

华安智能装备主题股票型证券投资基金
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：中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 3 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	881,702,163.49 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	贺倩
	联系电话	021-38969999	010-66060069
	电子邮箱	qiankun@huaan.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4008850099	95599
传真		021-68863414	010-68121816

2.4 信息披露方式

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

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2017 年	2016 年	2015 年 4 月 24 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
本期已实现收益	145,985,790.56	61,895,377.91	-178,361,474.76
本期利润	185,700,518.35	-264,582,968.71	103,956,095.32
加权平均基金份额本期利润	0.1366	-0.1510	0.0387
本期基金份额净值增长率	15.38%	-15.53%	10.10%
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	0.0728	-0.0698	-0.0349
期末基金资产净值	945,855,341.33	1,389,820,397.76	1,927,334,952.56
期末基金份额净值	1.073	0.930	1.101

注：1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如：封闭式基金交易佣

金、开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

3、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	0.00%	1.14%	1.41%	0.61%	-1.41%	0.53%
过去六个月	13.67%	1.13%	5.78%	0.55%	7.89%	0.58%
过去一年	15.38%	1.04%	11.28%	0.52%	4.10%	0.52%
自基金成立起至今	7.30%	2.04%	-14.91%	1.39%	22.21%	0.65%

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

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

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

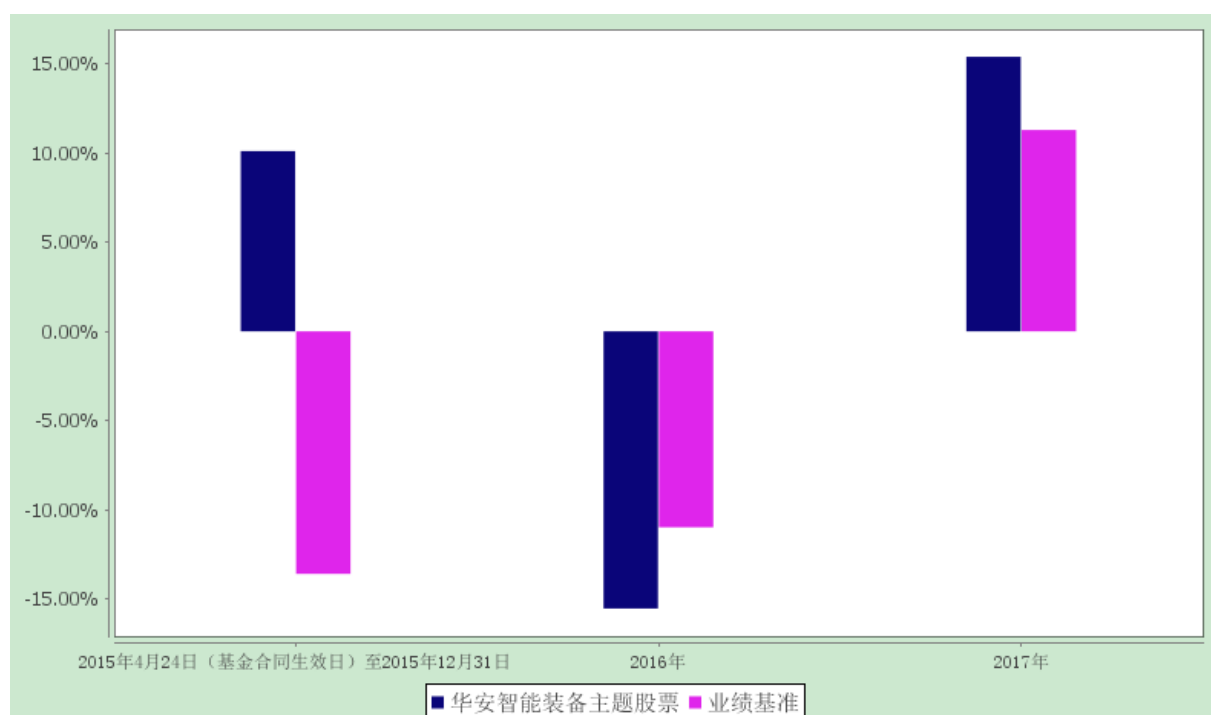
华安智能装备主题股票型证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2015 年 4 月 24 日至 2017 年 12 月 31 日)



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

华安智能装备主题股票型证券投资基金

自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



注：合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

无。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

华安基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1998]20 号文批准于 1998 年 6 月设立，是国内首批基金管理公司之一，注册资本 1.5 亿元人民币，公司总部设在上海陆家嘴金融贸易区。目前的股东为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		
李欣	本基金的基金经理	2015-07-09	-	8 年	硕士研究生，8 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 7 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

报告期内，市场呈现出比较显著的风格偏向，大盘蓝筹股、白马消费股、白马成长股整年走势较强，周期股波动较大，中小市值股票普遍有负的相对收益。

年内市场流动性趋紧。金融去杠杆限制了一部分流动性，利率水平随着宏观经济的回升而抬高，美国步入加息周期，这些因素都使得市场的流动性趋紧。流动性改变对市场的选股偏好产生了重大影响，低估值、高分红、市场流动性好的大盘蓝筹股，基本面预期稳定、市场流动性较好的白马消费和白马成长股获得市场的青睐；而基本面不确定性相对较高、市场流动性相对较差的中小市值股票表现相对不好。

海外增量资金的偏好对市场的走向也起到了相当大的作用。海外资金配置周期较长，对流动性要求较高，对 A 股上市公司的研究和调研成本较高，这些因素导致其配置较为偏好蓝筹白马类股票，这对市场风格起到了强化的作用。

在上述因素的共同作用下，白酒、家电、保险等板块出现业绩和估值的戴维斯双击，全年涨幅较高，表现突出。与此形成鲜明对比的是，中小市值成长股估值中枢不断下移。

在报告期内，本基金在基金契约规定的投资范围内，努力适应市场的方向变化，进行投资配置和调整，以求抓住市场在各个阶段的机会。

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 1.073 元,本报告期份额净值增长率为 15.38%,同期业绩比较基准增长率为 11.28%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本基金对今后一段时间的市场走势总体上是乐观的。国内宏观经济积极向好的态势是明显的:传统产业的供给侧改革取得阶段性成就,相关企业的资产负债表和现金流量表显著改善,其对金融机构的潜在风险随之大幅化解;金融系统降杠杆、防风险,清理了一大批系统性风险的隐患点,使得整个金融系统能够更加健康、稳健的运转,更好的服务于实体经济;房地产政策进入“长效机制、租售并举、因城施策”阶段,房价过快上涨的态势得到有效遏制,潜在的地产泡沫风险大为化解。

外部经济环境有一定不确定性,但总体而言是在改善的。主要发达经济体负债率较高、资产价格处于高位、市场利率走高,但消费、就业等经济数据是在明显改善的,而美国的减税和基建政策对经济也有一定的刺激作用,因此海外股市存在一定的风险,但较强劲的经济基本面尤其是消费需求对我国的出口较为有利。

证券市场方面,本基金认为机会大于风险。宏观经济和金融市场环境方面,若干系统性风险已被逐渐排除,发展更为健康持续;市场各个板块的估值得到修复和修正,之前被低估的蓝筹白马估值得到修复,一些估值较高的成长股的估值水平也已修正到与其成长性相匹配的水平。目前的市场相较于之前,更具有价值发现的作用,更能够将上市公司基本面的真实变化反映到其股价上。

投资方向上,重点看好消费升级和科技成长两大主线,同时关注周期性行业的机会。消费板块中,以家电、食品饮料、服务性体验性消费、医疗保健等作为投资的主要方向;科技成长中,看好新能源车产业链、消费电子产业链、半导体国产化、人工智能等方向。周期行业中,看好能够持续处于较高盈利水平、降低盈利波动率的行业和公司。

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 12 月 31 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

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

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§6 审计报告

本报告期的基金财务会计报告经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)审计,注册会计师 蒋燕华 蔡玉芝签字出具了安永华明(2018)审字第 60971571_B23 号标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：华安智能装备主题股票型证券投资基金

报告截止日：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	84,008,891.53	148,675,365.72
结算备付金	10,198,058.81	8,548,628.00
存出保证金	1,646,728.19	2,208,756.30
交易性金融资产	862,693,667.21	1,269,181,449.88
其中：股票投资	858,934,599.31	1,268,562,525.64
基金投资	-	-
债券投资	3,759,067.90	618,924.24
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	34,499.69	44,482.93
应收股利	-	-
应收申购款	341,222.07	149,796.05

递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	958,923,067.50	1,428,808,478.88
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	-	-
应付证券清算款	3,567,214.20	11,100,599.44
应付赎回款	2,677,536.98	19,690,370.45
应付管理人报酬	1,231,577.93	1,847,459.58
应付托管费	205,262.97	307,909.95
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	4,981,657.50	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	404,476.59	509,203.40
负债合计	13,067,726.17	38,988,081.12
所有者权益：	-	-
实收基金	881,702,163.49	1,494,149,307.29
未分配利润	64,153,177.84	-104,328,909.53
所有者权益合计	945,855,341.33	1,389,820,397.76
负债和所有者权益总计	958,923,067.50	1,428,808,478.88

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.073 元，基金份额总额 881,702,163.49 份。

7.2 利润表

会计主体：华安智能装备主题股票型证券投资基金

本报告期：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	252,775,200.89	-193,345,134.99
1.利息收入	1,173,056.18	1,563,169.51
其中：存款利息收入	1,169,686.93	1,562,419.48
债券利息收入	3,369.25	750.03
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）	210,043,947.83	125,801,431.81
其中：股票投资收益	201,057,138.32	120,552,820.39
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	8,986,809.51	5,248,611.42
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	39,714,727.79	-326,478,346.62
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	1,843,469.09	5,768,610.31
减：二、费用	67,074,682.54	71,237,833.72
1. 管理人报酬	19,965,004.28	24,559,228.64
2. 托管费	3,327,500.76	4,093,204.86

3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	43,331,407.17	42,133,098.76
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	450,770.33	452,301.46
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	185,700,518.35	-264,582,968.71
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	185,700,518.35	-264,582,968.71

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安智能装备主题股票型证券投资基金

本报告期：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）	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）	-	185,700,518.35	185,700,518.35
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）	-612,447,143.80	-17,218,430.98	-629,665,574.78
其中：1.基金申购款	412,884,915.71	1,681,586.75	414,566,502.46
2.基金赎回款	-1,025,332,059.51	-18,900,017.73	-1,044,232,077.24
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)	881,702,163.49	64,153,177.84	945,855,341.33
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)	1,751,001,345.80	176,333,606.76	1,927,334,952.56
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-264,582,968.71	-264,582,968.71
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-256,852,038.51	-16,079,547.58	-272,931,586.09
其中：1.基金申购款	888,652,413.76	-63,598,352.79	825,054,060.97
2.基金赎回款	-1,145,504,452.27	47,518,805.21	-1,097,985,647.06
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	1,494,149,307.29	-104,328,909.53	1,389,820,397.76

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

华安智能装备主题股票型证券投资基金(以下简称“本基金”),系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]207 号《关于准予华安智能装备主题股票型证券投资基金注册的批复》的核准,由基金管理人华安基金管理有限公司向社会公开发行募集,基金合同于 2015 年 4 月 24 日生效,首次设立募集规模为 3,237,720,619.07 份基金份额。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人及注册登记机构为华安基金管理有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

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

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

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

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

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《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、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(“农业银行”)	基金托管人、基金代销机构

上海国际信托有限公司	基金管理人的股东
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

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.8.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.8.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行回购交易。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	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
当期发生的基金应支付的管理费	19,965,004.28	24,559,228.64
其中：支付销售机构的客户维护费	8,535,694.81	10,718,507.10

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

$$H=E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

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

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 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	3,327,500.76	4,093,204.86

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

$$H=E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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及上年度末均未投资本基金。

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
农业银行	84,008,891.53	953,469.57	148,675,365.72	1,320,621.97

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.9 期末（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

金额单位：人民币元

7.4.9.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002923	润都股份	2017-12-28	2018-01-05	网下中签	17.01	17.01	954.00	16,227.54	16,227.54	-
300664	鹏鹞环保	2017-12-28	2018-01-05	网下中签	8.88	8.88	3,640.00	32,323.20	32,323.20	-
603080	新疆火炬	2017-12-25	2018-01-03	网下中签	13.60	13.60	1,187.00	16,143.20	16,143.20	-
603161	科华控股	2017-12-28	2018-01-05	网下中签	16.75	16.75	1,239.00	20,753.25	20,753.25	-
7.4.9.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本	期末估值	备注

				限类 型				总额	总额	
12300 3	蓝思 转债	2017-1 2-08	2018-0 1-17	认购 新发 证券	100.00	100.00	12,638 .00	1,263, 800.00	1,263, 800.00	-

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
00291 9	名臣健 康	2017-12 -28	重大事 项停牌	35.26	2018-0 1-02	38.79	821.00	10,311.76	28,948.46	-
30073 0	科创信 息	2017-12 -25	重大事 项停牌	41.55	2018-0 1-02	45.71	821.00	6,863.56	34,112.55	-
60030 9	万华化 学	2017-12 -05	重大事 项停牌	37.94	-	-	43,500.00	1,729,223.78	1,650,390.00	-
60090 3	贵州燃 气	2017-12 -28	重大事 项停牌	16.86	2018-0 1-02	16.01	3,928.00	8,680.88	66,226.08	-
60160 0	中国铝 业	2017-09 -12	重大事 项停牌	6.67	2018-0 2-26	7.28	896,600.00	6,491,384.00	5,980,322.00	-
60398 6	兆易创 新	2017-11 -01	重大事 项停牌	153.72	2018-0 3-02	150.00	136,600.00	21,640,086.45	20,998,152.00	-

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 832,586,268.93 元，属于第二层次的余额为人民币 30,107,398.28 元，无属于第三层次余额。

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

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	858,934,599.31	89.57
	其中：股票	858,934,599.31	89.57
2	固定收益投资	3,759,067.90	0.39
	其中：债券	3,759,067.90	0.39
	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	94,206,950.34	9.82
7	其他各项资产	2,022,449.95	0.21
8	合计	958,923,067.50	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	75,174,936.00	7.95

C	制造业	592,736,200.88	62.67
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	142,139.13	0.02
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	4,481,029.44	0.47
G	交通运输、仓储和邮政业	65,401,663.56	6.91
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,918,120.72	1.15
J	金融业	95,667,644.28	10.11
K	房地产业	4,682,759.00	0.50
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	9,567,558.20	1.01
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	162,548.10	0.02
S	综合	-	-
	合计	858,934,599.31	90.81

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值 比例(%)
1	600183	生益科技	2,656,039	45,843,233.14	4.85
2	000858	五 粮 液	522,300	41,721,324.00	4.41
3	600887	伊利股份	1,151,800	37,076,442.00	3.92
4	300138	晨光生物	2,497,960	31,674,132.80	3.35
5	002236	大华股份	1,332,932	30,777,399.88	3.25
6	002120	韵达股份	652,500	29,871,450.00	3.16

7	000651	格力电器	574,900	25,123,130.00	2.66
8	600115	东方航空	2,898,706	23,798,376.26	2.52
9	601225	陕西煤业	2,880,900	23,508,144.00	2.49
10	002142	宁波银行	1,314,900	23,418,369.00	2.48

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	000651	格力电器	280,568,982.26	20.19
2	002456	欧菲科技	238,457,896.68	17.16
3	002475	立讯精密	229,975,665.01	16.55
4	002236	大华股份	203,398,512.86	14.63
5	002045	国光电器	201,371,595.49	14.49
6	000725	京东方 A	179,045,693.70	12.88
7	002466	天齐锂业	166,669,396.94	11.99
8	002371	北方华创	158,200,583.95	11.38
9	300433	蓝思科技	157,129,176.08	11.31
10	600519	贵州茅台	155,894,885.88	11.22
11	300545	联得装备	144,674,627.09	10.41
12	600183	生益科技	144,312,225.46	10.38
13	603626	科森科技	134,584,435.61	9.68
14	000333	美的集团	134,277,126.28	9.66
15	601318	中国平安	130,625,360.55	9.40
16	002241	歌尔股份	127,317,806.57	9.16
17	601231	环旭电子	125,586,655.21	9.04
18	000050	深天马 A	123,247,965.23	8.87
19	002008	大族激光	117,355,515.25	8.44
20	600525	长园集团	112,348,433.29	8.08
21	300408	三环集团	103,457,173.92	7.44
22	300588	熙菱信息	100,478,686.59	7.23
23	300236	上海新阳	99,287,859.21	7.14
24	600585	海螺水泥	97,736,747.12	7.03
25	000823	超声电子	95,517,102.06	6.87
26	002142	宁波银行	94,528,342.49	6.80
27	600309	万华化学	93,533,794.23	6.73
28	002185	华天科技	91,967,175.96	6.62
29	600584	长电科技	91,752,229.99	6.60
30	603160	汇顶科技	91,663,739.89	6.60

31	600745	闻泰科技	91,563,747.04	6.59
32	002460	赣锋锂业	88,673,692.26	6.38
33	002831	裕同科技	88,401,798.18	6.36
34	000858	五 粮 液	87,896,447.97	6.32
35	002415	海康威视	86,838,224.43	6.25
36	300327	中颖电子	83,799,105.03	6.03
37	600019	宝钢股份	83,432,701.75	6.00
38	300613	富瀚微	82,144,915.85	5.91
39	600651	飞乐音响	78,655,655.88	5.66
40	600760	中航沈飞	78,481,629.44	5.65
41	600563	法拉电子	78,101,880.22	5.62
42	603986	兆易创新	75,244,520.19	5.41
43	300207	欣旺达	75,121,397.82	5.41
44	300458	全志科技	74,371,820.53	5.35
45	000636	风华高科	73,295,149.52	5.27
46	000049	德赛电池	72,934,550.62	5.25
47	300083	劲胜智能	71,571,477.87	5.15
48	300603	立昂技术	71,338,298.56	5.13
49	601988	中国银行	71,055,490.74	5.11
50	000709	河钢股份	70,990,156.14	5.11
51	600110	诺德股份	70,914,907.64	5.10
52	600104	上汽集团	69,701,747.03	5.02
53	002217	合力泰	69,661,485.56	5.01
54	300316	晶盛机电	67,558,892.48	4.86
55	000568	泸州老窖	66,158,939.92	4.76
56	600741	华域汽车	65,994,969.89	4.75
57	000768	中航飞机	65,658,275.88	4.72
58	002273	水晶光电	63,798,807.87	4.59
59	000717	韶钢松山	62,597,045.74	4.50
60	002074	国轩高科	61,568,341.20	4.43
61	600782	新钢股份	61,506,151.54	4.43
62	002222	福晶科技	60,087,155.68	4.32
63	300136	信维通信	59,932,252.18	4.31
64	601600	中国铝业	59,054,832.34	4.25
65	000898	鞍钢股份	58,353,546.97	4.20
66	601233	桐昆股份	57,875,412.59	4.16
67	601601	中国太保	52,235,844.96	3.76
68	600261	阳光照明	51,427,777.96	3.70
69	600507	方大特钢	50,971,614.28	3.67
70	601668	中国建筑	50,876,013.00	3.66
71	300373	扬杰科技	50,781,282.45	3.65
72	603799	华友钴业	49,859,206.28	3.59
73	300602	飞荣达	49,250,732.18	3.54
74	600887	伊利股份	48,761,272.67	3.51

75	600702	舍得酒业	48,740,379.75	3.51
76	300456	耐威科技	48,207,991.22	3.47
77	001979	招商蛇口	47,295,395.80	3.40
78	300567	精测电子	47,215,715.21	3.40
79	300496	中科创达	47,091,035.59	3.39
80	603005	晶方科技	46,267,367.95	3.33
81	300323	华灿光电	46,178,410.71	3.32
82	000988	华工科技	46,080,924.29	3.32
83	000100	TCL 集团	45,570,864.00	3.28
84	300474	景嘉微	45,289,129.97	3.26
85	600360	华微电子	45,187,286.29	3.25
86	603996	中新科技	44,431,504.41	3.20
87	002600	江粉磁材	44,336,234.50	3.19
88	603993	洛阳钼业	44,321,276.80	3.19
89	300346	南大光电	44,209,720.87	3.18
90	300415	伊之密	43,052,920.38	3.10
91	300400	劲拓股份	42,083,016.81	3.03
92	603660	苏州科达	42,031,072.63	3.02
93	300566	激智科技	41,866,125.62	3.01
94	002027	分众传媒	41,540,295.19	2.99
95	002180	纳思达	41,433,111.86	2.98
96	300138	晨光生物	41,047,619.48	2.95
97	300232	洲明科技	40,960,136.63	2.95
98	600660	福耀玻璃	40,927,756.22	2.94
99	603929	亚翔集成	40,904,717.32	2.94
100	002271	东方雨虹	40,868,547.93	2.94
101	002245	澳洋顺昌	40,633,780.70	2.92
102	002861	瀛通通讯	40,423,744.66	2.91
103	002850	科达利	40,250,927.61	2.90
104	601818	光大银行	39,508,594.74	2.84
105	603328	依顿电子	39,283,915.83	2.83
106	600362	江西铜业	39,153,675.59	2.82
107	603010	万盛股份	39,032,948.95	2.81
108	000848	承德露露	38,601,375.37	2.78
109	000661	长春高新	38,216,387.80	2.75
110	603515	欧普照明	37,581,902.97	2.70
111	600885	宏发股份	37,310,352.24	2.68
112	002196	方正电机	36,591,238.66	2.63
113	600038	中直股份	36,293,366.81	2.61
114	603002	宏昌电子	35,254,827.61	2.54
115	600569	安阳钢铁	34,597,501.92	2.49
116	300059	东方财富	34,406,456.28	2.48
117	002036	联创电子	34,135,606.38	2.46
118	002858	力盛赛车	33,164,883.24	2.39

119	000932	*ST 华菱	32,946,987.47	2.37
120	600667	太极实业	32,664,454.74	2.35
121	000063	中兴通讯	32,531,343.96	2.34
122	600977	中国电影	32,302,191.00	2.32
123	601688	华泰证券	32,275,450.33	2.32
124	600884	杉杉股份	31,431,749.68	2.26
125	600567	山鹰纸业	31,380,669.28	2.26
126	600489	中金黄金	31,373,359.87	2.26
127	601117	中国化学	31,259,291.68	2.25
128	002138	顺络电子	30,951,516.83	2.23
129	300116	坚瑞沃能	30,934,943.19	2.23
130	002139	拓邦股份	30,877,937.68	2.22
131	002738	中矿资源	30,868,510.17	2.22
132	000807	云铝股份	30,852,357.16	2.22
133	601336	新华保险	30,763,654.16	2.21
134	603337	杰克股份	30,744,956.73	2.21
135	300648	星云股份	30,574,933.75	2.20
136	002013	中航机电	30,411,184.28	2.19
137	300537	广信材料	30,276,903.81	2.18
138	600036	招商银行	30,250,633.00	2.18
139	600703	三安光电	29,579,317.81	2.13
140	000921	海信科龙	29,561,005.24	2.13
141	300595	欧普康视	29,510,985.30	2.12
142	002061	浙江交科	29,208,556.41	2.10
143	300367	东方网力	28,834,970.20	2.07
144	002841	视源股份	28,822,217.06	2.07
145	000546	金圆股份	28,334,557.59	2.04
146	601225	陕西煤业	28,020,285.18	2.02
147	300307	慈星股份	27,816,277.37	2.00
148	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。

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	000651	格力电器	285,420,883.01	20.54
2	002456	欧菲科技	253,427,117.16	18.23
3	002475	立讯精密	240,270,986.60	17.29
4	002236	大华股份	238,703,065.98	17.18

5	002045	国光电器	210,536,707.45	15.15
6	000725	京东方 A	193,234,705.52	13.90
7	002371	北方华创	183,133,187.59	13.18
8	002466	天齐锂业	181,325,973.83	13.05
9	600519	贵州茅台	149,644,215.19	10.77
10	300433	蓝思科技	144,460,912.23	10.39
11	300545	联得装备	143,607,078.84	10.33
12	603626	科森科技	130,587,901.19	9.40
13	002008	大族激光	124,908,495.03	8.99
14	601231	环旭电子	124,689,978.82	8.97
15	002241	歌尔股份	124,217,094.10	8.94
16	601318	中国平安	124,195,455.37	8.94
17	000333	美的集团	124,186,363.27	8.94
18	600525	长园集团	120,179,879.55	8.65
19	000050	深天马 A	117,789,265.85	8.48
20	002185	华天科技	113,744,504.68	8.18
21	300588	熙菱信息	110,442,311.79	7.95
22	300458	全志科技	107,639,516.93	7.74
23	300408	三环集团	104,337,470.81	7.51
24	600183	生益科技	104,029,767.51	7.49
25	002120	韵达股份	103,835,141.47	7.47
26	600745	闻泰科技	101,823,969.77	7.33
27	002831	裕同科技	97,121,859.36	6.99
28	002460	赣锋锂业	96,882,838.28	6.97
29	603160	汇顶科技	96,350,932.87	6.93
30	000823	超声电子	96,205,327.03	6.92
31	600309	万华化学	94,990,215.46	6.83
32	300236	上海新阳	93,128,631.52	6.70
33	600760	中航沈飞	91,917,117.43	6.61
34	600584	长电科技	90,776,079.31	6.53
35	002415	海康威视	88,868,095.21	6.39
36	300327	中颖电子	86,042,369.82	6.19
37	300613	富瀚微	85,026,453.36	6.12
38	600019	宝钢股份	81,689,495.81	5.88
39	603986	兆易创新	80,241,838.01	5.77
40	600651	飞乐音响	79,755,216.54	5.74
41	600585	海螺水泥	79,371,256.48	5.71
42	300603	立昂技术	77,825,418.60	5.60
43	600104	上汽集团	75,302,893.71	5.42
44	300207	欣旺达	74,393,664.91	5.35
45	002142	宁波银行	73,300,438.43	5.27
46	600782	新钢股份	72,459,014.13	5.21
47	002217	合力泰	71,380,916.12	5.14
48	300083	劲胜智能	71,066,746.45	5.11

49	000709	河钢股份	70,469,633.17	5.07
50	000049	德赛电池	70,160,208.79	5.05
51	600741	华域汽车	69,678,504.23	5.01
52	000636	风华高科	69,255,490.36	4.98
53	600110	诺德股份	67,541,335.75	4.86
54	300316	晶盛机电	66,866,320.10	4.81
55	000768	中航飞机	64,346,855.61	4.63
56	000717	韶钢松山	63,879,095.51	4.60
57	000568	泸州老窖	62,943,176.45	4.53
58	002273	水晶光电	62,924,965.27	4.53
59	600563	法拉电子	62,447,358.89	4.49
60	000898	鞍钢股份	61,543,250.18	4.43
61	002074	国轩高科	61,197,856.97	4.40
62	300136	信维通信	60,069,741.48	4.32
63	002222	福晶科技	59,868,924.81	4.31
64	300227	光韵达	58,930,947.11	4.24
65	601233	桐昆股份	58,921,696.62	4.24
66	000100	TCL 集团	58,278,417.40	4.19
67	601601	中国太保	55,318,995.36	3.98
68	000065	北方国际	55,033,556.37	3.96
69	601600	中国铝业	54,350,286.81	3.91
70	603799	华友钴业	54,111,570.15	3.89
71	601117	中国化学	53,952,733.86	3.88
72	000988	华工科技	53,543,138.86	3.85
73	300496	中科创达	52,101,147.10	3.75
74	600489	中金黄金	51,316,204.09	3.69
75	300346	南大光电	51,184,889.76	3.68
76	300373	扬杰科技	50,874,632.36	3.66
77	601988	中国银行	50,311,723.00	3.62
78	300456	耐威科技	50,076,812.38	3.60
79	300602	飞荣达	49,898,202.00	3.59
80	601818	光大银行	49,271,774.00	3.55
81	300567	精测电子	49,081,538.16	3.53
82	601668	中国建筑	48,586,208.20	3.50
83	600507	方大特钢	48,017,676.80	3.45
84	000858	五 粮 液	47,865,114.88	3.44
85	600015	华夏银行	47,620,847.52	3.43
86	600885	宏发股份	47,542,130.51	3.42
87	600702	舍得酒业	47,325,717.16	3.41
88	300323	华灿光电	47,031,387.46	3.38
89	601328	交通银行	46,078,053.45	3.32
90	300400	劲拓股份	45,801,122.59	3.30
91	002600	江粉磁材	45,752,619.69	3.29
92	603660	苏州科达	45,301,366.31	3.26

93	300415	伊之密	45,057,405.68	3.24
94	603005	晶方科技	44,239,608.27	3.18
95	002271	东方雨虹	44,121,973.58	3.17
96	300474	景嘉微	44,071,319.92	3.17
97	001979	招商蛇口	44,013,185.35	3.17
98	603929	亚翔集成	43,859,758.02	3.16
99	002027	分众传媒	43,595,225.92	3.14
100	000661	长春高新	43,543,465.91	3.13
101	603993	洛阳钼业	43,331,749.66	3.12
102	600261	阳光照明	43,212,488.95	3.11
103	300566	激智科技	42,030,734.58	3.02
104	600360	华微电子	41,794,534.70	3.01
105	002180	纳思达	41,529,017.91	2.99
106	002861	瀛通通讯	41,229,779.48	2.97
107	603010	万盛股份	41,088,357.15	2.96
108	600660	福耀玻璃	40,637,473.90	2.92
109	601688	华泰证券	39,758,404.27	2.86
110	300398	飞凯材料	39,716,099.33	2.86
111	002245	澳洋顺昌	39,421,527.81	2.84
112	600569	安阳钢铁	38,220,569.24	2.75
113	603515	欧普照明	38,193,955.37	2.75
114	000063	中兴通讯	37,868,803.48	2.72
115	300223	北京君正	37,604,271.98	2.71
116	600362	江西铜业	37,409,075.96	2.69
117	002139	拓邦股份	37,127,138.22	2.67
118	002850	科达利	37,040,613.75	2.67
119	000848	承德露露	36,458,624.28	2.62
120	603328	依顿电子	35,705,658.46	2.57
121	300116	坚瑞沃能	35,060,501.89	2.52
122	600114	东睦股份	35,022,752.01	2.52
123	603337	杰克股份	34,990,842.88	2.52
124	300059	东方财富	34,862,144.74	2.51
125	600884	杉杉股份	34,148,181.68	2.46
126	603996	中新科技	33,774,469.24	2.43
127	600667	太极实业	33,587,186.40	2.42
128	000807	云铝股份	32,709,372.08	2.35
129	300648	星云股份	32,681,973.29	2.35
130	300537	广信材料	32,611,767.66	2.35
131	603305	旭升股份	32,344,775.69	2.33
132	600038	中直股份	32,222,265.80	2.32
133	002138	顺络电子	32,009,377.18	2.30
134	601908	京运通	31,770,097.62	2.29
135	002196	方正电机	31,587,924.77	2.27
136	002841	视源股份	31,308,955.48	2.25

137	600977	中国电影	30,993,470.01	2.23
138	600567	山鹰纸业	30,873,056.30	2.22
139	002013	中航机电	30,796,217.04	2.22
140	300595	欧普康视	30,571,032.58	2.20
141	000546	金圆股份	30,429,231.09	2.19
142	600259	广晟有色	30,397,212.26	2.19
143	601012	隆基股份	30,150,175.30	2.17
144	002036	联创电子	29,984,538.76	2.16
145	002858	力盛赛车	29,962,638.68	2.16
146	600898	国美通讯	29,946,738.05	2.15
147	002511	中顺洁柔	29,810,119.39	2.14
148	002517	恺英网络	29,744,786.01	2.14
149	600703	三安光电	29,227,772.03	2.10
150	600068	葛洲坝	29,206,581.48	2.10
151	300232	洲明科技	29,205,886.71	2.10
152	600595	中孚实业	29,153,115.02	2.10
153	300446	乐凯新材	29,013,493.03	2.09
154	002341	新纶科技	28,708,269.29	2.07
155	002738	中矿资源	28,629,403.35	2.06
156	300367	东方网力	28,254,792.69	2.03
157	300523	辰安科技	28,012,434.20	2.02

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

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	13,943,685,836.31
卖出股票的收入（成交）总额	14,593,936,285.09

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-

3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	3,759,067.90	0.40
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	3,759,067.90	0.40

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	113015	隆基转债	11,730	1,388,949.30	0.15
2	123003	蓝思转债	12,638	1,263,800.00	0.13
3	110040	生益转债	5,540	599,871.20	0.06
4	128013	洪涛转债	5,484	506,447.40	0.05

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证投资。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

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

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

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

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

无。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

无。

8.12 投资组合报告附注

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

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

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,646,728.19
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	34,499.69
5	应收申购款	341,222.07
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,022,449.95

8.12.4 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	506,447.40	0.05

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况的股票。

§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
26,730	32,985.49	2,301,272.54	0.26%	879,400,890.95	99.74%

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	899.49	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 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	412,884,915.71
减：本报告期基金总赎回份额	1,025,332,059.51
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	881,702,163.49

§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：

本基金托管人于 2016 年 8 月 29 日任命史静欣女士为中国农业银行股份有限公司托管业务部/养老金管理中心副总经理，负责管理证券投资基金托管业务。因工作需要，余晓晨先生于 2017 年 3 月 8 日不再担任中国农业银行股份有限公司托管业务部/养老金管理中心副总经理职务。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内无基金投资策略的改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘为基金审计的会计师事务所。

报告年度应支付给聘任会计师事务所的报酬情况为人民币 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 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	8,052,258,037.61	28.22%	7,338,033.63	28.00%	-
中信证券	2	6,313,717,607.42	22.13%	5,824,112.20	22.22%	-
招商证券	4	5,976,394,471.62	20.95%	5,484,807.87	20.93%	-
安信证券	1	3,272,730,608.02	11.47%	2,982,443.37	11.38%	-
中信建投	1	2,825,231,665.86	9.90%	2,631,134.01	10.04%	-
太平洋证券	1	2,089,615,290.72	7.32%	1,946,057.19	7.43%	-

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：

2017 年 7 月完成租用托管在农业银行的太平洋证券上海 39422 交易单元

2017 年 12 月完成租用托管在农业银行的招商证券上海 40338 交易单元

2017 年 12 月完成租用托管在农业银行的招商证券上海 40339 交易单元

12 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