华安生态优先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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 3 月 22 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	华安生态优先混合
基金主代码	000294
交易代码	000294
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013 年 11 月 28 日
基金管理人	华安基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	67,313,842.51 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金重点投资于生态保护与生态友好相关的行业或企业，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。
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。
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	本基金为混合型基金，基金的风险与预期收益高于债券型基金和货币市场基金、低于股票型基金，属于证券投资基金中的中高风险投资品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	华安基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司

信息披露负责人	姓名	钱鲲	田青
	联系电话	021-38969999	010-67595096
	电子邮箱	qiankun@huaan.com.cn	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		4008850099	010-67595096
传真		021-68863414	010-66275853

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**
本期已实现收益	26,833,174.31	-13,103,553.10	51,596,045.41
本期利润	30,031,355.66	-31,734,802.82	52,637,961.93
加权平均基金份额本期利润	0.4223	-0.3738	0.6573
本期基金份额净值增长率	28.11%	-16.86%	57.34%
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	1.0506	0.6224	0.8103
期末基金资产净值	139,885,119.57	113,798,748.22	186,089,300.08
期末基金份额净值	2.078	1.622	1.951

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	3.85%	1.16%	1.41%	0.61%	2.44%	0.55%
过去六个月	24.06%	1.22%	5.78%	0.55%	18.28%	0.67%
过去一年	28.11%	1.12%	11.28%	0.52%	16.83%	0.60%
过去三年	67.58%	2.32%	11.47%	1.38%	56.11%	0.94%
自基金合同生效起至今	107.80%	2.04%	53.11%	1.27%	54.69%	0.77%

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

华安生态优先混合型证券投资基金

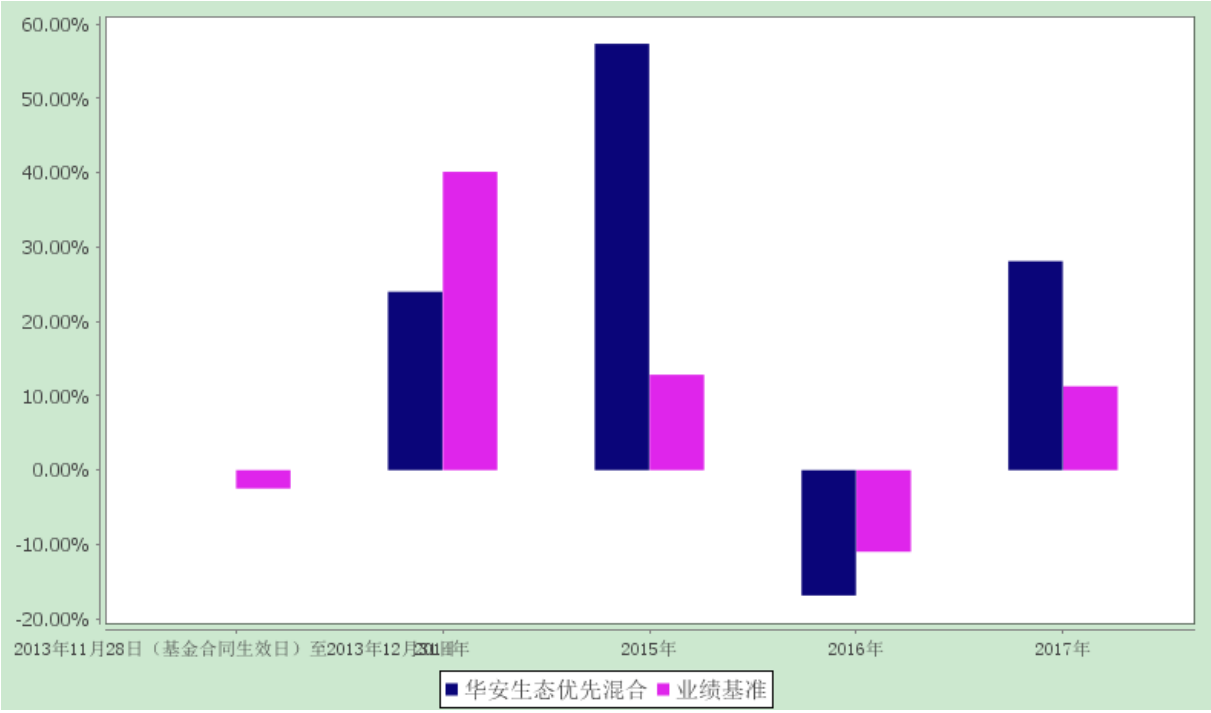
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2013 年 11 月 28 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

华安生态优先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

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		
刘伟亭	本基金的基金经理	2015-09-25	-	12 年	硕士研究生，12 年证券、基金从业经验，曾任长江巴黎百富勤证券有限公司助理经理、国海富兰克林基金基金经理。2015 年 6 月加入华安基金管理有限公司，2015 年 9 月起担任本基金及华安宝利配置证券投资基金的基金经理。2016 年 9 月起同时担任华安智增精选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遵规守信情况的说明

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

本基金在 2017 年下半年关注到周期行业改善的信号后，提高了周期行业的配置比例，较好的把握了钢铁等周期性行业的投资机会，四季度增加了消费股的配置，从结果来看，效果还可以。接下来我们会保持持续跟踪并动态修正对投资标的预期从而对持仓进行调整。

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 2.078 元，本报告期份额净值增长率为 28.11%，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

对经济判断：从短期静态的视角看，宏观经济温和复苏，流动性进入偏紧区间，汇率调整也依然还没完全达到均衡水平，外部风险依然存在，无风险收益率逐步上移。未来一段时间只要不出现超预期的风险因素，市场依然存在一定的结构性机会。居民加杠杆确定性放缓，对消费的挤出效应缓解，消费依然是中国经济可持续的亮点。2018 年去杠杆仍将延续，信贷环境偏紧，流动性将是制约经济和股市上行空间的负面因素。

股市展望：整体看来，2018 年 A 股受到流动性中性、无风险利率上行影响，风险偏好难以显著提升，风格差异将会弱于 2017 年。经历了一年多的估值扩张后，白马蓝筹继续提升估值的空间已经不大，18 年全年各板块机会将更为均衡，业绩与估值的匹配是主要关注点。一大批优质成长股的性价比已经很好，已经进入到了值得配置的区间。

操作思路：未来一段时间，企业盈利持续分化，利率高位盘整，流动性保持偏紧状态，市场更多的是呈现结构性机会，看好受益于利率上行周期的大金融板块；确定性较高、现金流好的消费品行业尤其是市占率快速提升的细分子行业龙头的以及处于景气周期、估值较低的部分周期股；新能源汽车、消费电子等成长性行业在估值调整之后的投资价值也更加具有吸引力。我们会更多的自下而上的选择可以较好把握基本面和未来表现的品种，尤其好公司如果存在信息被市场误读而出现错杀带来的投资机会，努力为投资人创造更好的收益。

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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

§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_B14 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：华安生态优先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	14,052,053.08	12,441,848.60
结算备付金	2,074,886.50	1,390,695.40
存出保证金	167,568.11	128,884.22
交易性金融资产	125,706,559.61	92,715,688.86
其中：股票投资	125,173,238.36	92,063,922.36
基金投资	-	-
债券投资	533,321.25	651,766.50
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	5,687,981.54	8,335,773.78

应收利息	4,402.65	3,553.22
应收股利	-	-
应收申购款	179,383.50	205,403.53
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	**147,872,834.99**	**115,221,847.61**
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	5,152,216.31	-
应付赎回款	1,219,525.69	75,586.56
应付管理人报酬	179,013.32	149,867.88
应付托管费	29,835.57	24,977.97
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	1,054,424.24	822,391.86
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	352,700.29	350,275.12
负债合计	**7,987,715.42**	**1,423,099.39**
所有者权益：	-	-
实收基金	67,313,842.51	70,142,239.08
未分配利润	72,571,277.06	43,656,509.14
所有者权益合计	**139,885,119.57**	**113,798,748.22**

负债和所有者权益总计	**147,872,834.99**	**115,221,847.61**

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值 2.078 元，基金份额总额 67,313,842.51 份。

7.2 利润表

会计主体：华安生态优先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	**38,069,353.78**	**-23,069,691.38**
1.利息收入	125,970.59	118,738.38
其中：存款利息收入	123,265.67	117,948.55
债券利息收入	2,704.92	789.83
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）	34,578,571.26	-4,690,793.30
其中：股票投资收益	33,919,312.91	-5,234,948.88
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	659,258.35	544,155.58
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	3,198,181.35	-18,631,249.72
4.汇兑收益（损失以“一”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	166,630.58	133,613.26
减：二、费用	**8,037,998.12**	**8,665,111.44**

1．管理人报酬	1,924,948.73	2,018,187.71
2．托管费	320,824.91	336,364.64
3．销售服务费	-	-
4．交易费用	5,433,410.73	5,945,337.03
5．利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6．其他费用	358,813.75	365,222.06
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	**30,031,355.66**	**-31,734,802.82**
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	**30,031,355.66**	**-31,734,802.82**

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安生态优先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）	70,142,239.08	43,656,509.14	113,798,748.22
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	30,031,355.66	30,031,355.66
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）	-2,828,396.57	-1,116,587.74	-3,944,984.31
其中：1.基金申购款	79,411,605.48	75,672,942.17	155,084,547.65
2.基金赎回款	-82,240,002.05	-76,789,529.91	-159,029,531.96
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）	67,313,842.51	72,571,277.06	139,885,119.57
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）	95,392,936.69	90,696,363.39	186,089,300.08
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-31,734,802.82	-31,734,802.82
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）	-25,250,697.61	-15,305,051.43	-40,555,749.04
其中：1.基金申购款	52,716,838.40	29,736,563.44	82,453,401.84
2.基金赎回款	-77,967,536.01	-45,041,614.87	-123,009,150.88
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）	70,142,239.08	43,656,509.14	113,798,748.22

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

华安生态优先混合型证券投资基金（原名华安生态优先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[2013]1017 号《关于核准华安生态优先股票型证券投资基金募集的批复》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 2013 年 11 月 28 日正式生效，首次设立募集规模为 952,701,097.47 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，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《关于实施<公开募集证券投资基金运作管理办法>有关问题的规定》及基金合同的有关约定，经协商基金托管人中国建设银行股份有限公司同意，并报中国证监会备案，自 2015 年 8 月 6 日起，将本基金更名为华安生态优先混合型证券投资基金。

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 A 股股票等权益类证券（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）、债券、货币市场工具、股指期货、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，但需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。

本基金的股票投资比例为基金资产的 60％-95%，其中，投资于生态保护与生态友好相关的股票的比例不低于非现金基金资产的 80%。持有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、注册登记机构、基金销售机构

中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	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 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	1,924,948.73	2,018,187.71
其中：支付销售机构的客户维护费	690,142.29	647,276.75

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×1.50%/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	320,824.91	336,364.64

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×0.25%/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

份额单位：份

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
期初持有的基金份额	-	7,303,871.44
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	7,303,871.44
期末持有的基金份额	-	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

注：期间申购/买入总份额含红利再投、转换入份额。期间赎回/卖出总份额含转换出份额。

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
建设银行	14,052,053.08	97,135.62	12,441,848.60	88,395.21

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
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	-

7.4.9.2 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
002507	涪陵榨菜	2017-12-04	重大事项停牌	17.94	-	-	328,000.00	4,978,793.44	5,884,320.00	-
002919	名臣健康	2017-12-28	重大事项停牌	35.26	2018-01-02	38.79	821.00	10,311.76	28,948.46	-
300730	科创信息	2017-12-25	重大事项停牌	41.55	2018-01-02	45.71	821.00	6,863.56	34,112.55	-
600309	万华化学	2017-12-05	重大事项停牌	37.94	-	-	190,300.00	7,147,842.00	7,219,982.00	-

注：本基金截至 2017 年 12 月 31 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

7.4.9.3 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金融资产款余额。

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 112,502,300.15 元，属于第二层次的余额为人民币 13,204,259.46 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 85,826,256.75 元，属于第二层次的余额为人民币 6,889,432.11 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	125,173,238.36	84.65
	其中：股票	125,173,238.36	84.65
2	固定收益投资	533,321.25	0.36
	其中：债券	533,321.25	0.36
	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	16,126,939.58	10.91
7	其他各项资产	6,039,335.80	4.08
8	合计	147,872,834.99	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	4,318,730.00	3.09
B	采矿业	4,157,808.00	2.97
C	制造业	106,741,396.27	76.31

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,143.20	0.01
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	17,957.94	0.01
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,548,422.95	1.11
J	金融业	4,793,630.00	3.43
K	房地产业	3,579,150.00	2.56
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	-	-
	合计	125,173,238.36	89.48

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	600309	万华化学	190,300	7,219,982.00	5.16
2	600176	中国巨石	436,000	7,102,440.00	5.08
3	300274	阳光电源	375,100	7,040,627.00	5.03
4	600782	新钢股份	1,067,000	7,020,860.00	5.02
5	600563	法拉电子	137,500	6,986,375.00	4.99
6	002677	浙江美大	401,800	6,810,510.00	4.87
7	603589	口子窖	142,900	6,580,545.00	4.70
8	000568	泸州老窖	97,000	6,402,000.00	4.58
9	000786	北新建材	267,100	6,009,750.00	4.30
10	002507	涪陵榨菜	328,000	5,884,320.00	4.21

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	600782	新钢股份	29,444,381.70	25.87
2	002456	欧菲科技	19,901,832.67	17.49
3	002466	天齐锂业	18,563,690.56	16.31
4	603589	口子窖	18,361,637.62	16.14
5	002460	赣锋锂业	18,312,791.92	16.09
6	000983	西山煤电	17,724,049.80	15.57
7	601688	华泰证券	17,720,246.43	15.57
8	600309	万华化学	17,687,774.04	15.54
9	600282	南钢股份	17,006,818.00	14.94
10	002635	安洁科技	16,922,535.80	14.87
11	600885	宏发股份	15,751,833.10	13.84
12	000988	华工科技	15,543,962.00	13.66
13	600563	法拉电子	15,299,599.88	13.44
14	300274	阳光电源	14,872,088.61	13.07
15	000568	泸州老窖	14,413,576.60	12.67
16	000717	韶钢松山	14,330,993.71	12.59
17	000661	长春高新	14,106,660.60	12.40
18	600958	东方证券	14,061,429.00	12.36
19	002497	雅化集团	13,148,160.19	11.55
20	000786	北新建材	12,419,577.93	10.91
21	601377	兴业证券	12,167,910.44	10.69
22	600298	安琪酵母	11,952,544.07	10.50
23	601003	柳钢股份	11,938,841.22	10.49
24	000858	五 粮 液	11,850,474.98	10.41
25	000789	万年青	11,777,906.50	10.35
26	600426	华鲁恒升	11,764,968.20	10.34
27	600549	厦门钨业	11,719,909.00	10.30
28	600019	宝钢股份	11,657,636.76	10.24
29	002050	三花智控	11,651,334.88	10.24
30	002157	正邦科技	11,563,357.69	10.16
31	600585	海螺水泥	11,533,552.24	10.14
32	600196	复星医药	11,494,700.38	10.10
33	603883	老百姓	11,437,857.80	10.05
34	002241	歌尔股份	11,375,934.12	10.00
35	603737	三棵树	11,118,344.64	9.77

36	000591	太阳能	10,840,052.80	9.53
37	002026	山东威达	10,823,736.46	9.51
38	600110	诺德股份	10,730,077.00	9.43
39	600702	舍得酒业	10,523,191.54	9.25
40	300196	长海股份	10,343,689.66	9.09
41	600884	杉杉股份	10,292,114.80	9.04
42	002677	浙江美大	10,189,668.50	8.95
43	300450	先导智能	10,181,442.00	8.95
44	000987	越秀金控	9,957,280.00	8.75
45	000823	超声电子	9,916,009.10	8.71
46	603993	洛阳钼业	9,795,587.00	8.61
47	600507	方大特钢	9,610,313.97	8.45
48	600801	华新水泥	9,599,768.03	8.44
49	600197	伊力特	9,565,379.36	8.41
50	300061	康旗股份	9,547,180.37	8.39
51	300007	汉威科技	9,436,400.45	8.29
52	000002	万　科Ａ	9,238,655.00	8.12
53	002507	涪陵榨菜	9,152,594.50	8.04
54	300498	温氏股份	9,060,752.76	7.96
55	603203	快克股份	8,961,270.30	7.87
56	000063	中兴通讯	8,914,834.92	7.83
57	002074	国轩高科	8,876,322.76	7.80
58	600570	恒生电子	8,808,397.00	7.74
59	002240	威华股份	8,689,711.49	7.64
60	001979	招商蛇口	8,625,872.00	7.58
61	600006	东风汽车	8,510,059.43	7.48
62	300408	三环集团	8,505,501.10	7.47
63	600997	开滦股份	8,344,674.97	7.33
64	300433	蓝思科技	8,318,546.99	7.31
65	600291	西水股份	8,254,284.75	7.25
66	000970	中科三环	8,162,245.11	7.17
67	600487	亨通光电	8,040,574.60	7.07
68	300124	汇川技术	7,905,904.90	6.95
69	600887	伊利股份	7,773,472.33	6.83
70	000878	云南铜业	7,733,813.00	6.80
71	002368	太极股份	7,703,218.07	6.77
72	300271	华宇软件	7,669,059.00	6.74
73	000937	冀中能源	7,569,287.20	6.65
74	000830	鲁西化工	7,567,726.00	6.65
75	000825	太钢不锈	7,547,789.70	6.63
76	600176	中国巨石	7,513,819.64	6.60
77	601607	上海医药	7,510,272.00	6.60
78	600486	扬农化工	7,485,344.60	6.58
79	002236	大华股份	7,451,587.00	6.55

80	600703	三安光电	7,410,832.50	6.51
81	000963	华东医药	7,385,019.80	6.49
82	300115	长盈精密	7,204,036.00	6.33
83	600466	蓝光发展	7,130,376.00	6.27
84	600438	通威股份	7,014,004.66	6.16
85	601328	交通银行	7,000,204.68	6.15
86	000783	长江证券	6,953,825.66	6.11
87	000739	普洛药业	6,893,110.65	6.06
88	600259	广晟有色	6,800,395.00	5.98
89	000049	德赛电池	6,766,166.30	5.95
90	603111	康尼机电	6,753,899.98	5.93
91	600966	博汇纸业	6,728,366.00	5.91
92	000651	格力电器	6,588,761.00	5.79
93	000426	兴业矿业	6,431,701.00	5.65
94	600004	白云机场	6,420,629.79	5.64
95	002714	牧原股份	6,370,374.04	5.60
96	600038	中直股份	6,367,692.00	5.60
97	601636	旗滨集团	6,271,909.00	5.51
98	300458	全志科技	6,266,543.95	5.51
99	600497	驰宏锌锗	6,201,085.00	5.45
100	300203	聚光科技	6,157,406.00	5.41
101	603626	科森科技	6,045,249.00	5.31
102	600050	中国联通	6,012,503.00	5.28
103	601012	隆基股份	5,663,780.00	4.98
104	002766	索菱股份	5,659,441.00	4.97
105	300365	恒华科技	5,651,885.00	4.97
106	002285	世联行	5,606,012.86	4.93
107	600191	华资实业	5,581,430.85	4.90
108	600352	浙江龙盛	5,576,569.92	4.90
109	000932	*ST 华菱	5,546,506.00	4.87
110	300198	纳川股份	5,505,958.00	4.84
111	603515	欧普照明	5,484,619.15	4.82
112	600335	国机汽车	5,474,287.46	4.81
113	002440	闰土股份	5,409,007.28	4.75
114	600720	祁连山	5,386,673.00	4.73
115	000807	云铝股份	5,385,264.00	4.73
116	002024	苏宁易购	5,373,728.00	4.72
117	600584	长电科技	5,272,036.00	4.63
118	300207	欣旺达	5,249,835.89	4.61
119	600686	金龙汽车	5,158,036.08	4.53
120	600808	马钢股份	5,143,254.00	4.52
121	300323	华灿光电	5,109,937.00	4.49
122	600809	山西汾酒	5,103,020.72	4.48
123	002668	奥马电器	5,059,868.64	4.45

124	000639	西王食品	5,058,858.00	4.45
125	600392	盛和资源	4,968,728.50	4.37
126	002425	凯撒文化	4,965,414.20	4.36
127	600872	中炬高新	4,952,542.00	4.35
128	600213	亚星客车	4,946,223.04	4.35
129	600030	中信证券	4,876,075.00	4.28
130	601318	中国平安	4,867,195.00	4.28
131	600760	中航沈飞	4,821,281.48	4.24
132	002573	清新环境	4,816,394.00	4.23
133	600741	华域汽车	4,805,791.53	4.22
134	600848	上海临港	4,764,954.00	4.19
135	600132	重庆啤酒	4,754,150.00	4.18
136	601888	中国国旅	4,729,114.22	4.16
137	600231	凌钢股份	4,692,234.00	4.12
138	600183	生益科技	4,652,385.00	4.09
139	000513	丽珠集团	4,633,216.34	4.07
140	000933	神火股份	4,627,442.00	4.07
141	600449	宁夏建材	4,625,876.45	4.06
142	601908	京运通	4,509,273.00	3.96
143	601601	中国太保	4,470,951.00	3.93
144	002510	天汽模	4,439,726.58	3.90
145	600366	宁波韵升	4,428,346.24	3.89
146	002140	东华科技	4,371,503.51	3.84
147	601933	永辉超市	4,352,856.00	3.83
148	002475	立讯精密	4,350,021.16	3.82
149	600522	中天科技	4,302,012.00	3.78
150	002626	金达威	4,297,357.20	3.78
151	603899	晨光文具	4,229,904.54	3.72
152	603757	大元泵业	4,194,209.00	3.69
153	600207	安彩高科	4,187,308.00	3.68
154	603517	绝味食品	4,158,943.97	3.65
155	000050	深天马 A	4,158,698.00	3.65
156	603939	益丰药房	4,131,804.00	3.63
157	601225	陕西煤业	4,116,172.08	3.62
158	600761	安徽合力	4,066,241.00	3.57
159	002517	恺英网络	4,057,188.40	3.57
160	000069	华侨城 A	4,045,339.61	3.55
161	002035	华帝股份	4,041,413.44	3.55
162	002455	百川股份	4,037,349.00	3.55
163	002445	中南文化	4,006,290.00	3.52
164	002449	国星光电	3,983,616.93	3.50
165	002468	申通快递	3,973,732.00	3.49
166	601799	星宇股份	3,973,705.95	3.49
167	000525	红 太 阳	3,855,811.92	3.39

168	002185	华天科技	3,850,263.03	3.38
169	002673	西部证券	3,821,592.00	3.36
170	300224	正海磁材	3,785,915.98	3.33
171	300003	乐普医疗	3,769,438.00	3.31
172	600999	招商证券	3,767,293.00	3.31
173	300116	坚瑞沃能	3,751,324.00	3.30
174	002284	亚太股份	3,742,014.00	3.29
175	002686	亿利达	3,740,759.00	3.29
176	600276	恒瑞医药	3,728,372.00	3.28
177	002812	创新股份	3,712,728.05	3.26
178	000957	中通客车	3,649,711.00	3.21
179	300127	银河磁体	3,639,856.16	3.20
180	300285	国瓷材料	3,620,343.80	3.18
181	002521	齐峰新材	3,591,390.92	3.16
182	002273	水晶光电	3,563,941.00	3.13
183	300463	迈克生物	3,540,640.57	3.11
184	601919	中远海控	3,516,432.00	3.09
185	600668	尖峰集团	3,509,924.00	3.08
186	000488	晨鸣纸业	3,499,092.00	3.07
187	300244	迪安诊断	3,479,004.80	3.06
188	601111	中国国航	3,478,284.00	3.06
189	300144	宋城演艺	3,471,083.99	3.05
190	000100	TCL 集团	3,470,306.00	3.05
191	002221	东华能源	3,443,243.00	3.03
192	603801	志邦股份	3,442,147.36	3.02
193	300114	中航电测	3,435,433.44	3.02
194	000546	金圆股份	3,415,785.00	3.00
195	002120	韵达股份	3,387,286.00	2.98
196	000758	中色股份	3,386,662.00	2.98
197	000923	河北宣工	3,371,102.98	2.96
198	601336	新华保险	3,354,411.00	2.95
199	002205	国统股份	3,327,882.00	2.92
200	600900	长江电力	3,311,073.00	2.91
201	002080	中材科技	3,299,930.38	2.90
202	600114	东睦股份	3,299,930.00	2.90
203	600111	北方稀土	3,293,001.01	2.89
204	600039	四川路桥	3,275,318.00	2.88
205	300310	宜通世纪	3,270,096.76	2.87
206	600029	南方航空	3,268,228.00	2.87
207	600383	金地集团	3,263,215.00	2.87
208	002043	兔 宝 宝	3,240,345.47	2.85
209	600787	中储股份	3,226,742.00	2.84
210	002366	台海核电	3,220,055.00	2.83
211	603799	华友钴业	3,189,479.00	2.80

212	603868	飞科电器	3,178,851.40	2.79
213	002410	广联达	3,145,317.85	2.76
214	002636	金安国纪	3,142,623.00	2.76
215	600546	山煤国际	3,102,230.22	2.73
216	002384	东山精密	3,076,322.90	2.70
217	600516	方大炭素	3,075,963.00	2.70
218	300137	先河环保	3,069,472.00	2.70
219	002174	游族网络	3,063,396.00	2.69
220	600596	新安股份	3,035,440.81	2.67
221	600711	盛屯矿业	2,980,584.00	2.62
222	603816	顾家家居	2,979,525.00	2.62
223	300340	科恒股份	2,960,895.00	2.60
224	002099	海翔药业	2,952,986.03	2.59
225	000728	国元证券	2,941,719.00	2.59
226	600990	四创电子	2,901,567.69	2.55
227	002381	双箭股份	2,892,587.49	2.54
228	600125	铁龙物流	2,846,607.84	2.50
229	002538	司尔特	2,840,852.74	2.50
230	601899	紫金矿业	2,840,425.00	2.50
231	300136	信维通信	2,838,013.20	2.49
232	300069	金利华电	2,834,595.00	2.49
233	600521	华海药业	2,831,384.00	2.49
234	600436	片仔癀	2,823,506.02	2.48
235	600416	湘电股份	2,811,193.43	2.47
236	600729	重庆百货	2,804,194.00	2.46
237	002094	青岛金王	2,776,508.59	2.44
238	600562	国睿科技	2,758,700.76	2.42
239	000725	京东方 A	2,757,348.00	2.42
240	600425	*ST 青松	2,752,899.00	2.42
241	300335	迪森股份	2,724,392.00	2.39
242	300411	金盾股份	2,700,537.00	2.37
243	600547	山东黄金	2,696,973.00	2.37
244	300033	同花顺	2,680,384.00	2.36
245	000333	美的集团	2,660,813.20	2.34
246	601168	西部矿业	2,646,109.00	2.33
247	603612	索通发展	2,625,051.00	2.31
248	002262	恩华药业	2,622,689.00	2.30
249	600055	万东医疗	2,610,755.00	2.29
250	000538	云南白药	2,580,588.00	2.27
251	000776	广发证券	2,580,165.73	2.27
252	600056	中国医药	2,572,270.00	2.26
253	300383	光环新网	2,569,494.46	2.26
254	000826	启迪桑德	2,564,365.26	2.25
255	002447	晨鑫科技	2,519,670.71	2.21

256	601600	中国铝业	2,476,818.00	2.18
257	000848	承德露露	2,472,639.00	2.17
258	603533	掌阅科技	2,404,136.33	2.11
259	002067	景兴纸业	2,384,348.00	2.10
260	000898	鞍钢股份	2,372,190.20	2.08
261	600308	华泰股份	2,366,347.00	2.08
262	300031	宝通科技	2,324,760.00	2.04
263	300465	高伟达	2,304,855.91	2.03
264	601595	上海电影	2,294,541.00	2.02
265	002477	雏鹰农牧	2,289,890.00	2.01

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	600782	新钢股份	26,587,327.65	23.36
2	002460	赣锋锂业	21,366,328.24	18.78
3	002466	天齐锂业	20,713,184.12	18.20
4	002456	欧菲科技	20,168,862.76	17.72
5	000983	西山煤电	17,160,018.69	15.08
6	601688	华泰证券	16,713,190.99	14.69
7	600282	南钢股份	16,498,784.97	14.50
8	603737	三棵树	16,002,056.03	14.06
9	002635	安洁科技	15,989,295.98	14.05
10	000661	长春高新	15,294,335.22	13.44
11	002497	雅化集团	14,268,131.63	12.54
12	600958	东方证券	13,997,028.60	12.30
13	000823	超声电子	13,230,495.48	11.63
14	000717	韶钢松山	12,947,952.00	11.38
15	600885	宏发股份	12,863,083.22	11.30
16	600309	万华化学	12,736,604.98	11.19
17	601003	柳钢股份	12,639,398.16	11.11
18	600019	宝钢股份	12,545,297.88	11.02
19	600196	复星医药	12,424,903.56	10.92
20	600298	安琪酵母	12,311,965.48	10.82
21	002157	正邦科技	12,159,247.92	10.68
22	601377	兴业证券	12,091,257.60	10.63
23	000789	万年青	12,024,217.00	10.57
24	603883	老百姓	11,888,553.72	10.45

25	002050	三花智控	11,887,741.50	10.45
26	600801	华新水泥	11,629,864.61	10.22
27	600549	厦门钨业	11,480,297.00	10.09
28	600507	方大特钢	11,290,090.61	9.92
29	600585	海螺水泥	11,276,636.79	9.91
30	603589	口子窖	11,268,483.00	9.90
31	000591	太阳能	11,053,973.22	9.71
32	300271	华宇软件	11,010,938.59	9.68
33	603993	洛阳钼业	10,722,867.00	9.42
34	600884	杉杉股份	10,686,943.43	9.39
35	600110	诺德股份	10,593,315.76	9.31
36	002241	歌尔股份	10,354,643.00	9.10
37	002026	山东威达	10,232,335.30	8.99
38	300450	先导智能	10,076,996.00	8.86
39	600197	伊力特	10,023,537.26	8.81
40	000987	越秀金控	9,811,198.83	8.62
41	300196	长海股份	9,614,260.50	8.45
42	300433	蓝思科技	9,600,847.60	8.44
43	000988	华工科技	9,566,222.00	8.41
44	000568	泸州老窖	9,531,841.25	8.38
45	000830	鲁西化工	9,469,442.11	8.32
46	000002	万　科Ａ	9,334,282.49	8.20
47	300061	康旗股份	9,312,877.00	8.18
48	002074	国轩高科	9,111,504.00	8.01
49	600563	法拉电子	9,103,356.50	8.00
50	000063	中兴通讯	9,048,384.20	7.95
51	603203	快克股份	8,987,747.98	7.90
52	300458	全志科技	8,915,781.98	7.83
53	300007	汉威科技	8,882,196.17	7.81
54	002766	索菱股份	8,786,023.75	7.72
55	001979	招商蛇口	8,680,739.42	7.63
56	600426	华鲁恒升	8,618,293.30	7.57
57	600887	伊利股份	8,556,415.00	7.52
58	000858	五 粮 液	8,551,530.84	7.51
59	002240	威华股份	8,481,729.62	7.45
60	300408	三环集团	8,396,555.00	7.38
61	000970	中科三环	8,360,848.16	7.35
62	600997	开滦股份	8,356,388.00	7.34
63	000878	云南铜业	8,277,576.33	7.27
64	600006	东风汽车	8,274,609.00	7.27
65	300124	汇川技术	8,198,011.00	7.20
66	300274	阳光电源	8,127,836.62	7.14
67	300323	华灿光电	8,080,407.61	7.10
68	002425	凯撒文化	7,940,390.67	6.98

69	600703	三安光电	7,918,660.32	6.96
70	600291	西水股份	7,907,401.00	6.95
71	002368	太极股份	7,767,302.05	6.83
72	600487	亨通光电	7,745,392.01	6.81
73	002447	晨鑫科技	7,702,029.87	6.77
74	000963	华东医药	7,625,257.00	6.70
75	600486	扬农化工	7,518,567.16	6.61
76	002714	牧原股份	7,468,104.00	6.56
77	300411	金盾股份	7,427,830.11	6.53
78	600497	驰宏锌锗	7,416,185.10	6.52
79	300377	赢时胜	7,412,113.09	6.51
80	601607	上海医药	7,311,603.00	6.43
81	000739	普洛药业	7,284,409.18	6.40
82	600438	通威股份	7,257,857.00	6.38
83	000825	太钢不锈	7,233,549.00	6.36
84	000049	德赛电池	7,232,348.68	6.36
85	601636	旗滨集团	7,207,733.23	6.33
86	002236	大华股份	7,176,036.00	6.31
87	300115	长盈精密	7,125,512.00	6.26
88	601328	交通银行	7,113,506.00	6.25
89	600570	恒生电子	7,106,114.60	6.24
90	002468	申通快递	7,090,166.90	6.23
91	600966	博汇纸业	6,839,112.00	6.01
92	002668	奥马电器	6,800,967.80	5.98
93	000783	长江证券	6,791,252.00	5.97
94	000426	兴业矿业	6,728,392.93	5.91
95	600004	白云机场	6,584,008.17	5.79
96	000651	格力电器	6,543,010.00	5.75
97	603111	康尼机电	6,542,729.00	5.75
98	600259	广晟有色	6,486,452.27	5.70
99	600466	蓝光发展	6,470,983.59	5.69
100	600038	中直股份	6,405,658.40	5.63
101	600686	金龙汽车	6,359,662.29	5.59
102	000786	北新建材	6,223,274.00	5.47
103	300365	恒华科技	6,205,261.28	5.45
104	002120	韵达股份	6,173,263.43	5.42
105	603626	科森科技	6,009,214.70	5.28
106	600720	祁连山	5,976,849.28	5.25
107	600050	中国联通	5,960,918.00	5.24
108	002440	闰土股份	5,937,977.35	5.22
109	300203	聚光科技	5,846,783.00	5.14
110	601012	隆基股份	5,802,885.00	5.10
111	000932	*ST 华菱	5,709,186.00	5.02
112	600702	舍得酒业	5,610,131.85	4.93

113	002094	青岛金王	5,533,086.89	4.86
114	000807	云铝股份	5,440,865.48	4.78
115	600392	盛和资源	5,424,793.46	4.77
116	600809	山西汾酒	5,411,404.82	4.76
117	300198	纳川股份	5,376,178.51	4.72
118	600449	宁夏建材	5,367,175.21	4.72
119	603515	欧普照明	5,351,367.00	4.70
120	600808	马钢股份	5,345,858.00	4.70
121	000513	丽珠集团	5,224,906.91	4.59
122	600191	华资实业	5,202,053.00	4.57
123	600213	亚星客车	5,201,373.60	4.57
124	600848	上海临港	5,185,756.57	4.56
125	600741	华域汽车	5,169,992.84	4.54
126	002475	立讯精密	5,132,049.00	4.51
127	002024	苏宁易购	5,110,840.51	4.49
128	600760	中航沈飞	5,064,590.19	4.45
129	600516	方大炭素	5,041,881.80	4.43
130	300379	东方通	4,966,074.76	4.36
131	600584	长电科技	4,964,137.00	4.36
132	002626	金达威	4,957,575.23	4.36
133	601888	中国国旅	4,949,775.51	4.35
134	600872	中炬高新	4,936,416.70	4.34
135	300207	欣旺达	4,885,411.37	4.29
136	600335	国机汽车	4,856,565.75	4.27
137	002507	涪陵榨菜	4,708,056.00	4.14
138	000639	西王食品	4,706,936.39	4.14
139	600030	中信证券	4,697,508.97	4.13
140	300498	温氏股份	4,684,406.60	4.12
141	600231	凌钢股份	4,635,260.98	4.07
142	600183	生益科技	4,578,469.92	4.02
143	002573	清新环境	4,517,389.00	3.97
144	002140	东华科技	4,506,879.44	3.96
145	000933	神火股份	4,498,741.00	3.95
146	600132	重庆啤酒	4,395,622.83	3.86
147	000069	华侨城Ａ	4,394,967.22	3.86
148	601908	京运通	4,379,611.74	3.85
149	601933	永辉超市	4,367,553.25	3.84
150	000525	红 太 阳	4,293,359.00	3.77
151	002035	华帝股份	4,278,749.44	3.76
152	600761	安徽合力	4,269,144.32	3.75
153	600366	宁波韵升	4,266,839.53	3.75
154	600207	安彩高科	4,219,487.88	3.71
155	603757	大元泵业	4,218,900.96	3.71
156	600522	中天科技	4,198,000.00	3.69

157	002185	华天科技	4,193,496.40	3.69
158	603939	益丰药房	4,182,922.00	3.68
159	002712	思美传媒	4,059,220.58	3.57
160	000050	深天马 A	4,053,806.00	3.56
161	300116	坚瑞沃能	4,036,967.92	3.55
162	601225	陕西煤业	3,999,131.00	3.51
163	601919	中远海控	3,987,429.00	3.50
164	002445	中南文化	3,953,718.33	3.47
165	601601	中国太保	3,953,586.50	3.47
166	002510	天汽模	3,935,315.50	3.46
167	601799	星宇股份	3,875,062.90	3.41
168	002455	百川股份	3,852,540.00	3.39
169	603799	华友钴业	3,851,752.80	3.38
170	300224	正海磁材	3,829,420.12	3.37
171	000923	河北宣工	3,823,232.00	3.36
172	603517	绝味食品	3,800,896.42	3.34
173	002517	恺英网络	3,796,259.70	3.34
174	002686	亿利达	3,753,920.94	3.30
175	000100	TCL 集团	3,749,506.00	3.29
176	300003	乐普医疗	3,745,150.49	3.29
177	002673	西部证券	3,710,351.98	3.26
178	002449	国星光电	3,661,950.00	3.22
179	600276	恒瑞医药	3,615,766.83	3.18
180	002669	康达新材	3,605,494.74	3.17
181	002812	创新股份	3,603,581.49	3.17
182	600425	*ST 青松	3,601,558.79	3.16
183	300285	国瓷材料	3,585,635.15	3.15
184	300398	飞凯材料	3,547,125.56	3.12
185	002284	亚太股份	3,533,426.00	3.10
186	603612	索通发展	3,500,217.36	3.08
187	300127	银河磁体	3,464,082.22	3.04
188	600999	招商证券	3,446,472.00	3.03
189	002221	东华能源	3,441,997.23	3.02
190	300244	迪安诊断	3,426,217.20	3.01
191	600900	长江电力	3,398,866.00	2.99
192	002043	兔 宝 宝	3,397,057.55	2.99
193	000758	中色股份	3,387,038.00	2.98
194	603801	志邦股份	3,380,228.64	2.97
195	000488	晨鸣纸业	3,372,348.00	2.96
196	300144	宋城演艺	3,368,855.60	2.96
197	601336	新华保险	3,352,543.25	2.95
198	000937	冀中能源	3,351,733.00	2.95
199	600668	尖峰集团	3,350,201.00	2.94
200	002521	齐峰新材	3,348,889.38	2.94

201	600759	洲际油气	3,323,660.09	2.92
202	600787	中储股份	3,310,702.00	2.91
203	600114	东睦股份	3,309,119.62	2.91
204	002636	金安国纪	3,299,107.00	2.90
205	002205	国统股份	3,280,053.08	2.88
206	002273	水晶光电	3,263,216.00	2.87
207	603868	飞科电器	3,251,045.66	2.86
208	000957	中通客车	3,249,911.00	2.86
209	300465	高伟达	3,242,868.08	2.85
210	601111	中国国航	3,242,346.00	2.85
211	300114	中航电测	3,242,189.03	2.85
212	600039	四川路桥	3,239,273.86	2.85
213	002080	中材科技	3,220,507.45	2.83
214	002410	广联达	3,197,300.20	2.81
215	603816	顾家家居	3,197,047.50	2.81
216	600596	新安股份	3,177,330.71	2.79
217	600383	金地集团	3,177,216.85	2.79
218	600111	北方稀土	3,174,298.14	2.79
219	300353	东土科技	3,164,524.95	2.78
220	600029	南方航空	3,158,068.00	2.78
221	002366	台海核电	3,148,221.92	2.77
222	600546	山煤国际	3,130,435.33	2.75
223	000546	金圆股份	3,108,219.00	2.73
224	000725	京东方 A	3,084,048.00	2.71
225	000928	中钢国际	3,020,417.82	2.65
226	002174	游族网络	3,017,700.00	2.65
227	002677	浙江美大	2,985,345.76	2.62
228	600125	铁龙物流	2,968,167.12	2.61
229	300310	宜通世纪	2,963,143.67	2.60
230	002099	海翔药业	2,957,270.37	2.60
231	600990	四创电子	2,949,569.78	2.59
232	600711	盛屯矿业	2,923,836.00	2.57
233	600562	国睿科技	2,904,081.00	2.55
234	002384	东山精密	2,900,795.00	2.55
235	601899	紫金矿业	2,893,044.00	2.54
236	300231	银信科技	2,892,579.74	2.54
237	600521	华海药业	2,848,123.71	2.50
238	600436	片仔癀	2,842,280.00	2.50
239	300137	先河环保	2,821,849.00	2.48
240	000728	国元证券	2,819,531.50	2.48
241	600055	万东医疗	2,808,303.00	2.47
242	300033	同花顺	2,803,552.00	2.46
243	300340	科恒股份	2,797,228.00	2.46
244	600416	湘电股份	2,783,792.00	2.45

245	300136	信维通信	2,777,986.41	2.44
246	600729	重庆百货	2,738,491.00	2.41
247	600547	山东黄金	2,719,056.00	2.39
248	002381	双箭股份	2,706,683.72	2.38
249	300069	金利华电	2,651,625.00	2.33
250	300335	迪森股份	2,642,204.00	2.32
251	000538	云南白药	2,636,216.90	2.32
252	000333	美的集团	2,632,355.25	2.31
253	300383	光环新网	2,601,491.00	2.29
254	601168	西部矿业	2,596,789.00	2.28
255	002538	司尔特	2,593,718.66	2.28
256	000776	广发证券	2,589,708.00	2.28
257	002262	恩华药业	2,519,555.35	2.21
258	600056	中国医药	2,506,627.00	2.20
259	000848	承德露露	2,380,235.26	2.09
260	002477	雏鹰农牧	2,366,786.80	2.08
261	603186	华正新材	2,365,019.15	2.08
262	300236	上海新阳	2,348,924.60	2.06
263	002458	益生股份	2,343,505.92	2.06
264	600595	中孚实业	2,340,546.00	2.06
265	601600	中国铝业	2,332,437.52	2.05
266	000826	启迪桑德	2,328,987.56	2.05
267	600308	华泰股份	2,314,316.00	2.03
268	002067	景兴纸业	2,313,375.00	2.03
269	600835	上海机电	2,290,324.15	2.01

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	1,797,890,454.46
卖出股票的收入（成交）总额	1,802,017,077.97

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）	533,321.25	0.38
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	533,321.25	0.38

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	128013	洪涛转债	5,775	533,321.25	0.38

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

本基金本报告期未投资股指期货。

8.10.2 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

无。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期没有投资国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

无。

8.12 投资组合报告附注

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

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

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	167,568.11
2	应收证券清算款	5,687,981.54
3	应收股利	-
4	应收利息	4,402.65
5	应收申购款	179,383.50
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	6,039,335.80

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	533,321.25	0.38

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	600309	万华化学	7,219,982.00	5.16	重大事项停牌
2	002507	涪陵榨菜	5,884,320.00	4.21	重大事项停牌

§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
6,382	10,547.45	12,980.28	0.02%	67,300,862.23	99.98%

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	52,331.47	0.08%

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(2013 年 11 月 28 日)基金份额总额	952,701,097.47
本报告期期初基金份额总额	70,142,239.08
本报告期基金总申购份额	79,411,605.48
减：本报告期基金总赎回份额	82,240,002.05
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	67,313,842.51

注：总申购份额含转换入份额。总赎回份额含转换出份额。

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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 9 月 1 日，中国建设银行发布公告，聘任纪伟为中国建设银行资产托管业务部总经理。

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 50,000.00 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	
万联证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
联讯证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
广州证券	2	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
财富证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中山证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	696,646,175.83	19.36%	634,855.69	19.17%	-
天风证券	2	644,706,460.78	17.92%	588,768.91	17.78%	-
西南证券	1	426,744,848.63	11.86%	388,893.66	11.74%	-
华泰证券	1	418,501,992.78	11.63%	389,749.90	11.77%	-
招商证券	3	373,677,310.32	10.39%	348,005.00	10.51%	-
海通证券	1	300,720,960.05	8.36%	280,060.46	8.46%	-
广发证券	1	207,356,114.65	5.76%	193,110.67	5.83%	-

光大证券	1	121,026,068.95	3.36%	110,290.58	3.33%	-
华安证券	1	99,114,507.78	2.75%	92,306.33	2.79%	-
中金公司	1	79,918,299.59	2.22%	74,428.05	2.25%	-
兴业证券	1	70,641,731.24	1.96%	65,788.61	1.99%	-
国泰君安	1	41,621,201.76	1.16%	37,929.51	1.15%	-
上海证券	2	30,067,077.80	0.84%	27,400.18	0.83%	-
中信证券	1	28,426,063.92	0.79%	26,473.16	0.80%	-
东北证券	1	25,208,566.94	0.70%	23,476.21	0.71%	-
申万宏源	3	18,371,458.92	0.51%	16,741.98	0.51%	-
长江证券	2	14,977,480.79	0.42%	13,948.53	0.42%	-

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 11 月完成租用托管在建行的长江证券深圳 000510 交易单元。

华安基金管理有限公司

二〇一八年三月二十七日