

华安智能装备主题股票型证券投资基金
2017 年半年度报告
2017 年 6 月 30 日

基金管理人：华安基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一七年八月二十五日

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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 23 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
2 基金简介	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
3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	12
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	12
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	16
7 投资组合报告	33
7.1 期末基金资产组合情况	33
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	34
7.3 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	35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	44
7.6 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	44
7.7 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	44
7.8 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	44
7.9 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	45
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	45
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	45
7.12 投资组合报告附注	45
8 基金份额持有人信息	46
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	46

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	47
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	47
9 开放式基金份额变动	47
10 重大事件揭示	47
10.1 基金份额持有人大会决议	47
10.2 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	47
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	47
10.4 基金投资策略的改变	48
10.5 报告期内改聘会计师事务所情况	48
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	48
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	48
10.8 其他重大事件	49
11 影响投资者决策的其他重要信息	52
12 备查文件目录	52
12.1 备查文件目录	52
12.2 存放地点	52
12.3 查阅方式	52

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华安智能装备主题股票型证券投资基金
基金简称	华安智能装备主题股票
基金主代码	001072
交易代码	001072
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 4 月 24 日
基金管理人	华安基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,607,047,860.39 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华安基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	钱鲲	林葛
	联系电话	021-38969999	010-66060069
	电子邮箱	qiankun@huanan.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4008850099	95599
传真		021-68863414	010-68121816
注册地址		上海市世纪大道8号上海国金	北京市东城区建国门内大街69

	中心二期31层、32层	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28号凯晨世贸中心东座F9
邮政编码	200120	100031
法定代表人	朱学华	周慕冰

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
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.huaan.com.cn
基金半年度报告备置地点	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
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 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期（2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	-57,242,749.03
本期利润	14,862,848.59
加权平均基金份额本期利润	0.0094
本期加权平均净值利润率	1.01%
本期基金份额净值增长率	1.51%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-89,783,480.01
期末可供分配基金份额利润	-0.0559
期末基金资产净值	1,517,264,380.38
期末基金份额净值	0.944
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-5.60%

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

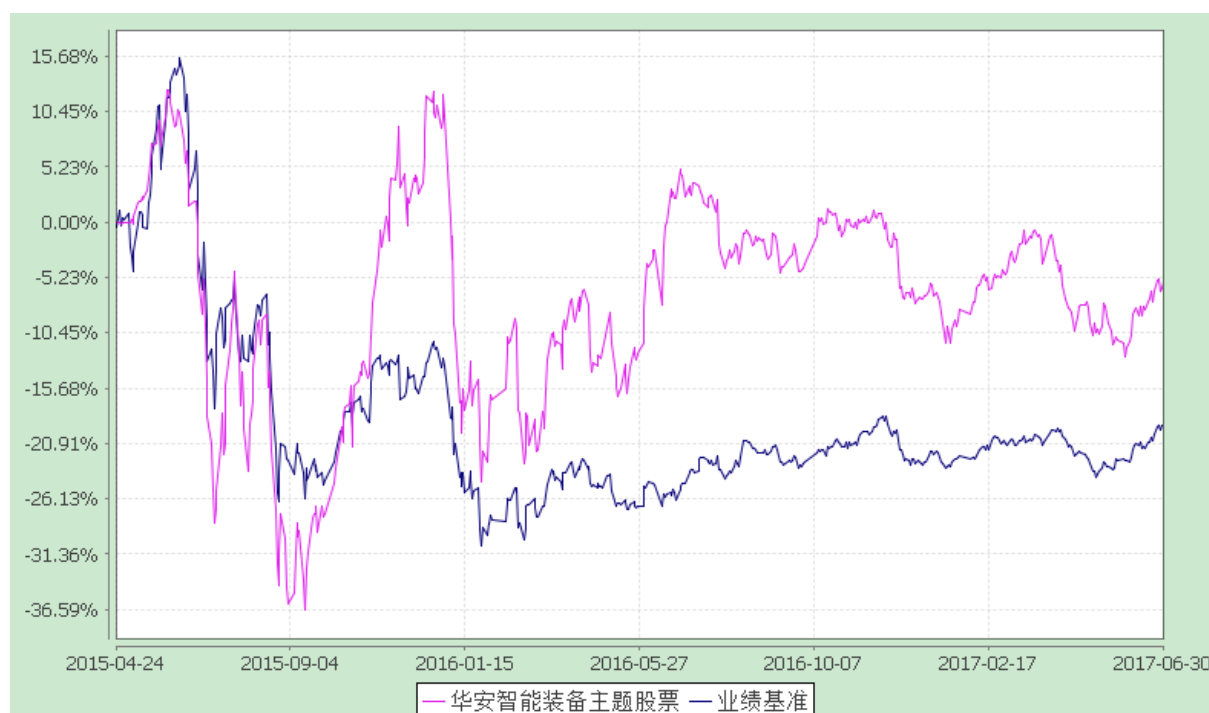
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	6.55%	0.93%	4.25%	0.51%	2.30%	0.42%
过去三个月	-2.18%	1.02%	2.26%	0.53%	-4.44%	0.49%
过去六个月	1.51%	0.95%	5.06%	0.49%	-3.55%	0.46%
过去一年	-8.79%	0.95%	8.34%	0.56%	-17.13%	0.39%
自基金成立起至今	-5.60%	2.21%	-19.22%	1.52%	13.62%	0.69%

3.2.2 自基金合同生效以来 基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华安智能装备主题股票型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2015 年 4 月 24 日至 2017 年 6 月 30 日）



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。公司在北京、上海、沈阳、成都、广州等地设有分公司，在香港和上海设有子公司—华安（香港）资产管理有限公司、华安未来资产管理有限公司。截至 2017 年 6 月 30 日，公司旗下共管理华安创新混合、华安 MSCI 中国 A、华安现金富利货币、华安稳定收益债券、华安黄金易 ETF、华安沪港深外延增长混合、华安全球美元收益债券等 96 只开放式基金，管理资产规模达到 1478.85 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		
李欣	本基金的基金经理	2015-07-09	-	7 年	硕士研究生，7 年证券、基金从业经历，拥有基金从业资格证书。曾任华泰联合证券有限责任公司研究员。2012 年 5 月加入华安基金，任投资研究部研究员。2015 年 7 月起担任本基金的基金经理。2017 年 6 月起，同时担任华安文体健康主题灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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。

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。

4.3.2 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，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 0 次，未出现异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，市场风格较为显著，低估值、当前和短期业绩增长确定性成为市场选股的主要逻辑，这是全社会和金融体系降杠杆的大背景在二级市场的体现。由于我国城镇化周期和居民资产配置周期的原因，虽然地产政策持续收紧，但地产销量、尤其是三四线地产销量仍持续超预期，带动家电、建材、钢铁等行业需求超预期，同时传统周期性产业供给侧改革得到有效执行，带来显著的价格弹性，形成量价齐升的局面。白酒等消费品行业在需求侧的消费升级和供给侧的产能与库存周期的合力作用下，上半年也迎来了基本面的显著优化。

报告期内，在注重低估值、注重业绩确定性、注重当前和短期业绩的市场选股偏好下，白马成长、“漂亮 50”、业绩高弹性的周期股成为市场追逐的主要热点。而同时，新能源汽车和以苹果产业链为代表的消费电子由于其成长逻辑清晰、成长空间大、业绩确定性强，成为市场较为认可的成长性板块。

报告期内，本基金重点投资了消费电子和安防产业链、新能源车产业链、白马成长股等板块，取得了一定的效果；但同时，也投资了一些尚处于成长中前期或基本面拐点的标的，由于上半年的市场风格是偏重于当前和短期业绩的确定性、偏重于低估值，这些投资对整体业绩起到了一定的负面作用。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止 2017 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 0.944 元，本报告期份额净值增长率为 1.51%，同期业绩比较基准增长率为 5.06%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本基金认为，今年下半年国内宏观经济将保持稳健增长的格局。地产行业方面，虽然调控政策对短期需求有一定的延后和抑制作用，但由于我国仍处于大规模城镇化周期，城市住房附带的社会资源属性和居民资产配置周期逻辑仍未被打破，加之地产周期的固有惯性，因此地产销售和新开工增速仍将保持在一定水平，预计不会出现快速下滑，从而对耐用消费品、地产相关周期品的需求形成支撑。

同时，以一带一路、雄安新区等国家级战略为龙头，全社会的固定资产投资将保持较高增速。我国的基础设施、重大工程的投资空间和潜力仍然巨大，对建材、建筑、钢铁、有色等相关产业能够形成有效的需求拉动。

本基金认为，新能源汽车、工业自动化、消费电子与汽车电子等战略新兴产业在下半年和今后长期都具有较好的增长潜力，也具有较高的成长确定性。这些新兴产业的发展，有助于我国制造业整体水平的提升，有助于我国在全球产业价值分布中地位的提高，从而促进我国实现对科技发达国家在制造业领域的弯道超车。服务实体经济、帮助实体经济提升产业竞争力、实现产业技术和产品升级是金融体系的基本定位和功能，这些战略新兴产业也是二级市场的重要投资方向。

本基金认为，下半年市场风格会更加偏重于估值和成长速度、成长空间、成长确定性的匹配性，资金会逐渐从一些环比增长趋势走弱的行业和板块流出，流入增长加速的行业和板块。新能源汽车产业链关键性产业环节有望继续享受量价齐升的行业红利，电子化趋势在汽车等行业将快速渗透，智能化加工设备在消费电子等领域将快速放量，人工智能在安防、语音等领域将率先普及，增长确定性强、产业落地路径明确的成长性行业在下半年将有较好的投资机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，负责在证券发行机构发生了严重影响证券价格的重大事件时，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；同时将采用的估值方法以及采用该方法对相关证券的估值与基金的托管银行进行沟通。估值委员会成员由投资总监、研究总监、固定收益部总监、指数投资部总监、基金运营部总经理、风险管理部总监等人员组成，具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备行业研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供银行间同业市场及交易所交易的债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期不进行收益分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人华安基金管理有限公司 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

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

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

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

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华安智能装备主题股票型证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资 产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	109,852,760.89	148,675,365.72
结算备付金		8,946,010.48	8,548,628.00
存出保证金		1,338,426.22	2,208,756.30
交易性金融资产	6.4.7.2	1,422,750,399.08	1,269,181,449.88
其中：股票投资		1,422,194,869.88	1,268,562,525.64
基金投资		-	-
债券投资		555,529.20	618,924.24
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		31,587,513.16	-
应收利息	6.4.7.5	26,823.84	44,482.93
应收股利		-	-
应收申购款		24,198.93	149,796.05
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,574,526,132.60	1,428,808,478.88
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
负 债：		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		45,073,972.39	11,100,599.44
应付赎回款		2,063,804.64	19,690,370.45
应付管理人报酬		1,829,233.78	1,847,459.58
应付托管费		304,872.30	307,909.95
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	7,787,962.61	5,532,538.30
应交税费		-	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	201,906.50	509,203.40
负债合计		57,261,752.22	38,988,081.12
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.9	1,607,047,860.39	1,494,149,307.29
未分配利润	6.4.7.10	-89,783,480.01	-104,328,909.53
所有者权益合计		1,517,264,380.38	1,389,820,397.76
负债和所有者权益总计		1,574,526,132.60	1,428,808,478.88

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.944 元，基金份额总额 1,607,047,860.39 份。

6.2 利润表

会计主体：华安智能装备主题股票型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
一、收入		50,312,259.53	-60,928,781.76
1.利息收入		602,945.53	793,388.11
其中：存款利息收入	6.4.7.11	602,075.30	793,388.11
债券利息收入		870.23	-
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）		-22,749,441.17	41,050,450.54
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-27,881,471.36	36,257,668.38
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	5,132,030.19	4,792,782.16
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	72,105,597.62	-106,314,196.47
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	353,157.55	3,541,576.06
减：二、费用		35,449,410.94	35,623,695.34
1. 管理人报酬	6.4.10.2	10,923,041.43	12,178,741.14
2. 托管费	6.4.10.2	1,820,506.95	2,029,790.25

3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	22,484,362.83	21,191,277.80
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.19	221,499.73	223,886.15
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		14,862,848.59	-96,552,477.10
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		14,862,848.59	-96,552,477.10

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安智能装备主题股票型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 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）	1,494,149,307.29	-104,328,909.53	1,389,820,397.76
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	14,862,848.59	14,862,848.59
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）	112,898,553.10	-317,419.07	112,581,134.03
其中：1.基金申购款	282,490,820.70	-9,786,142.64	272,704,678.06
2.基金赎回款	-169,592,267.60	9,468,723.57	-160,123,544.03
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	1,607,047,860.39	-89,783,480.01	1,517,264,380.38
项目	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,751,001,345.80	176,333,606.76	1,927,334,952.56
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-96,552,477.10	-96,552,477.10
三、本期基金份额交易产	67,504,736.63	-16,127,670.72	51,377,065.91

生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）			
其中：1.基金申购款	711,038,058.82	-62,419,463.09	648,618,595.73
2.基金赎回款	-643,533,322.19	46,291,792.37	-597,241,529.82
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	1,818,506,082.43	63,653,458.94	1,882,159,541.37

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，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：赵敏，会计机构负责人：陈林

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华安智能装备主题股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)，系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2015]207 号《关于准予华安智能装备主题股票型证券投资基金注册的批复》的核准，由华安基金管理有限公司作为管理人自 2015 年 4 月 1 日至 2015 年 4 月 22 日止期间向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)验证并出具安永华明(2015)验字第 60971571_B15 号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2015 年 4 月 24 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 3,236,451,383.40 元，在募集期间产生的存款利息为人民币 1,269,235.67 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 3,237,720,619.07 元，折合 3,237,720,619.07 份基金份额。本基金的基金管理人及注册登记机构为华安基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

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

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

本基金的投资组合比例为：股票资产投资比例为基金资产的 80%-95%，其中，投资于智能装备相关的股票资产的比例不低于非现金基金资产的 80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳

的交易保证金后，应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。 本基金业绩比较基准： $80\% \times \text{中证 800 指数收益率} + 20\% \times \text{中国债券总指数收益率}$ 。

本财务报表由本基金的基金管理人华安基金管理有限公司于 2017 年 8 月 23 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本会计期间不存在会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本会计期间不存在会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本会计期间不存在差错更正。

6.4.6 税项

6.4.6.1 印花税

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

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

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

6.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

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

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或

汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 2018 年 1 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。

6.4.6.3 企业所得税

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

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

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

6.4.6.4 个人所得税

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

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

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
活期存款	109,852,760.89
定期存款	-
其他存款	-
合计	109,852,760.89

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2017 年 6 月 30 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		1,394,257,178.00	1,422,194,869.88	27,937,691.88
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	548,400.00	555,529.20	7,129.20
	银行间市场	-	-	-
	合计	548,400.00	555,529.20	7,129.20
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		1,394,805,578.00	1,422,750,399.08	27,944,821.08

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	21,038.38
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	3,623.13
应收债券利息	1,620.26
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	542.07
合计	26,823.84

6.4.7.6 其他资产

无余额。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	7,787,962.61
银行间市场应付交易费用	-
合计	7,787,962.61

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	3,552.22
预提账户维护费	-
预提审计费	49,588.57
预提信息披露费	148,765.71
合计	201,906.50

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
----	---------------------------------------

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,494,149,307.29	1,494,149,307.29
本期申购	282,490,820.70	282,490,820.70
本期赎回（以“-”号填列）	-169,592,267.60	-169,592,267.60
本期末	1,607,047,860.39	1,607,047,860.39

注：申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 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	-2,585,551.58	-101,743,357.95	-104,328,909.53
本期利润	-57,242,749.03	72,105,597.62	14,862,848.59
本期基金份额交易产生的变动数	-1,528,445.12	1,211,026.05	-317,419.07
其中：基金申购款	-5,223,323.34	-4,562,819.30	-9,786,142.64
基金赎回款	3,694,878.22	5,773,845.35	9,468,723.57
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-61,356,745.73	-28,426,734.28	-89,783,480.01

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	490,615.46
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	96,432.65
其他	15,027.19
合计	602,075.30

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	7,428,816,207.96
减：卖出股票成本总额	7,456,697,679.32
买卖股票差价收入	-27,881,471.36

6.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
股票投资产生的股利收益	5,132,030.19
基金投资产生的股利收益	-
合计	5,132,030.19

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
1.交易性金融资产	72,105,597.62
——股票投资	72,168,992.66
——债券投资	-63,395.04
——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	72,105,597.62

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
基金赎回费收入	353,157.55
合计	353,157.55

注：1. 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。

2. 本基金的转换费由赎回费和申购费补差两部分构成，其中赎回费部分的 25%归入转出基金的基金资产。

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
交易所市场交易费用	22,484,362.83
银行间市场交易费用	-
合计	22,484,362.83

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
审计费用	49,588.57
信息披露费	148,765.71
银行汇划费用	13,935.45
账户维护费	9,180.00
其他费用	30.00
合计	221,499.73

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

无。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华安基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构

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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

无。

6.4.10.1.4 债券回购交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月 30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	10,923,041.43	12,178,741.14
其中：支付销售机构的客户维护费	4,545,099.64	5,350,812.28

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月 30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6 月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,820,506.95	2,029,790.25

注：支付基金托管人 中国农业银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.4.2 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。

6.4.10.5 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 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司	109,852,760.89	490,615.46	181,684,895.11	664,375.54

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.11 利润分配情况

本报告期不进行收益分配。

6.4.12 期末（2017 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 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

6.4.12.1.1 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
002879	长缆科技	2017-06-05	2017-07-07	网下中签	18.02	18.02	1,313.00	23,660.26	23,660.26	-
002888	金龙	2017-06-05	2017-07-07	网下中签	6.20	6.20	2,966.00	18,389.20	18,389.20	-

2	羽	6-15	7-17	中签			0			
300670	大烨智能	2017-06-26	2017-07-03	网下中签	10.93	10.93	1,259.00	13,760.87	13,760.87	-
300671	富满电子	2017-06-27	2017-07-05	网下中签	8.11	8.11	942.00	7,639.62	7,639.62	-
300672	国科微	2017-06-30	2017-07-12	网下中签	8.48	8.48	1,257.00	10,659.36	10,659.36	-
603305	旭升股份	2017-06-30	2017-07-10	网下中签	11.26	11.26	1,351.00	15,212.26	15,212.26	-
603331	百达精工	2017-06-27	2017-07-05	网下中签	9.63	9.63	999.00	9,620.37	9,620.37	-
603617	君禾股份	2017-06-23	2017-07-03	网下中签	8.93	8.93	832.00	7,429.76	7,429.76	-
603933	睿能科技	2017-06-28	2017-07-06	网下中签	20.20	20.20	857.00	17,311.40	17,311.40	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002127	南极电商	2017-06-29	筹划重大资产重组	12.08	2017-07-06	12.61	1,507,400.00	19,271,565.84	18,209,392.00	-
002175	东方网络	2017-03-09	筹划重大资产重组	16.38	2017-07-13	14.74	178,000.00	2,825,033.00	2,915,640.00	-
002696	百洋股份	2017-06-22	筹划重大资产重组	20.87	2017-07-03	21.74	482,400.00	11,833,571.41	10,067,688.00	-
600603	广汇物流	2017-06-15	筹划重大资产重组	11.81	2017-07-27	11.71	554,800.00	7,346,479.19	6,552,188.00	-
603238	诺邦股份	2017-06-07	筹划重大资产重组	29.38	-	-	1,750.00	23,292.50	51,415.00	-

注：本基金截至 2017 年 6 月 30 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。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 6 月 30 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 6 月 30 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金为股票型基金，基金的风险与预期收益都要高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金，属于证券投资基金中的高风险投资品种。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。本基金重点投资于与智能装备相关的子行业或企业，在严格控制风险的前提下，力争把握标的行业投资机会实现基金资产的长期稳健增值。

6.4.13.1 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控制委员会，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；在管理层层面设立合规与风险控制委员会，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。

6.4.13.2 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建设银行，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。

6.4.13.3 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%。本基金所持证券均在证券交易所上市，因此除附注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。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 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。

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金等，其余金融资产和金融负债均不计息，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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	109,852,760.89	-	-	-	109,852,760.89
结算备付金	8,946,010.48	-	-	-	8,946,010.48
存出保证金	1,338,426.22	-	-	-	1,338,426.22
交易性金融资产	555,529.20	-	-	1,422,194,869.88	1,422,750,399.08
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	31,587,513.16	31,587,513.16
应收利息	-	-	-	26,823.84	26,823.84
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	24,198.93	24,198.93
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	120,692,726.79	-	-	1,453,833,405.81	1,574,526,132.60
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	45,073,972.39	45,073,972.39
应付赎回款	-	-	-	2,063,804.64	2,063,804.64
应付管理人报酬	-	-	-	1,829,233.78	1,829,233.78
应付托管费	-	-	-	304,872.30	304,872.30
应付交易费用	-	-	-	7,787,962.61	7,787,962.61
应付税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	201,906.50	201,906.50
负债总计	-	-	-	57,261,752.22	57,261,752.22

利率敏感度缺口	120,692,726.79	-	-	1,396,571,653.59	1,517,264,380.38
上年度末 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	148,675,365.72	-	-	-	148,675,365.72
结算备付金	8,548,628.00	-	-	-	8,548,628.00
存出保证金	2,208,756.30	-	-	-	2,208,756.30
交易性金融资产	618,924.24	-	-	1,268,562,525.64	1,269,181,449.88
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	44,482.93	44,482.93
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	149,796.05	149,796.05
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	160,051,674.26	-	-	1,268,756,804.62	1,428,808,478.88
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	11,100,599.44	11,100,599.44
应付赎回款	-	-	-	19,690,370.45	19,690,370.45
应付管理人报酬	-	-	-	1,847,459.58	1,847,459.58
应付托管费	-	-	-	307,909.95	307,909.95
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	5,532,538.30	5,532,538.30
应付税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	509,203.40	509,203.40
负债总计	-	-	-	38,988,081.12	38,988,081.12
利率敏感度缺口	160,051,674.26	-	-	1,229,768,723.50	1,389,820,397.76

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。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金于 2017 年 6 月 30 日未持有债券资产，且持有的银行存款均为活期存款，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 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。

6.4.13.4.3 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。

本基金采取相对稳定的资产配置策略，一般情况下将保持股票配置比例的相对稳定，避免因过于主动的仓位调整带来额外的风险。在大类资产配置过程中，本基金将使用定量与定性相结合的研究方法对宏观经济、国家政策、资金面和市场情绪等可能影响证券市场的重要因素进行研究和预测，结合使用公司自主研发的多因子动态资产配置模型、基于投资时钟理论的资产配置模型等经济模型，分析和比较股票、债券等市场和不同金融工具的风险收益特征，确定合适的资产配置比例，动态优化投资组合。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。本基金股票投资占基金资产的比例范围为 80%-95%，其中投资于智能装备相关的股票资产的比例不低于非现金基金资产的 80%。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，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末		上年度末	
	2017 年 6 月 30 日		2016 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资	公允价值	占基金资

		产净值比 例（%）		产净值比 例（%）
交易性金融资产—股票投资	1,422,194,869.88	93.73	1,268,562,525.64	91.28
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	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,422,194,869.88	93.73	1,268,562,525.64	91.28

6.4.13.4.3.2 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 影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
	业绩比较基准增加 5%	增加约 11,699	增加约 10,222
	业绩比较基准减少 5%	减少约 11,699	减少约 10,222

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比 例（%）
1	权益投资	1,422,194,869.88	90.33
	其中：股票	1,422,194,869.88	90.33
2	固定收益投资	555,529.20	0.04
	其中：债券	555,529.20	0.04
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-

4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	118,798,771.37	7.55
7	其他各项资产	32,976,962.15	2.09
8	合计	1,574,526,132.60	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	20,654,904.00	1.36
B	采矿业	7,480,100.00	0.49
C	制造业	1,209,913,717.71	79.74
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	82,628.70	0.01
E	建筑业	3,425,334.14	0.23
F	批发和零售业	10,218,405.83	0.67
G	交通运输、仓储和邮政业	10,782,342.02	0.71
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	32,095,871.69	2.12
J	金融业	72,625,849.01	4.79
K	房地产业	5,138,635.48	0.34
L	租赁和商务服务业	40,153,462.12	2.65
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	101,633.58	0.01
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	2,969,797.60	0.20
S	综合	6,552,188.00	0.43
	合计	1,422,194,869.88	93.73

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

7.3 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	002466	天齐锂业	1,254,395	68,176,368.25	4.49
2	000651	格力电器	1,364,100	56,159,997.00	3.70
3	000050	深天马 A	2,681,700	55,162,569.00	3.64
4	300083	劲胜精密	5,359,927	49,525,725.48	3.26
5	002139	拓邦股份	3,344,570	36,021,018.90	2.37
6	002475	立讯精密	1,209,185	35,356,569.40	2.33
7	002236	大华股份	1,492,168	34,036,352.08	2.24
8	300136	信维通信	839,246	33,586,624.92	2.21
9	300545	联得装备	443,578	32,070,689.40	2.11
10	603337	杰克股份	825,933	31,963,607.10	2.11
11	600114	东睦股份	1,772,434	31,017,595.00	2.04
12	002511	中顺洁柔	2,246,322	29,718,840.06	1.96
13	002217	合力泰	2,902,900	28,680,652.00	1.89
14	002120	韵达股份	538,893	27,806,878.80	1.83
15	600030	中信证券	1,590,400	27,068,608.00	1.78
16	600584	长电科技	1,651,354	26,504,231.70	1.75
17	300138	晨光生物	1,989,903	26,107,527.36	1.72
18	002185	华天科技	3,504,968	25,375,968.32	1.67
19	603660	苏州科达	615,263	25,195,019.85	1.66
20	600309	万华化学	835,100	23,917,264.00	1.58
21	300232	洲明科技	1,462,855	23,405,680.00	1.54
22	601601	中国太保	657,300	22,262,751.00	1.47
23	300236	上海新阳	746,343	21,031,945.74	1.39
24	002074	国轩高科	648,221	20,451,372.55	1.35
25	300458	全志科技	698,959	18,410,580.06	1.21
26	002127	南极电商	1,507,400	18,209,392.00	1.20
27	600651	飞乐音响	2,035,100	17,237,297.00	1.14
28	300588	熙菱信息	488,500	16,994,915.00	1.12
29	002045	国光电器	1,019,801	16,204,637.89	1.07
30	002138	顺络电子	866,500	16,099,570.00	1.06
31	000063	中兴通讯	675,200	16,029,248.00	1.06
32	000951	中国重汽	1,009,717	15,438,572.93	1.02
33	600563	法拉电子	305,757	15,107,453.37	1.00
34	002271	东方雨虹	380,700	14,123,970.00	0.93

35	600507	方大特钢	1,614,100	13,768,273.00	0.91
36	300604	长川科技	368,711	13,697,613.65	0.90
37	600093	易见股份	1,016,100	13,646,223.00	0.90
38	300207	欣旺达	1,139,892	13,439,326.68	0.89
39	002850	科达利	146,900	13,337,051.00	0.88
40	002371	北方华创	556,700	13,316,264.00	0.88
41	002196	方正电机	1,100,697	12,580,966.71	0.83
42	600036	招商银行	524,700	12,545,577.00	0.83
43	300327	中颖电子	381,500	12,093,550.00	0.80
44	600207	安彩高科	1,587,417	11,842,130.82	0.78
45	000333	美的集团	271,538	11,686,995.52	0.77
46	300568	星源材质	264,890	11,244,580.50	0.74
47	000998	隆平高科	480,800	10,587,216.00	0.70
48	002179	中航光电	338,600	10,560,934.00	0.70
49	300400	劲拓股份	695,826	10,381,723.92	0.68
50	000970	中科三环	693,700	10,252,886.00	0.68
51	002696	百洋股份	482,400	10,067,688.00	0.66
52	600693	东百集团	795,100	9,795,632.00	0.65
53	300603	立昂技术	296,658	9,724,449.24	0.64
54	000988	华工科技	656,900	9,584,171.00	0.63
55	603515	欧普照明	264,269	9,545,396.28	0.63
56	603160	汇顶科技	90,300	9,057,090.00	0.60
57	300316	晶盛机电	723,500	9,036,515.00	0.60
58	300306	远方光电	506,478	8,777,263.74	0.58
59	002831	裕同科技	116,100	8,707,500.00	0.57
60	000661	长春高新	64,877	8,376,269.47	0.55
61	002027	分众传媒	600,000	8,256,000.00	0.54
62	000921	海信科龙	475,575	8,184,645.75	0.54
63	002365	永安药业	266,500	8,064,290.00	0.53
64	000807	云铝股份	1,112,200	8,030,084.00	0.53
65	300572	安车检测	174,800	7,498,920.00	0.49
66	600497	驰宏锌锗	1,142,000	7,480,100.00	0.49
67	002753	永东股份	402,300	7,470,711.00	0.49
68	603318	派思股份	622,712	6,986,828.64	0.46
69	600603	广汇物流	554,800	6,552,188.00	0.43
70	601318	中国平安	128,232	6,361,589.52	0.42
71	600156	华升股份	834,800	6,294,392.00	0.41
72	002396	星网锐捷	324,597	6,280,951.95	0.41
73	002456	欧菲光	338,000	6,141,460.00	0.40
74	002245	澳洋顺昌	672,600	6,066,852.00	0.40
75	300648	星云股份	121,957	5,812,470.62	0.38
76	002222	福晶科技	405,703	5,789,381.81	0.38
77	600622	嘉宝集团	315,641	5,138,635.48	0.34
78	002087	新野纺织	822,468	4,646,944.20	0.31

79	300296	利亚德	241,300	4,536,440.00	0.30
80	300285	国瓷材料	224,800	4,428,560.00	0.29
81	002611	东方精工	305,800	4,385,172.00	0.29
82	600029	南方航空	501,000	4,358,700.00	0.29
83	601336	新华保险	81,700	4,199,380.00	0.28
84	603996	中新科技	205,431	3,512,870.10	0.23
85	300007	汉威电子	181,665	3,498,867.90	0.23
86	002415	海康威视	99,993	3,229,773.90	0.21
87	601117	中国化学	458,300	3,203,517.00	0.21
88	002083	孚日股份	388,000	2,964,320.00	0.20
89	002175	东方网络	178,000	2,915,640.00	0.19
90	300336	新文化	186,200	2,878,652.00	0.19
91	300602	飞荣达	58,601	2,771,241.29	0.18
92	300365	恒华科技	62,145	2,218,576.50	0.15
93	300129	泰胜风能	220,469	1,563,125.21	0.10
94	002449	国星光电	90,200	1,492,810.00	0.10
95	601212	白银有色	39,958	325,258.12	0.02
96	601228	广州港	32,911	283,692.82	0.02
97	603833	欧派家居	2,329	255,863.94	0.02
98	601878	浙商证券	11,049	187,943.49	0.01
99	603986	兆易创新	2,266	176,317.46	0.01
100	002833	弘亚数控	2,743	160,465.50	0.01
101	300618	寒锐钴业	1,600	150,880.00	0.01
102	601952	苏垦农发	10,425	144,594.75	0.01
103	603881	数据港	2,877	140,455.14	0.01
104	300625	三雄极光	3,934	129,035.20	0.01
105	603708	家家悦	7,636	125,612.20	0.01
106	603839	安正时尚	4,550	123,396.00	0.01
107	603165	荣晟环保	1,767	117,240.45	0.01
108	601366	利群股份	8,400	116,760.00	0.01
109	603225	新凤鸣	3,197	115,667.46	0.01
110	002867	周大生	3,444	106,350.72	0.01
111	600939	重庆建工	9,500	101,840.00	0.01
112	603603	博天环境	2,421	101,633.58	0.01
113	002852	道道全	1,271	96,596.00	0.01
114	603980	吉华集团	3,449	91,846.87	0.01
115	601858	中国科传	7,280	91,145.60	0.01
116	603358	华达科技	1,769	89,617.54	0.01
117	603877	太平鸟	3,180	89,008.20	0.01
118	603058	永吉股份	3,869	83,957.30	0.01
119	300623	捷捷微电	1,242	83,462.40	0.01
120	603689	皖天然气	4,818	82,628.70	0.01
121	603345	安井食品	3,227	82,611.20	0.01
122	300583	赛托生物	1,582	82,200.72	0.01

123	603133	碳元科技	2,445	82,054.20	0.01
124	603113	金能科技	3,496	81,526.72	0.01
125	603717	天域生态	2,490	81,198.90	0.01
126	603303	得邦照明	2,392	79,868.88	0.01
127	300641	正丹股份	4,020	77,586.00	0.01
128	002880	卫光生物	998	75,548.60	0.00
129	603298	杭叉集团	3,641	75,477.93	0.00
130	002845	同兴达	1,048	75,246.40	0.00
131	300660	江苏雷利	946	74,979.96	0.00
132	002848	高斯贝尔	2,500	74,525.00	0.00
133	002872	天圣制药	2,003	74,050.91	0.00
134	603630	拉芳家化	1,985	73,881.70	0.00
135	603385	惠达卫浴	2,750	73,672.50	0.00
136	603032	德新交运	1,628	73,097.20	0.00
137	603239	浙江仙通	2,772	72,155.16	0.00
138	603768	常青股份	2,755	70,087.20	0.00
139	603920	世运电路	3,125	70,062.50	0.00
140	300627	华测导航	1,498	69,806.80	0.00
141	603586	金麒麟	2,046	69,666.30	0.00
142	002851	麦格米特	1,708	68,097.96	0.00
143	603208	江山欧派	1,221	65,970.63	0.00
144	603179	新泉股份	1,495	65,645.45	0.00
145	603639	海利尔	1,206	64,062.72	0.00
146	603906	龙蟠科技	2,816	63,557.12	0.00
147	603728	鸣志电器	2,719	63,434.27	0.00
148	603138	海量数据	1,425	63,384.00	0.00
149	300610	晨化股份	2,694	63,228.18	0.00
150	300600	瑞特股份	1,124	62,606.80	0.00
151	603360	百傲化学	2,072	62,139.28	0.00
152	603826	坤彩科技	3,299	59,579.94	0.00
153	603966	法兰泰克	2,590	59,518.20	0.00
154	603197	保隆科技	1,086	57,612.30	0.00
155	002846	英联股份	1,492	51,921.60	0.00
156	603238	诺邦股份	1,750	51,415.00	0.00
157	300657	弘信电子	1,021	48,089.10	0.00
158	603801	志邦股份	1,406	47,522.80	0.00
159	603043	广州酒家	1,810	45,738.70	0.00
160	300666	江丰电子	2,276	43,448.84	0.00
161	300658	延江股份	1,110	43,101.30	0.00
162	300662	科锐国际	1,656	41,847.12	0.00
163	002875	安奈儿	1,158	41,514.30	0.00
164	603326	我乐家居	1,452	40,612.44	0.00
165	603316	诚邦股份	1,824	38,778.24	0.00
166	603380	易德龙	1,298	35,370.50	0.00

167	300663	科蓝软件	1,293	30,812.19	0.00
168	603226	菲林格尔	872	29,892.16	0.00
169	603879	永悦科技	1,227	28,343.70	0.00
170	603335	迪生力	2,230	24,864.50	0.00
171	603536	惠发股份	1,008	24,141.60	0.00
172	002879	长缆科技	1,313	23,660.26	0.00
173	002881	美格智能	989	22,608.54	0.00
174	603679	华体科技	809	21,438.50	0.00
175	603938	三孚股份	1,246	20,932.80	0.00
176	002882	金龙羽	2,966	18,389.20	0.00
177	603933	睿能科技	857	17,311.40	0.00
178	603305	旭升股份	1,351	15,212.26	0.00
179	300669	沪宁股份	841	14,650.22	0.00
180	300670	大烨智能	1,259	13,760.87	0.00
181	603286	日盈电子	890	13,528.00	0.00
182	300672	国科微	1,257	10,659.36	0.00
183	603331	百达精工	999	9,620.37	0.00
184	300671	富满电子	942	7,639.62	0.00
185	603617	君禾股份	832	7,429.76	0.00
186	600703	三安光电	220	4,334.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000651	格力电器	171,234,002.04	12.32
2	002475	立讯精密	160,553,714.98	11.55
3	002456	欧菲光	139,811,828.20	10.06
4	300545	联得装备	118,491,775.37	8.53
5	002466	天齐锂业	114,361,027.94	8.23
6	002045	国光电器	111,746,059.38	8.04
7	002008	大族激光	101,588,472.70	7.31
8	000050	深天马 A	100,865,671.68	7.26
9	002236	大华股份	97,948,864.66	7.05
10	002831	裕同科技	88,401,798.18	6.36
11	002185	华天科技	88,373,086.96	6.36
12	000333	美的集团	87,563,757.65	6.30
13	000725	京东方 A	87,355,826.50	6.29
14	002371	北方华创	83,777,757.35	6.03
15	300588	熙菱信息	76,991,432.11	5.54

16	300603	立昂技术	71,338,298.56	5.13
17	300083	劲胜智能	67,613,539.87	4.86
18	300236	上海新阳	65,781,454.91	4.73
19	601231	环旭电子	64,593,004.92	4.65
20	002415	海康威视	63,560,569.18	4.57
21	300207	欣旺达	61,219,747.82	4.40
22	002222	福晶科技	60,087,155.68	4.32
23	600760	中航黑豹	59,386,218.50	4.27
24	300327	中颖电子	59,276,057.90	4.27
25	600104	上汽集团	57,109,505.03	4.11
26	603160	汇顶科技	56,677,542.20	4.08
27	600584	长电科技	55,457,895.95	3.99
28	600525	长园集团	55,034,453.37	3.96
29	002241	歌尔股份	54,278,217.50	3.91
30	000768	中航飞机	54,138,168.38	3.90
31	300408	三环集团	53,232,337.21	3.83
32	300316	晶盛机电	53,116,287.48	3.82
33	000823	超声电子	51,578,188.06	3.71
34	300458	全志科技	50,448,373.93	3.63
35	002217	合力泰	50,302,197.85	3.62
36	601318	中国平安	49,668,628.92	3.57
37	600563	法拉电子	48,335,636.86	3.48
38	001979	招商蛇口	47,295,395.80	3.40
39	600183	生益科技	47,295,057.46	3.40
40	600741	华域汽车	46,386,643.89	3.34
41	601668	中国建筑	44,891,837.00	3.23
42	300136	信维通信	44,613,602.18	3.21
43	603996	中新科技	44,431,504.41	3.20
44	300415	伊之密	43,052,920.38	3.10
45	000049	德赛电池	42,533,544.94	3.06
46	002142	宁波银行	42,367,013.05	3.05
47	002074	国轩高科	41,979,888.84	3.02
48	002271	东方雨虹	40,868,547.93	2.94
49	002850	科达利	40,250,927.61	2.90
50	603005	晶方科技	40,182,248.95	2.89
51	300323	华灿光电	40,014,657.71	2.88
52	600261	阳光照明	39,867,501.98	2.87
53	300474	景嘉微	39,802,332.97	2.86
54	603328	依顿电子	39,283,915.83	2.83
55	000848	承德露露	38,601,375.37	2.78
56	600660	福耀玻璃	38,094,504.28	2.74
57	600651	飞乐音响	37,747,873.67	2.72
58	603515	欧普照明	37,581,902.97	2.70
59	600885	宏发股份	37,310,352.24	2.68

60	300456	耐威科技	37,103,824.22	2.67
61	002196	方正电机	36,591,238.66	2.63
62	601601	中国太保	36,367,391.16	2.62
63	000709	河钢股份	36,273,034.06	2.61
64	300138	晨光生物	34,250,023.25	2.46
65	002036	联创电子	34,135,606.38	2.46
66	300373	扬杰科技	33,984,638.07	2.45
67	002460	赣锋锂业	33,908,871.01	2.44
68	300346	南大光电	33,536,266.13	2.41
69	002858	力盛赛车	33,164,883.24	2.39
70	300567	精测电子	32,805,177.55	2.36
71	000063	中兴通讯	32,531,343.96	2.34
72	600519	贵州茅台	31,882,046.14	2.29
73	300613	富瀚微	31,598,822.41	2.27
74	600884	杉杉股份	31,431,749.68	2.26
75	300116	坚瑞沃能	30,934,943.19	2.23
76	002139	拓邦股份	30,877,937.68	2.22
77	002738	中矿资源	30,868,510.17	2.22
78	603337	杰克股份	30,744,956.73	2.21
79	300537	广信材料	30,276,903.81	2.18
80	600362	江西铜业	29,713,085.37	2.14
81	000988	华工科技	29,597,422.90	2.13
82	300595	欧普康视	29,510,985.30	2.12
83	300400	劲拓股份	28,850,898.00	2.08
84	002841	视源股份	28,822,217.06	2.07
85	600489	中金黄金	28,353,249.50	2.04
86	300496	中科创达	28,217,474.50	2.03
87	000858	五 粮 液	28,198,918.00	2.03
88	300307	慈星股份	27,816,277.37	2.00
89	000059	华锦股份	27,815,031.79	2.00

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000651	格力电器	151,199,982.35	10.88
2	002456	欧菲光	141,234,870.67	10.16
3	002475	立讯精密	135,425,726.59	9.74
4	002236	大华股份	124,165,744.26	8.93
5	002045	国光电器	113,989,101.57	8.20

6	002008	大族激光	108,791,910.36	7.83
7	002371	北方华创	95,715,722.37	6.89
8	000725	京东方 A	91,373,771.20	6.57
9	002831	裕同科技	89,158,135.16	6.42
10	300545	联得装备	86,808,808.01	6.25
11	002185	华天科技	85,829,357.30	6.18
12	000333	美的集团	84,796,904.04	6.10
13	002120	韵达股份	79,076,631.21	5.69
14	600760	中航黑豹	71,668,709.24	5.16
15	601231	环旭电子	69,562,802.70	5.01
16	300588	熙菱信息	67,257,172.38	4.84
17	300603	立昂技术	65,456,462.82	4.71
18	600104	上汽集团	61,886,183.71	4.45
19	002415	海康威视	61,129,733.39	4.40
20	300458	全志科技	61,093,754.90	4.40
21	300227	光韵达	58,930,947.11	4.24
22	600525	长园集团	57,812,738.55	4.16
23	002241	歌尔股份	56,595,112.12	4.07
24	002222	福晶科技	54,166,161.87	3.90
25	000768	中航飞机	53,117,499.71	3.82
26	000823	超声电子	52,617,618.26	3.79
27	300408	三环集团	52,579,597.49	3.78
28	002466	天齐锂业	51,727,254.01	3.72
29	603160	汇顶科技	49,752,836.81	3.58
30	300207	欣旺达	49,493,790.54	3.56
31	601318	中国平安	49,361,049.69	3.55
32	300327	中颖电子	49,338,474.11	3.55
33	600489	中金黄金	48,046,589.09	3.46
34	600885	宏发股份	47,542,130.51	3.42
35	000065	北方国际	47,513,573.29	3.42
36	300316	晶盛机电	47,056,588.10	3.39
37	600741	华域汽车	47,023,036.86	3.38
38	600183	生益科技	46,544,729.99	3.35
39	601328	交通银行	46,078,053.45	3.32
40	300415	伊之密	45,057,405.68	3.24
41	002142	宁波银行	44,318,128.94	3.19
42	001979	招商蛇口	44,013,185.35	3.17
43	000049	德赛电池	43,797,640.02	3.15
44	601668	中国建筑	42,750,400.20	3.08
45	000050	深天马 A	41,738,869.09	3.00
46	300346	南大光电	41,172,084.51	2.96
47	300323	华灿光电	41,098,411.46	2.96
48	600660	福耀玻璃	40,637,473.90	2.92
49	000709	河钢股份	39,633,918.71	2.85

50	002460	赣锋锂业	39,627,360.33	2.85
51	600261	阳光照明	39,560,943.96	2.85
52	300456	耐威科技	39,029,186.38	2.81
53	603005	晶方科技	38,221,093.32	2.75
54	300474	景嘉微	38,006,282.92	2.73
55	300236	上海新阳	37,843,007.32	2.72
56	600362	江西铜业	37,409,075.96	2.69
57	000848	承德露露	36,458,624.28	2.62
58	603328	依顿电子	35,705,658.46	2.57
59	601117	中国化学	35,066,776.86	2.52
60	300116	坚瑞沃能	35,060,501.89	2.52
61	600782	新钢股份	34,900,491.13	2.51
62	600563	法拉电子	34,473,722.44	2.48
63	600884	杉杉股份	34,148,181.68	2.46
64	300373	扬杰科技	33,829,857.36	2.43
65	600519	贵州茅台	33,170,575.07	2.39
66	300537	广信材料	32,611,767.66	2.35
67	300567	精测电子	32,198,484.76	2.32
68	601908	京运通	31,770,097.62	2.29
69	002841	视源股份	31,308,955.48	2.25
70	300496	中科创达	30,574,071.65	2.20
71	300595	欧普康视	30,571,032.58	2.20
72	603996	中新科技	30,470,610.32	2.19
73	300613	富瀚微	30,110,009.13	2.17
74	002036	联创电子	29,984,538.76	2.16
75	002858	力盛赛车	29,962,638.68	2.16
76	002271	东方雨虹	29,959,803.58	2.16
77	600898	国美通讯	29,946,738.05	2.15
78	002517	恺英网络	29,744,786.01	2.14
79	600068	葛洲坝	29,206,581.48	2.10
80	300446	乐凯新材	29,013,493.03	2.09
81	601688	华泰证券	28,851,028.18	2.08
82	002341	新纶科技	28,708,269.29	2.07
83	002738	中矿资源	28,629,403.35	2.06
84	603515	欧普照明	28,594,719.49	2.06
85	000858	五 粮 液	28,333,317.06	2.04

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。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	7,538,161,030.90
卖出股票的收入（成交）总额	7,428,816,207.96

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。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	555,529.20	0.04
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	555,529.20	0.04

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	128013	洪涛转债	5,484	555,529.20	0.04

7.7 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。

7.8 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。

7.9 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。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 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。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，有选择地投资于流动性好、交易活跃的股指期货合约。

本基金在进行股指期货投资时，首先将基于对证券市场总体行情的判断和组合风险收益的分析确定投资时机以及套期保值的类型（多头套期保值或空头套期保值），并根据风险资产投资（或拟投资）的总体规模和风险系数决定股指期货的投资比例；其次，本基金将在综合考虑证券市场和期货市场运行趋势以及股指期货流动性、收益性、风险特征和估值水平的基础上进行投资品种选择，以对冲风险资产组合的系统性风险和流动性风险。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

无。

7.11.2 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。

7.11.3 本期国债期货投资评价

无。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

7.12.2 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。

7.12.3 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	1,338,426.22

2	应收证券清算款	31,587,513.16
3	应收股利	-
4	应收利息	26,823.84
5	应收申购款	24,198.93
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	32,976,962.15

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	128013	洪涛转债	555,529.20	0.04

7.12.5 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。

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
34,248	46,923.85	213,441,429.13	13.28%	1,393,606,431.26	86.72%

8.2 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	51,591.67	0.00%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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。

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015 年 4 月 24 日）基金份额总额	3,237,720,619.07
本报告期期初基金份额总额	1,494,149,307.29
本报告期基金总申购份额	282,490,820.70
减：本报告期基金总赎回份额	169,592,267.60
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,607,047,860.39

10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本基金管理人重大人事变动如下：

2017 年 8 月 9 日，基金管理人发布了《华安基金管理有限公司关于副总经理变更的公告》，章国富先生不再担任本基金管理人的副总经理。

2、本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动如下：

无。

10.3 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。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内无基金投资策略的改变。

10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘为基金审计的会计师事务所。

10.6 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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
长江证券	1	5,647,743,906.44	37.75%	5,146,797.77	37.49%	-
招商证券	2	2,911,667,877.25	19.46%	2,674,022.22	19.48%	-
中信证券	2	2,661,286,931.13	17.79%	2,456,869.55	17.90%	-
中信建投	1	2,030,874,555.30	13.57%	1,891,352.71	13.78%	-
安信证券	1	1,710,940,130.11	11.43%	1,559,181.59	11.36%	-

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领导审批

公司分管领导对相关部门提交的《新增交易单元申请审核表》及其对券商综合评估的结果进行审核，并签署审批意见。

(4) 协议签署及通知托管人

基金管理人与被选择的券商签订《证券交易单元租用协议》，并通知基金托管人。

3、报告期内基金租用券商交易单元的变更情况：

无。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的 比例	成交金额	占当期回购成交总额的 比例	成交金额	占当期权证成交总额的 比例
长江证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-

10.8 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	华安基金关于增加民生银行为华安旗下部分基金代理销售机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-01-05
2	关于旗下部分基金增加济安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》和公司网站	2017-01-11
3	关于旗下部分基金增加泰诚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》和公司网站	2017-01-18
4	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的	《上海证券报》、《证券时报》	2017-01-18

	“安洁科技”股票估值调整的公告	报》、《中国证券报》和公司网站	
5	关于旗下部分基金增加北京肯特瑞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	2017-02-08
6	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	2017-02-13
7	关于旗下部分基金增加海峡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》和公司网站	2017-02-15
8	关于旗下部分基金增加朝阳永续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	2017-02-22
9	关于旗下部分基金增加华阳众惠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	2017-03-02
10	关于旗下部分基金增加华夏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	2017-03-21
11	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	2017-03-28
12	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加通华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》和公司网站	2017-04-06
13	华安基金关于参加华宝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	2017-04-12
14	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	2017-04-22
15	关于“微钱宝”快速取现服务升级的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-04-25
16	华安基金关于《深圳证券交易所分级基金业务管理指引》实施的风险提示性公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-04-25
17	华安基金关于《深圳证券交易所分级基金业务管理指引》实施的风险提示性公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-04-26
18	关于旗下部分基金增加中原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》和公司网站	2017-04-27

19	华安基金关于《深圳证券交易所分级基金业务管理指引》实施的风险提示性公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-04-27
20	华安基金关于《深圳证券交易所分级基金业务管理指引》实施的风险提示性公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-04-28
21	华安基金关于《深圳证券交易所分级基金业务管理指引》实施的风险提示性公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-04-29
22	华安基金关于《深圳证券交易所分级基金业务管理指引》实施的风险提示性公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-05-03
23	华安基金关于《深圳证券交易所分级基金业务管理指引》实施的风险提示性公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-05-04
24	华安基金关于《深圳证券交易所分级基金业务管理指引》实施的风险提示性公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-05-06
25	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	2017-05-10
26	关于旗下部分基金增加武汉伯嘉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	2017-05-17
27	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“东睦股份”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	2017-05-20
28	关于旗下部分基金增加中民财富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	2017-06-07
29	华安基金关于参加上海农商行优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-06-07
30	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	2017-06-27
31	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	2017-06-30

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。

11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 影响投资者决策的其他重要信息

无。

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、《华安智能装备主题股票型证券投资基金基金合同》
- 2、《华安智能装备主题股票型证券投资基金招募说明书》
- 3、《华安智能装备主题股票型证券投资基金托管协议》
- 4、中国证监会批准华安智能装备主题股票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

二〇一七年八月二十五日