

华安新丰利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：中国邮政储蓄银行股份有限公司

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。

基金托管人中国邮政储蓄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	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
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	11
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	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	13
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
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	37
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	37
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	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	47
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	47
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	48
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	48
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	48
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	48
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	48
7.12 投资组合报告附注	48
8 基金份额持有人信息	49
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	49

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	50
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	50
9 开放式基金份额变动	50
10 重大事件揭示	50
10.1 基金份额持有人大会决议	50
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	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	51
10.4 基金投资策略的改变	51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	51
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	51
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	51
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	52
10.8 其他重大事件	52
11 影响投资者决策的其他重要信息	53
12 备查文件目录	54
12.1 备查文件目录	54
12.2 存放地点	54
12.3 查阅方式	54

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华安新丰利灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	华安新丰利混合	
基金主代码	003803	
交易代码	003803	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 12 月 29 日	
基金管理人	华安基金管理有限公司	
基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	197,646,575.65 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华安新丰利混合 A	华安新丰利混合 C
下属分级基金的交易代码	003803	003804
报告期末下属分级基金的份额总额	996,626.48 份	196,649,949.17 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。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率×50%+中债综合全价指数收益率×50%
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	中国邮政储蓄银行股份有限公司
信息披露	姓名	钱鲲	田东辉
	联系电话	021-38969999	010-68858113

负责人	电子邮箱	qiankun@huaan.com.cn	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		4008850099	95580
传真		021-68863414	010-68858120
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	北京市西城区金融大街3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	北京市西城区金融大街3号A座
邮政编码		200120	100808
法定代表人		朱学华	李国华

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	上海市世纪大道 8 号上海国金中心二期 31、32 层

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）	
	华安新丰利混合 A	华安新丰利混合 C
本期已实现收益	26,629.52	1,148,131.88
本期利润	-329,293.91	-22,241,147.24
加权平均基金份额本期利润	-0.3655	-0.1131
本期加权平均净值利润率	-11.85%	-10.37%
本期基金份额净值增长率	-9.90%	-10.24%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018 年 6 月 30 日)	
	华安新丰利混合 A	华安新丰利混合 C

期末可供分配利润	1,818,347.95	-1,595,148.37
期末可供分配基金份额利润	1.8245	-0.0081
期末基金资产净值	2,814,974.43	195,054,800.80
期末基金份额净值	2.8245	0.9919
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2018 年 6 月 30 日)	
	华安新丰利混合 A	华安新丰利混合 C
基金份额累计净值增长率	182.45%	-0.81%

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：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

华安新丰利混合 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	-6.13%	1.20%	-3.87%	0.69%	-2.26%	0.51%
过去三个月	-7.70%	1.06%	-5.09%	0.58%	-2.61%	0.48%
过去六个月	-9.90%	1.08%	-5.84%	0.58%	-4.06%	0.50%
过去一年	176.88%	7.76%	-3.20%	0.48%	180.08%	7.28%
自基金成立起至今	182.45%	6.35%	-0.80%	0.43%	183.25%	5.92%

华安新丰利混合 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	-6.14%	1.20%	-3.87%	0.69%	-2.27%	0.51%
过去三个月	-7.77%	1.06%	-5.09%	0.58%	-2.68%	0.48%
过去六个月	-10.24%	1.08%	-5.84%	0.58%	-4.40%	0.50%
过去一年	-2.23%	0.86%	-3.20%	0.48%	0.97%	0.38%
自基金成立起至今	-0.81%	0.70%	-0.80%	0.43%	-0.01%	0.27%

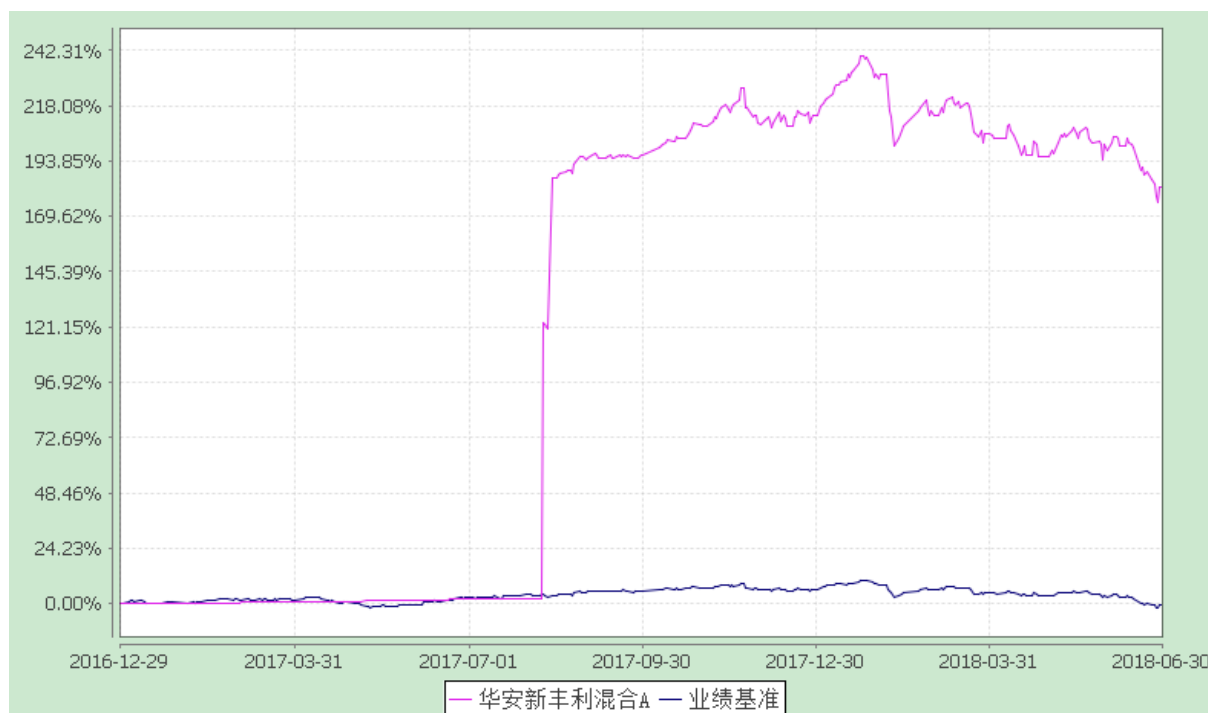
3.2.2 自基金合同生效以来 基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华安新丰利灵活配置混合型证券投资基金

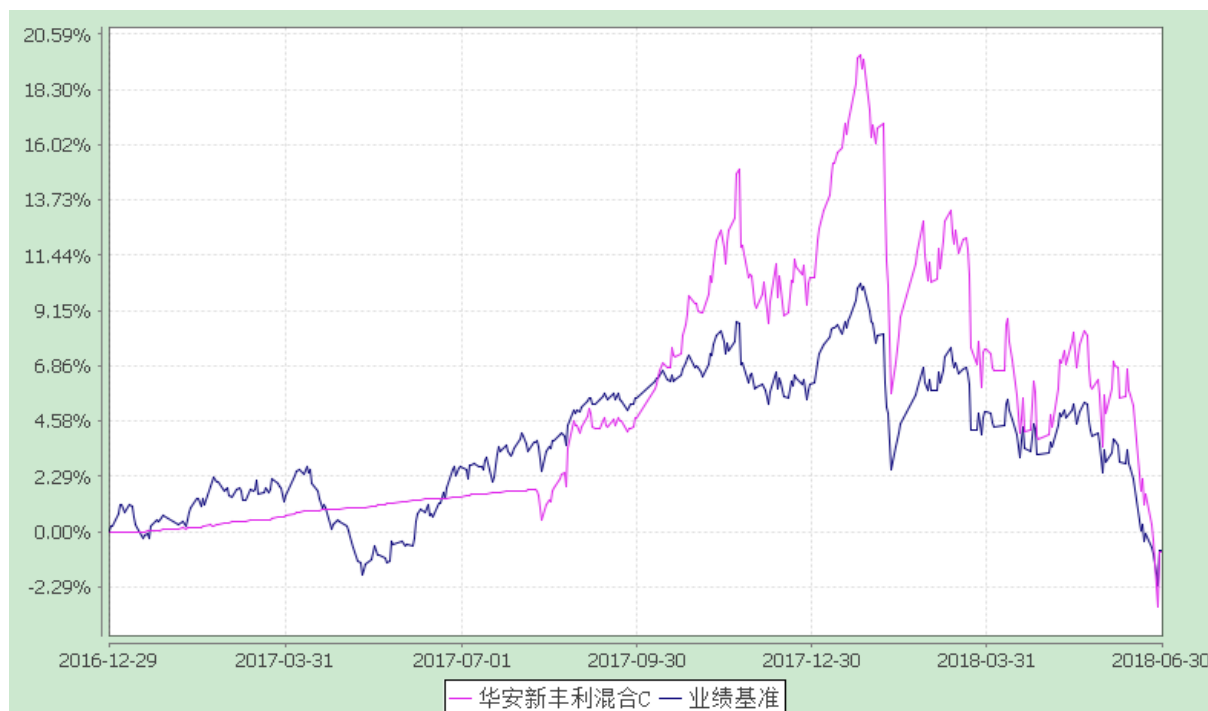
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2016 年 12 月 29 日至 2018 年 6 月 30 日)

华安新丰利混合 A



华安新丰利混合 C



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

4 管理人报告

4.1 基金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		
孙丽娜	本基金的基金经理	2016-12-29	-	7 年	硕士研究生，7 年债券、基金行业从业经验。曾任上海国际货币经纪公司债券经纪人。2010 年 8 月加入华安基金管理有限公司，先后担任债券交易员、基金经理助理。2014 年 8 月至 2017 年 7 月担任华安日日鑫货币市场基金及华安汇财通货币市场基金的基金经理，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 10 月起同时担任华安现金富利投资基金的基金经理。2015 年 2 月起担任华安年年盈定期开放债券型证券投资基金的基金经理。2015 年 6 月起同时担任华安添颐养老混合型发起式证券投资基金的基金经理。2016 年 10 月至 2018 年 1 月，同时担任华安润灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016 年 12 月起，同时担任本基金的基金经理。2017 年 3 月起，

					同时担任华安现金宝货币市场基金的基金经理。2018 年 5 月起，同时担任华安日日鑫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

上半年，海外主要经济体复苏进程有所分化。美国经济延续强劲，非农就业大超预期；欧洲经济复苏放缓，但通胀水平有明显改善。国内宏观经济大体平稳，通胀温和回落。受去杠杆和资管新规影响，社融萎缩明显，但出口和房地产投资仍支撑经济韧性。货币政策逐步趋向宽松，央行三次降准支持实体经济降低融资成本，并增量投放 MLF 鼓励商业银行向中小企业增加信贷投放。债市在国际金融市场动荡加剧、国内流动性显著改善、中美贸易战发酵等因素影响下，收益率震荡回落。信用债市场，“紧信用”影响渐增，一级市场净融资额大幅下滑，信用利差显著走阔。

本基金继续保持较高的权益仓位，积极参与两市打新，努力为持有人赚取收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2018 年 6 月 30 日,华安新丰利灵活配置混合 A 份额净值为 2.8245 元,C 份额净值为 0.9919 元;华安新丰利灵活配置混合 A 份额净值增长率为-9.90%,C 份额净值增长率为-10.24%,同期业绩比较基准增长率-5.84%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年,美国或将迎来本轮经济增长峰值,欧元区经济有望企稳,主要经济体货币政策仍走在回归正常化道路上。对中国而言,外有贸易战和全球需求的不确定性,内有融资环境恶化带来的经济潜在风险,宏观经济具有一定的下行压力。但目前中国正处于新旧动能切换从量变到质变的关键期,新动能规模和部分旧动能已经等量齐观。货币政策有望继续中性偏宽松,流动性整体较为宽裕,随着表外融资的压缩,表内信贷将有所放松。利率债和高等级信用债大概率将进一步走牛,但仍需警惕信用风险,尤其是对于信用资质较差的民企。股票市场关注业绩确定性高、符合政策和产业升级方向的个股。

本基金将保持较高的权益仓位以及适度的债券仓位,同时积极参与沪深两市新股申购,努力为投资人赚取收益。

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

本报告期内，中国邮政储蓄银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在华安新丰利灵活配置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、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：华安新丰利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	6,047,633.59	4,037,653.47
结算备付金		-	-
存出保证金		57.79	94,649.41
交易性金融资产	6.4.7.2	192,066,221.54	215,598,673.16

其中：股票投资		181,759,810.59	203,452,434.86
基金投资		-	-
债券投资		10,306,410.95	12,146,238.30
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	6.4.7.3	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.4	60,602.85	322,658.79
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		198,174,515.77	220,053,634.83
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		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		150.21	30,907.68
应付管理人报酬		102,038.61	111,265.34
应付托管费		17,006.45	18,544.23
应付销售服务费		16,767.12	18,361.27
应付交易费用	6.4.7.5	175.00	-
应交税费		1.46	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	168,601.69	350,045.34
负债合计		304,740.54	529,123.86
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.7	197,646,575.65	197,332,911.15
未分配利润	6.4.7.8	223,199.58	22,191,599.82
所有者权益合计		197,869,775.23	219,524,510.97
负债和所有者权益总计		198,174,515.77	220,053,634.83

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0011 元，基金份额总额 197,646,575.65 份，其中 A 类基金份额净值 2.8245 元，份额总额 996,626.48 份；C 类基金份额净值 0.9919 元，份额总额 196,649,949.17 份。

6.2 利润表

会计主体：华安新丰利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		-21,523,866.28	4,888,310.50
1.利息收入		214,118.98	4,114,695.95
其中：存款利息收入	6.4.7.9	14,360.82	743,931.89
债券利息收入		199,758.16	2,921,544.57
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	449,219.49
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,999,313.99	394,857.05
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-16,764.50	394,857.05
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	6.4.7.12	2,016,078.49	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.13	-23,745,202.55	700.00
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.14	7,903.30	378,057.50
减：二、费用		1,046,574.87	1,642,330.00
1. 管理人报酬		645,429.24	563,628.85
2. 托管费		107,571.60	93,938.19
3. 销售服务费		106,196.68	4.63
4. 交易费用	6.4.7.15	175.00	5,379.04
5. 利息支出		-	799,218.39
其中：卖出回购金融资产支出		-	799,218.39
6.税金及附加		0.85	-
7. 其他费用	6.4.7.16	187,201.50	180,160.90
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-22,570,441.15	3,245,980.50
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-22,570,441.15	3,245,980.50

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安新丰利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）	197,332,911.15	22,191,599.82	219,524,510.97
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-22,570,441.15	-22,570,441.15
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）	313,664.50	602,040.91	915,705.41
其中：1.基金申购款	794,874.24	1,641,851.90	2,436,726.14
2.基金赎回款	-481,209.74	-1,039,810.99	-1,521,020.73
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）	197,646,575.65	223,199.58	197,869,775.23
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）	200,005,952.70	4,349.66	200,010,302.36
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	3,245,980.50	3,245,980.50
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）	-148,950,757.81	-2,222,243.53	-151,173,001.34
其中：1.基金申购款	54,125.02	823.19	54,948.21
2.基金赎回款	-149,004,882.83	-2,223,066.72	-151,227,949.55
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）	51,055,194.89	1,028,086.63	52,083,281.52

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

华安新丰利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〔2016〕2606 号《关于准予华安新丰利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 2016 年 12 月 26 日到 2016 年 12 月 27 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（2016）验字第 60971571_B28 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 2016 年 12 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 200,005,952.69 元，在募集期间产生的存款利息为人民币 0.01 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 200,005,952.70 元，折合 200,005,952.70 份基金份额，其中 A 类基金份额 199,999,243.69 份，C 类基金份额 6,709.01 份。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，基金托管人为中国邮政储蓄银行股份有限公司。

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（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、地方政府债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、短期融资券、超短期融资券、中期票据、中小企业私募债等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金根据相关法律法规参与融资业务。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。

本基金的业绩比较基准为：中证 800 指数收益率×50%+中债综合全价指数收益率×50%。

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 6 月 30 日的财务状况以及 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 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

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

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

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 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。

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 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，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。

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[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。

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	6,047,633.59
定期存款	-

其他存款	-
合计	6,047,633.59

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		187,891,781.92	181,759,810.59	-6,131,971.33
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	345,400.00	353,410.95	8,010.95
	银行间市场	9,938,830.00	9,953,000.00	14,170.00
	合计	10,284,230.00	10,306,410.95	22,180.95
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		198,176,011.92	192,066,221.54	-6,109,790.38

6.4.7.3 买入返售金融资产

6.4.7.3.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.3.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.4 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	1,065.11
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	-
应收债券利息	59,537.74
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	-
合计	60,602.85

6.4.7.5 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	-
银行间市场应付交易费用	175.00
合计	175.00

6.4.7.6 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	0.19
预提账户维护费	-
预提审计费	29,752.78
预提信息披露费	138,848.72
合计	168,601.69

6.4.7.7 实收基金

华安新丰利混合 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	726,902.28	726,902.28
本期申购	744,811.97	744,811.97
本期赎回（以“-”号填列）	-475,087.77	-475,087.77
本期末	996,626.48	996,626.48

华安新丰利混合 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	196,606,008.87	196,606,008.87
本期申购	50,062.27	50,062.27
本期赎回（以“-”号填列）	-6,121.97	-6,121.97
本期末	196,649,949.17	196,649,949.17

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

华安新丰利混合 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	1,365,529.31	186,423.72	1,551,953.03
本期利润	26,629.52	-355,923.43	-329,293.91
本期基金份额交易产生的变动数	508,228.70	87,460.13	595,688.83
其中：基金申购款	1,401,361.65	233,606.42	1,634,968.07
基金赎回款	-893,132.95	-146,146.29	-1,039,279.24
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,900,387.53	-82,039.58	1,818,347.95

华安新丰利混合 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	3,036,407.45	17,603,239.34	20,639,646.79
本期利润	1,148,131.88	-23,389,279.12	-22,241,147.24
本期基金份额交易产生的变动数	658.25	5,693.83	6,352.08
其中：基金申购款	741.47	6,142.36	6,883.83
基金赎回款	-83.22	-448.53	-531.75
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,185,197.58	-5,780,345.95	-1,595,148.37

6.4.7.9 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	14,093.78
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	-

其他	267.04
合计	14,360.82

6.4.7.10 股票投资收益

无。

6.4.7.11 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	12,465,400.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	12,016,764.50
减：应收利息总额	465,400.00
买卖债券差价收入	-16,764.50

6.4.7.12 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	2,016,078.49
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,016,078.49

6.4.7.13 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	-23,745,202.55
——股票投资	-23,805,909.70
——债券投资	60,707.15
——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	-23,745,202.55
----	----------------

6.4.7.14 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	3,785.73
转换费收入	4,117.57
合计	7,903.30

6.4.7.15 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	-
银行间市场交易费用	175.00
合计	175.00

6.4.7.16 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	29,752.78
信息披露费	138,848.72
账户维护费	18,300.00
其他费用	300.00
合计	187,201.50

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
中国邮政储蓄银行股份有限公司(“中国邮政储蓄银行”)	基金托管人

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 债券交易

无。

6.4.10.1.4 债券回购交易

无。

6.4.10.1.5 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	645,429.24	563,628.85
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.6%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.6\% \div \text{当年天数}$$

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

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 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托管费	107,571.60	93,938.19

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

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

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		
	华安新丰利混合 A	华安新丰利混合 C	合计
华安基金管理有限公司	-	106,196.68	106,196.68
合计	-	106,196.68	106,196.68
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		
	华安新丰利混合 A	华安新丰利混合 C	合计
华安基金管理有限公司	-	4.63	4.63
合计	-	4.63	4.63

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.1%年费率计提。销售服务费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

H 为本基金 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为本基金 C 类基金份额前一日基金资产净值

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

无。

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
中国邮政储蓄银行	6,047,633.59	14,093.78	623,210.60	93,280.35

注：本基金的银行存款由基金托管人中国邮政储蓄银行保管，按银行同业利率计息。

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。

6.4.11 利润分配情况

无。

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 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

6.4.12.1.1 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
603105	芯能科技	2018-06-29	2018-07-09	网下中签	4.83	4.83	3,410.00	16,470.30	16,470.30	-
603693	江苏新能	2018-06-25	2018-07-03	网下中签	9.00	9.00	5,384.00	48,456.00	48,456.00	-
60370	东方	2018-0	2018-0	网下	13.09	13.09	1,765.	23,103	23,103	-

6	环宇	6-29	7-09	中签			00	.85	.85	
---	----	------	------	----	--	--	----	-----	-----	--

6.4.12.2 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
000008	神州高铁	2018-06-06	重大事项停牌	4.96	2018-08-07	4.46	22,700.00	176,416.00	112,592.00	-
000415	渤海金控	2018-01-17	重大事项停牌	5.21	2018-07-17	5.19	41,900.00	288,946.00	218,299.00	-
000540	中天金融	2017-08-21	重大资产重组	4.87	-	-	94,200.00	472,786.00	458,754.00	-
000793	华闻传媒	2018-02-01	重大事项停牌	8.40	2018-07-16	7.55	44,700.00	470,364.00	375,480.00	-
002310	东方园林	2018-05-25	重大资产重组	15.03	-	-	21,800.00	386,085.00	327,654.00	-
002411	必康股份	2018-06-18	重大事项停牌	28.34	-	-	9,600.00	251,745.00	272,064.00	-
002602	世纪华通	2018-06-12	重大资产重组	32.50	-	-	6,500.00	217,389.00	211,250.00	-
300072	三聚环保	2018-06-18	重大事项停牌	22.38	2018-07-10	18.38	18,400.00	580,851.00	411,792.00	-
300740	御家汇	2018-06-18	重大事项停牌	29.91	-	-	3,172.00	39,615.18	94,874.52	-
600221	海航控股	2018-01-10	重大事项停牌	3.23	2018-07-20	2.91	146,500.00	483,437.00	473,195.00	-
601118	海南橡胶	2018-05-24	重大资产重组	6.62	-	-	21,300.00	144,188.00	141,006.00	-
601390	中国中铁	2018-05-07	重大事项停牌	7.47	2018-08-20	7.25	168,900.00	1,441,721.00	1,261,683.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至报告期末 2018 年 6 月 30 日止，本基金无银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2018 年 6 月 30 日止，本基金无交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

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都要低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金，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、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。

本公司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经中国人民银行和中国证券监督管理委员会所批准的具有基金托管资格和基金代销资格的银行，并根据本公司管理交易对手的经验进行筛选，因而与这些银行存款相关的信用风险不重大。本基金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；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。

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。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2018年6月30日	上年末 2017年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	-	1,997,000.00
合计	-	1,997,000.00

注：未评级债券为超短期融资券。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2018年6月30日	上年末 2017年12月31日
AAA	181,240.36	110,800.00
AAA 以下	172,170.59	55,438.30
未评级	9,953,000.00	9,983,000.00
合计	10,306,410.95	10,149,238.30

注：未评级债券为国债、政策性金融债。

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。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理,通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券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的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%,本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的 30%。

本基金所持部分证券在证券交易所上市,其余亦可在银行间同业市场交易,部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注。此外,本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求,其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算,确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时,本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度;按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理,以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外,本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度:根据质押品的资质确定质押率水平;持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额;并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时,可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施,本基金在本报告期内流动性情况良好。

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。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

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	6,047,633.59	-	-	-	6,047,633.59
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	57.79	-	-	-	57.79
交易性金融资产	10,306,410.95	-	-	181,759,810.59	192,066,221.54
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	60,602.85	60,602.85
应收申购款	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
资产总计	16,354,102.33	-	-	181,820,413.44	198,174,515.77
负债					
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	102,038.61	102,038.61
应付托管费	-	-	-	17,006.45	17,006.45
应付销售服务费	-	-	-	16,767.12	16,767.12
应付交易费用	-	-	-	175.00	175.00
应付税费	-	-	-	1.46	1.46
其他负债	-	-	-	168,601.69	168,601.69
应付赎回款	-	-	-	150.21	150.21

负债总计	-	-	-	304,740.54	304,740.54
利率敏感度缺口	16,354,102.33	-	-	181,515,672.90	197,869,775.23
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	4,037,653.47	-	-	-	4,037,653.47
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	94,649.41	-	-	-	94,649.41
交易性金融资产	11,980,000.00	35,264.70	130,973.60	203,452,434.86	215,598,673.16
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	322,658.79	322,658.79
应收申购款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	16,112,302.88	35,264.70	130,973.60	203,775,093.65	220,053,634.83
负债					
应付赎回款	-	-	-	30,907.68	30,907.68
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	111,265.34	111,265.34
应付托管费	-	-	-	18,544.23	18,544.23
应付销售服务费	-	-	-	18,361.27	18,361.27
应付交易费用	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	350,045.34	350,045.34
负债总计	-	-	-	529,123.86	529,123.86
利率敏感度缺口	16,112,302.88	35,264.70	130,973.60	203,245,969.79	219,524,510.97

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

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
	市场利率下行 25 个基点	-	增加约 1
	市场利率上行 25 个基点	-	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。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。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。本基金投资组合中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%。

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	上年度末
----	-----	------

	2018 年 6 月 30 日		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	181,759,810.59	91.86	203,452,434.86	92.68
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
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	181,759,810.59	91.86	203,452,434.86	92.68

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

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
	业绩比较基准上升 5%	增加约 1,792	增加约 853
	业绩比较基准下降 5%	减少约 1,792	减少约 853

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	181,759,810.59	91.72
	其中：股票	181,759,810.59	91.72
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	10,306,410.95	5.20
	其中：债券	10,306,410.95	5.20
	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	6,047,633.59	3.05
8	其他各项资产	60,660.64	0.03
9	合计	198,174,515.77	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	560,514.00	0.28
B	采矿业	6,221,651.80	3.14
C	制造业	74,037,565.18	37.42
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,950,609.90	2.50
E	建筑业	5,852,597.60	2.96
F	批发和零售业	4,049,906.12	2.05
G	交通运输、仓储和邮政业	5,925,876.46	2.99

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,313,958.35	3.19
J	金融业	58,121,985.18	29.37
K	房地产业	9,932,531.00	5.02
L	租赁和商务服务业	2,163,165.36	1.09
M	科学研究和技术服务业	79,391.50	0.04
N	水利、环境和公共设施管理业	928,142.14	0.47
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	694,272.00	0.35
R	文化、体育和娱乐业	1,739,044.00	0.88
S	综合	188,600.00	0.10
	合计	181,759,810.59	91.86

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	601318	中国平安	218,200	12,782,156.00	6.46
2	600519	贵州茅台	9,900	7,241,454.00	3.66
3	600016	民生银行	545,300	3,817,100.00	1.93
4	600036	招商银行	140,200	3,706,888.00	1.87
5	600887	伊利股份	123,200	3,437,280.00	1.74
6	600276	恒瑞医药	45,370	3,437,231.20	1.74
7	000333	美的集团	62,600	3,268,972.00	1.65
8	601288	农业银行	879,700	3,026,168.00	1.53
9	000858	五粮液	39,100	2,971,600.00	1.50
10	600104	上汽集团	78,000	2,729,220.00	1.38
11	002415	海康威视	71,200	2,643,656.00	1.34
12	601166	兴业银行	181,400	2,612,160.00	1.32
13	000651	格力电器	55,200	2,602,680.00	1.32
14	600000	浦发银行	255,700	2,444,492.00	1.24
15	000002	万科A	97,000	2,386,200.00	1.21
16	600900	长江电力	147,500	2,380,650.00	1.20
17	601328	交通银行	401,500	2,304,610.00	1.16
18	601601	中国太保	69,700	2,219,945.00	1.12
19	601169	北京银行	338,200	2,039,346.00	1.03
20	600048	保利地产	160,400	1,956,880.00	0.99

21	000725	京东方 A	543,200	1,922,928.00	0.97
22	600030	中信证券	115,800	1,918,806.00	0.97
23	600837	海通证券	187,000	1,770,890.00	0.89
24	601766	中国中车	219,800	1,692,460.00	0.86
25	601988	中国银行	461,600	1,666,376.00	0.84
26	601398	工商银行	311,300	1,656,116.00	0.84
27	002304	洋河股份	12,400	1,631,840.00	0.82
28	600028	中国石化	239,800	1,556,302.00	0.79
29	600585	海螺水泥	43,300	1,449,684.00	0.73
30	601888	中国国旅	21,300	1,371,933.00	0.69
31	600019	宝钢股份	171,900	1,339,101.00	0.68
32	600518	康美药业	57,500	1,315,600.00	0.66
33	600690	青岛海尔	67,400	1,298,124.00	0.66
34	601390	中国中铁	168,900	1,261,683.00	0.64
35	601006	大秦铁路	134,200	1,101,782.00	0.56
36	002024	苏宁易购	75,300	1,060,224.00	0.54
37	000538	云南白药	9,500	1,016,120.00	0.51
38	001979	招商蛇口	52,400	998,220.00	0.50
39	601939	建设银行	152,000	995,600.00	0.50
40	000338	潍柴动力	110,300	965,125.00	0.49
41	002142	宁波银行	56,200	915,498.00	0.46
42	002230	科大讯飞	27,900	894,753.00	0.45
43	601009	南京银行	115,700	894,361.00	0.45
44	601186	中国铁建	103,500	892,170.00	0.45
45	600196	复星医药	20,900	865,051.00	0.44
46	601857	中国石油	110,300	850,413.00	0.43
47	002008	大族激光	15,600	829,764.00	0.42
48	601628	中国人寿	36,700	826,484.00	0.42
49	601899	紫金矿业	228,200	823,802.00	0.42
50	600741	华域汽车	34,600	820,712.00	0.41
51	600031	三一重工	89,200	800,124.00	0.40
52	000001	平安银行	85,500	777,195.00	0.39
53	600660	福耀玻璃	30,200	776,442.00	0.39
54	600009	上海机场	13,100	726,788.00	0.37
55	600999	招商证券	51,600	705,888.00	0.36
56	300124	汇川技术	21,300	699,066.00	0.35
57	600015	华夏银行	93,300	695,085.00	0.35
58	000963	华东医药	14,400	694,800.00	0.35
59	002044	美年健康	30,720	694,272.00	0.35
60	600886	国投电力	93,200	677,564.00	0.34
61	600309	万华化学	14,900	676,758.00	0.34
62	000063	中兴通讯	51,900	676,257.00	0.34
63	600436	片仔癀	6,000	671,580.00	0.34
64	600958	东方证券	72,200	659,186.00	0.33

65	600029	南方航空	77,200	652,340.00	0.33
66	002236	大华股份	28,500	642,675.00	0.32
67	601933	永辉超市	82,900	633,356.00	0.32
68	600271	航天信息	24,900	629,223.00	0.32
69	600352	浙江龙盛	52,500	627,375.00	0.32
70	600089	特变电工	86,800	601,524.00	0.30
71	000166	申万宏源	137,500	600,875.00	0.30
72	002475	立讯精密	26,600	599,564.00	0.30
73	601985	中国核电	104,400	589,860.00	0.30
74	601225	陕西煤业	69,700	572,934.00	0.29
75	000776	广发证券	43,100	571,937.00	0.29
76	002202	金风科技	45,240	571,833.60	0.29
77	601377	兴业证券	107,800	568,106.00	0.29
78	000423	东阿阿胶	10,500	565,005.00	0.29
79	600066	宇通客车	29,400	564,186.00	0.29
80	002456	欧菲科技	34,300	553,259.00	0.28
81	002594	比亚迪	11,500	548,320.00	0.28
82	601669	中国电建	101,400	543,504.00	0.27
83	600606	绿地控股	83,000	542,820.00	0.27
84	000895	双汇发展	20,400	538,764.00	0.27
85	600570	恒生电子	10,100	534,795.00	0.27
86	000069	华侨城 A	73,700	532,851.00	0.27
87	000568	泸州老窖	8,600	523,396.00	0.26
88	600383	金地集团	51,200	521,728.00	0.26
89	300070	碧水源	37,400	520,982.00	0.26
90	600406	国电南瑞	31,600	499,280.00	0.25
91	600535	天士力	19,320	498,842.40	0.25
92	600010	包钢股份	320,900	497,395.00	0.25
93	601788	光大证券	44,700	490,806.00	0.25
94	601336	新华保险	11,400	488,832.00	0.25
95	600893	航发动力	21,800	486,576.00	0.25
96	000100	TCL 集团	167,300	485,170.00	0.25
97	600705	中航资本	102,600	479,142.00	0.24
98	000768	中航飞机	30,600	478,584.00	0.24
99	600221	海航控股	146,500	473,195.00	0.24
100	000540	中天金融	94,200	458,754.00	0.23
101	600332	白云山	11,700	445,185.00	0.22
102	600111	北方稀土	38,500	438,130.00	0.22
103	600637	东方明珠	29,000	436,740.00	0.22
104	600018	上港集团	72,900	434,484.00	0.22
105	600115	东方航空	65,200	431,624.00	0.22
106	600674	川投能源	49,100	428,152.00	0.22
107	601998	中信银行	68,700	426,627.00	0.22
108	600023	浙能电力	91,400	425,924.00	0.22

109	600588	用友网络	17,030	417,405.30	0.21
110	000783	长江证券	76,100	413,223.00	0.21
111	601688	华泰证券	27,600	413,172.00	0.21
112	002241	歌尔股份	40,500	412,695.00	0.21
113	300072	三聚环保	18,400	411,792.00	0.21
114	600739	辽宁成大	27,000	409,860.00	0.21
115	600085	同仁堂	11,600	409,248.00	0.21
116	000157	中联重科	99,200	407,712.00	0.21
117	000425	徐工机械	96,000	407,040.00	0.21
118	000977	浪潮信息	16,700	398,295.00	0.20
119	601618	中国中冶	119,300	397,269.00	0.20
120	000625	长安汽车	44,100	396,900.00	0.20
121	603993	洛阳钼业	62,300	391,867.00	0.20
122	300024	机器人	22,500	391,500.00	0.20
123	601111	中国国航	43,400	385,826.00	0.19
124	600547	山东黄金	16,000	382,720.00	0.19
125	601800	中国交建	33,500	381,565.00	0.19
126	600362	江西铜业	24,000	380,400.00	0.19
127	002007	华兰生物	11,700	376,272.00	0.19
128	000793	华闻传媒	44,700	375,480.00	0.19
129	600256	广汇能源	91,520	374,316.80	0.19
130	601607	上海医药	15,600	372,840.00	0.19
131	601018	宁波港	88,300	371,743.00	0.19
132	600522	中天科技	42,000	370,020.00	0.19
133	601099	太平洋	158,100	369,954.00	0.19
134	600177	雅戈尔	48,000	369,600.00	0.19
135	600208	新湖中宝	96,600	369,012.00	0.19
136	000623	吉林敖东	20,500	368,590.00	0.19
137	601555	东吴证券	53,800	367,454.00	0.19
138	300144	宋城演艺	15,500	364,250.00	0.18
139	002065	东华软件	41,300	355,180.00	0.18
140	600816	安信信托	47,760	345,782.40	0.17
141	002049	紫光国微	7,800	344,136.00	0.17
142	002081	金螳螂	33,900	342,390.00	0.17
143	000792	盐湖股份	31,500	340,830.00	0.17
144	601668	中国建筑	61,460	335,571.60	0.17
145	600340	华夏幸福	13,000	334,750.00	0.17
146	300750	宁德时代	4,617	332,239.32	0.17
147	600109	国金证券	46,600	331,326.00	0.17
148	002310	东方园林	21,800	327,654.00	0.17
149	601600	中国铝业	85,100	326,784.00	0.17
150	002146	荣盛发展	37,400	326,502.00	0.17
151	000876	新希望	50,500	320,170.00	0.16
152	601198	东兴证券	24,500	319,480.00	0.16

153	000630	铜陵有色	144,500	319,345.00	0.16
154	600170	上海建工	99,800	303,392.00	0.15
155	300168	万达信息	14,800	301,920.00	0.15
156	601117	中国化学	44,800	301,504.00	0.15
157	002673	西部证券	39,900	301,245.00	0.15
158	300017	网宿科技	28,100	300,951.00	0.15
159	000728	国元证券	40,400	298,960.00	0.15
160	601229	上海银行	18,800	296,288.00	0.15
161	600804	鹏博士	24,400	292,800.00	0.15
162	600068	葛洲坝	39,400	284,074.00	0.14
163	002465	海格通信	35,200	282,656.00	0.14
164	002714	牧原股份	6,300	280,098.00	0.14
165	600688	上海石化	49,100	279,379.00	0.14
166	600297	广汇汽车	47,400	277,764.00	0.14
167	000413	东旭光电	45,500	275,730.00	0.14
168	002411	必康股份	9,600	272,064.00	0.14
169	000060	中金岭南	55,200	268,272.00	0.14
170	600489	中金黄金	39,300	268,026.00	0.14
171	600498	烽火通信	10,600	263,410.00	0.13
172	000983	西山煤电	34,900	262,099.00	0.13
173	600415	小商品城	60,600	261,186.00	0.13
174	600583	海油工程	49,400	259,844.00	0.13
175	000826	启迪桑德	14,700	256,956.00	0.13
176	601633	长城汽车	26,000	255,320.00	0.13
177	600663	陆家嘴	15,800	249,482.00	0.13
178	002500	山西证券	36,900	248,706.00	0.13
179	600118	中国卫星	12,900	246,390.00	0.12
180	600820	隧道股份	41,600	245,856.00	0.12
181	601919	中远海控	48,700	239,604.00	0.12
182	600718	东软集团	18,200	237,692.00	0.12
183	002470	金正大	34,100	234,608.00	0.12
184	000750	国海证券	65,000	232,050.00	0.12
185	600061	国投资本	24,600	228,288.00	0.12
186	601992	金隅集团	69,500	227,960.00	0.12
187	002027	分众传媒	23,160	221,641.20	0.11
188	600060	海信电器	16,400	219,596.00	0.11
189	300027	华谊兄弟	35,600	219,296.00	0.11
190	000415	渤海金控	41,900	218,299.00	0.11
191	000671	阳光城	36,200	216,114.00	0.11
192	000402	金融街	26,700	214,935.00	0.11
193	002074	国轩高科	15,080	212,024.80	0.11
194	002602	世纪华通	6,500	211,250.00	0.11
195	600008	首创股份	50,000	211,000.00	0.11
196	601877	正泰电器	9,300	207,576.00	0.10

197	002926	华西证券	20,592	206,743.68	0.10
198	601333	广深铁路	48,300	205,275.00	0.10
199	000559	万向钱潮	30,100	204,680.00	0.10
200	601066	中信建投	18,690	201,104.40	0.10
201	600157	永泰能源	112,800	200,784.00	0.10
202	000686	东北证券	31,100	199,351.00	0.10
203	600704	物产中大	38,100	199,263.00	0.10
204	000627	天茂集团	28,200	197,964.00	0.10
205	300251	光线传媒	19,300	196,474.00	0.10
206	600977	中国电影	12,100	194,084.00	0.10
207	600038	中直股份	4,800	191,952.00	0.10
208	600901	江苏租赁	24,935	188,757.95	0.10
209	600895	张江高科	16,400	188,600.00	0.10
210	002508	老板电器	6,100	186,782.00	0.09
211	002153	石基信息	6,400	185,600.00	0.09
212	603156	养元饮品	2,967	184,132.02	0.09
213	002385	大北农	44,500	183,785.00	0.09
214	601997	贵阳银行	14,800	182,928.00	0.09
215	600919	江苏银行	28,100	180,121.00	0.09
216	000839	中信国安	37,500	177,375.00	0.09
217	300454	深信服	1,604	176,375.84	0.09
218	601866	中远海发	70,500	175,545.00	0.09
219	002352	顺丰控股	3,900	175,500.00	0.09
220	600827	百联股份	17,000	173,400.00	0.09
221	600649	城投控股	28,300	173,196.00	0.09
222	300315	掌趣科技	41,400	173,052.00	0.09
223	000938	紫光股份	2,700	169,020.00	0.09
224	002925	盈趣科技	3,052	169,019.76	0.09
225	600737	中粮糖业	22,200	167,388.00	0.08
226	601021	春秋航空	4,600	161,138.00	0.08
227	600376	首开股份	22,500	158,175.00	0.08
228	002152	广电运通	26,700	156,996.00	0.08
229	000961	中南建设	24,500	154,595.00	0.08
230	600037	歌华有线	14,900	153,768.00	0.08
231	600372	中航电子	11,600	151,496.00	0.08
232	600682	南京新百	9,100	149,604.00	0.08
233	000959	首钢股份	36,300	149,193.00	0.08
234	002195	二三四五	34,320	146,889.60	0.07
235	600150	*ST 船舶	14,800	143,412.00	0.07
236	300133	华策影视	13,400	142,710.00	0.07
237	000917	电广传媒	24,600	141,696.00	0.07
238	601118	海南橡胶	21,300	141,006.00	0.07
239	601818	光大银行	38,400	140,544.00	0.07
240	002299	圣农发展	9,000	139,410.00	0.07

241	002920	德赛西威	4,569	136,613.10	0.07
242	600373	中文传媒	10,200	131,070.00	0.07
243	002131	利欧股份	62,348	130,930.80	0.07
244	601958	金铂股份	20,800	130,416.00	0.07
245	000738	航发控制	9,600	127,968.00	0.06
246	002174	游族网络	6,400	127,360.00	0.06
247	600703	三安光电	6,600	126,852.00	0.06
248	600021	上海电力	18,600	125,364.00	0.06
249	600482	中国动力	7,100	123,895.00	0.06
250	000718	苏宁环球	33,600	123,312.00	0.06
251	002558	巨人网络	4,900	116,522.00	0.06
252	000156	华数传媒	12,000	115,680.00	0.06
253	603712	七一二	4,022	113,983.48	0.06
254	603056	德邦股份	4,146	113,558.94	0.06
255	300504	天邑股份	2,857	112,651.51	0.06
256	000008	神州高铁	22,700	112,592.00	0.06
257	600446	金证股份	10,200	112,302.00	0.06
258	601838	成都银行	12,799	111,991.25	0.06
259	601990	南京证券	10,230	110,995.50	0.06
260	600188	兖州煤业	8,400	109,536.00	0.06
261	002930	宏川智慧	2,467	108,893.38	0.06
262	300745	欣锐科技	1,304	107,032.32	0.05
263	603486	科沃斯	1,639	105,338.53	0.05
264	300741	华宝股份	2,625	104,422.50	0.05
265	002555	三七互娱	8,500	103,275.00	0.05
266	002292	奥飞娱乐	11,100	99,123.00	0.05
267	300740	御家汇	3,172	94,874.52	0.05
268	600926	杭州银行	8,400	93,156.00	0.05
269	600685	中船防务	6,800	90,712.00	0.05
270	601828	美凯龙	5,897	90,106.16	0.05
271	600549	厦门钨业	5,850	88,803.00	0.04
272	600929	湖南盐业	5,696	88,800.64	0.04
273	600233	圆通速递	6,700	88,440.00	0.04
274	002929	润建通信	2,152	87,156.00	0.04
275	603876	鼎胜新材	2,823	84,746.46	0.04
276	300634	彩讯股份	2,058	84,110.46	0.04
277	601375	中原证券	17,500	81,725.00	0.04
278	601611	中国核建	10,300	81,370.00	0.04
279	601330	绿色动力	4,971	81,226.14	0.04
280	300746	汉嘉设计	2,318	79,391.50	0.04
281	603587	地素时尚	1,868	77,167.08	0.04
282	603348	文灿股份	2,011	74,246.12	0.04
283	601966	玲珑轮胎	4,700	74,119.00	0.04
284	300737	科顺股份	6,133	73,044.03	0.04

285	300664	鹏鹞环保	3,640	68,978.00	0.03
286	300033	同花顺	1,700	66,079.00	0.03
287	300735	光弘科技	3,463	66,004.78	0.03
288	603733	仙鹤股份	2,438	64,948.32	0.03
289	300684	中石科技	827	64,315.79	0.03
290	603773	沃格光电	881	64,313.00	0.03
291	601163	三角轮胎	4,800	64,128.00	0.03
292	002913	奥士康	1,442	60,924.50	0.03
293	601127	小康股份	3,500	60,515.00	0.03
294	300739	明阳电路	1,893	55,729.92	0.03
295	002918	蒙娜丽莎	2,268	53,660.88	0.03
296	603897	长城科技	1,595	53,544.15	0.03
297	603301	振德医疗	1,066	52,521.82	0.03
298	603596	伯特利	1,532	52,118.64	0.03
299	603160	汇顶科技	800	51,912.00	0.03
300	603858	步长制药	1,200	51,348.00	0.03
301	603693	江苏新能	5,384	48,456.00	0.02
302	603214	爱婴室	919	48,229.12	0.02
303	002927	泰永长征	1,249	47,774.25	0.02
304	002928	华夏航空	1,640	46,330.00	0.02
305	002931	锋龙股份	895	44,660.50	0.02
306	603045	福达合金	891	43,427.34	0.02
307	603680	今创集团	1,443	43,362.15	0.02
308	300730	科创信息	1,395	40,971.15	0.02
309	603080	新疆火炬	1,187	40,536.05	0.02
310	000709	河钢股份	13,700	40,415.00	0.02
311	603516	淳中科技	1,173	40,374.66	0.02
312	002917	金奥博	1,090	39,774.10	0.02
313	600871	*ST 油服	20,100	38,592.00	0.02
314	603283	赛腾股份	1,349	37,920.39	0.02
315	002923	润都股份	1,144	34,903.44	0.02
316	002915	中欣氟材	1,085	34,665.75	0.02
317	002841	视源股份	640	34,182.40	0.02
318	603477	振静股份	1,955	33,880.15	0.02
319	603329	上海雅仕	1,183	33,810.14	0.02
320	300731	科创新源	808	33,677.44	0.02
321	300733	西菱动力	1,693	33,216.66	0.02
322	300727	润禾材料	1,131	33,115.68	0.02
323	603848	好太太	1,377	32,621.13	0.02
324	600153	建发股份	3,400	30,566.00	0.02
325	002922	伊戈尔	1,245	30,004.50	0.02
326	002831	裕同科技	600	30,000.00	0.02
327	603711	香飘飘	1,318	29,061.90	0.01
328	002919	名臣健康	821	28,316.29	0.01

329	603161	科华控股	1,239	26,873.91	0.01
330	603890	春秋电子	1,577	26,651.30	0.01
331	603356	华菱精工	1,239	25,994.22	0.01
332	603706	东方环宇	1,765	23,103.85	0.01
333	603685	晨丰科技	1,212	22,846.20	0.01
334	603917	合力科技	1,431	22,037.40	0.01
335	603655	朗博科技	881	19,364.38	0.01
336	300059	东方财富	1,440	18,979.20	0.01
337	002466	天齐锂业	345	17,108.55	0.01
338	603105	芯能科技	3,410	16,470.30	0.01

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	002926	华西证券	194,800.32	0.09
2	603156	养元饮品	166,828.87	0.08
3	600901	江苏租赁	155,843.75	0.07
4	300750	宁德时代	116,071.38	0.05
5	300741	华宝股份	101,325.00	0.05
6	601066	中信建投	101,299.80	0.05
7	601838	成都银行	89,465.01	0.04
8	002925	盈趣科技	68,670.00	0.03
9	300737	科顺股份	61,023.35	0.03
10	601828	美凯龙	60,326.31	0.03
11	600256	广汇能源	53,856.00	0.02
12	002929	润建通信	51,540.40	0.02
13	603587	地素时尚	51,407.36	0.02
14	603693	江苏新能	48,456.00	0.02
15	300454	深信服	48,232.28	0.02
16	603680	今创集团	47,171.67	0.02
17	300740	御家汇	39,615.18	0.02
18	601990	南京证券	38,771.70	0.02
19	603876	鼎胜新材	38,223.42	0.02
20	300504	天邑股份	37,312.42	0.02

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。

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

无。

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	2,113,285.43
卖出股票的收入（成交）总额	-

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。

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	9,953,000.00	5.03
	其中：政策性金融债	9,953,000.00	5.03
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）	353,410.95	0.18
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	10,306,410.95	5.21

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	160415	16 农发 15	100,000	9,953,000.00	5.03
2	128024	宁行转债	1,108	115,907.88	0.06
3	127005	长证转债	688	65,332.48	0.03
4	127006	敖东转债	425	41,501.25	0.02
5	128035	大族转债	336	38,572.80	0.02

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），并根据权益类资产投资（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，以对冲权益类资产组合的系统性风险和流动性风险。

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

无。

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。

7.11.3 本期国债期货投资评价

无。

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	57.79
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	60,602.85
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	60,660.64

7.12.4 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	128024	宁行转债	115,907.88	0.06
2	123005	万信转债	20,029.83	0.01
3	113016	小康转债	5,474.40	0.00
4	123006	东财转债	1,563.51	0.00

7.12.5 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。

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	户均持有的	持有人结构
------	------	-------	-------

	数(户)	基金份额	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
华安新丰利混合 A	101	9,867.59	0.00	0.00%	996,626.48	100.00%
华安新丰利混合 C	407	483,169.41	196,579,516.41	99.96%	70,432.76	0.04%
合计	508	389,068.06	196,579,516.41	99.46%	1,067,059.24	0.54%

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	华安新丰利混合 A	5.98	0.00%
	华安新丰利混合 C	35.72	0.00%
	合计	41.70	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	华安新丰利混合 A	华安新丰利混合 C
基金合同生效日（2016 年 12 月 29 日）基金份额总额	199,999,243.69	6,709.01
本报告期期初基金份额总额	726,902.28	196,606,008.87
本报告期基金总申购份额	744,811.97	50,062.27
减：本报告期基金总赎回份额	475,087.77	6,121.97
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	996,626.48	196,649,949.17

注：总申购份额含转换入份额。总赎回份额含转换出份额。

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	
国泰君安	2	-	-	-	-	-

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

基金管理人或被选择的券商签订《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
国泰君安	-	-	-	-	-	-

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	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
3	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“金正大”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	2018-02-05
4	华安基金管理有限公司关于副总经理变更的	《上海证券报》、《证券时	2018-02-13

	公告	报》、《中国证券报》和公司网站	
5	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	2018-03-14
6	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
7	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
8	华安新丰利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
9	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“渤海金控”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	2018-04-20
10	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“中兴通讯”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	2018-04-21
11	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
12	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
13	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“德豪润达”、“三聚环保”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	2018-06-25
14	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
15	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

注：前款所涉重大事件已作为临时报告在《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 www.huaan.com.cn 上披露。

11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者	报告期内持有基金份额变化情况	报告期末持有基金情况
-----	----------------	------------

类别	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20180101-20180630	196, 579, 516.41	0.00	0.00	196, 579, 516.41	99.46%
产品特有风险							
本基金报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过20%的情形。如该单一投资者大额赎回将可能导致基金份额净值波动风险、基金流动性风险等特定风险。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、《华安新丰利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- 2、《华安新丰利灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》
- 3、《华安新丰利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丰利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；

12.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的办公场所，并登载于基金管理人互联网站 <http://www.huaan.com.cn>。

12.3 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