### 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 1.5408 元，本报告期份额净值增长率为-13.77%，同期业绩比较基准增长率为-17.27%。

#### 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，我们判断市场将维持震荡的格局。我们并不担心国内外经济基本面，企业盈利大概率会保持改善势头；政府对于股市的维稳诉求仍将持续，社保资金入市也可期，国内各项改革有序进行中。问题在于，央行货币政策态度已经明显转变，在经济好转和金融去杠杆的背景下，资金很有可能“脱虚向实”，市场流动性将不会像以往那么宽松。如果 PPI 向 CPI 的传导，通胀上行风险将偏大，央行紧缩货币的力度将上升。此外，美国新总统上台之后，中美之间贸易冲突将如何演变需要观察，而 2017 年还是中国的换届之年。可以说，这一系列因素将使得 2017 年市场前景的不确定性依然很高。在市场整体估值水平仍然不低的情况下，我们倾向于保持谨慎乐观的态度，通过把握结构性的机会和自下而上选股来为投资人创造良好的收益。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，公司合规监察稽核部从维护基金份额持有人利益、保障基金的合规运作出发，重点在法律事务、合规管理、内部稽核、信息披露、反洗钱、员工行为规范等方面开展工作，深化员工的合规意识，推动公司的合规文化和内部风险控制机制的完善与优化。

监察稽核工作重点集中于以下几个方面：

- （1）积极配合监管部门新法规的实施，不断完善公司的内部控制制度和业务操作流程；
- （2）继续深化“主动合规”的管理理念，强化全体员工的合规意识和风险控制意识，通过定期组织员工进行职业道德规范、反洗钱、防范利益冲突、客户信息保密、销售适用性等方面的合规培训和内部审计，推动公司建立良好的内控环境和合规文化。

(3) 完善公司内控建设, 强化基金的公平交易和异常交易的检查与监控, 防范内幕交易与操纵市场行为的出现, 同时进行投资管理人员合规培训、及定期进行基金经理的合规谈话, 建立健全坚守“三条底线”的长效机制;

(4) 做好在新基金产品开发、新投资品种、及其他创新业务中法律、合规及风险控制方面的支持, 坚持定期对投资、研究、交易、核算、销售等相关业务活动的日常合规性检查。

(5) 推动落实公司投资、运营业务操作流程标准化, 细化各相关部门在各业务环节的操作流程及工作职责, 降低操作风险发生的概率。

(6) 按照法规的要求, 做好旗下各只基金的信息披露工作, 做到信息披露的真实、完整、准确、及时。

(7) 有计划地对公司投资研究、基金销售、后台运营等相关业务部门进行了多次全面或专项稽核, 强化对公司制度执行和风控措施的落实。

本基金管理人承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产, 不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性, 努力防范和控制各种风险, 保障基金份额持有人的合法权益。

#### 4.7 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。

**4.8 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。

**4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明**

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

**§5 托管人报告**

**5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明**

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

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

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

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

本托管人依法对华安基金管理有限公司编制和披露的华安中小盘成长混合型证券投资基金 2016 年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## §6 审计报告

普华永道中天审字(2017)第 20228 号

华安中小盘成长混合型证券投资基金全体基金份额持有人：

我们审计了后附的华安中小盘成长混合型证券投资基金(以下简称“华安中小盘成长基金”)的财务报表，包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表、2016 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

### 6.1 管理层对财务报表的责任

编制和公允列报财务报表是华安中小盘成长基金 的基金管理人华安基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括：

(1) 按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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财务报表，并使其实现公允反映；

(2) 设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

### 6.2 注册会计师的责任

我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。

我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

### 6.3 审计意见

我们认为，上述华安中小盘成长基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中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，公允反映了华安中小盘成长基金 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。

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙) 中国注册会计师

单峰 张振波

上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼

2017 年 3 月 24 日

## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：华安中小盘成长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       | 附注号     | 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     | 7.4.7.1 | 176,152,808.63          | 58,318,678.73            |
| 结算备付金    |         | 3,671,267.47            | 10,138,880.17            |
| 存出保证金    |         | 526,439.25              | 2,037,669.09             |
| 交易性金融资产  | 7.4.7.2 | 2,113,564,619.68        | 2,865,890,279.35         |
| 其中：股票投资  |         | 2,113,564,619.68        | 2,767,670,679.35         |
| 基金投资     |         | -                       | -                        |
| 债券投资     |         | -                       | 98,219,600.00            |
| 资产支持证券投资 |         | -                       | -                        |
| 贵金属投资    |         | -                       | -                        |
| 衍生金融资产   | 7.4.7.3 | -                       | -                        |

|                 |            |                                 |                                  |
|-----------------|------------|---------------------------------|----------------------------------|
| 买入返售金融资产        | 7.4.7.4    | -                               | -                                |
| 应收证券清算款         |            | 12,969,114.42                   | 41,035,675.34                    |
| 应收利息            | 7.4.7.5    | 40,780.89                       | 1,811,795.78                     |
| 应收股利            |            | -                               | -                                |
| 应收申购款           |            | 189,892.18                      | 229,038.38                       |
| 递延所得税资产         |            | -                               | -                                |
| 其他资产            | 7.4.7.6    | -                               | -                                |
| <b>资产总计</b>     |            | <b>2,307,114,922.52</b>         | <b>2,979,462,016.84</b>          |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2016 年 12 月 31 日</b> | <b>上年度末<br/>2015 年 12 月 31 日</b> |
| 负 债:            |            | -                               | -                                |
| 短期借款            |            | -                               | -                                |
| 交易性金融负债         |            | -                               | -                                |
| 衍生金融负债          | 7.4.7.3    | -                               | -                                |
| 卖出回购金融资产款       |            | -                               | -                                |
| 应付证券清算款         |            | 1,346,222.40                    | -                                |
| 应付赎回款           |            | 1,122,540.46                    | 3,776,572.49                     |
| 应付管理人报酬         |            | 3,096,402.64                    | 3,794,778.87                     |
| 应付托管费           |            | 516,067.10                      | 632,463.14                       |
| 应付销售服务费         |            | -                               | -                                |
| 应付交易费用          | 7.4.7.7    | 2,325,061.39                    | 4,934,356.05                     |
| 应交税费            |            | -                               | -                                |
| 应付利息            |            | -                               | -                                |
| 应付利润            |            | -                               | -                                |
| 递延所得税负债         |            | -                               | -                                |
| 其他负债            | 7.4.7.8    | 900,251.09                      | 1,156,658.34                     |
| <b>负债合计</b>     |            | <b>9,306,545.08</b>             | <b>14,294,828.89</b>             |
| <b>所有者权益:</b>   |            | -                               | -                                |
| 实收基金            | 7.4.7.9    | 644,218,514.43                  | 716,870,082.32                   |

|            |          |                         |                         |
|------------|----------|-------------------------|-------------------------|
| 未分配利润      | 7.4.7.10 | 1,653,589,863.01        | 2,248,297,105.63        |
| 所有者权益合计    |          | <b>2,297,808,377.44</b> | <b>2,965,167,187.95</b> |
| 负债和所有者权益总计 |          | <b>2,307,114,922.52</b> | <b>2,979,462,016.84</b> |

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.5408 元，基金份额总额 1,491,311,964.05 份。

## 7.2 利润表

会计主体：华安中小盘成长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                    | 附注号      | 本期<br>2016 年 1 月 1 日至<br>2016 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2015 年 1 月 1 日至<br>2015 年 12 月 31 日 |
|-----------------------|----------|-------------------------------------------|------------------------------------------------|
| 一、收入                  |          | <b>-352,584,804.53</b>                    | <b>2,495,292,533.78</b>                        |
| 1.利息收入                |          | 1,866,645.08                              | 6,947,551.17                                   |
| 其中：存款利息收入             | 7.4.7.11 | 991,362.93                                | 1,335,048.71                                   |
| 债券利息收入                |          | 875,282.15                                | 5,612,502.46                                   |
| 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）      |          | -118,381,031.77                           | 3,570,818,311.53                               |
| 其中：股票投资收益             | 7.4.7.12 | -135,602,296.44                           | 3,540,998,241.08                               |
| 基金投资收益                |          | -                                         | -                                              |
| 债券投资收益                | 7.4.7.13 | -233,994.50                               | 7,607,620.04                                   |
| 资产支持证券投资收益            |          | -                                         | -                                              |
| 贵金属投资收益               |          | -                                         | -                                              |
| 衍生工具收益                | 7.4.7.14 | -                                         | -                                              |
| 股利收益                  | 7.4.7.15 | 17,455,259.17                             | 22,212,450.41                                  |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 7.4.7.16 | -236,477,578.88                           | -1,083,523,876.88                              |

|                            |          |                        |                         |
|----------------------------|----------|------------------------|-------------------------|
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）         |          | -                      | -                       |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）         | 7.4.7.17 | 407,161.04             | 1,050,547.96            |
| <b>减：二、费用</b>              |          | <b>58,198,787.57</b>   | <b>117,119,501.90</b>   |
| 1. 管理人报酬                   |          | 36,588,766.73          | 57,711,904.00           |
| 2. 托管费                     |          | 6,098,127.80           | 9,618,650.74            |
| 3. 销售服务费                   |          | -                      | -                       |
| 4. 交易费用                    | 7.4.7.18 | 15,073,817.04          | 49,130,952.78           |
| 5. 利息支出                    |          | -                      | 214,949.55              |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |          | -                      | 214,949.55              |
| 6. 其他费用                    | 7.4.7.19 | 438,076.00             | 443,044.83              |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |          | <b>-410,783,592.10</b> | <b>2,378,173,031.88</b> |
| 减：所得税费用                    |          | -                      | -                       |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |          | <b>-410,783,592.10</b> | <b>2,378,173,031.88</b> |

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安中小盘成长混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目                              | 本期<br>2016 年 1 月 1 日至 2016 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）                 | 716,870,082.32                         | 2,248,297,105.63 | 2,965,167,187.95 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）        | -                                      | -410,783,592.10  | -410,783,592.10  |
| 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 | -72,651,567.89                         | -183,923,650.52  | -256,575,218.41  |

|                                        |                                  |                   |                   |
|----------------------------------------|----------------------------------|-------------------|-------------------|
| 列)                                     |                                  |                   |                   |
| 其中：1.基金申购款                             | 88,051,039.66                    | 211,229,279.16    | 299,280,318.82    |
| 2.基金赎回款                                | -160,702,607.55                  | -395,152,929.68   | -555,855,537.23   |
| 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）                        | 644,218,514.43                   | 1,653,589,863.01  | 2,297,808,377.44  |
| 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）                        | 1,922,960,463.32                 | 3,083,324,413.10  | 5,006,284,876.42  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                                | 2,378,173,031.88  | 2,378,173,031.88  |
| 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）      | -1,206,090,381.00                | -3,213,200,339.35 | -4,419,290,720.35 |
| 其中：1.基金申购款                             | 202,827,098.70                   | 562,198,385.82    | 765,025,484.52    |
| 2.基金赎回款                                | -1,408,917,479.70                | -3,775,398,725.17 | -5,184,316,204.87 |
| 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）                        | 716,870,082.32                   | 2,248,297,105.63  | 2,965,167,187.95  |

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

华安中小盘成长混合型证券投资基金(原名为华安中小盘成长股票型证券投资基金，以下简称“本基金”)是根据原安瑞证券投资基金(以下简称“基金安瑞”)基金份额持有人大会 2007 年 3 月 1 日审议通过的《关于安瑞证券投资基金转型有关事项的议案》并经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2007]81 号《于核准安瑞证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复》核准，由原基金安瑞转型而来。原基金安瑞为契约型封闭式基金，于上海证券交易所(以下简称“上交所”)交易上市，存续期限至 2007 年 6 月 30 日止。根据中国证监会批复及上海证券交易所上证债字 [2007]21 号《关于终止安瑞证券投资基金上市的决定》，原基金安瑞于 2007 年 4 月 9 日进行终止上市权利登记,自 2007 年 4 月 10 日起，原基金安瑞终止上市,更名为华安中小盘成长股票型证券投资基金(以下简称“中小盘成长股票基金”)，《安瑞证券投资基金基金合同》失效的同时《华安中小盘成长股票型证券投资基金基金合同》生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为华安基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。原基金安瑞于基金合同失效前经审计的基金资产净值为人民币 1,060,436,162.37 元，已于中小盘成长股票基金基金合同生效日全部转为中小盘成长股票基金的基金资产净值。根据《华安中小盘成长股票型证券投资基金招募说明书》和《关于原安瑞证券投资基金基金份额折算结果的公告》的有关规定，中小盘成长股票基金于 2007 年 4 月 18 日进行了基金份额拆分，拆分比例为 1:2.314909165，并于 2007 年 4 月 18 日进行了份额变更登记。

中小盘成长股票基金在基金合同生效后于 2007 年 4 月 16 日开放集中申购，共募集人民币 9,883,484,414.21 元，业经立信长江会计师事务所有限公司信会师报字(2007)第 11233 号验资报告予以验证。上述集中申购募集资金已按 2007 年 4 月 18 日基金份额转换后的基金份额净值 1.0000 元折合为 9,883,484,414.21 份基金份额，并于 2007 年 4 月 18 日进行了份额确认登记。

根据 2014 年中国证监会令第 104 号《公开募集证券投资基金运作管理办法》，华安中小盘成长股票型证券投资基金于 2015 年 8 月 6 日公告后更名为华安中小盘成长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《华安中小盘成长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国内依法公开发行、上市的股票、债券及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具或金融衍生工具。其中，股票投资比例为基金资产的 60%-95%，股票资产中的 80%以上投资于中国 A 股市场上具有良好成长性和基本面良好的中小盘股票；债券、权证、资产支持证券、货币市场工具及国家证券监管机构允许基金投资的其他金融工具占基金资产的比例范围为 0-40%；现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例在 5%以上。本基金的业绩比较基准为：天相中盘成长指数×40%+天相小盘成长指数×40%+中债-国债总指数×20%。

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》、《华安中小盘成长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 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

## (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按红利发放日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1)对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38 号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2)对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会计字[2007]21 号《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》之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

(3)在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21 号《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》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债

登记结算有限责任公司独立提供。

(4)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外),按照中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

#### 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

本基金本报告期末发生会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末发生会计估计变更。

##### 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 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目   | 本期末<br>2016 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2015 年 12 月 31 日 |
|------|-------------------------|--------------------------|
| 活期存款 | 176,152,808.63          | 58,318,678.73            |
| 定期存款 | -                       | -                        |
| 其他存款 | -                       | -                        |
| 合计   | 176,152,808.63          | 58,318,678.73            |

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2016 年 12 月 31 日 |                  |                 |
|---------------|-------------------------|------------------|-----------------|
|               | 成本                      | 公允价值             | 公允价值变动          |
| 股票            | 2,318,025,417.74        | 2,113,564,619.68 | -204,460,798.06 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | -                       | -                | -               |
| 债券            | -                       | -                | -               |
| 交易所市场         | -                       | -                | -               |

|               |       |                  |                  |                 |
|---------------|-------|------------------|------------------|-----------------|
|               | 银行间市场 | -                | -                | -               |
|               | 合计    | -                | -                | -               |
| 资产支持证券        |       | -                | -                | -               |
| 基金            |       | -                | -                | -               |
| 其他            |       | -                | -                | -               |
| 合计            |       | 2,318,025,417.74 | 2,113,564,619.68 | -204,460,798.06 |
| 项目            |       | 上年度末             |                  |                 |
|               |       | 2015 年 12 月 31 日 |                  |                 |
|               |       | 成本               | 公允价值             | 公允价值变动          |
| 股票            |       | 2,735,632,504.03 | 2,767,670,679.35 | 32,038,175.32   |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 |       | -                | -                | -               |
| 债券            | 交易所市场 | 98,240,994.50    | 98,219,600.00    | -21,394.50      |
|               | 银行间市场 | -                | -                | -               |
|               | 合计    | 98,240,994.50    | 98,219,600.00    | -21,394.50      |
| 资产支持证券        |       | -                | -                | -               |
| 基金            |       | -                | -                | -               |
| 其他            |       | -                | -                | -               |
| 合计            |       | 2,833,873,498.53 | 2,865,890,279.35 | 32,016,780.82   |

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目         | 本期末<br>2016 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2015 年 12 月 31 日 |
|------------|-------------------------|--------------------------|
| 应收活期存款利息   | 38,891.89               | 19,423.23                |
| 应收定期存款利息   | -                       | -                        |
| 应收其他存款利息   | -                       | -                        |
| 应收结算备付金利息  | 1,652.10                | 4,562.50                 |
| 应收债券利息     | -                       | 1,786,893.15             |
| 应收买入返售证券利息 | -                       | -                        |
| 应收申购款利息    | -                       | -                        |
| 应收黄金合约拆借孳息 | -                       | -                        |
| 其他         | 236.90                  | 916.90                   |
| 合计         | 40,780.89               | 1,811,795.78             |

#### 7.4.7.6 其他资产

无余额。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2016 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2015 年 12 月 31 日 |
|-------------|-------------------------|--------------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 2,325,061.39            | 4,934,356.05             |
| 银行间市场应付交易费用 | -                       | -                        |
| 合计          | 2,325,061.39            | 4,934,356.05             |

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2016 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2015 年 12 月 31 日 |
|-------------|-------------------------|--------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | 500,000.00              | 750,000.00               |

|       |            |              |
|-------|------------|--------------|
| 应付赎回费 | 251.09     | 2,658.34     |
| 预提费用  | 400,000.00 | 404,000.00   |
| 合计    | 900,251.09 | 1,156,658.34 |

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期                               |                 |
|---------------|----------------------------------|-----------------|
|               | 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日 |                 |
|               | 基金份额（份）                          | 账面金额            |
| 上年度末          | 1,659,487,886.03                 | 716,870,082.32  |
| 本期申购          | 203,832,083.82                   | 88,051,039.66   |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -372,008,005.80                  | -160,702,607.55 |
| 本期末           | 1,491,311,964.05                 | 644,218,514.43  |

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 项目             | 已实现部分            | 未实现部分           | 未分配利润合计          |
|----------------|------------------|-----------------|------------------|
| 上年度末           | 2,296,961,637.96 | -48,664,532.33  | 2,248,297,105.63 |
| 本期利润           | -174,306,013.22  | -236,477,578.88 | -410,783,592.10  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -214,248,187.06  | 30,324,536.54   | -183,923,650.52  |
| 其中：基金申购款       | 267,301,185.18   | -56,071,906.02  | 211,229,279.16   |
| 基金赎回款          | -481,549,372.24  | 86,396,442.56   | -395,152,929.68  |
| 本期已分配利润        | -                | -               | -                |
| 本期末            | 1,908,407,437.68 | -254,817,574.67 | 1,653,589,863.01 |

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期                          | 上年度可比期间                     |
|----|-----------------------------|-----------------------------|
|    | 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 | 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 |

|           | 31 日       | 月 31 日       |
|-----------|------------|--------------|
| 活期存款利息收入  | 906,145.81 | 1,112,887.87 |
| 定期存款利息收入  | -          | -            |
| 其他存款利息收入  | -          | -            |
| 结算备付金利息收入 | 71,362.05  | 183,513.23   |
| 其他        | 13,855.07  | 38,647.61    |
| 合计        | 991,362.93 | 1,335,048.71 |

#### 7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

| 项目         | 本期<br>2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日 |
|------------|----------------------------------------|---------------------------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 5,084,694,994.58                       | 17,748,574,218.56                           |
| 减：卖出股票成本总额 | 5,220,297,291.02                       | 14,207,575,977.48                           |
| 买卖股票差价收入   | -135,602,296.44                        | 3,540,998,241.08                            |

#### 7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

| 项目                     | 本期<br>2016年1月1日至2016年12月<br>31日 | 上年度可比期间<br>2015年1月1日至2015年12月<br>31日 |
|------------------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额   | 100,669,175.30                  | 543,369,879.78                       |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 98,240,994.50                   | 522,457,263.70                       |
| 减：应收利息总额               | 2,662,175.30                    | 13,304,996.04                        |
| 买卖债券差价收入               | -233,994.50                     | 7,607,620.04                         |

#### 7.4.7.14 衍生工具收益

无。

#### 7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

| 项目          | 本期<br>2016年1月1日至2016年12月31日 | 上年度可比期间<br>2015年1月1日至2015年12月31日 |
|-------------|-----------------------------|----------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 17,455,259.17               | 22,212,450.41                    |
| 基金投资产生的股利收益 | -                           | -                                |
| 合计          | 17,455,259.17               | 22,212,450.41                    |

#### 7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称       | 本期<br>2016年1月1日至2016年12月31日 | 上年度可比期间<br>2015年1月1日至2015年12月31日 |
|------------|-----------------------------|----------------------------------|
| 1.交易性金融资产  | -236,477,578.88             | -1,083,523,876.88                |
| ——股票投资     | -236,498,973.38             | -1,083,218,636.08                |
| ——债券投资     | 21,394.50                   | -305,240.80                      |
| ——资产支持证券投资 | -                           | -                                |
| ——基金投资     | -                           | -                                |
| ——贵金属投资    | -                           | -                                |
| ——其他       | -                           | -                                |
| 2.衍生工具     | -                           | -                                |
| ——权证投资     | -                           | -                                |
| 3.其他       | -                           | -                                |
| 合计         | -236,477,578.88             | -1,083,523,876.88                |

#### 7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2016年1月1日至2016年12月31日 | 上年度可比期间<br>2015年1月1日至2015年12月31日 |
|---------|-----------------------------|----------------------------------|
| 基金赎回费收入 | 407,161.04                  | 1,050,547.96                     |
| 合计      | 407,161.04                  | 1,050,547.96                     |

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

#### 7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2016年1月1日至2016年12月31日 | 上年度可比期间<br>2015年1月1日至2015年12月31日 |
|-----------|-----------------------------|----------------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 15,073,817.04               | 49,127,452.78                    |
| 银行间市场交易费用 | -                           | 3,500.00                         |
| 合计        | 15,073,817.04               | 49,130,952.78                    |

#### 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2016年1月1日至2016年12月<br>31日 | 上年度可比期间<br>2015年1月1日至2015年12月31日 |
|---------|---------------------------------|----------------------------------|
| 审计费用    | 100,000.00                      | 104,000.00                       |
| 信息披露费   | 300,000.00                      | 300,000.00                       |
| 银行划款手续费 | 876.00                          | 2,844.83                         |
| 账户维护费   | 37,200.00                       | 36,200.00                        |
| 合计      | 438,076.00                      | 443,044.83                       |

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布《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》(财税[2016]140 号)，要求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，自 2016 年 5 月 1 日起执行。

根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》(财税[2017]2 号)，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。资管产品运营过程中发生增值税应税行为的具体征

收管理办法，由国家税务总局另行制定。截至本财务报表批准报出日止，上述税收政策对本基金 2016 年度的财务状况和经营成果无影响。

#### 7.4.9 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 |
| 中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”) | 基金托管人、基金销售机构        |
| 上海国际信托有限公司             | 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。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.10.1.1 股票交易

无。

##### 7.4.10.1.2 权证交易

无。

##### 7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

无。

##### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2016年1月1日至2016年12<br>月31日 | 上年度可比期间<br>2015年1月1日至2015年12<br>月31日 |
|-----------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 36,588,766.73                   | 57,711,904.00                        |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 6,321,759.10                    | 10,285,817.71                        |

注：支付基金管理人华安基金公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日管理人报酬＝前一日基金资产净值×1.5%/当年天数。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2016年1月1日至2016年12<br>月31日 | 上年度可比期间<br>2015年1月1日至2015年12<br>月31日 |
|----------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 6,098,127.80                    | 9,618,650.74                         |

注：支付基金托管人中国工商银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日托管费＝前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

| 本期<br>2016年1月1日至2016年12月31日      |        |      |       |      |                |           |
|----------------------------------|--------|------|-------|------|----------------|-----------|
| 银行间市场<br>交易的各关<br>联方名称           | 债券交易金额 |      | 基金逆回购 |      | 基金正回购          |           |
|                                  | 基金买入   | 基金卖出 | 交易金额  | 利息收入 | 交易金额           | 利息支出      |
| -                                | -      | -    | -     | -    | -              | -         |
| 上年度可比期间<br>2015年1月1日至2015年12月31日 |        |      |       |      |                |           |
| 银行间市场<br>交易的各关<br>联方名称           | 债券交易金额 |      | 基金逆回购 |      | 基金正回购          |           |
|                                  | 基金买入   | 基金卖出 | 交易金额  | 利息收入 | 交易金额           | 利息支出      |
| 中国工商银行                           | -      | -    | -     | -    | 200,000,000.00 | 42,801.37 |

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

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

份额单位：份

| 项目                | 本期                    | 上年度可比期间               |
|-------------------|-----------------------|-----------------------|
|                   | 2016年1月1日至2016年12月31日 | 2015年1月1日至2015年12月31日 |
| 期初持有的基金份额         | -                     | 7,787,245.24          |
| 期间申购/买入总份额        | -                     | -                     |
| 期间因拆分变动份额         | -                     | -                     |
| 减：期间赎回/卖出总份额      | -                     | 7,787,245.24          |
| 期末持有的基金份额         | -                     | -                     |
| 期末持有的基金份额占基金总份额比例 | -                     | -                     |

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

无。

#### 7.4.10.5 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       |
| 中国工商银行 | 176,152,808.63        | 906,145.81 | 58,318,678.73         | 1,112,887.87 |

注：本基金的银行存款由基金托管人 中国工商银行 保管，按银行同业利率计息。

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.11 利润分配情况

无。

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

##### 7.4.12.1 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

| 7.4.12.1.1 受限证券类别：股票 |      |            |            |        |       |        |           |            |            |    |
|----------------------|------|------------|------------|--------|-------|--------|-----------|------------|------------|----|
| 证券代码                 | 证券名称 | 成功认购日      | 可流通日       | 流通受限类型 | 认购价格  | 期末估值单价 | 数量(单位：股)  | 期末成本总额     | 期末估值总额     | 备注 |
| 002838               | 道恩股份 | 2016-12-28 | 2017-01-06 | 网下中签   | 15.28 | 15.28  | 682.00    | 10,420.96  | 10,420.96  | -  |
| 002840               | 华统股份 | 2016-12-29 | 2017-01-10 | 网下中签   | 6.55  | 6.55   | 1,814.00  | 11,881.70  | 11,881.70  | -  |
| 300583               | 赛托生物 | 2016-12-29 | 2017-01-06 | 网下中签   | 40.29 | 40.29  | 1,582.00  | 63,738.78  | 63,738.78  | -  |
| 300586               | 美联新材 | 2016-12-26 | 2017-01-04 | 网下中签   | 9.30  | 9.30   | 1,006.00  | 9,355.80   | 9,355.80   | -  |
| 300587               | 天铁股份 | 2016-12-28 | 2017-01-05 | 网下中签   | 14.11 | 14.11  | 1,438.00  | 20,290.18  | 20,290.18  | -  |
| 300588               | 熙菱信息 | 2016-12-27 | 2017-01-05 | 网下中签   | 4.94  | 4.94   | 1,380.00  | 6,817.20   | 6,817.20   | -  |
| 300591               | 万里马  | 2016-12-30 | 2017-01-10 | 网下中签   | 3.07  | 3.07   | 2,397.00  | 7,358.79   | 7,358.79   | -  |
| 601375               | 中原证券 | 2016-12-20 | 2017-01-03 | 网下中签   | 4.00  | 4.00   | 26,695.00 | 106,780.00 | 106,780.00 | -  |
| 603032               | 德新交运 | 2016-12-27 | 2017-01-05 | 网下中签   | 5.81  | 5.81   | 1,628.00  | 9,458.68   | 9,458.68   | -  |
| 603035               | 常熟汽饰 | 2016-12-27 | 2017-01-05 | 网下中签   | 10.44 | 10.44  | 2,316.00  | 24,179.04  | 24,179.04  | -  |
| 603186               | 华正新材 | 2016-12-26 | 2017-01-03 | 网下中签   | 5.37  | 5.37   | 1,874.00  | 10,063.38  | 10,063.38  | -  |
| 603228               | 景旺电子 | 2016-12-28 | 2017-01-06 | 网下中签   | 23.16 | 23.16  | 3,491.00  | 80,851.56  | 80,851.56  | -  |
| 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  | -  |

##### 7.4.12.2 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<br>注 |
|----------|----------|----------------|-----------------|------------|----------------|--------------------|--------------|---------------|---------------|--------|
| 000516   | 国际<br>医学 | 2016-12<br>-05 | 重大资<br>产重组      | 7.90       | -              | -                  | 2,200,000.00 | 14,674,438.18 | 17,380,000.00 | -      |
| 300271   | 华宇<br>软件 | 2016-12<br>-19 | 重大资<br>产重组      | 17.45      | -              | -                  | 1,018,600.00 | 21,470,309.15 | 17,774,570.00 | -      |
| 300420   | 五洋<br>科技 | 2016-12<br>-13 | 重大资<br>产重组      | 24.98      | 2017-03<br>-23 | 27.48              | 1,200,095.00 | 30,839,560.59 | 29,978,373.10 | -      |
| 600711   | 盛屯<br>矿业 | 2016-12<br>-19 | 重大事<br>项未公<br>告 | 7.02       | 2017-01<br>-11 | 7.38               | 3,000,000.00 | 22,973,813.49 | 21,060,000.00 | -      |

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。

### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.12.3.1 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。

#### 7.4.12.3.2 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。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

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。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

#### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督

察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部等相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理和投资风险、绩效评估等。监察稽核部和风险管理部对公司执行总裁负责，并由督察长分管。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具，通过特定的风险量化指标、模型，形成常规的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国工商银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2016 年 12 月 31 日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券(2015 年 12 月 31 日：0.00%)。

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密

监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2016 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2016 年 12 月 31 日  | 1 年以内          | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息              | 合计               |
|--------------------------|----------------|-------|-------|------------------|------------------|
| 资产                       |                |       |       |                  |                  |
| 银行存款                     | 176,152,808.63 | -     | -     | -                | 176,152,808.63   |
| 结算备付金                    | 3,671,267.47   | -     | -     | -                | 3,671,267.47     |
| 存出保证金                    | 526,439.25     | -     | -     | -                | 526,439.25       |
| 交易性金融资产                  | -              | -     | -     | 2,113,564,619.68 | 2,113,564,619.68 |
| 应收证券清算款                  | -              | -     | -     | 12,969,114.42    | 12,969,114.42    |
| 应收利息                     | -              | -     | -     | 40,780.89        | 40,780.89        |
| 应收申购款                    | -              | -     | -     | 189,892.18       | 189,892.18       |
| 资产总计                     | 180,350,515.35 | -     | -     | 2,126,764,407.17 | 2,307,114,922.52 |
| 负债                       |                |       |       |                  |                  |
| 应付证券清算款                  | -              | -     | -     | 1,346,222.40     | 1,346,222.40     |
| 应付赎回款                    | -              | -     | -     | 1,122,540.46     | 1,122,540.46     |
| 应付管理人报酬                  | -              | -     | -     | 3,096,402.64     | 3,096,402.64     |
| 应付托管费                    | -              | -     | -     | 516,067.10       | 516,067.10       |
| 应付交易费用                   | -              | -     | -     | 2,325,061.39     | 2,325,061.39     |
| 其他负债                     | -              | -     | -     | 900,251.09       | 900,251.09       |
| 负债总计                     | -              | -     | -     | 9,306,545.08     | 9,306,545.08     |
| 利率敏感度缺口                  | 180,350,515.35 | -     | -     | 2,117,457,862.09 | 2,297,808,377.44 |
| 上年度末<br>2015 年 12 月 31 日 | 1 年以内          | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息              | 合计               |
| 资产                       |                |       |       |                  |                  |
| 银行存款                     | 58,318,678.73  | -     | -     | -                | 58,318,678.73    |
| 结算备付金                    | 10,138,880.17  | -     | -     | -                | 10,138,880.17    |
| 存出保证金                    | 2,037,669.09   | -     | -     | -                | 2,037,669.09     |
| 交易性金融资产                  | 98,219,600.00  | -     | -     | 2,767,670,679.35 | 2,865,890,279.35 |
| 应收证券清算款                  | -              | -     | -     | 41,035,675.34    | 41,035,675.34    |
| 应收利息                     | -              | -     | -     | 1,811,795.78     | 1,811,795.78     |
| 应收申购款                    | -              | -     | -     | 229,038.38       | 229,038.38       |
| 资产总计                     | 168,714,827.99 | -     | -     | 2,810,747,188.85 | 2,979,462,016.84 |
| 负债                       |                |       |       |                  |                  |
| 应付赎回款                    | -              | -     | -     | 3,776,572.49     | 3,776,572.49     |
| 应付管理人报酬                  | -              | -     | -     | 3,794,778.87     | 3,794,778.87     |
| 应付托管费                    | -              | -     | -     | 632,463.14       | 632,463.14       |
| 应付交易费用                   | -              | -     | -     | 4,934,356.05     | 4,934,356.05     |
| 其他负债                     | -              | -     | -     | 1,156,658.34     | 1,156,658.34     |

|         |                |   |   |                  |                  |
|---------|----------------|---|---|------------------|------------------|
| 负债总计    | -              | - | - | 14,294,828.89    | 14,294,828.89    |
| 利率敏感度缺口 | 168,714,827.99 | - | - | 2,796,452,359.96 | 2,965,167,187.95 |

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金于 2016 年 12 月 31 日未持有债券资产(2015 年 12 月 31 日：3.31%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2015 年 12 月 31 日：同)。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票投资比例为基金总资产的 60%-95%，债券、权证、资产支持证券、货币市场工具及国家证券监管机构允许基金投资的其他金融工具占基金资产的比例范围为 0-40%，现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例在 5%以上。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时对风险进行跟踪和控制。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2016 年 12 月 31 日 |                          | 上年度末<br>2015 年 12 月 31 日 |                          |
|---------------|-------------------------|--------------------------|--------------------------|--------------------------|
|               | 公允价值                    | 占基金<br>资产净<br>值比例<br>(%) | 公允价值                     | 占基金<br>资产净<br>值比例<br>(%) |
| 交易性金融资产—股票投资  | 2,113,564,619.68        | 91.98                    | 2,767,670,679.35         | 93.34                    |
| 交易性金融资产—基金投资  | -                       | -                        | -                        | -                        |
| 交易性金融资产—贵金属投资 | -                       | -                        | -                        | -                        |
| 衍生金融资产—权证投资   | -                       | -                        | -                        | -                        |
| 合计            | 2,113,564,619.68        | 91.98                    | 2,767,670,679.35         | 93.34                    |

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 假设 | 除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变 |                                 |                          |
|----|----------------------|---------------------------------|--------------------------|
| 分析 | 相关风险变量的变动            | 对资产负债表日基金资产净值的<br>影响金额（单位：人民币元） |                          |
|    |                      | 本期末<br>2016 年 12 月 31 日         | 上年度末<br>2015 年 12 月 31 日 |
|    | 业绩比较基准上升 5%          | 增加约 136,050,000.00              | 增加约 189,740,000.00       |
|    | 业绩比较基准下降 5%          | 减少约 136,050,000.00              | 减少约 189,740,000.00       |

#### 7.4.14 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 2,026,881,976.79 元,属于第二层次的余额为 86,682,642.89 元,无属于第三层次的余额(2015 年 12 月 31 日:第一层次 2,720,833,047.35 元,第二层次 145,057,232.00 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              | 2,113,564,619.68 | 91.61        |
|    | 其中：股票             | 2,113,564,619.68 | 91.61        |
| 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      | 179,824,076.10   | 7.79         |
| 7  | 其他各项资产            | 13,726,226.74    | 0.59         |
| 8  | 合计                | 2,307,114,922.52 | 100.00       |

## 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别             | 公允价值             | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|------------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | 25,056,000.00    | 1.09         |
| B  | 采矿业              | 78,280,000.00    | 3.41         |
| C  | 制造业              | 1,287,814,732.71 | 56.05        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 92,738,217.66    | 4.04         |
| E  | 建筑业              | 15,592.23        | 0.00         |
| F  | 批发和零售业           | 79,945,045.00    | 3.48         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 325,533,989.88   | 14.17        |
| H  | 住宿和餐饮业           | 36,634,000.00    | 1.59         |

|   |                 |                  |       |
|---|-----------------|------------------|-------|
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 28,852,262.20    | 1.26  |
| J | 金融业             | 106,780.00       | 0.00  |
| K | 房地产业            | 145,568,000.00   | 6.34  |
| L | 租赁和商务服务业        | 13,020,000.00    | 0.57  |
| 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              | 2,113,564,619.68 | 91.98 |

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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  | 002152 | 广电运通 | 12,000,000 | 159,360,000.00 | 6.94         |
| 2  | 600761 | 安徽合力 | 8,800,000  | 111,936,000.00 | 4.87         |
| 3  | 603001 | 奥康国际 | 4,500,000  | 103,050,000.00 | 4.48         |
| 4  | 600428 | 中远海特 | 15,811,360 | 96,765,523.20  | 4.21         |
| 5  | 001979 | 招商蛇口 | 5,500,000  | 90,145,000.00  | 3.92         |
| 6  | 601021 | 春秋航空 | 2,359,200  | 86,677,008.00  | 3.77         |
| 7  | 603799 | 华友钴业 | 2,200,000  | 77,374,000.00  | 3.37         |
| 8  | 600096 | 云天化  | 8,000,000  | 75,920,000.00  | 3.30         |
| 9  | 600436 | 片仔癀  | 1,600,000  | 73,264,000.00  | 3.19         |
| 10 | 600518 | 康美药业 | 4,000,000  | 71,400,000.00  | 3.11         |
| 11 | 002172 | 澳洋科技 | 6,800,000  | 69,564,000.00  | 3.03         |
| 12 | 600896 | 览海投资 | 5,500,000  | 67,980,000.00  | 2.96         |
| 13 | 600085 | 同仁堂  | 2,000,000  | 62,760,000.00  | 2.73         |
| 14 | 000722 | 湖南发展 | 4,080,000  | 57,976,800.00  | 2.52         |
| 15 | 600716 | 凤凰股份 | 6,500,000  | 49,855,000.00  | 2.17         |
| 16 | 000970 | 中科三环 | 3,500,000  | 46,725,000.00  | 2.03         |
| 17 | 002381 | 双箭股份 | 3,800,000  | 44,346,000.00  | 1.93         |
| 18 | 600259 | 广晟有色 | 1,000,000  | 42,490,000.00  | 1.85         |
| 19 | 300068 | 南都电源 | 2,200,000  | 42,394,000.00  | 1.84         |

|    |        |       |           |               |      |
|----|--------|-------|-----------|---------------|------|
| 20 | 600060 | 海信电器  | 2,200,000 | 37,664,000.00 | 1.64 |
| 21 | 601007 | 金陵饭店  | 2,600,000 | 36,634,000.00 | 1.59 |
| 22 | 002353 | 杰瑞股份  | 1,800,000 | 36,540,000.00 | 1.59 |
| 23 | 600195 | 中牧股份  | 1,600,000 | 34,000,000.00 | 1.48 |
| 24 | 000930 | 中粮生化  | 2,500,000 | 33,600,000.00 | 1.46 |
| 25 | 600172 | 黄河旋风  | 1,800,000 | 32,184,000.00 | 1.40 |
| 26 | 300420 | 五洋科技  | 1,200,095 | 29,978,373.10 | 1.30 |
| 27 | 002308 | 威创股份  | 2,000,000 | 29,480,000.00 | 1.28 |
| 28 | 600993 | 马应龙   | 1,398,500 | 27,928,045.00 | 1.22 |
| 29 | 002468 | 申通快递  | 880,000   | 26,593,600.00 | 1.16 |
| 30 | 600009 | 上海机场  | 1,000,000 | 26,520,000.00 | 1.15 |
| 31 | 601118 | 海南橡胶  | 3,600,000 | 25,056,000.00 | 1.09 |
| 32 | 601933 | 永辉超市  | 5,000,000 | 24,550,000.00 | 1.07 |
| 33 | 000089 | 深圳机场  | 3,000,000 | 24,000,000.00 | 1.04 |
| 34 | 600787 | 中储股份  | 2,600,000 | 23,582,000.00 | 1.03 |
| 35 | 601766 | 中国中车  | 2,400,000 | 23,448,000.00 | 1.02 |
| 36 | 600711 | 盛屯矿业  | 3,000,000 | 21,060,000.00 | 0.92 |
| 37 | 601139 | 深圳燃气  | 2,150,000 | 19,543,500.00 | 0.85 |
| 38 | 603589 | 口子窖   | 600,000   | 19,278,000.00 | 0.84 |
| 39 | 300271 | 华宇软件  | 1,018,600 | 17,774,570.00 | 0.77 |
| 40 | 000516 | 国际医学  | 2,200,000 | 17,380,000.00 | 0.76 |
| 41 | 002588 | 史丹利   | 1,500,000 | 17,025,000.00 | 0.74 |
| 42 | 600856 | 中天能源  | 1,100,000 | 15,180,000.00 | 0.66 |
| 43 | 600759 | 洲际油气  | 1,500,000 | 14,730,000.00 | 0.64 |
| 44 | 601888 | 中国国旅  | 300,000   | 13,020,000.00 | 0.57 |
| 45 | 002494 | 华斯股份  | 800,000   | 11,072,000.00 | 0.48 |
| 46 | 600089 | 特变电工  | 1,200,000 | 10,956,000.00 | 0.48 |
| 47 | 002230 | 科大讯飞  | 400,000   | 10,836,000.00 | 0.47 |
| 48 | 603108 | 润达医疗  | 200,000   | 6,112,000.00  | 0.27 |
| 49 | 600639 | 浦东金桥  | 300,000   | 5,568,000.00  | 0.24 |
| 50 | 600713 | 南京医药  | 500,000   | 3,975,000.00  | 0.17 |
| 51 | 002001 | 新 和 成 | 200,000   | 3,920,000.00  | 0.17 |
| 52 | 600305 | 恒顺醋业  | 200,000   | 2,336,000.00  | 0.10 |
| 53 | 000729 | 燕京啤酒  | 100,000   | 695,000.00    | 0.03 |
| 54 | 600996 | 贵广网络  | 12,500    | 234,875.00    | 0.01 |
| 55 | 603823 | 百合花   | 3,762     | 123,167.88    | 0.01 |
| 56 | 601375 | 中原证券  | 26,695    | 106,780.00    | 0.00 |
| 57 | 603298 | 杭叉集团  | 3,641     | 88,403.48     | 0.00 |
| 58 | 603228 | 景旺电子  | 3,491     | 80,851.56     | 0.00 |
| 59 | 603577 | 汇金通   | 2,460     | 69,642.60     | 0.00 |
| 60 | 603218 | 日月股份  | 1,652     | 68,805.80     | 0.00 |
| 61 | 603877 | 太平鸟   | 3,180     | 67,734.00     | 0.00 |
| 62 | 300583 | 塞托生物  | 1,582     | 63,738.78     | 0.00 |
| 63 | 603416 | 信捷电气  | 1,076     | 53,886.08     | 0.00 |

|    |        |      |       |           |      |
|----|--------|------|-------|-----------|------|
| 64 | 002833 | 弘亚数控 | 2,743 | 48,331.66 | 0.00 |
| 65 | 603058 | 永吉股份 | 3,869 | 42,675.07 | 0.00 |
| 66 | 603886 | 元祖股份 | 2,242 | 39,683.40 | 0.00 |
| 67 | 603689 | 皖天然气 | 4,818 | 37,917.66 | 0.00 |
| 68 | 300582 | 英飞特  | 1,359 | 35,157.33 | 0.00 |
| 69 | 603239 | 浙江仙通 | 924   | 29,059.80 | 0.00 |
| 70 | 002835 | 同为股份 | 1,126 | 24,220.26 | 0.00 |
| 71 | 603035 | 常熟汽饰 | 2,316 | 24,179.04 | 0.00 |
| 72 | 603266 | 天龙股份 | 1,562 | 22,852.06 | 0.00 |
| 73 | 300587 | 天铁股份 | 1,438 | 20,290.18 | 0.00 |
| 74 | 603929 | 亚翔集成 | 2,193 | 15,592.23 | 0.00 |
| 75 | 002840 | 华统股份 | 1,814 | 11,881.70 | 0.00 |
| 76 | 002838 | 道恩股份 | 682   | 10,420.96 | 0.00 |
| 77 | 603186 | 华正新材 | 1,874 | 10,063.38 | 0.00 |
| 78 | 603032 | 德新交运 | 1,628 | 9,458.68  | 0.00 |
| 79 | 300586 | 美联新材 | 1,006 | 9,355.80  | 0.00 |
| 80 | 300591 | 万里马  | 2,397 | 7,358.79  | 0.00 |
| 81 | 300588 | 熙菱信息 | 1,380 | 6,817.20  | 0.00 |

#### 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  | 603799 | 华友钴业  | 214,295,572.12 | 7.23               |
| 2  | 001979 | 招商蛇口  | 208,457,604.68 | 7.03               |
| 3  | 601021 | 春秋航空  | 188,579,136.99 | 6.36               |
| 4  | 300059 | 东方财富  | 119,521,951.70 | 4.03               |
| 5  | 600096 | 云天化   | 116,274,112.13 | 3.92               |
| 6  | 600428 | 中远海特  | 113,044,037.23 | 3.81               |
| 7  | 600029 | 南方航空  | 111,845,250.79 | 3.77               |
| 8  | 601766 | 中国中车  | 82,497,554.86  | 2.78               |
| 9  | 600735 | 新华锦   | 80,197,560.74  | 2.70               |
| 10 | 002001 | 新 和 成 | 73,137,857.60  | 2.47               |
| 11 | 601888 | 中国国旅  | 71,887,305.84  | 2.42               |
| 12 | 000722 | 湖南发展  | 67,313,001.59  | 2.27               |
| 13 | 600060 | 海信电器  | 66,192,567.14  | 2.23               |
| 14 | 300068 | 南都电源  | 65,214,670.24  | 2.20               |
| 15 | 600085 | 同仁堂   | 64,013,165.13  | 2.16               |
| 16 | 601933 | 永辉超市  | 63,664,761.36  | 2.15               |

|    |        |        |               |      |
|----|--------|--------|---------------|------|
| 17 | 600172 | 黄河旋风   | 63,469,638.49 | 2.14 |
| 18 | 002152 | 广电运通   | 62,412,545.76 | 2.10 |
| 19 | 000831 | *ST 五稀 | 61,816,086.71 | 2.08 |
| 20 | 000970 | 中科三环   | 60,427,042.57 | 2.04 |

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  | 603799 | 华友钴业   | 280,790,580.73 | 9.47               |
| 2  | 601888 | 中国国旅   | 199,431,888.72 | 6.73               |
| 3  | 001979 | 招商蛇口   | 146,106,599.06 | 4.93               |
| 4  | 600029 | 南方航空   | 116,975,248.62 | 3.94               |
| 5  | 300059 | 东方财富   | 110,311,887.84 | 3.72               |
| 6  | 600060 | 海信电器   | 101,650,263.25 | 3.43               |
| 7  | 600325 | 华发股份   | 97,097,081.58  | 3.27               |
| 8  | 600735 | 新华锦    | 94,963,822.32  | 3.20               |
| 9  | 601336 | 新华保险   | 88,222,009.80  | 2.98               |
| 10 | 002051 | 中工国际   | 86,234,792.13  | 2.91               |
| 11 | 000728 | 国元证券   | 78,161,814.50  | 2.64               |
| 12 | 000831 | *ST 五稀 | 77,803,919.61  | 2.62               |
| 13 | 600436 | 片仔癀    | 74,258,434.43  | 2.50               |
| 14 | 002376 | 新北洋    | 73,377,653.09  | 2.47               |
| 15 | 601021 | 春秋航空   | 73,210,328.51  | 2.47               |
| 16 | 600009 | 上海机场   | 71,101,284.17  | 2.40               |
| 17 | 600172 | 黄河旋风   | 67,424,650.77  | 2.27               |
| 18 | 601933 | 永辉超市   | 66,241,893.96  | 2.23               |
| 19 | 002344 | 海宁皮城   | 66,090,037.09  | 2.23               |
| 20 | 002001 | 新 和 成  | 66,062,711.86  | 2.23               |
| 21 | 601766 | 中国中车   | 64,483,350.87  | 2.17               |
| 22 | 000911 | 南宁糖业   | 62,851,041.56  | 2.12               |
| 23 | 600594 | 益佰制药   | 59,989,949.68  | 2.02               |

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

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

|               |                  |
|---------------|------------------|
| 买入股票的成本（成交）总额 | 4,802,690,204.73 |
|---------------|------------------|

|               |                  |
|---------------|------------------|
| 卖出股票的收入（成交）总额 | 5,084,694,994.58 |
|---------------|------------------|

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

## 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

## 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券投资。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证投资。

## 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期没有投资股指期货。

### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 本期国债期货投资政策

无。

### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期没有投资国债期货。

### 8.11.3 本期国债期货投资评价

无。

## 8.12 投资组合报告附注

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

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

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称      | 金额            |
|----|---------|---------------|
| 1  | 存出保证金   | 526,439.25    |
| 2  | 应收证券清算款 | 12,969,114.42 |
| 3  | 应收股利    | -             |
| 4  | 应收利息    | 40,780.89     |
| 5  | 应收申购款   | 189,892.18    |
| 6  | 其他应收款   | -             |
| 7  | 待摊费用    | -             |
| 8  | 其他      | -             |
| 9  | 合计      | 13,726,226.74 |

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## §9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数(户) | 户均持有的<br>基金份额 | 持有人结构 |      |       |      |
|----------|---------------|-------|------|-------|------|
|          |               | 机构投资者 |      | 个人投资者 |      |
|          |               | 持有份额  | 占总份额 | 持有份额  | 占总份额 |

|         |           |                |       |                  |        |
|---------|-----------|----------------|-------|------------------|--------|
|         |           |                | 比例    |                  | 比例     |
| 109,376 | 13,634.73 | 102,930,520.55 | 6.90% | 1,388,381,443.50 | 93.10% |

## 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 持有份额总数（份） | 占基金总份额比例 |
|------------------|-----------|----------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 2,689.61  | 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(2007年4月10日)基金份额总额 | 500,000,000.00   |
| 本报告期期初基金份额总额              | 1,659,487,886.03 |
| 本报告期基金总申购份额               | 203,832,083.82   |
| 减：本报告期基金总赎回份额             | 372,008,005.80   |
| 本报告期基金拆分变动份额              | -                |
| 本报告期期末基金份额总额              | 1,491,311,964.05 |

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

本报告期基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 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<br>票成交总<br>额的比例 | 佣金           | 占当期佣<br>金总量的<br>比例 |    |
| 财富里昂 | 1              | -                | -                    | -            | -                  | -  |
| 中投证券 | 2              | -                | -                    | -            | -                  | -  |
| 长城证券 | 1              | -                | -                    | -            | -                  | -  |
| 申万宏源 | 1              | -                | -                    | -            | -                  | -  |
| 国都证券 | 1              | -                | -                    | -            | -                  | -  |
| 中天证券 | 1              | -                | -                    | -            | -                  | -  |
| 天风证券 | 1              | -                | -                    | -            | -                  | -  |
| 东兴证券 | 1              | -                | -                    | -            | -                  | -  |
| 银河证券 | 1              | -                | -                    | -            | -                  | -  |
| 高华证券 | 1              | -                | -                    | -            | -                  | -  |
| 东北证券 | 1              | -                | -                    | -            | -                  | -  |
| 上海证券 | 1              | -                | -                    | -            | -                  | -  |
| 民族证券 | 1              | -                | -                    | -            | -                  | -  |
| 华融证券 | 1              | -                | -                    | -            | -                  | -  |
| 宏信证券 | 1              | -                | -                    | -            | -                  | -  |
| 中金公司 | 1              | 2,227,899,011.45 | 22.55%               | 2,074,838.10 | 22.77%             | -  |
| 国金证券 | 2              | 1,587,193,047.62 | 16.06%               | 1,462,761.68 | 16.05%             | -  |
| 中泰证券 | 2              | 1,052,088,781.43 | 10.65%               | 959,702.99   | 10.53%             | -  |
| 川财证券 | 1              | 823,569,986.94   | 8.33%                | 750,520.46   | 8.24%              | -  |
| 广发证券 | 1              | 604,518,134.69   | 6.12%                | 550,898.14   | 6.05%              | -  |
| 民生证券 | 1              | 501,276,587.21   | 5.07%                | 466,838.55   | 5.12%              | -  |
| 华创证券 | 1              | 445,934,544.33   | 4.51%                | 415,297.45   | 4.56%              | -  |

|        |   |                |       |            |       |   |
|--------|---|----------------|-------|------------|-------|---|
| 国泰君安   | 1 | 327,987,424.32 | 3.32% | 298,894.66 | 3.28% | - |
| 华泰证券   | 1 | 311,539,442.44 | 3.15% | 283,906.09 | 3.12% | - |
| 安信证券   | 1 | 307,885,733.18 | 3.12% | 280,576.29 | 3.08% | - |
| 国信证券   | 1 | 277,233,316.27 | 2.81% | 258,187.18 | 2.83% | - |
| 中信证券   | 1 | 276,229,494.74 | 2.80% | 257,251.99 | 2.82% | - |
| 广发华福   | 1 | 272,240,065.40 | 2.76% | 253,537.73 | 2.78% | - |
| 招商证券   | 1 | 249,287,804.69 | 2.52% | 227,176.50 | 2.49% | - |
| 恒泰证券   | 1 | 241,259,994.74 | 2.44% | 224,685.72 | 2.47% | - |
| 信达证券   | 1 | 172,101,119.30 | 1.74% | 160,279.16 | 1.76% | - |
| 兴业证券   | 1 | 103,064,646.04 | 1.04% | 95,984.05  | 1.05% | - |
| 西藏东方财富 | 1 | 69,964,165.19  | 0.71% | 63,758.43  | 0.70% | - |
| 中银国际   | 1 | 30,133,519.33  | 0.30% | 27,460.68  | 0.30% | - |

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4月完成租用托管在工商银行的西藏东方财富证券深圳395395交易单元

2016年8月完成租用托管在工商银行的天风证券深圳398013交易单元

2016年11月完成租用托管在工商银行的宏信证券深圳002331深圳交易单元

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<br>债券成<br>交总额<br>的比例 | 成交金<br>额 | 占当期回<br>购成交总<br>额的比例 | 成交金额 | 占当期权<br>证成交总<br>额的比例 |
| 财富里昂 | -             | -                        | -        | -                    | -    | -                    |
| 中投证券 | -             | -                        | -        | -                    | -    | -                    |
| 长城证券 | -             | -                        | -        | -                    | -    | -                    |
| 申万宏源 | -             | -                        | -        | -                    | -    | -                    |
| 国都证券 | -             | -                        | -        | -                    | -    | -                    |
| 中天证券 | -             | -                        | -        | -                    | -    | -                    |
| 天风证券 | -             | -                        | -        | -                    | -    | -                    |
| 东兴证券 | -             | -                        | -        | -                    | -    | -                    |
| 银河证券 | -             | -                        | -        | -                    | -    | -                    |
| 高华证券 | -             | -                        | -        | -                    | -    | -                    |
| 东北证券 | -             | -                        | -        | -                    | -    | -                    |
| 上海证券 | -             | -                        | -        | -                    | -    | -                    |
| 民族证券 | -             | -                        | -        | -                    | -    | -                    |
| 华融证券 | -             | -                        | -        | -                    | -    | -                    |
| 宏信证券 | -             | -                        | -        | -                    | -    | -                    |
| 中金公司 | 10,007,000.00 | 100.00%                  | -        | -                    | -    | -                    |
| 国金证券 | -             | -                        | -        | -                    | -    | -                    |
| 中泰证券 | -             | -                        | -        | -                    | -    | -                    |
| 川财证券 | -             | -                        | -        | -                    | -    | -                    |
| 广发证券 | -             | -                        | -        | -                    | -    | -                    |
| 民生证券 | -             | -                        | -        | -                    | -    | -                    |
| 华创证券 | -             | -                        | -        | -                    | -    | -                    |
| 国泰君安 | -             | -                        | -        | -                    | -    | -                    |
| 华泰证券 | -             | -                        | -        | -                    | -    | -                    |
| 安信证券 | -             | -                        | -        | -                    | -    | -                    |
| 国信证券 | -             | -                        | -        | -                    | -    | -                    |
| 中信证券 | -             | -                        | -        | -                    | -    | -                    |

|        |   |   |   |   |   |   |
|--------|---|---|---|---|---|---|
| 广发华福   | - | - | - | - | - | - |
| 招商证券   | - | - | - | - | - | - |
| 恒泰证券   | - | - | - | - | - | - |
| 信达证券   | - | - | - | - | - | - |
| 兴业证券   | - | - | - | - | - | - |
| 西藏东方财富 | - | - | - | - | - | - |
| 中银国际   | - | - | - | - | - | - |

### 11.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项                                         | 法定披露方式                      | 法定披露日期     |
|----|----------------------------------------------|-----------------------------|------------|
| 1  | 华安基金关于 2016 年 1 月 4 日指数熔断期间调整旗下基金相关业务办理时间的公告 | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-01-04 |
| 2  | 华安基金管理有限公司关于旗下场内基金在指数熔断期间暂停申购赎回业务的提示性公告      | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-01-06 |
| 3  | 华安基金关于 2016 年 1 月 7 日指数熔断期间调整旗下基金相关业务办理时间的公告 | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-01-07 |
| 4  | 华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加金牛网为销售机构并参加费率优惠活动的公告     | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-01-14 |
| 5  | 华安基金管理有限公司关于参加渤海银行费率优惠的公告                    | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-01-19 |
| 6  | 华安基金管理有限公司关于参加京东淘宝费率优惠活动的公告                  | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-01-19 |
| 7  | 华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加泰信财富为销售机构的公告             | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-01-25 |
| 8  | 华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“苏宁环球”、“和晶科技”股票估值调整的公告    | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-01-30 |
| 9  | 华安基金管理有限公司关于基金电子交易平台延长工行直联结算方式费率优惠活动的公告      | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-02-03 |
| 10 | 华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海凯石财富基金销售有限公司为销售机构的公告   | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-02-23 |
| 11 | 华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中正为销售机构并参加费率优惠活动的公       | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》      | 2016-02-25 |

|    |                                                 |                                 |            |
|----|-------------------------------------------------|---------------------------------|------------|
|    | 告                                               | 和公司网站                           |            |
| 12 | 华安基金管理有限公司关于电子直销平台延长“微钱宝”账户交易费率优惠时间的公告          | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》<br>和公司网站 | 2016-03-28 |
| 13 | 华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加苏州银行为销售机构并参加费率优惠活动的公告       | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》<br>和公司网站 | 2016-03-23 |
| 14 | 华安基金管理有限公司关于参加深圳新兰德费率优惠的公告                      | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》<br>和公司网站 | 2016-03-24 |
| 15 | 关于华安旗下基金参加工商银行申购费率优惠活动的公告                       | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》<br>和公司网站 | 2016-03-30 |
| 16 | 华安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加东亚银行（中国）有限公司定期定额申购费率优惠活动的公告 | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》<br>和公司网站 | 2016-03-30 |
| 17 | 华安基金管理有限公司关于以固有资金购买基金所涉风险资产的公告                  | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》<br>和公司网站 | 2016-03-30 |
| 18 | 华安基金管理有限公司关于参加好买基金网费率优惠的公告                      | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》<br>和公司网站 | 2016-04-11 |
| 19 | 华安基金管理有限公司关于基金电子交易平台暂停部分基金赎回转申购业务的公告            | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》<br>和公司网站 | 2016-04-12 |
| 20 | 华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加钱景财富为销售机构并参加费率优惠活动的公告       | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》<br>和公司网站 | 2016-04-19 |
| 21 | 华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加格上理财为销售机构并参加费率优惠活动的公告       | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》<br>和公司网站 | 2016-04-26 |
| 22 | 华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“南山铝业”股票估值调整的公告              | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》<br>和公司网站 | 2016-04-27 |
| 23 | 华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中经北证为销售机构并参加费率优惠活动的公告       | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》<br>和公司网站 | 2016-04-29 |
| 24 | 华安基金管理有限公司关于华安旗下部分基金参加中国民生银行股份有限公司费率优惠活动的公告     | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》<br>和公司网站 | 2016-05-05 |
| 25 | 华安基金管理有限公司关于华安基金公司淘宝店关闭申购服务的公告                  | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》<br>和公司网站 | 2016-05-05 |
| 26 | 华安基金管理有限公司关于基金电子交易平                             | 《上海证券报》、《证券                     | 2016-05-05 |

|    |                                            |                             |            |
|----|--------------------------------------------|-----------------------------|------------|
|    | 台支付宝渠道关闭基金支付服务的公告                          | 时报》、《中国证券报》和公司网站            |            |
| 27 | 华安基金管理有限公司关于参加金牛网费率优惠的公告                   | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-05-06 |
| 28 | 华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加金观诚为销售机构并参加费率优惠活动的公告   | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-05-10 |
| 29 | 华安基金管理有限公司关于基金电子交易平台延长工行直联结算方式费率优惠活动的公告    | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-05-10 |
| 30 | 华安基金管理有限公司关于参加中正费率优惠的公告                    | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-05-18 |
| 31 | 关于华安基金管理有限公司旗下基金参加泉州银行优惠活动的公告              | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-05-25 |
| 32 | 华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加东莞农商行为销售机构并参加费率优惠活动的公告 | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-06-02 |
| 33 | 华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加晟视天下为销售机构并参加费率优惠活动的公告  | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-06-03 |
| 34 | 华安基金管理有限公司关于电子直销平台延长“微钱宝”账户交易费率优惠活动时间公告    | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-06-08 |
| 35 | 华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加奕丰金融为销售机构并参加费率优惠活动的公告  | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-06-14 |
| 36 | 华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“广电运通”股票估值调整的公告         | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-06-16 |
| 37 | 华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加广源达信为销售机构并参加费率优惠活动的公告  | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-06-21 |
| 38 | 关于华安基金管理有限公司旗下基金参加交通银行费率优惠活动的公告            | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-06-23 |
| 39 | 华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中信期货为销售机构的公告           | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-06-28 |
| 40 | 华安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加京东费率优惠活动的公告            | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-06-28 |

|    |                                    |                             |            |
|----|------------------------------------|-----------------------------|------------|
| 41 | 华安基金关于旗下部分基金增加金斧子为销售机构并参加费率优惠活动的公告 | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-07-05 |
| 42 | 关于旗下部分基金增加凯恩斯为销售机构并参加费率优惠活动的公告     | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-07-12 |
| 43 | 华安基金管理有限公司关于旗下基金参加和讯费率优惠的公告        | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-07-15 |
| 44 | 关于旗下部分基金增加常熟农商行为销售机构并参加费率优惠活动的公告   | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-07-20 |
| 45 | 华安基金新增蛋卷基金代销并参加费率优惠的公告             | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-07-22 |
| 46 | 华安基金关于旗下部分基金增加大智慧为销售机构并参加费率优惠活动的公告 | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-08-06 |
| 47 | 关于华安基金管理有限公司旗下基金参加中信证券优惠活动的公告      | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-08-09 |
| 48 | 关于旗下部分基金增加创金启富为销售机构并参加费率优惠活动的公告    | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-08-13 |
| 49 | 关于基金电子交易平台延长工行直联结算方式费率优惠活动的公告      | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-08-15 |
| 50 | 华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“中海海盛”股票估值调整的公告 | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-08-18 |
| 51 | 关于华安基金管理有限公司旗下基金参加联泰优惠活动的公告        | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-08-19 |
| 52 | 关于旗下部分基金增加昆山农商行为销售机构并参加费率优惠活动的公告   | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-09-06 |
| 53 | 关于旗下部分基金增加新浪仓石为销售机构并参加费率优惠活动的公告    | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-09-12 |
| 54 | 关于华安基金管理有限公司旗下基金参加交通银行费率优惠活动的公告    | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-09-20 |
| 55 | 关于旗下部分基金增加嘉兴银行为销售机构的公告             | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》      | 2016-09-21 |

|    |                                 | 和公司网站                           |            |
|----|---------------------------------|---------------------------------|------------|
| 56 | 关于旗下部分基金增加宁波银行为销售机构的公告          | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》<br>和公司网站 | 2016-09-21 |
| 57 | 关于电子直销平台延长“微钱宝”账户交易费率优惠活动时间公告   | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》<br>和公司网站 | 2016-09-23 |
| 58 | 关于旗下部分基金增加苏宁为销售机构并参加费率优惠活动的公告   | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》<br>和公司网站 | 2016-09-29 |
| 59 | 关于旗下部分基金增加万得为销售机构并参加费率优惠活动的公告   | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》<br>和公司网站 | 2016-10-11 |
| 60 | 华安基金管理有限公司关于旗下基金参加钱景财富费率优惠的公告   | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》<br>和公司网站 | 2016-10-13 |
| 61 | 关于旗下部分基金增加国美为销售机构并参加费率优惠活动的公告   | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》<br>和公司网站 | 2016-10-18 |
| 62 | 关于旗下部分基金增加途牛为销售机构并参加费率优惠活动的公告   | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》<br>和公司网站 | 2016-10-27 |
| 63 | 关于旗下部分基金增加和耕为销售机构并参加费率优惠活动的公告   | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》<br>和公司网站 | 2016-11-01 |
| 64 | 关于旗下部分基金增加云湾投资为销售机构并参加费率优惠活动的公告 | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》<br>和公司网站 | 2016-11-10 |
| 65 | 关于基金电子交易平台延长工行直联结算方式费率优惠活动的公告   | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》<br>和公司网站 | 2016-11-10 |
| 66 | 华安基金管理有限公司关于统一客户服务热线号的公告        | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》<br>和公司网站 | 2016-11-16 |
| 67 | 关于旗下部分基金增加乾道金融为销售机构并参加费率优惠活动的公告 | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》<br>和公司网站 | 2016-11-16 |
| 68 | 关于电子直销平台延长“微钱宝”账户交易费率优惠活动时间公告   | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》<br>和公司网站 | 2016-11-29 |
| 69 | 关于华安基金管理有限公司旗下基金参加交通银行费率优惠活动的公告 | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》<br>和公司网站 | 2016-11-29 |
| 70 | 华安基金管理有限公司关于旗下基金参加凯             | 《上海证券报》、《证券                     | 2016-11-30 |

|    |                                          |                             |            |
|----|------------------------------------------|-----------------------------|------------|
|    | 石费率优惠的公告                                 | 时报》、《中国证券报》和公司网站            |            |
| 71 | 关于旗下部分基金增加懒猫为销售机构并参加费率优惠活动的公告            | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-11-30 |
| 72 | 关于旗下部分基金增加华鑫证券为销售机构并参加费率优惠活动的公告          | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-12-06 |
| 73 | 关于旗下部分基金增加汇付金融为销售机构并参加费率优惠的公告            | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-12-13 |
| 74 | 关于旗下部分基金增加东海期货为销售机构并参加费率优惠活动的公告          | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-12-20 |
| 75 | 关于华安基金管理有限公司旗下基金参加交通银行费率优惠活动的公告          | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-12-22 |
| 76 | 关于旗下部分基金增加挖财为销售机构并参加费率优惠活动的公告            | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-12-23 |
| 77 | 关于华安基金管理有限公司旗下基金参加中国农业银行费率优惠活动的公告        | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-12-28 |
| 78 | 关于旗下部分基金开通并参加中国工商银行股份有限公司基金定期定额投资优惠活动的公告 | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-12-28 |
| 79 | 华安基金管理有限公司关于旗下基金参加苏州银行费率优惠的公告            | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-12-28 |
| 80 | 华安基金管理有限公司关于参加东莞银行费率优惠的公告                | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-12-30 |
| 81 | 华安基金管理有限公司关于参加烟台银行费率优惠的公告                | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2016-12-30 |

注：前款所涉重大事件已作为临时报告在《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站www.huaan.com.cn上披露。

## §12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、《华安中小盘成长混合型证券投资基金基金合同》

- 2、《华安中小盘成长混合型证券投资基金招募说明书》
- 3、《华安中小盘成长混合型证券投资基金托管协议》
- 4、中国证监会批准华安中小盘成长混合型证券投资基金设立的文件；
- 5、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告原件；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
- 7、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 8、华安基金管理有限公司开放式基金业务规则；

## 12.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的办公场所，并登载于基金管理人互联网站 <http://www.huaan.com.cn>。

## 12.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站查阅，或在营业时间内至基金管理人或基金托管人的办公场所免费查阅。

华安基金管理有限公司

二〇一七年三月二十八日