

华安新乐享保本混合型证券投资基金
2017 年年度报告摘要
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：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一八年三月二十七日

§1 重要提示

1.1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 3 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	华安新乐享保本混合
基金主代码	001800
交易代码	001800
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 9 月 10 日
基金管理人	华安基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,260,581,552.52 份

2.2 基金产品说明

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），动态调整稳健资产与风险资产的投资比例，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），上述“三年期银行定期存款收益率”是指中国人民银行网站上发布的三年期“金融机构人民币存款基准利率”。基金存续期内，三年期银行定期存款收益率随中国人民银行公布的利率水平的调整而调整。
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。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。

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	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	钱鲲	王永民
	联系电话	021-38969999	010-66594896
	电子邮箱	qiankun@huaan.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		4008850099	95566
传真		021-68863414	010-66594942

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告摘要的管理人互联网网址	www.huaan.com.cn
基金年度报告备置地点	上海市世纪大道 8 号上海国金中心二期 31、32 层

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2017 年	2016 年	2015 年 9 月 10 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
本期已实现收益	121,835,108.58	11,730,857.09	18,320,466.55
本期利润	106,316,745.39	-789,708.94	43,217,963.82
加权平均基金份额本期利润	0.0569	-0.0003	0.0146
本期基金份额净值增长率	7.30%	-0.10%	1.50%
3.1.2 期末数据和指标	2017 年末	2016 年末	2015 年末
期末可供分配基金份额利润	0.0878	0.0109	0.0062
期末基金资产净值	1,371,249,712.27	2,418,256,316.02	2,942,484,123.31
期末基金份额净值	1.088	1.014	1.015

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	6.77%	0.29%	0.69%	0.01%	6.08%	0.28%
过去六个月	8.04%	0.21%	1.39%	0.01%	6.65%	0.20%
过去一年	7.30%	0.18%	2.75%	0.01%	4.55%	0.17%
自基金合同生效起至今	8.80%	0.17%	6.39%	0.01%	2.41%	0.16%

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

华安新乐享保本混合型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

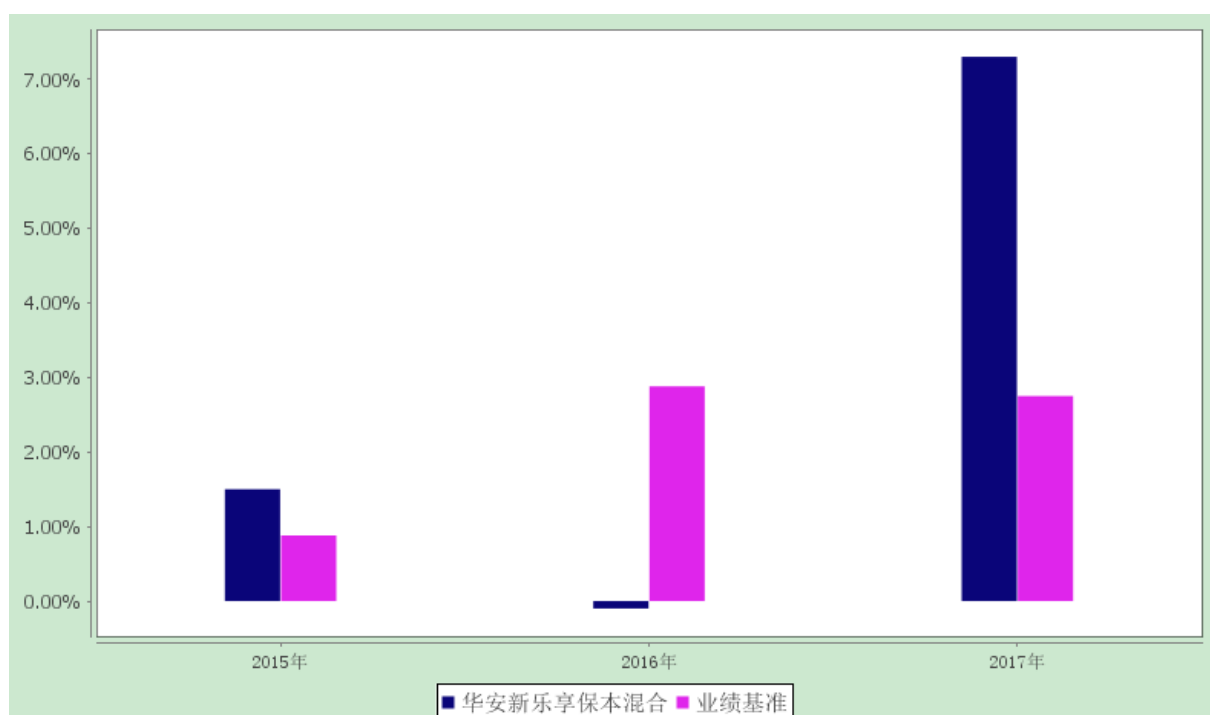
(2015 年 9 月 10 日至 2017 年 12 月 31 日)



3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华安新乐享保本混合型证券投资基金

自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年没有利润分配。

§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。目前的股东为国泰君安投资管理股份有限公司、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创新投资有限公司。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 12 月 31 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 98 只开放式基金，管理资产规模达到 1851.32 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		
贺涛	本基金的基金经理、固定收益部总监	2015-09-10	-	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 月起担任本基金的基金经理。2015 年 12 月至 2017 年 7 月,同时担任华安乐惠保本混合型证券投资基金的基金经理。2016 年 2 月起,同时担任华安安华保本混合型证券投资基金的基金经理。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。
蒋 璆	本基金的基金经理	2015-11-26	-	10 年	硕士, 10 年从业经历。曾任国泰君安证券有限公司研究员、华宝兴业基金管理有限公司研究员。2011 年 6 月加入华安基金管理有限公司,担任投资研究部行业分析师、基金经理助理。2015 年 6 月至 2016 年 9 月担任华安安信消费服务混合型证券投资基金、华安升级主题混合型证券投资基金的基金经理;2015 年 6 月起同时担任华安动态灵活配置混合型证券投资基金;2015 年 11 月起,同时担任本基金的基金经理。2017 年 3 月起,同时担任华安睿安定期开放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 1 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

2017 年全球主要经济体呈现高增长、低通胀的复苏态势，欧美消费信心指数、制造业经理人指数等景气指标不断走强。美国失业率降至历史低位、薪资水平稳步抬升，美联储加息三次并启动缩表进程。欧元区主要国家政府平稳换届、整体失业率下行、出口快速增长、财政赤字率大幅缩减，欧央行宣布缩减购债规模。中国“供给侧改革”和房地产“去库存”取得较大成效，企业盈利恢复，名义 GDP 保持两位数增长，且消费对 GDP 贡献的比重增加，投资占比下降。随着中国经济“L”型甚至是“新周期”预期的强化，人民币兑美元汇率由贬转升。央行全年维持偏紧的货币政策取向，3 次上调公开市场操作利率，逐步引导市场利率上行。金融监管加强，其中，二季度银监会“三三四十”等监管措施密集出台，引起市场较大波动。下半年为防范“处置风险的风险”，一行三会监管协调加强，央行采取“削峰填谷”措施调节市场流动性，9 月底宣布定向降准。受金融机构去杠杆影响，M2 增长降至个位数，但在“紧货币、宽信用、严监管”基调下，社融增速依然保持相对稳定。股票市场整体表现良好但结构分化，其中上证 50 指数全年上涨超过 25%，创业板指数下跌逾 6%。债券市场利

率全面上行，其中同业存单发行利率最高突破 5%，企业发债成本超过同期限贷款利率，10 年期国债收益率最高突破 4%，10 年期国开债收益率突破 5%。可转债市场供给扩容，个券表现差异较大。本基金在报告期内以绝对收益为目标，优选周期龙头、环保、新能源汽车等基本面确定个股、分散投资。

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 1.088 元，本报告期份额净值增长率为 7.30%，同期业绩比较基准增长率为 2.75%。

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 2018 年，全球经济复苏延续。美国低失业率叠加减税政策刺激，通胀风险上升，市场预计美联储加息 3 至 4 次。欧元区银行信贷资产不良仍较高，预计欧央行退出宽松步伐较慢。日本出口强劲，逐步走出通缩，日央行是否维持宽松或存变数。2018 年是十九大后的开局之年，中央经济工作会议提出今后 3 年要重点抓好决胜全面建成小康社会的防范化解重大风险、精准脱贫、污染防治三大攻坚战。其中，打好防范化解重大风险攻坚战，重点是防控金融风险，要服务于供给侧结构性改革这条主线，促进形成金融和实体经济、金融和房地产、金融体系内部的良性循环，做好重点领域风险防范和处置，坚决打击违法违规金融活动，加强薄弱环节监管制度建设。预计全年经济增速略有回落，但整体平稳，增长质量进一步提高。为进一步控制宏观杠杆率，货币政策维持中性偏紧、财政政策积极但赤字率下降，进一步规范地方政府举债行为、租售并举建立房地产长效机制、控制居民加杠杆速度。两会后，随着新的金融监管体系的建立，货币政策和宏观审慎政策双支柱调控框架将进一步健全。预期 18 年股指维持窄幅波动，前低后高的概率较大。经济平，盈利稳，无风险利率也在高位区间震荡，市场运行方向将更多取决于风险偏好的波动。虽然 18 年金融监管力度不会放松，但边际上随着各项监管细则的落地市场预期会逐步趋于温和，预计整体风险溢价会从现有高位小幅下行，对应指数震荡上行的概率较大。鉴于白马蓝筹的性价比优势已大幅缩小，预计 18 年市场风格会相对均衡一些。上半年“大强小弱”的格局可能延续，1 季度不排除存在春季躁动行情的可能，其中业绩增长确定性最高的周期板块有望成为阶段性热点；随着经济增长新动能的显现、年中商誉减值考验期结束，下半年成长股有望迎来趋势性机会。基于上述对于市场的预判，我们计划在 18 年将本基金股票仓位总体控制在中性偏低水平，积极把握结构性投资机会，操作上优选低估值高流动性品种进行分散化投资。主题上相对看好先进制造、环保等。本基金将秉承稳健、专业的投资理念，勤勉尽责地维护持有人利益。

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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对华安新乐享保本混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持

有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§6 审计报告

本报告期的基金财务会计报告经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙) 审计，注册会计师 蒋燕华 蔡玉芝签字出具了安永华明(2018)审字第 60971571_B33 号标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：华安新乐享保本混合型证券投资基金

报告截止日：2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资 产：	-	-
银行存款	267,638,066.79	407,114,994.86
结算备付金	326,674.45	170,573.73
存出保证金	117,200.44	130,036.42
交易性金融资产	731,479,170.72	1,745,935,204.89
其中：股票投资	68,237,170.72	207,465,600.81
基金投资	-	-
债券投资	660,380,000.00	1,538,469,604.08
资产支持证券投资	2,862,000.00	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-

买入返售金融资产	373,350,880.03	259,400,814.10
应收证券清算款	-	6,289,148.87
应收利息	8,872,124.78	16,280,338.58
应收股利	-	-
应收申购款	37,810.78	308.32
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,381,821,927.99	2,435,321,419.77
负债和所有者权益	本期末 2017 年 12 月 31 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	-	-
卖出回购金融资产款	-	6,000,000.00
应付证券清算款	2,676,891.46	-
应付赎回款	5,466,897.42	7,199,751.38
应付管理人报酬	1,434,109.40	2,569,328.55
应付托管费	239,018.26	428,221.40
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	334,014.38	385,414.77
应交税费	-	-
应付利息	-	159.59
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	421,284.80	482,228.06
负债合计	10,572,215.72	17,065,103.75
所有者权益：	-	-
实收基金	1,260,581,552.52	2,385,210,390.71

未分配利润	110,668,159.75	33,045,925.31
所有者权益合计	1,371,249,712.27	2,418,256,316.02
负债和所有者权益总计	1,381,821,927.99	2,435,321,419.77

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.088 元，基金份额总额 1,260,581,552.52 份。

7.2 利润表

会计主体：华安新乐享保本混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
一、收入	135,545,599.07	43,506,573.46
1.利息收入	68,613,770.85	88,412,043.68
其中：存款利息收入	10,565,361.09	3,150,643.50
债券利息收入	51,412,527.03	80,400,984.87
资产支持证券利息收入	373,019.75	-
买入返售金融资产收入	6,262,862.98	4,860,415.31
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	79,258,812.69	-35,396,731.34
其中：股票投资收益	87,242,947.46	-19,531,645.14
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-8,494,193.03	-16,138,358.42
资产支持证券投资收益	0.00	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	510,058.26	273,272.22
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-15,518,363.19	-12,520,566.03

4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	3,191,378.72	3,011,827.15
减：二、费用	29,228,853.68	44,296,282.40
1. 管理人报酬	22,956,796.10	34,680,994.47
2. 托管费	3,826,132.63	5,780,165.73
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	1,411,847.74	2,091,671.39
5. 利息支出	569,376.91	1,273,170.81
其中：卖出回购金融资产支出	569,376.91	1,273,170.81
6. 其他费用	464,700.30	470,280.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	106,316,745.39	-789,708.94
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	106,316,745.39	-789,708.94

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安新乐享保本混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 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）	2,385,210,390.71	33,045,925.31	2,418,256,316.02
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	106,316,745.39	106,316,745.39
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）	-1,124,628,838.19	-28,694,510.95	-1,153,323,349.14

其中：1.基金申购款	12,724,240.96	982,114.81	13,706,355.77
2.基金赎回款	-1,137,353,079.15	-29,676,625.76	-1,167,029,704.91
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）	1,260,581,552.52	110,668,159.75	1,371,249,712.27
项目	上年度可比期间		
	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）	2,899,629,529.37	42,854,593.94	2,942,484,123.31
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-789,708.94	-789,708.94
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）	-514,419,138.66	-9,018,959.69	-523,438,098.35
其中：1.基金申购款	211,980,598.94	-1,864,474.06	210,116,124.88
2.基金赎回款	-726,399,737.60	-7,154,485.63	-733,554,223.23
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）	2,385,210,390.71	33,045,925.31	2,418,256,316.02

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：赵敏，会计机构负责人：陈林

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

华安新乐享保本混合型证券投资基金(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]1899 号《关于准予华安新乐享保本混合型证券投资基金注册的批复》的核准,由基金管理人华安基金管理有限公司向社会公开发行募集。基金合同于 2015 年 9 月 10 日生效,首次设立募集规模为 2,989,632,166.92 份基金份额。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人及注册登记机构为华安基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《华安新乐享保本混合型证券投资基金基金合同》的规定,除提前到期情形外,本基金以每三年为一个保本周期,第一个保本周期自基金合同生效日起至三个公历年后的对应日止,如该对应日为非工作日或无该对应日,则顺延至下一个工作日。保本周期届满时,若符合本基金存续条件,本基金转入下一保本周期;基金管理人将在保本周期到期前公告到期处理规则,确定下一个保本周期的起始时间;第一个保本周期之后各保本周期自基金公告的保本周期起始之日起至三个公历年后对应日止,若该对应日为非工作日或无该对应日,则顺延至下一个工作日。但在保本周期内,如本基金份额累计净值增长率连续 15 个工作日达到或超过当期保本周期的触发收益率,则基金管理人将在基金份额累计净值增长率连续达到或超过触发收益率的第 15 个工作日当日起 10 个工作日内公告本基金当期保本周期提前到期(提前到期日距离满足提前到期条件之日起不超过 20 个工作日,且不得晚于非提前到期情形下的保本周期到期日)。

本基金第一个保本周期到期日,如基金份额持有人认购并持有到期的基金份额可赎回金额加上该部分基金份额累计分红金额之和低于认购保本金额,则基金管理人应补足该差额(即“保本赔付差额”),并在保本周期到期日后 20 个工作日内(含第 20 个工作日)将该差额支付给基金份额持有人。

其后各保本周期到期日,如基金份额持有人过渡期申购并持有到期以及从上一保本周期转入当期保本周期并持有到期的基金份额可赎回金额加上该部分基金份额在当期保本周期内的累计分红款项之和低于其保本金额,由当期有效的基金合同、《保证合同》或《风险买断合同》约定的基金管理人或保本义务人将保本赔付差额支付给基金份额持有人。

本基金到期操作期间为保本周期到期日及之后 5 个工作日(含第 5 个工作日)。在到期操作期间内,本基金接受赎回和转换转出申请,不接受申购和转换转入申请。如果基金份额持有人在到期操

作期间内未选择赎回或转换转出，则基金管理人根据本基金到期存续形式视其默认选择转入下一保本周期或继续持有转型后的“华安新乐享灵活配置混合型证券投资基金”基金份额，默认操作日期为到期操作期间的最后一个工作日。

基金管理人有权视业务需要设定过渡期。过渡期指到期操作期间结束日的下一工作日至下一保本周期开始日前一工作日的时间区间，最长不超过 20 个工作日，具体由基金管理人在当期保本周期到期前公告的到期处理规则中确定。投资人在过渡期内申请购买本基金基金份额的行为称为“过渡期申购”。在过渡期内，投资人转换转入本基金基金份额，视同为过渡期申购。过渡期内，本基金将暂停办理日常赎回和转换转出业务。过渡期内，本基金不收取基金管理费和基金托管费。

保本周期届满时，若符合保本基金存续条件，本基金转入下一保本周期。保本周期届满时，在满足法律法规和基金合同规定的基金存续要求的前提下，若本基金不符合上述保本基金存续条件，则本基金将按基金合同的约定变更为“华安新乐享灵活配置混合型证券投资基金”。同时，基金的投资目标、投资范围、投资策略以及基金费率等相关内容也将根据基金合同的约定作相应修改。

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（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货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的相关规定）。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。

本基金将根据中国宏观经济情况和证券市场的阶段性变化，按照投资组合保险机制对稳健资产和风险资产的投资比例进行动态调整。本基金投资的股票等风险资产占基金资产的比例不高于 40%；债券、货币市场工具等稳健资产占基金资产的比例不低于 60%；现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%。

本基金整体业绩比较基准：三年期银行定期存款收益率（税后）。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《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（以下统称“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并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券

投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年度的经营成果和净值变动情况。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

根据中国证券投资基金业协会中基协发[2017]6 号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）>的通知》（以下简称“估值业务指引”），自 2017 年 10 月 20 日起，本基金持有的流通受限股票参考估值业务指引进行估值。该会计估计变更对本基金本期末的基金资产净值及本期损益均无影响。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

7.4.6.1 印花税

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

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

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

征收印花税。

7.4.6.2 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，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

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

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2017]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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价

格作为买入价计算销售额。

7.4.6.3 企业所得税

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

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

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

7.4.6.4 个人所得税

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

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

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

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

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
华安基金管理有限公司(“华安基金公司”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构

中国银行股份有限公司(“中国银行”)	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
国泰君安创新投资有限公司	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
华安资产管理（香港）有限公司	基金管理人的全资子公司
华安未来资产管理（上海）有限公司	基金管理人的全资子公司

注：1.下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

2.经华安基金管理有限公司股东会第四十一次会议审议通过，并经中国证券监督管理委员会证监许可【2017】1809 号文核准，华安基金管理有限公司的原股东上海电气（集团）总公司已变更为国泰君安创新投资有限公司。华安基金管理有限公司已于 2017 年 10 月 17 日就上述股东变更事项进行公告。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.8.1.3 债券交易

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.8.1.4 债券回购交易

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行回购交易。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12 月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12 月31日
当期发生的基金应支付的管理费	22,956,796.10	34,680,994.47
其中：支付销售机构的客户维护费	9,145,981.13	13,114,062.01

注：支付基金管理人华安基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 1.20% / 当年天数。

经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12 月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12 月31日
当期发生的基金应支付的托管费	3,826,132.63	5,780,165.73

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值 X 0.20% / 当年天数。

经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节

假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2017年1月1日至2017年12月31日						
银行间市场	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
交易的各关	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出

关联方名称						
中国银行	259,564,290.06	99,581,118.68	-	-	-	-
上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日						
银行间市场 交易的各关 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
-	-	-	-	-	-	-

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末未投资本基金。

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2017年1月1日至2017年12月31日		2016年1月1日至2016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
中国银行	17,638,066.79	379,887.56	7,114,994.86	959,361.32

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.9 期末（2017 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票 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
300730	科创信息	2017-12-25	重大资产重组	41.55	2018-01-02	45.71	821.00	6,863.56	34,112.55	

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 12 月 31 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 12 月 31 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1 公允价值

7.4.14.1.1 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括贷款和应收款项以及其他金融负债，其因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

7.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

7.4.14.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于 2017 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币 68,203,058.17 元，属于第二层次的余额为人民币 663,276,112.55 元，无第三层次余额。

于 2016 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于

第一层次的余额为人民币 207,173,406.02 元，属于第二层次的余额为人民币 1,538,761,798.87 元，无第三层次余额。

7.4.14.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关股票和可转换债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。

7.4.14.1.2.3 第三层次公允价值余额和本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具第三层次公允价值本期未发生变动。

7.4.14.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

7.4.14.3 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

7.4.14.4 财务报表的批准

本财务报表已于 2018 年 3 月 22 日经本基金的基金管理人批准。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	68,237,170.72	4.94
	其中：股票	68,237,170.72	4.94

2	固定收益投资	663,242,000.00	48.00
	其中：债券	660,380,000.00	47.79
	资产支持证券	2,862,000.00	0.21
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	373,350,880.03	27.02
	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	267,964,741.24	19.39
7	其他各项资产	9,027,136.00	0.65
8	合计	1,381,821,927.99	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	28,611,191.17	2.09
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	24,686,000.00	1.80
G	交通运输、仓储和邮政业	12,045,867.00	0.88
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	34,112.55	0.00
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	-	-
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	2,860,000.00	0.21
	合计	68,237,170.72	4.98

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值 比例(%)
1	601636	旗滨集团	2,000,000	12,480,000.00	0.91
2	601006	大秦铁路	1,328,100	12,045,867.00	0.88
3	601607	上海医药	400,000	9,676,000.00	0.71
4	300121	阳谷华泰	500,000	6,705,000.00	0.49
5	600153	建发股份	600,000	6,672,000.00	0.49
6	600693	东百集团	500,000	5,130,000.00	0.37
7	600114	东睦股份	299,990	4,748,841.70	0.35
8	000717	韶钢松山	500,000	4,430,000.00	0.32
9	600297	广汇汽车	400,000	3,208,000.00	0.23
10	600895	张江高科	200,000	2,860,000.00	0.21

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资 产净值比例 (%)
1	601668	中国建筑	20,885,331.00	0.86
2	601006	大秦铁路	18,485,658.00	0.76
3	002409	雅克科技	16,669,649.62	0.69
4	601601	中国太保	16,098,489.00	0.67
5	600048	保利地产	13,438,512.00	0.56

6	600307	酒钢宏兴	13,044,817.00	0.54
7	601636	旗滨集团	12,417,987.18	0.51
8	000921	海信科龙	12,353,859.86	0.51
9	601607	上海医药	10,286,352.15	0.43
10	000898	鞍钢股份	10,205,633.50	0.42
11	601318	中国平安	8,239,460.00	0.34
12	600153	建发股份	6,965,963.35	0.29
13	300121	阳谷华泰	6,647,741.00	0.27
14	002636	金安国纪	6,272,642.80	0.26
15	600745	闻泰科技	6,088,937.00	0.25
16	002074	国轩高科	6,047,482.63	0.25
17	002126	银轮股份	5,731,864.00	0.24
18	600693	东百集团	5,400,000.00	0.22
19	600297	广汇汽车	5,210,234.08	0.22
20	300336	新文化	4,701,482.02	0.19

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002409	雅克科技	203,113,957.28	8.40
2	600083	博信股份	45,732,208.84	1.89
3	601668	中国建筑	19,185,000.00	0.79
4	601601	中国太保	17,164,640.95	0.71
5	600048	保利地产	14,256,618.94	0.59
6	600307	酒钢宏兴	12,692,860.00	0.52
7	000921	海信科龙	12,547,821.63	0.52
8	000898	鞍钢股份	11,866,901.66	0.49
9	002325	洪涛股份	10,656,670.00	0.44
10	600093	易见股份	8,753,049.50	0.36
11	601318	中国平安	8,663,732.00	0.36
12	002074	国轩高科	7,267,979.98	0.30
13	600745	闻泰科技	7,060,075.00	0.29
14	002636	金安国纪	6,843,374.00	0.28
15	002126	银轮股份	6,384,739.00	0.26
16	601006	大秦铁路	6,306,259.00	0.26
17	300568	星源材质	6,282,958.46	0.26
18	002624	完美世界	5,142,748.73	0.21
19	600801	华新水泥	5,081,591.00	0.21
20	600782	新钢股份	4,804,286.00	0.20

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	325,613,635.69
卖出股票的收入（成交）总额	533,279,400.20

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	69,810,000.00	5.09
	其中：政策性金融债	69,810,000.00	5.09
4	企业债券	148,485,000.00	10.83
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	442,085,000.00	32.24
9	其他	-	-
10	合计	660,380,000.00	48.16

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	111784850	17 杭州银行 CD187	1,500,000	146,475,000.00	10.68
2	122465	15 广越 01	1,000,000	99,060,000.00	7.22
3	170408	17 农发 08	500,000	49,850,000.00	3.64
4	111771090	17 合肥科技农村商行	500,000	49,760,000.00	3.63

		CD049			
5	111771754	17 绵阳商行 CD019	500,000	49,760,000.00	3.63

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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	1789045	17 上和 1A1	200,000	2,862,000.00	0.21

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证投资。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

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

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

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

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同，本基金不能投资于国债期货。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.12 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	117,200.44
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	8,872,124.78
5	应收申购款	37,810.78
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,027,136.00

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300730	科创信息	34,112.55	0.00	重大资产重组

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例
8,966	140,595.76	791,004.34	0.06%	1,259,790,548.18	99.94%

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	97.89	0.00%

9.3 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。

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2015 年 9 月 10 日)基金份额总额	2,989,632,166.92
本报告期期初基金份额总额	2,385,210,390.71
本报告期基金总申购份额	12,724,240.96
减：本报告期基金总赎回份额	1,137,353,079.15
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,260,581,552.52

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本基金管理人重大人事变动如下：

(1)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)2018 年 2 月 13 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》，翁启森先生、姚国平先生、谷媛媛女士新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：

2017 年 8 月，陈四清先生担任中国银行股份有限公司董事长、执行董事、董事会战略发展委员会主席及委员等职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金财产、基金托管业务的诉讼。报告期内基金管理人无涉及本基金财产的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内无基金投资策略的改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘为基金审计的会计师事务所。

报告年度应支付给聘任会计师事务所的报酬为人民币 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证券监管部门稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易 单元	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股	佣金	占当期佣	

	数量		票成交总 额的比例		金总量的 比例	
中信金通	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	326,255,097.04	38.20%	297,316.61	37.81%	-
西南证券	1	309,406,272.07	36.23%	288,147.41	36.64%	-
长江证券	1	122,635,155.77	14.36%	111,757.22	14.21%	-
中泰证券	1	95,484,831.63	11.18%	88,925.12	11.31%	-
安信证券	1	312,616.80	0.04%	291.12	0.04%	-

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

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国泰君安	186,133.66	0.05%	-	-	-	-
西南证券	3,480,616.26	0.90%	744,300,000.00	57.05%	-	-
长江证券	1,126,775.30	0.29%	-	-	-	-
中泰证券	-	-	540,300,000.00	41.41%	-	-
安信证券	383,247,328.18	98.76%	20,000,000.00	1.53%	-	-

12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 影响投资者决策的其他重要信息

无。

华安基金管理有限公司

二〇一八年三月二十七日