

# 华安安华保本混合型证券投资基金

## 2017 年第 4 季度报告

2017 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：招商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一八年一月二十二日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 1 月 18 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## § 2 基金产品概况

|            |                                                                                                                                      |
|------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 基金简称       | 华安安华保本混合                                                                                                                             |
| 基金主代码      | 002350                                                                                                                               |
| 交易代码       | 002350                                                                                                                               |
| 基金运作方式     | 契约型开放式                                                                                                                               |
| 基金合同生效日    | 2016 年 2 月 3 日                                                                                                                       |
| 报告期末基金份额总额 | 2,019,391,801.76 份                                                                                                                   |
| 投资目标       | 通过运用投资组合保险技术，有效控制本金损失的风险，在本金安全的基础上力争实现基金资产的稳定增值。                                                                                     |
| 投资策略       | 本基金采用基于 VaR 的风险乘数全程可变的 CPPI 策略（恒定比例组合保险策略）。基金管理人主要通过数量分析，根据市场的波动来调整和修正安全垫放大倍数（即风险乘数），动态调整固定收益类资产与权益类资产的投资比例，以确保基金在一段时间以后其价值不低于事先设定的某 |

|        |                                                                                                                           |
|--------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|        | 一目标价值，从而实现投资组合的保本增值目标。同时，本基金将通过对宏观经济、国家政策等可能影响证券市场的重要因素的研究和预测，分析和比较不同证券子市场和不同金融工具的收益及风险特征，确定具体的投资券种选择，积极寻找各种可能的套利和价值增长机会。 |
| 业绩比较基准 | 三年期银行定期存款收益率（税后）                                                                                                          |
| 风险收益特征 | 本基金为保本混合型基金，属于证券投资基金中的低风险品种。<br>投资者投资于保本基金并不等于将资金作为存款放在银行或存款类金融机构，保本基金在极端情况下仍然存在本金损失的风险。                                  |
| 基金管理人  | 华安基金管理有限公司                                                                                                                |
| 基金托管人  | 招商银行股份有限公司                                                                                                                |
| 基金保证人  | 北京首创融资担保有限公司                                                                                                              |

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标          | 报告期<br>(2017 年 10 月 1 日-2017 年 12 月 31 日) |
|-----------------|-------------------------------------------|
| 1. 本期已实现收益      | 22,107,939.17                             |
| 2. 本期利润         | 18,534,384.91                             |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0091                                    |
| 4. 期末基金资产净值     | 2,113,604,030.47                          |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.047                                     |

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

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

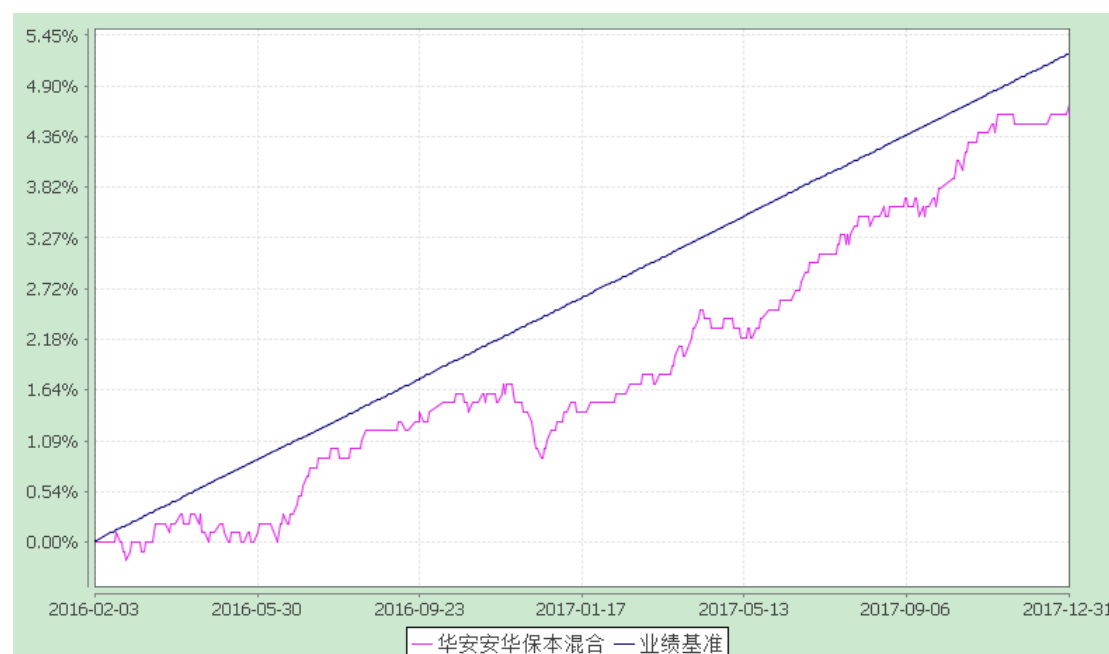
## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 本报告期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    | 净值增长率① | 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 | 0.87%  | 0.05%     | 0.69%      | 0.01%         | 0.18% | 0.04% |

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

华安安华保本混合型证券投资基金  
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2016 年 2 月 3 日至 2017 年 12 月 31 日)



注：根据本基金基金合同，本基金建仓期为6 个月。基金管理人自基金合同生效之日起 6 个月内已使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

| 姓名 | 职务               | 任本基金的基金经理期限 |      | 证券从业年限 | 说明                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
|----|------------------|-------------|------|--------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|    |                  | 任职日期        | 离任日期 |        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |
| 贺涛 | 本基金的基金经理、固定收益部总监 | 2016-02-03  | -    | 20 年   | 金融学硕士（金融工程方向），20 年证券、基金从业经历。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、固定收益投资经理。2008 年 4 月起担任华安稳定收益债券型证券投资基金的基金经理。2011 年 6 月起同时担任华安可转换债券债券型证券投资基金的基金经理。2012 年 12 月至 2017 年 6 月担任华安信用增强债券型证券投资基金的基金经理。2013 年 6 月起同时担任华安双债添利债券型证券投资基金的基金经理、固定收益部助理总监。2013 年 8 月起担任固定收益部副总监。2013 年 10 月至 2017 年 7 月，同时担任华安现金富利投资基金、华安月月鑫短期理财债券型证券投资基金、华安季季鑫短期理财债券型证券投资基金、华安月安鑫短期理财债券型证券投资基金的基金经理。2014 年 7 月至 2017 年 7 月，同时担任华安汇财通货币市场基金的基金经理。2015 年 2 月至 2017 年 6 月担任华安年年盈定期开放债券型证券投资基金的基金经理。2015 年 5 月起担任固定收益部总监。2015 年 5 月至 2017 年 7 月，担任华安新回 |

|     |          |            |   |      |                                                                                                                                                                                                                                                                    |
|-----|----------|------------|---|------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|     |          |            |   |      | 报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2015 年 9 月起担任华安新乐享保本混合型证券投资基金的基金经理；2015 年 12 月至 2017 年 7 月，同时担任本基金的基金经理。2016 年 2 月起，同时担任本基金的基金经理。2016 年 7 月起同时担任华安安进保本混合型发起式证券投资基金的基金经理。2016 年 11 月起，同时担任华安睿享定期开放混合型发起式证券投资基金、华安新希望灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 2 月起，同时担任华安新活力灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。 |
| 廖发达 | 本基金的基金经理 | 2016-02-18 | - | 16 年 | 博士研究生，16 年金融行业从业经验，曾任上海证大投资管理有限公司副经理、金鹰基金研究员、中国人寿资产管理研究员、太平洋资产管理投资经理。2015 年 6 月加入华安基金管理有限公司，2015 年 8 月起担任本基金的基金经理。2016 年 2 月起担任本基金的基金经理。2016 年 8 月起同时担任华安安进保本混合型发起式证券投资基金的基金经理。2017 年 8 月起，同时担任华安大安全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 公平交易专项说明

#### 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、发送邮件、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，则投资部门在风控部门的监督参与下，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；风险管理部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。

#### 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,出现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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

四季度,欧美经济继续走好,PMI 继续维持高位,失业率走低,通胀温和。特朗普减税方案获得通过,美联储于 12 月如期加息。国内经济进出口增速回升,消费保持平稳,固定资产投资下滑幅度趋缓,其中制造业、基建投资保持平稳,房地产投资继续小幅下行。CPI 保持平稳,PPI 环比继续增长,同比仍维持在 6%附近高位,超出年初市场预期。人民币兑美元先贬后升,外汇占款由负转正。央行维持中性偏紧政策基调,并跟随美联储,调高公开市场及 MLF 操作利率 5bp。受年末 MPA 考核影响,年末货币市场利率大幅走高。十九大报告增强了市场对中长期经济增长的信心,央行资管新规出台意味监管升级。长久期利率受此影响大幅上升,其中 10 年期国债收益率接近 4%,10 年国开债收益率接近 5%。信用债收益率走高、信用利差走阔。股市高位震荡,白马蓝筹表现优于中小创。

本基金在报告期内股票部分采取相对审慎、相对均衡的配置策略,自上而下与自下而上相结合,积极寻找结构性机会。债券部分继续压缩组合久期,积极把握年末短期限债券收益走高的再投资机会。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2017 年 12 月 31 日,本基金份额净值为 1.047 元,本报告期份额净值增长率为 0.87%,同期业绩比较基准增长率为 0.69%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望一季度，国内经济稳健，产能过剩压力消退，房地产库存减低，企业盈利改善，潜在通胀风险有所上升。“紧货币、宽财政”的组合经济下行风险可控。一季度金融防风险基调下，严监管措施将密集出台，金融机构资产负债结构将加速调整，需警惕相关的流动性风险和信用风险。金融空转和套利活动的减弱，市场杠杆率将进一步走低，资金需求的减弱也有助于短期利率的下行，预计市场收益率曲线将逐步陡峭化。

2017 年是三四线地产超预期，供给侧改革成效显著、经济持续复苏的一年，2017 年也是金融去杠杆，利率震荡上行的一年。随着沪港通、深港通的开通，A 股市场与港股市场在联动性、投资理念上的相互影响显著增强。中国后工业化时代的环保硬约束、供给侧改革、寡头定价权等使得行业龙头的竞争力和盈利能力显著提升。微信时代信息快速传递和机构配置的流动性要求等使得龙头股溢价效应逐步显现。

2018 年，经济将继续保持总体平稳，结构分化，行业集中度提高的趋势。各行业的细分行业龙头都将在中长期胜出。具体为：环保督查、排污许可证等环保约束将使部分周期行业龙头公司显著受益。业绩稳健增长、估值合理的优质消费、成长龙头公司将有望继续获得超额收益。具有消费属性的保险龙头、息差有望见底回升的中大型银行以及连续三年大幅调整，PB 接近历史低位的龙头券商将有望获得一定稳健收益。

下阶段，本基金将以行业景气和公司基本面为出发点，采取成长与价值融合、自上而下与自下而上相结合策略，积极寻找结构性机会。在操作上，以绝对收益为思路，通过组合的动态调整，在控制回撤风险的条件下，实现基金业绩的持续、稳健增长。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

#### 5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目   | 金额(元)         | 占基金总资产的比例(%) |
|----|------|---------------|--------------|
| 1  | 权益投资 | 63,861,539.96 | 3.01         |

|   |                   |                  |        |
|---|-------------------|------------------|--------|
|   | 其中：股票             | 63,861,539.96    | 3.01   |
| 2 | 固定收益投资            | 1,273,085,433.00 | 59.94  |
|   | 其中：债券             | 1,273,085,433.00 | 59.94  |
|   | 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          | 160,000,360.00   | 7.53   |
|   | 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      | 607,534,068.73   | 28.61  |
| 7 | 其他各项资产            | 19,376,525.62    | 0.91   |
| 8 | 合计                | 2,123,857,927.31 | 100.00 |

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 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         | -             | -            |
| B  | 采矿业              | 4,240,121.00  | 0.20         |
| C  | 制造业              | 37,623,557.93 | 1.78         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -             | -            |
| E  | 建筑业              | -             | -            |
| F  | 批发和零售业           | 5,278,714.00  | 0.25         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 2,067,702.00  | 0.10         |
| H  | 住宿和餐饮业           | -             | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 981,150.00    | 0.05         |
| J  | 金融业              | -             | -            |
| K  | 房地产业             | -             | -            |
| L  | 租赁和商务服务业         | -             | -            |

|   |               |               |      |
|---|---------------|---------------|------|
| M | 科学研究和技术服务业    | -             | -    |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 6,308,889.00  | 0.30 |
| 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     | 7,361,406.03  | 0.35 |
| S | 综合            | -             | -    |
|   | 合计            | 63,861,539.96 | 3.02 |

### 5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量(股)   | 公允价值(元)      | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|---------|--------------|--------------|
| 1  | 600528 | 中铁工业 | 694,800 | 8,434,872.00 | 0.40         |
| 2  | 002343 | 慈文传媒 | 206,723 | 7,361,406.03 | 0.35         |
| 3  | 600038 | 中直股份 | 137,600 | 6,402,528.00 | 0.30         |
| 4  | 300463 | 迈克生物 | 217,900 | 5,223,063.00 | 0.25         |
| 5  | 002573 | 清新环境 | 188,100 | 4,275,513.00 | 0.20         |
| 6  | 002440 | 闰土股份 | 216,700 | 4,266,823.00 | 0.20         |
| 7  | 600028 | 中国石化 | 691,700 | 4,240,121.00 | 0.20         |
| 8  | 002013 | 中航机电 | 392,700 | 4,237,233.00 | 0.20         |
| 9  | 600993 | 马应龙  | 154,700 | 3,168,256.00 | 0.15         |
| 10 | 000717 | 韶钢松山 | 244,500 | 2,166,270.00 | 0.10         |

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种      | 公允价值(元)        | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|----------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | -              | -            |
| 2  | 央行票据      | -              | -            |
| 3  | 金融债券      | 386,015,000.00 | 18.26        |
|    | 其中：政策性金融债 | 386,015,000.00 | 18.26        |
| 4  | 企业债券      | 12,956,433.00  | 0.61         |
| 5  | 企业短期融资券   | -              | -            |
| 6  | 中期票据      | 140,998,000.00 | 6.67         |

|    |           |                  |       |
|----|-----------|------------------|-------|
| 7  | 可转债（可交换债） | -                | -     |
| 8  | 同业存单      | 733,116,000.00   | 34.69 |
| 9  | 其他        | -                | -     |
| 10 | 合计        | 1,273,085,433.00 | 60.23 |

### 5.5 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债券投资明细

| 序号 | 债券代码      | 债券名称              | 数量(张)     | 公允价值(元)        | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|-------------------|-----------|----------------|--------------|
| 1  | 111771811 | 17 宁波银行 CD248     | 2,000,000 | 197,380,000.00 | 9.34         |
| 2  | 150223    | 15 国开 23          | 1,500,000 | 147,915,000.00 | 7.00         |
| 3  | 101565003 | 15 粤海 MTN001      | 1,000,000 | 100,690,000.00 | 4.76         |
| 4  | 111771090 | 17 合肥科技农村商行 CD049 | 1,000,000 | 99,520,000.00  | 4.71         |
| 5  | 111771754 | 17 绵阳商行 CD019     | 1,000,000 | 99,520,000.00  | 4.71         |

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

### 5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证投资。

### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

## 5.9.2 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。此外，基金管理人还将建立股指期货交易决策部门或小组，授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项，同时针对股指期货交易制定投资决策流程和风险控制等制度并报董事会批准。

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.10.1 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同，本基金不能投资于国债期货。

### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

## 5.11 投资组合报告附注

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

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

### 5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额(元)        |
|----|---------|--------------|
| 1  | 存出保证金   | 502,720.15   |
| 2  | 应收证券清算款 | 3,986,127.65 |

|   |       |               |
|---|-------|---------------|
| 3 | 应收股利  | -             |
| 4 | 应收利息  | 14,887,677.82 |
| 5 | 应收申购款 | -             |
| 6 | 其他应收款 | -             |
| 7 | 待摊费用  | -             |
| 8 | 其他    | -             |
| 9 | 合计    | 19,376,525.62 |

#### 5.11.4 报告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。

#### 5.11.5 报告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。

### § 6 开放式基金份额变动

单位：份

|              |                  |
|--------------|------------------|
| 本报告期期初基金份额总额 | 2,074,996,407.50 |
| 报告期基金总申购份额   | 2,048.57         |
| 减：报告期基金总赎回份额 | 55,606,654.31    |
| 报告期基金拆分变动份额  | -                |
| 本报告期期末基金份额总额 | 2,019,391,801.76 |

### § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

#### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

无。

#### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

## § 8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

| 投资者类别                                                                       | 报告期内持有基金份额变化情况 |                        |                  |      |      | 报告期末持有基金情况       |        |
|-----------------------------------------------------------------------------|----------------|------------------------|------------------|------|------|------------------|--------|
|                                                                             | 序号             | 持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间 | 期初份额             | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额             | 份额占比   |
| 机构                                                                          | 1              | 20171001-20171231      | 500,179,000.00   | 0.00 | 0.00 | 500,179,000.00   | 24.77% |
|                                                                             | 2              | 20171001-20171231      | 1,000,359,000.00 | 0.00 | 0.00 | 1,000,359,000.00 | 49.54% |
| 产品特有风险                                                                      |                |                        |                  |      |      |                  |        |
| 本基金报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过20%的情形。如该单一投资者大额赎回将可能导致基金份额净值波动风险、基金流动性风险等特定风险。 |                |                        |                  |      |      |                  |        |

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、《华安安华保本混合型证券投资基金基金合同》
- 2、《华安安华保本混合型证券投资基金招募说明书》
- 3、《华安安华保本混合型证券投资基金托管协议》

### 9.2 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>。

### 9.3 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  
 二〇一八年一月二十二日