华安新优选灵活配置混合型证券投资基金

2018 年半年度报告

2018 年 6 月 30 日

基金管理人：华安基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一八年八月二十四日

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 8 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录 2
1.1 重要提示 2
2 基金简介 5
2.1 基金基本情况 5
2.2 基金产品说明 5
2.3 基金管理人和基金托管人 5
2.4 信息披露方式 6
2.5 其他相关资料 6
3 主要财务指标和基金净值表现 6
3.1 主要会计数据和财务指标 6
3.2 基金净值表现 7
4 管理人报告 8
4.1 基金管理人及基金经理情况 8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 10
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 12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 13
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 13
5 托管人报告 13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 13
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 14
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 14
6 半年度财务会计报告（未经审计） 14
6.1 资产负债表 14
6.2 利润表 15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表 16
6.4 报表附注 17
7 投资组合报告 35
7.1 期末基金资产组合情况 35
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 36
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 38
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 39
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 40
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 40
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 40
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 40
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 40
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 41
7.12 投资组合报告附注 41
8 基金份额持有人信息 42
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 42

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 42
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 42
9 开放式基金份额变动 42
10 重大事件揭示 43
10.1 基金份额持有人大会决议 43
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 43
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 43
10.4 基金投资策略的改变 43
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 43
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 43
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 43
10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况 44
10.8 其他重大事件 45
11 备查文件目录 47
11.1 备查文件目录 47
11.2 存放地点 47
11.3 查阅方式 47

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华安新优选灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	华安新优选混合	
基金主代码	001312	
交易代码	001312	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015 年 5 月 29 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	47,288,650.64 份	
下属分级基金的基金简称	华安新优选 A	华安新优选 C
下属分级基金的交易代码	001312	002144
报告期末下属分级基金的份额总额	47,228,444.88 份	60,205.76 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险的前提下，通过大类资产的优化配置和高安全边际的证券精选，追求超越业绩比较基准的投资回报和资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金采取相对灵活的资产配置策略，通过将基金资产在权益类、固定收益类工具之间灵活配置，并适当借用金融衍生品的投资来追求基金资产的长期稳健增值。 在具体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。 在个股投资方面本基金将主要采用“自下而上”的个股选择方法，在拟配置的行业内部通过定量与定性相结合的分析方法选筛选个股。
业绩比较基准	中国人民银行公布的一年期定期存款利率（税后）+3%
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	中国银行股份有限公司
信息披露	姓名	钱鲲	王永民
	联系电话	021-38969999	010-66594896

负责人	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
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区世纪大道8号国金中心二期31－32层	北京西城区复兴门内大街1号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区世纪大道8号国金中心二期31－32层	北京西城区复兴门内大街1号
邮政编码		200120	100818
法定代表人		朱学华	陈四清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.huaan.com.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	华安基金管理有限公司	上海市世纪大道8号上海国金中心二期31、32 层

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	**报告期（2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日）**	
	华安新优选 A	华安新优选 C
本期已实现收益	-660,271.72	123.43
本期利润	-5,275,141.26	-5,695.73
加权平均基金份额本期利润	-0.1035	-0.1359
本期加权平均净值利润率	-10.18%	-13.26%
本期基金份额净值增长率	-10.86%	-10.29%
3.1.2 期末数据和指标	**报告期末(2018 年 6 月 30 日)**	
	华安新优选 A	华安新优选 C
期末可供分配利润	-3,818,309.56	-4,040.03

期末可供分配基金份额利润	-0.0808	-0.0671
期末基金资产净值	43,410,135.32	56,165.73
期末基金份额净值	0.919	0.933
3.1.3 累计期末指标	**报告期末(2018 年 6 月 30 日)**	
	华安新优选 A	华安新优选 C
基金份额累计净值增长率	-8.10%	-6.42%

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

华安新优选 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	-5.45%	1.77%	0.37%	0.01%	-5.82%	1.76%
过去三个月	-14.11%	1.38%	1.12%	0.01%	-15.23%	1.37%
过去六个月	-10.86%	1.19%	2.23%	0.01%	-13.09%	1.18%
过去一年	-11.04%	0.95%	4.50%	0.01%	-15.54%	0.94%
过去三年	-7.82%	0.56%	13.63%	0.01%	-21.45%	0.55%
自基金合同生效起至今	-8.10%	0.55%	14.10%	0.01%	-22.20%	0.54%

华安新优选 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	-5.47%	1.76%	0.37%	0.01%	-5.84%	1.75%
过去三个月	-14.01%	1.36%	1.12%	0.01%	-15.13%	1.35%
过去六个月	-10.29%	1.18%	2.23%	0.01%	-12.52%	1.17%
过去一年	-9.51%	0.94%	4.50%	0.01%	-14.01%	0.93%
自基金合同生效起至今	-6.42%	0.59%	11.77%	0.01%	-18.19%	0.58%

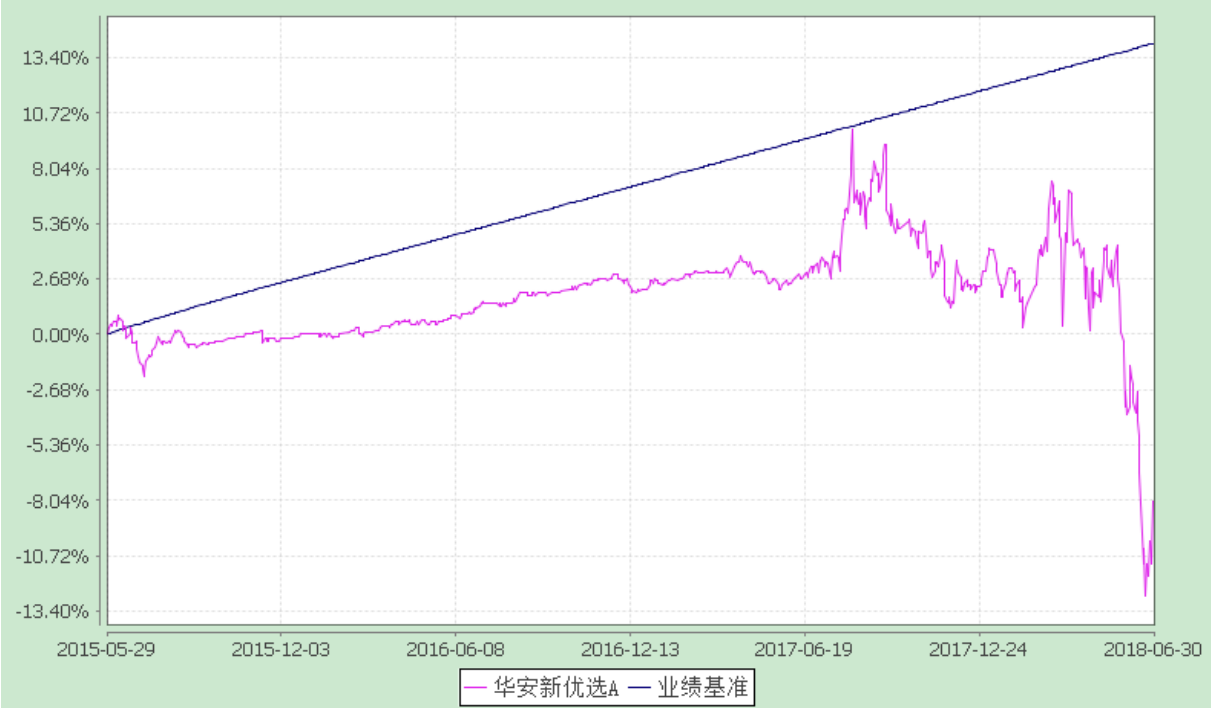
3.2.2 自基金合同生效以来 基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华安新优选灵活配置混合型证券投资基金

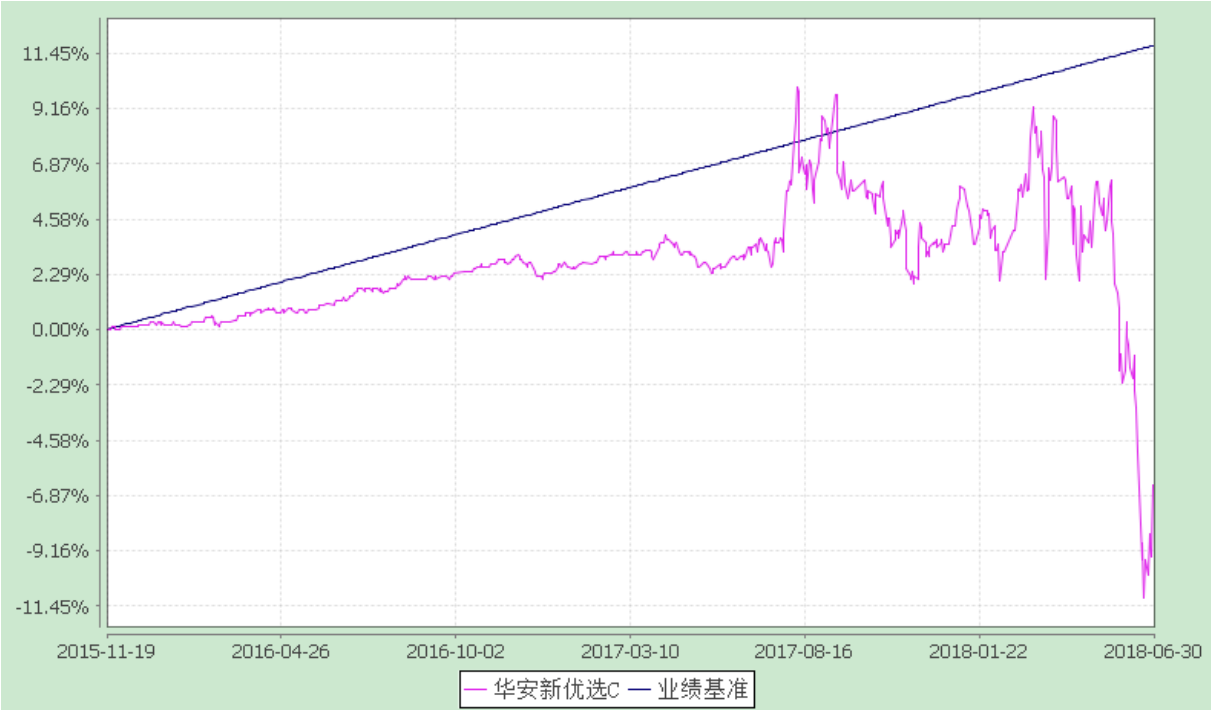
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2015 年 5 月 29 日至 2018 年 6 月 30 日）

华安新优选 A



华安新优选 C



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 2018 年 6 月 30 日，公司旗下共管理华安创新混合、华安 MSCI 中国 A、华安现金富利货币、华安稳定收益债券、华安黄金易 ETF、华安沪港深外延增长混合、华安全球美元收益债券等 103 只开放式基金，管理资产规模达到 2,460.80 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		
郑可成	本基金的基金经理，固定收益部助理总监	2015-05-29	-	16 年	硕士研究生，16 年证券基金从业经历。2001 年 7 月至 2004 年 12 月在闽发证券有限责任公司担任研究员，从事债券研究及投资，2005 年 1 月至 2005 年 9 月在福建儒林投资顾问有限公司任研究员，2005 年 10 月至 2009 年 7 月在益民基金管理有限公司任基金经理，2009 年 8 月至今任职于华安基金管理有限公司固定收益部。2010 年 12 月起担任华安稳固收益债券型证券投资基金的基金经理。2012 年 9 月起同时担任华安安心收益债券型证券投资基金的基金经理。2012 年 11 月至 2017 年 7 月同时担任华安日日鑫货币市场基金的基金经理。2012 年 12 月起同时担任华安信用增强债券型证券投资基金的基金经理。2013 年 5 月起同时担任华安保本混合型证券投资基金的基金经理。2014 年 8 月至 2015 年 1 月，同时担任华安七日鑫短期理财债券型证券投资基金的基金经理，2014 年 8 月起，同时担任华安年年红定期开放债券型证券投资基金的基金经理。2015 年 3 月起担任华安新动力灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2015 年 5 月起同时担任

					华安新机遇灵活配置混合型证券投资基金及本基金的基金经理。2015 年 6 月起同时担任华安添颐混合型发起式证券投资基金的基金经理。2015 年 11 月起，同时担任华安安益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2015 年 12 月至 2018 年 1 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 月至 2017 年 7 月，同时担任华安安康保本混合型证券投资基金的基金经理。2016 年 4 月至 2017 年 7 月，同时担任华安安禧保本混合型证券投资基金的基金经理。2016 年 10 月至 2018 年 1 月，同时担任华安安润灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 2 月起，同时担任华安安享灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 3 月起，同时担任华安现金宝货币市场基金的基金经理。

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 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了《华安基金管理有限公司公平交易管理制度》，将封闭式基金、开放式基金、特定客户资产管理组合及其他投资组合资产在研究分析、投资决策、交易执行等方面全部纳入公平交易管理中。控制措施包括：在研究环节，研究员在为公司管理的各类投资组合提供研究信息、投资建议过程中，使用晨会发言、邮件发送、登录在研究报告管理系统中等方式来确保各类投资组合经理可以公平享有信息获取机会。在投资环节，公司各投资组合经理根据投资组合的风格和投资策略，制定并严格执行交易决策规则，

以保证各投资组合交易决策的客观性和独立性。同时严格执行投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体授权机制，投资组合经理在授权范围内自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易环节，公司实行强制公平交易机制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。（1） 交易所二级市场业务，遵循价格优先、时间优先、比例分配、综合平衡的控制原则，实现同一时间下达指令的投资组合在交易时机上的公平性。（2） 交易所一级市场业务，投资组合经理按意愿独立进行业务申报，集中交易部以投资组合名义对外进行申报。若该业务以公司名义进行申报与中签，则按实际中签情况以价格优先、比例分配原则进行分配。若中签量过小无法合理进行比例分配，且以公司名义获得，则投资部门在合规监察员监督参与下，进行公平协商分配。（3） 银行间市场业务遵循指令时间优先原则，先到先询价的控制原则。通过内部共同的 iwind 群，发布询价需求和结果，做到信息公开。若是多个投资组合进行一级市场投标，则各投资组合经理须以各投资组合名义向集中交易部下达投资意向，交易员以此进行投标，以确保中签结果与投资组合投标意向一一对应。若中签量过小无法合理进行比例分配，且以公司名义获得，则投资部门在风险管理部投资监督参与下，进行公平协商分配。交易监控、分析与评估环节，公司风险管理部对公司旗下的各投资组合投资境内证券市场上市交易的投资品种、进行场外的非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购、不同投资组合同日和临近交易日的反向交易以及可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控，根据市场公认的第三方信息（如：中债登的债券估值），定期对各投资组合与交易对手之间议价交易的交易价格公允性进行审查，对不同投资组合临近交易日的同向交易的交易时机和交易价差进行分析。

本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

本基金管理人通过统计检验的方法对管理的不同投资组合，在不同时间窗下（日内、3 日内、5 日内）的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。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司合规监察稽核部会同基金投资、交易部门讨论制定了公募基金、专户针对股票、债券、回购等投资品种在交易所及银行间的同日反向交易控制规则，并在投资系统中进行了设置，实现了完全的系统控制。同时加强了对基金、专户间的同日反向交易的监控与隔日反向交易的检查；风险管理部开发了同向交易分析系统，对相关同向交易指标进行持续监控，并定期对组合间的同向交易行为进行了重点分析。

本报告期内，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

3 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

2018 年上半年全球宏观经济出现一些分化。美国经济进一步走强，失业率下降，通胀缓步抬升；欧洲表现则相对偏弱。我国宏观经济体现出一定的韧性，但面临向下的风险。首先，社会融资渠道出现堵塞，非标融资受到金融监管的影响大幅下滑，委托贷款和信托贷款出现负增长；其次，债券违约向上市公司扩散，部分公司股权质押触及平仓线，地方政府平台融资受限，导致基建投资出现断崖式下滑；再有，中美贸易战为中国未来添加下行风险。面对风险，货币政策在一季度开始边际上的宽松，监管政策也较以前有所放松，导致债券收益率在今年上半年出现快速下行。权益市场受到信用收缩和贸易战影响，风险偏好显著降低，在指数整体下跌过程中，中小市值个股受损更为严重，消费类股票显现出明显防御性。

本基金在由于规模较小，在债券市场的参与力度较小，在权益市场保持较高的仓位，并产生了较大的波动。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2018 年 06 月 30 日，华安新优选混合 A 份额净值为 0.919 元，C 份额净值为 0.933 元；华安新优选混合 A 份额净值增长率为-10.86%， C 份额净值增长率为-10.29%，同期 A 级业绩比较基准增长率为 2.23%，同期 C 级业绩比较基准增长率为 2.23%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2018 年下半年。宏观经济短期韧性仍在，但金融去杠杆导致投资增速预期下行和中美贸易战导致出口预期下行这两个因素叠加下，后续经济存在下行压力，对应上市公司整体业绩增速 2 季度或继续上行，但 3 季度往后面临回落风险。中美贸易战加剧的背景下，国内政策转向为适度扩大内需，货币政策和监管政策已经转松，财政政策预计未来会有新的稳增长举措。在宽货币和稳信用的结合下，无风险利率或将进入区间震荡。目前解决小微企业融资难、融资贵的问题已经得到中央的重视，预计信用违约风险将得到缓和，信用利差有进一步压缩的空间。下半年权益面临的系统性风险将会大幅减轻，3 季度存在修复性反弹机会。虽然中美贸易战带来的经济下行压力和美联储持续加息带来的利率上行压力是两大灰犀牛，对权益市场会形成长期压制，但短期股市已过分担忧。我们认为决定短期股市方向的最核心因素仍是国内货币政策的取向，底线思维告诉我们大概率不会出现处置风险的风险，国内政策有足够的微调空间以确保市场平稳。

本基金将在下半年仍然以中低久期信用债为主要配置品种，在控制信用风险的前提下适当配置一些中高收益的券种以增强静态收益水平。对于长久期利率债，保持波段操作态度。权益方面会择机加仓参与市场反弹以增厚基金业绩。

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

本基金报告期内基金持有人数不低于 200 人；基金资产净值连续超过 20 个工作日低于 5000 万元。

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”）在对新优选灵活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 托管人对本半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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华安新优选灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	6,966,854.45	4,636,498.02
结算备付金		47,539.64	272,094.99
存出保证金		21,602.74	77,464.64
交易性金融资产	6.4.7.2	36,533,358.08	34,492,142.00
其中：股票投资		31,518,358.08	11,033,842.00
基金投资		-	-
债券投资		5,015,000.00	23,458,300.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	20,000,150.00
应收证券清算款		-	3,004,837.81
应收利息	6.4.7.5	88,060.29	568,373.71
应收股利		-	-
应收申购款		3,560.66	982.29
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		43,660,975.86	63,052,543.46

负债和所有者权益	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
负债：		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		11,285.49	53,832.95
应付管理人报酬	6.4.10.2	25,494.48	37,782.24
应付托管费	6.4.10.2	9,105.16	13,493.61
应付销售服务费		4.53	1.08
应付交易费用	6.4.7.7	59,508.32	20,982.58
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	89,276.83	360,160.67
负债合计		194,674.81	486,253.13
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.9	47,288,650.64	60,677,889.68
未分配利润	6.4.7.10	-3,822,349.59	1,888,400.65
所有者权益合计		43,466,301.05	62,566,290.33
负债和所有者权益总计		43,660,975.86	63,052,543.46

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.919 元，基金份额总额 47,288,650.64 份。其中 A 类基金份额净值 0.919 元，基金份额总额 47,228,444.88 份；C 类基金份额净值 0.933 元，基金份额总额 60,205.76 份。

6.2 利润表

会计主体：华安新优选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
一、收入		**-4,810,576.00**	**11,012,774.91**
1.利息收入		460,749.87	8,562,155.10
其中：存款利息收入	6.4.7.11	23,461.95	152,652.09
债券利息收入		390,045.30	5,588,725.75
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		47,242.62	2,820,777.26

其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-654,054.90	4,688,728.77
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-1,329,646.69	4,245,431.32
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	491,071.57	55,600.02
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	184,520.22	387,697.43
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-4,620,688.70	-2,316,467.76
4.汇兑收益（损失以“一”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	3,417.73	78,358.80
减：二、费用		**470,260.99**	**3,568,290.84**
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	180,029.26	2,063,694.49
2．托管费	6.4.10.2.2	64,296.19	737,033.70
3．销售服务费		21.69	154,871.89
4．交易费用	6.4.7.18	85,486.30	369,434.61
5．利息支出		28,633.68	11,585.10
其中：卖出回购金融资产支出		28,633.68	11,585.10
6.税金及附加		18.83	-
7．其他费用	6.4.7.19	111,775.04	231,671.05
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		**-5,280,836.99**	**7,444,484.07**
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		**-5,280,836.99**	**7,444,484.07**

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安新优选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	60,677,889.68	1,888,400.65	62,566,290.33
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-5,280,836.99	-5,280,836.99
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）	-13,389,239.04	-429,913.25	-13,819,152.29

其中：1.基金申购款	850,698.36	1,137.69	851,836.05
2.基金赎回款	-14,239,937.40	-431,050.94	-14,670,988.34
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）	47,288,650.64	-3,822,349.59	43,466,301.05
项目	**上年度可比期间** 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		
	实收基金	**未分配利润**	**所有者权益合计**
一、期初所有者权益（基金净值）	928,661,436.77	19,728,348.16	948,389,784.93
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	7,444,484.07	7,444,484.07
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）	-563,848,187.89	-15,243,922.92	-579,092,110.81
其中：1.基金申购款	108,830,886.22	2,680,581.37	111,511,467.59
2.基金赎回款	-672,679,074.11	-17,924,504.29	-690,603,578.40
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）	364,813,248.88	11,928,909.31	376,742,158.19

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：朱学华，主管会计工作负责人：赵敏，会计机构负责人：陈林

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华安新优选灵活配置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]806 号《关于准予华安新优选灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》的核准，由华安基金管理有限公司作为管理人自 2015 年 5 月 13 日至 2015 年 5 月 26 日止期间向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具安永华明（2015）验字第 60971571_B20 号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于

2015 年 5 月 29 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 688,772,738.44 元，在募集期间产生的存款利息为人民币 122,225.81 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 688,894,964.25 元，折合 688,894,964.25 份基金份额。本基金的基金管理人及注册登记机构为华安基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。本基金自 2015 年 11 月 18 日起增加 C 类基金份额，本基金原基金份额转为 A 类基金份额。对于 A 类基金份额，投资者申购时需缴纳申购费；对于 C 类基金份额，投资者申购时无需缴纳申购费，而从 C 类基金资产中收取销售服务费。

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）、权证、股指期货等权益类金融工具，债券等固定收益类金融工具（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、中小企业私募债、地方政府债券、中期票据、可转换债券（含分离交易可转债）、短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款等）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。

基金的投资组合比例为：股票占基金资产的比例为 0-95%；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%；权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。 本基金业绩比较基准：中国人民银行公布的一年期定期存款利率（税后）+3%。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2018 年 06 月 30 日的财务状况以及 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 06 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1会计政策变更的说明

本会计期间不存在会计政策变更。

6.4.5.2会计估计变更的说明

本会计期间不存在会计估计变更。

6.4.5.3差错更正的说明

本会计期间不存在差错更正。

6.4.6 税项

6.4.6.1 印花税

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

6.4.6.2 营业税、增值税

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，继续免征营业税；

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，质押式买入返售金融商品及持有政策性金融债券的利息收入免征增值税；

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，买断式买入返售金融商品、同业存单以及持有金融债券的利息收入免征增值税。

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

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

6.4.6.3 企业所得税

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

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

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

入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

6.4.6.4 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定，对基金取得的股票的股息、红利收入，债券的利息收入、储蓄存款利息收入，由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴 20%的个人所得税；

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；

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

6.4.7重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
活期存款	6,966,854.45
定期存款	-
其他存款	-
合计	6,966,854.45

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2018 年 6 月 30 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		36,337,512.89	31,518,358.08	-4,819,154.81
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	4,994,655.00	5,015,000.00	20,345.00
	合计	4,994,655.00	5,015,000.00	20,345.00
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		41,332,167.89	36,533,358.08	-4,798,809.81

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

无。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	1,262.44
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	19.26
应收债券利息	86,769.86
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	8.73
合计	88,060.29

6.4.7.6 其他资产

无余额。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	58,842.17
银行间市场应付交易费用	666.15
合计	59,508.32

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	16.68
预提账户维护费	-
预提审计费	24,795.19
预提信息披露费	64,464.96
合计	89,276.83

6.4.7.9 实收基金

华安新优选 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	60,672,769.18	60,672,769.18
本期申购	771,730.37	771,730.37
本期赎回（以“-”号填列）	-14,216,054.67	-14,216,054.67
本期末	47,228,444.88	47,228,444.88

华安新优选 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	5,120.50	5,120.50

本期申购	78,967.99	78,967.99
本期赎回（以“-”号填列）	-23,882.73	-23,882.73
本期末	60,205.76	60,205.76

6.4.7.10 未分配利润

华安新优选 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	4,101,121.87	-2,212,927.72	1,888,194.15
本期利润	-660,271.72	-4,614,869.54	-5,275,141.26
本期基金份额交易产生的变动数	-785,096.92	353,734.47	-431,362.45
其中：基金申购款	43,557.26	-45,082.58	-1,525.32
基金赎回款	-828,654.18	398,817.05	-429,837.13
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,655,753.23	-6,474,062.79	-3,818,309.56

华安新优选 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	393.64	-187.14	206.50
本期利润	123.43	-5,819.16	-5,695.73
本期基金份额交易产生的变动数	3,794.81	-2,345.61	1,449.20
其中：基金申购款	5,540.01	-2,877.00	2,663.01
基金赎回款	-1,745.20	531.39	-1,213.81
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,311.88	-8,351.91	-4,040.03

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	22,050.44
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	1,192.17
其他	219.34
合计	23,461.95

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	19,116,103.90
减：卖出股票成本总额	20,445,750.59
买卖股票差价收入	-1,329,646.69

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	53,885,585.13
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	52,465,610.00
减：应收利息总额	928,903.56
买卖债券差价收入	491,071.57

6.4.7.14 衍生工具收益

无。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
股票投资产生的股利收益	184,520.22
基金投资产生的股利收益	-
合计	184,520.22

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
1.交易性金融资产	-4,620,688.70
——股票投资	-4,067,113.70
——债券投资	-553,575.00
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-

——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-4,620,688.70

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
基金赎回费收入	3,417.55
转换费收入	0.18
合计	3,417.73

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	83,648.80
银行间市场交易费用	1,837.50
合计	85,486.30

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
审计费用	24,795.19
信息披露费	64,464.96
银行汇划费用	3,914.89
帐户维护费	18,000.00
其他费用	600.00
合计	111,775.04

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华安基金管理有限公司(“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、基金代销机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	180,029.26	2,063,694.49
其中：支付销售机构的客户维护费	143,481.91	270,045.44

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6

	30日	月30日
当期发生的基金应支付的托管费	64,296.19	737,033.70

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华安新优选 A	华安新优选 C	合计
华安基金管理有限公司	-	2.95	2.95
中国银行	-	-	-
合计	-	2.95	2.95
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华安新优选A	华安新优选C	合计
华安基金	-	154,871.89	154,871.89
中国银行	-	-	-
合计	-	154,871.89	154,871.89

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2018年1月1日至2018年6月30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
中国银行	-	5,018,180.68	-	-	-	-
上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30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
-	-	-	-	-	-	-

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	6,966,854.45	22,050.44	11,667,303.55	142,701.74

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

6.4.10.7.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期未进行利润分配。

6.4.12 期末（2018 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 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
300072	三聚环保	2018-06-18	重大事项	22.38	2018-07-10	24.00	46,000	1,508,323.18	1,029,480.00	-
30019	铁汉生	2018-05	重大资	5.37	-	-	69,000	478,015.18	370,530.00	-

7	态	-28	产重组							

6.4.12.2 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.2.1 银行间市场债券正回购

本报告期末本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.2.2 交易所市场债券正回购

本报告期末本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金为混合型基金，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等风险和中等收益投资品种。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报和资产的长期稳健增值。

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部等相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立合规与风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理和投资风险管理、绩效评估等。监察稽核部和风险管理部对公司督察长负责。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具，通过特定的风险量化指标、模型，形成常规的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持证券均在证券交易所上市，因此除附注中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性

金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2018 年 6 月 30 日	**1 年以内**	**1-5 年**	**5 年以上**	**不计息**	**合计**
资产					
银行存款	6,966,854.45	-	-	-	6,966,854.45
结算备付金	47,539.64	-	-	-	47,539.64
存出保证金	21,602.74	-	-	-	21,602.74
交易性金融资产	5,015,000.00	-	-	31,518,358.08	36,533,358.08
应收利息	-	-	-	88,060.29	88,060.29
应收申购款	-	-	-	3,560.66	3,560.66
资产总计	12,050,996.83	-	-	31,609,979.03	43,660,975.86
负债					
应付赎回款	-	-	-	11,285.49	11,285.49
应付管理人报酬	-	-	-	25,494.48	25,494.48
应付托管费	-	-	-	9,105.16	9,105.16
应付销售服务费	-	-	-	4.53	4.53
应付交易费用	-	-	-	59,508.32	59,508.32
其他负债	-	-	-	89,276.83	89,276.83
负债总计	-	-	-	194,674.81	194,674.81
利率敏感度缺口	12,050,996.83	-	-	31,415,304.22	43,466,301.05
上年度末 2017 年 12 月 31 日	**1 年以内**	**1-5 年**	**5 年以上**	**不计息**	**合计**
资产					
银行存款	4,636,498.02	-	-	-	4,636,498.02
结算备付金	272,094.99	-	-	-	272,094.99
存出保证金	77,464.64	-	-	-	77,464.64
交易性金融资产	19,960,000.00	3,498,300.00	-	11,033,842.00	34,492,142.00
买入返售金融资	20,000,150.00	-	-	-	20,000,150.00

产					
应收证券清算款	-	-	-	3,004,837.81	-
应收利息	-	-	-	568,373.71	568,373.71
应收申购款	-	-	-	982.29	982.29
资产总计	44,946,207.65	3,498,300.00	-	14,608,035.81	63,052,543.46
负债					
应付赎回款	-	-	-	53,832.95	53,832.95
应付管理人报酬	-	-	-	37,782.24	37,782.24
应付托管费	-	-	-	13,493.61	13,493.61
应付销售服务费	-	-	-	1.08	1.08
应付交易费用	-	-	-	20,982.58	20,982.58
其他负债	-	-	-	360,160.67	360,160.67
负债总计	-	-	-	486,253.13	486,253.13
利率敏感度缺口	44,946,207.65	3,498,300.00	-	14,121,782.68	62,566,290.33

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
	市场利率下降 25 个基点	增加约 1	增加约 1
	市场利率上升 25 个基点	减少约 1	减少约 1

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金采取相对稳定的资产配置策略，一般情况下将保持股票配置比例的相对稳定，避免因过于主动的仓位调整带来额外的风险。在大类资产配置过程中，本基金将使用定量与定性相结合的研

究方法对宏观经济、国家政策、资金面和市场情绪等可能影响证券市场的重要因素进行研究和预测，结合使用公司自主研发的多因子动态资产配置模型、基于投资时钟理论的资产配置模型等经济模型，分析和比较股票、债券等市场和不同金融工具的风险收益特征，确定合适的资产配置比例，动态优化投资组合。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金股票投资占基金资产的比例范围为0%-95%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日		上年度末 2017 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产－股票投资	31,518,358.08	72.51	11,033,842.00	17.64
交易性金融资产－基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产－债券投资	5,015,000.00	11.54	-	-
交易性金融资产－贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产－权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	36,533,358.08	84.05	11,033,842.00	17.64

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元）

		本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
	业绩比较基准增加 5%	-	增加约 195
	业绩比较基准减少 5%	-	减少约 195

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.14.1 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。

6.4.14.2 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。

6.4.14.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2018 年 8 月 23 日经本基金的基金管理人批准。

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	31,518,358.08	72.19
	其中：股票	31,518,358.08	72.19
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	5,015,000.00	11.49
	其中：债券	5,015,000.00	11.49
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-

7	银行存款和结算备付金合计	7,014,394.09	16.07
8	其他各项资产	113,223.69	0.26
9	合计	43,660,975.86	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	15,921,098.24	36.63
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	687,654.00	1.58
F	批发和零售业	349,048.00	0.80
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,640,942.84	22.18
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	890,652.00	2.05
N	水利、环境和公共设施管理业	2,185,835.00	5.03
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	1,843,128.00	4.24
S	综合	-	-
	合计	31,518,358.08	72.51

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净

					值比例(%)
1	300059	东方财富	152,280	2,007,050.40	4.62
2	300017	网宿科技	182,800	1,957,788.00	4.50
3	300070	碧水源	133,100	1,854,083.00	4.27
4	300124	汇川技术	55,200	1,811,664.00	4.17
5	000988	华工科技	100,000	1,445,000.00	3.32
6	300408	三环集团	55,200	1,297,200.00	2.98
7	300618	寒锐钴业	9,240	1,185,861.60	2.73
8	300136	信维通信	36,800	1,130,864.00	2.60
9	300024	机器人	64,400	1,120,560.00	2.58
10	300072	三聚环保	46,000	1,029,480.00	2.37
11	300676	华大基因	9,200	890,652.00	2.05
12	300144	宋城演艺	36,800	864,800.00	1.99
13	300168	万达信息	36,800	750,720.00	1.73
14	000066	中国长城	100,000	711,000.00	1.64
15	300253	卫宁健康	52,200	646,758.00	1.49
16	300170	汉得信息	36,800	597,632.00	1.37
17	300088	长信科技	101,200	586,960.00	1.35
18	300433	蓝思科技	27,600	579,048.00	1.33
19	300450	先导智能	18,371	555,539.04	1.28
20	300418	昆仑万维	27,600	521,088.00	1.20
21	300027	华谊兄弟	82,800	510,048.00	1.17
22	300315	掌趣科技	119,600	499,928.00	1.15
23	300014	亿纬锂能	27,600	485,760.00	1.12
24	300251	光线传媒	46,000	468,280.00	1.08
25	300699	光威复材	9,200	415,840.00	0.96
26	300274	阳光电源	46,000	412,620.00	0.95
27	300287	飞利信	55,200	396,888.00	0.91
28	300377	赢时胜	27,300	371,007.00	0.85
29	300197	铁汉生态	69,000	370,530.00	0.85
30	300115	长盈精密	27,600	357,972.00	0.82
31	300033	同花顺	9,200	357,604.00	0.82
32	300413	快乐购	9,200	349,048.00	0.80
33	300222	科大智能	18,400	341,136.00	0.78
34	300355	蒙草生态	55,200	331,752.00	0.76
35	300207	欣旺达	36,800	331,568.00	0.76
36	300098	高新兴	41,328	329,797.44	0.76
37	300113	顺网科技	18,400	320,344.00	0.74
38	300053	欧比特	27,600	320,160.00	0.74
39	300055	万邦达	27,600	317,124.00	0.73
40	300073	当升科技	9,200	313,352.00	0.72
41	300077	国民技术	27,600	306,912.00	0.71
42	300496	中科创达	9,200	271,124.00	0.62

43	300078	思创医惠	27,600	261,648.00	0.60
44	300459	金科文化	26,100	252,126.00	0.58
45	300085	银之杰	18,400	238,832.00	0.55
46	300075	数字政通	17,400	234,726.00	0.54
47	300037	新宙邦	8,700	233,073.00	0.54
48	300083	劲胜智能	46,000	221,720.00	0.51
49	300134	大富科技	18,400	164,496.00	0.38
50	300431	暴风集团	9,200	139,656.00	0.32
51	300316	晶盛机电	2,340	31,098.60	0.07
52	601138	工业富联	1,000	18,440.00	0.04

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占**期初**基金资产净值比例（%）
1	600115	东方航空	2,610,000.00	4.17
2	601111	中国国航	2,590,000.00	4.14
3	300017	网宿科技	2,353,119.00	3.76
4	300070	碧水源	2,277,305.00	3.64
5	000671	阳 光 城	2,259,952.00	3.61
6	300618	寒锐钴业	2,120,782.00	3.39
7	300059	东方财富	1,819,400.00	2.91
8	600029	南方航空	1,770,000.00	2.83
9	300124	汇川技术	1,698,985.00	2.72
10	300072	三聚环保	1,524,718.00	2.44
11	300676	华大基因	1,462,651.32	2.34
12	300136	信维通信	1,408,354.00	2.25
13	300408	三环集团	1,235,334.00	1.97
14	300024	机器人	1,206,332.00	1.93
15	000066	中国长城	887,540.00	1.42
16	300315	掌趣科技	841,692.00	1.35
17	300027	华谊兄弟	826,823.00	1.32
18	300274	阳光电源	826,566.00	1.32
19	300088	长信科技	723,929.00	1.16
20	300144	宋城演艺	722,910.00	1.16

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占**期初**基金资产净值比例

				（%）
1	601225	陕西煤业	2,505,012.02	4.00
2	000671	阳 光 城	2,410,104.00	3.85
3	600115	东方航空	2,388,000.00	3.82
4	600449	宁夏建材	2,382,323.88	3.81
5	601111	中国国航	2,230,000.00	3.56
6	600309	万华化学	1,708,000.00	2.73
7	601600	中国铝业	1,639,983.00	2.62
8	600029	南方航空	1,587,000.00	2.54
9	000807	云铝股份	1,346,834.00	2.15
10	300618	寒锐钴业	358,352.00	0.57
11	300055	万邦达	145,358.00	0.23
12	300216	千山药机	83,930.00	0.13
13	300355	蒙草生态	61,938.00	0.10
14	300315	掌趣科技	58,100.00	0.09
15	300124	汇川技术	19,560.00	0.03
16	300676	华大基因	14,770.00	0.02
17	300408	三环集团	14,483.00	0.02
18	300072	三聚环保	13,965.00	0.02
19	300024	机器人	13,731.00	0.02
20	300136	信维通信	12,700.00	0.02

7.4.3 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	44,997,380.37
卖出股票的收入（成交）总额	19,116,103.90

注：1、本项“买入股票的成本（成交）总额”和“卖出股票的收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	5,015,000.00	11.54
	其中：政策性金融债	5,015,000.00	11.54

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）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	5,015,000.00	11.54

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	180201	18 国开 01	50,000	5,015,000.00	11.54

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证投资。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期未投资股指期货。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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同，本基金不能投资于国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

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

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	21,602.74
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	88,060.29
5	应收申购款	3,560.66
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	113,223.69

7.12.4 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。

7.12.5 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	300072	三聚环保	1,029,480.00	2.37	重大事项

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	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
华安新优选 A	1,453	32,504.09	4,456,863.04	9.44%	42,771,581.84	90.56%
华安新优选 C	15	4,013.72	0.00	0.00%	60,205.76	100.00%
合计	1,468	32,212.98	4,456,863.04	9.42%	42,831,787.60	90.58%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	华安新优选 A	-	-
	华安新优选 C	1.61	0.00%
	合计	1.61	0.00%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间为 0。

本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 0。

9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华安新优选 A	华安新优选 C
基金合同生效日（2015 年 5 月 29	688,894,964.25	-

日）基金份额总额		
本报告期期初基金份额总额	60,672,769.18	5,120.50
本报告期基金总申购份额	771,730.37	78,967.99
减：本报告期基金总赎回份额	14,216,054.67	23,882.73
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	47,228,444.88	60,205.76

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本报告期内本基金管理人重大人事变动如下：

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：

无。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内无基金投资策略的改变。

10.5 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。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内无管理人、托管人及其高级管理人员受证券监管部门稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国信证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	40,429,443.37	63.07%	36,843.35	62.61%	-
西南证券	1	15,680,012.02	24.46%	14,602.88	24.82%	-
中泰证券	1	5,730,306.88	8.94%	5,336.42	9.07%	-
长江证券	1	2,259,952.00	3.53%	2,059.52	3.50%	-

注：1、券商专用交易单元选择标准：

基金管理人负责选择证券经营机构，选用其交易单元供本基金证券买卖专用，选择标准为：

（1）内部管理规范、严谨；具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；

（2）研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能够针对本基金业务需要，提供高质量的研究报告和较为全面的服务；

（3）具有战略规划和定位，能够积极推动多边业务合作，最大限度地调动整体资源，为基金投资赢取机会；

（4）其他有利于基金持有人利益的商业合作考虑。

2、券商专用交易单元选择程序：

(1) 对交易单元候选券商的综合服务进行评估

由相关部门牵头并组织有关人员依据上述交易单元选择标准和《券商服务评价办法》，对候选交易单元的券商服务质量和综合实力进行评估。

(2) 填写《新增交易单元申请审核表》

牵头部门汇总对各候选交易单元券商的综合评估结果，择优选出拟新增单元，填写《新增交易单元申请审核表》，对拟新增交易单元的必要性和合规性进行阐述。

(3) 候选交易单元名单提交分管领导审批

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

(4)协议签署及通知托管人

基金管理人与被选择的券商签订《证券交易单元租用协议》，并通知基金托管人。

3、报告期内基金租用券商交易单元的变更情况：

无

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国信证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-

西南证券	-	-	50,000,000.00	86.21%	-	-
中泰证券	3,361,660.20	100.00%	8,000,000.00	13.79%	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华安基金管理有限公司关于旗下产品实施增值税政策的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2018-01-03
2	关于旗下部分基金增加大河财富为销售机构并参加费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2018-01-09
3	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“中弘股份“、“万华化学”股票估值调整的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2018-01-11
4	关于旗下部分基金增加电盈基金为销售机构并参加费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2018-01-16
5	华安基金关于参加大泰金石优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2018-01-18
6	关于旗下部分基金增加国金证券为销售机构并参加费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2018-01-20
7	华安基金关于参加北京展恒优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2018-01-27
8	关于旗下部分基金参加华信证券费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2018-02-08
9	华安基金管理有限公司关于副总经理变更的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2018-02-13
10	关于旗下部分基金增加众禄为销售机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2018-03-08
11	关于基金电子交易平台延长工行直联结算方式费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公	2018-03-14

		司网站	
12	关于电子直销平台开展“微钱宝”账户交易费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2018-03-21
13	关于旗下公开募集证券投资基金根据流动性风险管理规定修改基金合同的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2018-03-24
14	华安新优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同修改前后对照表	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2018-03-24
15	华安基金管理有限公司关于旗下基金参加东海证券费率优惠的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2018-03-27
16	关于旗下部分基金增加蚂蚁财富为销售机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2018-04-10
17	华安基金关于参加中国银行优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2018-04-11
18	华安基金关于参加华安证券优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2018-04-12
19	华安基金管理有限公司关于暂停上海华信证券有限责任公司销售旗下基金业务公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2018-04-13
20	关于旗下部分基金增加鑫鼎盛为销售机构并参加费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2018-04-14
21	关于旗下部分基金增加唐鼎耀华为销售机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2018-04-20
22	关于旗下部分基金增加钜派为销售机构并参加费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2018-05-18
23	关于基金电子交易平台汇付天天盈渠道关闭基金支付服务的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2018-06-11
24	关于华安暂停与苏州财路开展基金销售合作业务的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2018-06-13
25	关于基金电子交易平台延长工行直联结算方式费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2018-06-15
26	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的	《上海证券报》、《证券时	2018-06-25

	“德豪润达”、“三聚环保”股票估值调整的公告	报》、《中国证券报》和公司网站	
27	关于旗下部分基金增加嘉实财富为销售机构并参加费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2018-06-26
28	关于电子直销平台延长“微钱宝”账户交易费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2018-06-27
29	关于基金电子交易平台调整微钱宝快速取现服务限额的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2018-06-27

11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

1、《华安新优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》

2、《华安新优选灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》

3、《华安新优选灵活配置混合型证券投资基金托管协议》

4、中国证监会批准华安新优选灵活配置混合型证券投资基金设立的文件；

5、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告原件；

6、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；

7、基金托管人业务资格批件和营业执照；

8、华安基金管理有限公司开放式基金业务规则；

11.2 存放地点

基金管理人和基金托管人住所，并登载于基金管理人互联网站 http://www.huaan.com.cn。

11.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站查阅，或在营业时间内至基金管理人或基金托管人的办公场所免费查阅。

华安基金管理有限公司

二〇一八年八月二十四日