

华安沪港深通精选灵活配置混合型证券投资基金
2018 年年度报告摘要
2018 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：二〇一九年三月三十日

§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 2019 年 3 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自 2018 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	华安沪港深通精选灵活配置混合
基金主代码	001581
交易代码	001581
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 2 月 16 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	411,937,175.35 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制投资组合风险的前提下,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。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。在本合同约定的投资比例范围内,本基金将根据宏观经济、估值水平、资金面、市场情绪等因素,制定并适时调整国内 A 股和香港(港股通标的股票)两地股票配置比例及投资策略。
业绩比较基准	30%×中证 800 指数收益率+30%×恒生综合指数收益率+40%×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。本基

	金将投资港股通标的股票，还将面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。
--	--

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华安基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信 息 披 露 负 责 人	姓名	陆滢	田青
	联系电话	021-38969999	010-67595096
	电子邮箱	luying@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 层、32 层

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2018 年	2017 年 2 月 16 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-83,873,454.67	43,092,521.44
本期利润	-94,995,644.89	52,565,080.56
加权平均基金份额本期利润	-0.2329	0.2465
本期基金份额净值增长率	-10.44%	32.10%
3.1.2 期末数据和指标	2018 年末	2017 年末
期末可供分配基金份额利润	0.0290	0.3001

期末基金资产净值	443,114,990.68	159,170,567.41
期末基金份额净值	1.076	1.321

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）

4、合同生效日当年的主要会计数据和财务指标按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

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	-8.08%	1.55%	-5.06%	0.92%	-3.02%	0.63%
过去六个月	-14.02%	1.36%	-7.47%	0.80%	-6.55%	0.56%
过去一年	-10.44%	1.33%	-10.75%	0.74%	0.31%	0.59%
自基金合同生效起至今	18.31%	1.17%	-2.73%	0.60%	21.04%	0.57%

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

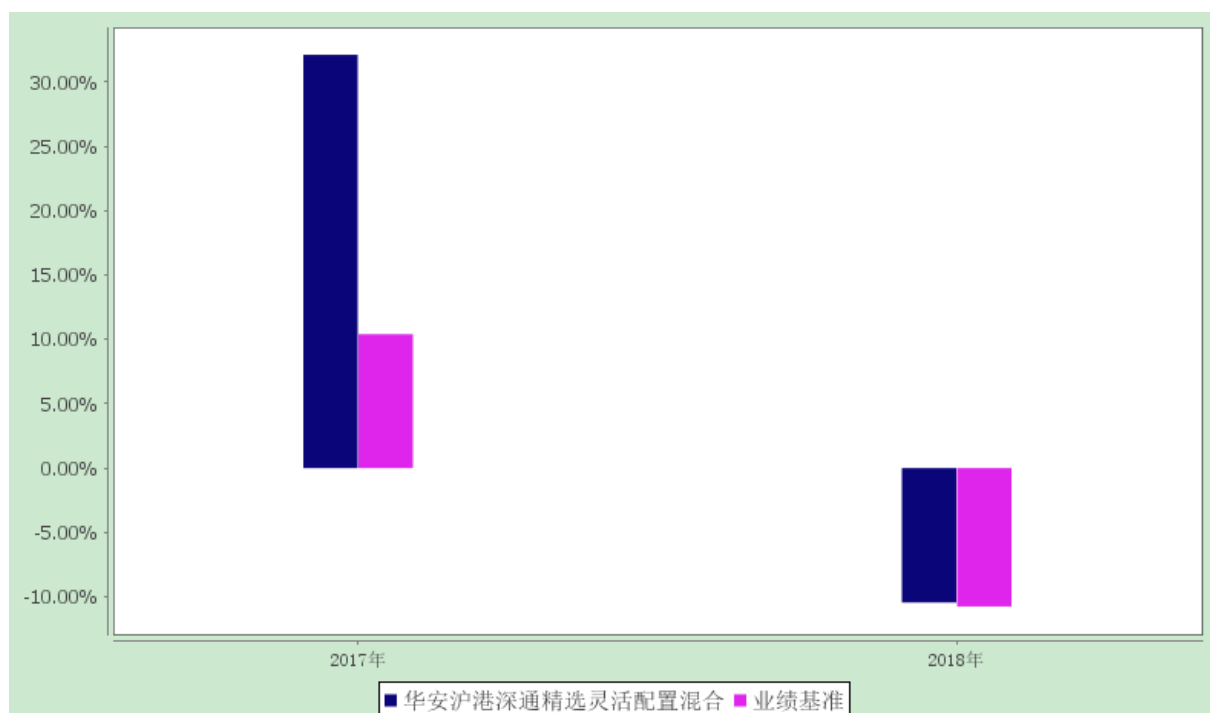
华安沪港深通精选灵活配置混合型证券投资基金
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
 (2017 年 2 月 16 日至 2018 年 12 月 31 日)



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

华安沪港深通精选灵活配置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



注：合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2018 年	1.190	39,383,567.89	13,034,129.85	52,417,697.74	-
2017 年	-	-	-	-	-
合计	1.190	39,383,567.89	13,034,129.85	52,417,697.74	-

§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证券股份有限公司、上海上国投资产管理有限公司、上海锦江国际投资管理有限公司、上海工业投资（集团）有限公司和国泰君安投资管理股份有限公司。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 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 108 只开放式基金，管理资产规模达到 2756.06 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		
苏圻涵	本基金的基金经理、全球投资部副总监	2017-02-16	-	14 年	博士研究生，14 年证券、基金从业经历,持有基金从业执业证书。2004 年 6 月加入华安基金管理有限公司，曾先后于研究发展部、战略策划部工作，担任行业研究员和产品经理职务。目前任职于全球投资部，担任基金经理职务。2010 年 9 月起担任华安香港精选股票型证券投资基金的基金经理。2011 年 5 月起同时担任华安

					大中华升级股票型证券投资基金的基金经理。2015 年 6 月至 2016 年 9 月同时担任华安国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016 年 3 月至 2018 年 3 月同时担任华安沪港深外延增长灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016 年 3 月至 2018 年 2 月同时担任华安全球美元收益债券型证券投资基金的基金经理。2016 年 6 月至 2018 年 2 月同时担任华安全球美元票息债券型证券投资基金的基金经理。2017 年 2 月起，同时担任本基金的基金经理。2017 年 5 月至 2018 年 9 月，同时担任华安沪港深机会灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 6 月起，同时担任华安文体健康主题灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 8 月起，同时担任华安大安全主题灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 10 月起，同时担任华安 CES 港股通精选 100 交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理。
高钥群	本基金的基金经理	2017-04-24	-	12 年	硕士研究生，12 年证券、基金从业经验。历任 Longview Partners 资产管理公司数量分析员，高华证券有限责任公司行业及公司研究分析员，2011 年 2 月加入华安基金，历任全球投资部研究员、助理投资经理。2017 年 4 月起担任本基金的基金经理。

注：此处的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日，即以公告日为准。证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、招募说明书等有关基金法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益，不存在违法违规或未履行基金合同承诺的情形。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了《华安基金管理有限公司公平交易管理制度》，将封闭式基金、开放式基金、特定客户资产管理组合及其他投资组合资产在研究分析、投资决策、交易执行等方面全部纳入公平交易管理中。控制措施包括：在研究环节，研究员在为公司管理的各类投资组合提供研究信息、投资建议过程中，使用晨会发言、邮件发送、登录在研究报告管理系统中等方式来确保各类投资组合经理可以公平享有信息获取机会。在投资环节，公司各投资组合经理根据投资组合的风格和投资策略，制定并严格执行交易决策规则，以保证各投资组合交易决策的客观性和独立性。同时严格执行投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体授权机制，投资组合经理在授权范围内自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易环节，公司实行强制公平交易机制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。（1）交易所二级市场业务，遵循价格优先、时间优先、比例分配、综合平衡的控制原则，实现同一时间下达指令的投资组合在交易时机上的公平性。（2）交易所一级市场业务，投资组合经理按意愿独立进行业务申报，集中交易部以投资组合名义对外进行申报。若该业务以公司名义进行申报与中签，则按实际中签情况以价格优先、比例分配原则进行分配。若中签量过小无法合理进行比例分配，且以公司名义获得，则投资部门在合规监察员监督参与下，进行公平协商分配。（3）银行间市场业务遵循指令时间优先原则，先到先询价的控制原则。通过内部共同的 iwind 群，发布询价需求和结果，做到信息公开。若是多个投资组合进行一级市场投标，则各投资组合经理须以各投资组合名义向集中交易部下达投资意向，交易员以此进行投标，以确保中签结果与投资组合投标意向一一对应。若中签量过小无法合理进行比例分配，且以公司名义获得，则投资部门在风险管理部投资监督参与下，进行公平协商分配。交易监控、分析与评估环节，公司风险管理部对公司旗下的各投资组合投资境内证券市场上市交易的投资品种、进行场外的非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购、不同投资组合同日和临近交易日的反向交易以及可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控，根据市场公认的第三方信息（如：中债登的债券估值），定期对各投资组合与交易对手之间议价交易的交易价格公允性进行审查，对不同投资组合临近交易日的同向交易的交易时机和交易价差进行分析。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

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

日内)的本年度同向交易价差进行了专项分析,未发现违反公平交易原则的异常情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

本报告期内,因组合流动性管理或投资策略调整需要,除指数基金以外的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的次数为 4 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

下半年,尤其是 4 季度开始,美国经济见顶,企业盈利增速见顶的预期正在成为市场一致预期,市场对于联储加息预期发生改变,预期 2019 年的加息次数显著下行(1-2 次)。美国加息预期下行,以及美股的调整,导致 1-10 月饱受资金流出影响的新兴市场压力缓解,新兴市场股票跑赢发达市场。

期内 S&P500 指数累计下跌 6.24%, 斯托克 50 指数下跌 14.34%, 而 MSCI 新兴市场指数累计下跌 16.63%, 新兴市场显著跑输发达市场。

香港市场,跟随新兴市场出现震荡走势,恒生指数下跌 13.61%, 恒生国企指数下跌 13.53%。

在报告期内,基于我们对于市场结构的判断,我们看好业绩稳定的内需,医药,公用事业类股(风电,高速公路),以及业绩成长确定性高,财政政策逆周期投资的板块,高铁,5G,基建等有望领先。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2018 年 12 月 31 日,本基金份额净值为 1.076 元,本报告期份额净值增长率为-10.44%,同期业绩比较基准增长率为-10.75%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

对于 2019 年港股,我们判断可能仍是震荡市,前低后高。首先从历史数据来看,港股估值和盈利增长呈现很强的正相关性,在明年上半年宏观仍有下行压力,企业盈利增速仍有大幅下调的

预期下，港股出现估值扩张的可能较小。市场的机会可能在于经济下行迫使政策托底导致的反弹行情。

1 季度我们认为市场进入底部区域，估值继续大幅下行可能较小，部分盈利确定性高的类股或高股息类股，可能获得资金青睐，如果伴随 MSCI 纳入 A 股权重增加，价值股有望跑赢成长股。

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

本报告期内实施了 2018 年度的两次分红。

2018 年度第一次分红，分红方案为：0.630 元/10 份，权益登记日及除息日：2018 年 5 月 29 日；现金红利发放日：2018 年 5 月 30 日。

2018 年度第二次分红，分红方案为：0.560 元/10 份，权益登记日及除息日：2018 年 11 月 14 日；现金红利发放日：2018 年 11 月 15 日。

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关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金实施利润分配的金额为 52,417,697.74。

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 沈熙苑签字出具了安永华明（2019）审字第 60971571_B24 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：华安沪港深通精选灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资产：	-	-

银行存款	104,799,602.82	12,710,483.44
结算备付金	1,562,178.73	5,780,957.32
存出保证金	1,169,093.23	601,417.66
交易性金融资产	341,927,224.69	145,526,006.41
其中：股票投资	341,927,224.69	145,526,006.41
基金投资	-	-
债券投资	-	-
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	-	3,641,827.78
应收利息	27,459.25	6,790.54
应收股利	-	45,600.00
应收申购款	-	616,591.89
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	449,485,558.72	168,929,675.04
负债和所有者权益	本期末 2018 年 12 月 31 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	747,247.75	7,979,206.26
应付赎回款	-	703,058.31
应付管理人报酬	626,716.02	187,996.00
应付托管费	104,452.65	31,332.69

应付销售服务费	-	-
应付交易费用	4,562,149.70	496,318.27
应交税费	1.92	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	330,000.00	361,196.10
负债合计	6,370,568.04	9,759,107.63
所有者权益：	-	-
实收基金	411,937,175.35	120,472,440.16
未分配利润	31,177,815.33	38,698,127.25
所有者权益合计	443,114,990.68	159,170,567.41
负债和所有者权益总计	449,485,558.72	168,929,675.04

注：（1）报告截止日 2018 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.076 元，基金份额总额 411,937,175.35 份。

（2）本基金基金合同于 2017 年 2 月 16 日生效。上年度可比期间为 2017 年 2 月 16 日至 2017 年 12 月 31 日。

7.2 利润表

会计主体：华安沪港深通精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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 2 月 16 日（基金合 同生效日）至 2017 年 12 月 31 日
一、收入	-68,149,943.35	61,633,872.67
1.利息收入	1,132,874.98	772,435.31
其中：存款利息收入	1,132,663.70	453,922.53
债券利息收入	211.28	-

资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	318,512.78
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	-59,557,782.15	50,058,435.21
其中：股票投资收益	-64,566,684.07	46,517,377.81
基金投资收益	-	-
债券投资收益	11,617.29	-
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	4,997,284.63	3,541,057.40
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-11,122,190.22	9,472,559.12
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	1,397,154.04	1,330,443.03
减：二、费用	26,845,701.54	9,068,792.11
1. 管理人报酬	7,717,511.83	3,007,071.14
2. 托管费	1,286,251.86	501,178.47
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	17,497,082.74	5,195,953.78
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 税金及附加	0.70	-
7. 其他费用	344,854.41	364,588.72
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-94,995,644.89	52,565,080.56
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-94,995,644.89	52,565,080.56

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安沪港深通精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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2018 年 1 月 1 日至 2018 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）	120,472,440.16	38,698,127.25	159,170,567.41
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-94,995,644.89	-94,995,644.89
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）	291,464,735.19	139,893,030.71	431,357,765.90
其中：1.基金申购款	640,999,140.70	236,994,134.54	877,993,275.24
2.基金赎回款	-349,534,405.51	-97,101,103.83	-446,635,509.34
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）	-	-52,417,697.74	-52,417,697.74
五、期末所有者权益（基金净值）	411,937,175.35	31,177,815.33	443,114,990.68
项目	上年度可比期间		
	2017 年 2 月 16 日（基金合同生效日）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）	397,870,618.87	-	397,870,618.87
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本	-	52,565,080.56	52,565,080.56

期利润)			
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）	-277,398,178.71	-13,866,953.31	-291,265,132.02
其中：1.基金申购款	144,996,710.71	29,894,415.17	174,891,125.88
2.基金赎回款	-422,394,889.42	-43,761,368.48	-466,156,257.90
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）	120,472,440.16	38,698,127.25	159,170,567.41

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

华安沪港深通精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]1286 号《关于准予华安沪港深通精选灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》以及机构部函[2016]2905 号《关于华安沪港深通精选灵活配置混合型证券投资基金延期募集备案的回函》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 2017 年 2 月 16 日生效，首次设立募集规模为 397,870,618.87 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。

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）、港股通标的股票、债券（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、资产支持证券等）、债券回购、银行存款、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)。

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%,其中投资于国内依法发行上市的股票比例为基金资产的 0-95%,投资于港股通标的股票比例为基金资产的 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%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等;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: 30%×中证 800 指数收益率+30%×恒生综合指数收益率+40%×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 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 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

本基金本报告期无会计估计变更。

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，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金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，本基金的基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对本基金在 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，已纳税额从本基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

7.4.6.3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011 年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

7.4.6.4 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。

7.4.6.5 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。

7.4.6.6 境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127 号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行

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、基金销售机构
国泰君安创新投资有限公司	基金管理人的股东(2018 年 12 月 5 日前)
上海国际信托有限公司	基金管理人的股东(2018 年 12 月 5 日前)
国泰君安证券股份有限公司	基金管理人的股东(自 2018 年 12 月 5 日起)、基金销售机构
上海上国投资产管理有限公司	基金管理人的股东(自 2018 年 12 月 5 日起)
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.根据华安基金管理有限公司于 2018 年 12 月 7 日发布的公告，经华安基金管理有限公司股东会第五十六次会议决议、第五十九次会议决议及中国证券监督管理委员会证监许可[2018]2012 号文核准，华安基金管理有限公司股东国泰君安创新投资有限公司、上海国际信托有限公司将各持有的华安基金管理有限公司 20%的股权分别转让给国泰君安证券股份有限公司和上海上国投资产管理有限公司。自 2018 年 12 月 5 日起，华安基金管理有限公司股东变更为国泰君安证券股份有限公司、上海上国投资产管理有限公司、上海锦江国际投资管理有限公司、上海工业投资（集团）有限公司和国泰君安投资管理股份有限公司。

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年12月31日		上年度可比期间 2017年2月16日（基金合同生效日） 至2017年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的 比例	成交金额	占当期股票成交总额的 比例
国泰君安	47,899,609.11	0.47%	-	-

注：通过国泰君安交易单元进行的交易本期实际期间为 2018 年 12 月 5 日至 12 月 31 日。

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期			
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
国泰君安	38,293.14	0.45%	38,293.14	0.84%
关联方名称	上年度可比期间			
	2017年2月16日（基金合同生效日）至2017年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
国泰君安	-	-	-	-

注：（1）上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

（2）通过国泰君安交易单元进行的交易本期实际期间为 2018 年 12 月 5 日至 12 月 31 日。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018年1月1日至2018年12月31日	2017年2月16日（基金合同生效日）至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	7,717,511.83	3,007,071.14
其中：支付销售机构的客户维护费	2,081,681.83	1,675,066.66

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

$H = E \times \text{基金管理费年费率} / \text{当年天数}$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12 月31日	上年度可比期间 2017年2月16日（基金合同 生效日）至2017年12月31 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,286,251.86	501,178.47

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

$H = E \times \text{基金托管费年费率} / \text{当年天数}$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

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 2018年1月1日至2018年12月31日		上年度可比期间 2017年2月16日（基金合同生效日） 至2017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	104,799,602.82	923,597.75	12,710,483.44	345,915.92

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（2018 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
601860	紫金银行	2018-12-20	2019-01-03	认购新发证券	3.14	3.14	15,970.00	50,145.80	50,145.80	-

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	复牌开盘价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600030	中信证券	2018-12-25	重大事项停牌	16.01	2019-01-10	17.15	789,400.00	12,366,257.00	12,638,294.00	

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2018 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金融资产款余额。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2018 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

7.4.10.1 公允价值

7.4.10.1.1 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。

7.4.10.1.2 以公允价值计量的金融工具

7.4.10.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于 2018 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 329,238,784.89 元，属于第二层次的余额为人民币 12,688,439.80 元，属于第三层次的余额为人民币 0.00 元（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 142,191,006.41 元，属于第二层次的余额为人民币 3,335,000.00 元，属于第三层次的余额为人民币 0.00 元）。

7.4.10.1.2.2 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。

7.4.10.1.2.3 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。

7.4.10.2 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。

7.4.10.3 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。

7.4.10.4 财务报表的批准

本财务报表已于 2019 年 3 月 26 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	341,927,224.69	76.07
	其中：股票	341,927,224.69	76.07
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	106,361,781.55	23.66
7	其他各项资产	1,196,552.48	0.27
8	合计	449,485,558.72	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-

C	制造业	94,909,446.62	21.42
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	10,663,380.00	2.41
E	建筑业	10,876,522.00	2.45
F	批发和零售业	9,414,515.53	2.12
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	17,404,330.00	3.93
J	金融业	23,480,093.60	5.30
K	房地产业	7,298,010.00	1.65
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	174,046,297.75	39.28

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
基础材料	6,965,790.00	1.57
消费者非必需品	7,413,002.48	1.67
金融	25,704,641.30	5.80
医疗保健	21,891,874.53	4.94
工业	13,398,850.40	3.02
信息技术	25,722,830.51	5.81
电信服务	6,883,287.01	1.55
公用事业	23,535,327.82	5.31
房地产	36,365,322.89	8.21
合计	167,880,926.94	37.89

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	01918	融创中国	938,000	20,957,827.80	4.73
2	603605	珀莱雅	426,950	18,815,686.50	4.25
3	00285	比亚迪电子	1,548,380	13,349,835.07	3.01
4	600030	中信证券	789,400	12,638,294.00	2.85
5	600305	恒顺醋业	1,054,200	10,963,680.00	2.47
6	601186	中国铁建	1,000,600	10,876,522.00	2.45
7	600025	华能水电	3,385,200	10,663,380.00	2.41
8	01558	东阳光药	463,800	10,606,558.72	2.39
9	02318	中国平安	170,000	10,300,169.10	2.32
10	01299	友邦保险	174,200	9,921,212.60	2.24

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	02382	舜宇光学科技	83,882,802.41	52.70
2	000717	韶钢松山	80,330,807.93	50.47
3	00700	腾讯控股	76,868,804.57	48.29
4	01918	融创中国	71,859,223.61	45.15
5	00916	龙源电力	68,578,606.89	43.08
6	002110	三钢闽光	64,371,824.15	40.44
7	600258	首旅酒店	64,165,511.26	40.31
8	002475	立讯精密	63,648,920.10	39.99
9	600845	宝信软件	63,605,908.90	39.96
10	601155	新城控股	63,362,108.13	39.81
11	03968	招商银行	56,733,189.92	35.64
12	601888	中国国旅	56,235,880.10	35.33
13	01093	石药集团	55,577,998.17	34.92
14	01030	新城发展控股	54,139,680.75	34.01
15	01177	中国生物制药	53,603,585.94	33.68
16	00753	中国国航	50,707,720.94	31.86
17	01313	华润水泥控股	49,484,039.64	31.09
18	00670	中国东方航空股份	49,107,245.55	30.85

19	00880	澳博控股	46,767,185.29	29.38
20	300122	智飞生物	46,224,540.17	29.04
21	02328	中国财险	46,217,512.37	29.04
22	002236	大华股份	45,234,408.00	28.42
23	01347	华虹半导体	44,553,236.51	27.99
24	02318	中国平安	44,004,375.91	27.65
25	00902	华能国际电力股份	43,666,718.43	27.43
26	00027	银河娱乐	42,524,985.89	26.72
27	000063	中兴通讯	41,603,064.18	26.14
28	300036	超图软件	41,388,554.48	26.00
29	300017	网宿科技	41,350,680.12	25.98
30	002456	欧菲科技	40,659,289.35	25.54
31	00175	吉利汽车	39,778,490.19	24.99
32	600276	恒瑞医药	39,639,262.49	24.90
33	00966	中国太平	39,290,565.27	24.68
34	600305	恒顺醋业	39,288,052.01	24.68
35	01766	中国中车	38,553,193.76	24.22
36	000672	上峰水泥	38,477,501.00	24.17
37	002507	涪陵榨菜	38,349,649.22	24.09
38	000932	华菱钢铁	36,482,839.52	22.92
39	03323	中国建材	35,987,116.20	22.61
40	01055	中国南方航空股份	35,617,503.12	22.38
41	00354	中国软件国际	35,369,396.29	22.22
42	600887	伊利股份	35,209,201.84	22.12
43	000977	浪潮信息	34,965,397.95	21.97
44	600801	华新水泥	34,938,327.80	21.95
45	00857	中国石油股份	34,724,130.17	21.82
46	01299	友邦保险	34,038,652.92	21.39
47	001979	招商蛇口	34,023,874.00	21.38
48	300618	寒锐钴业	33,620,304.00	21.12
49	002281	光迅科技	33,504,392.02	21.05
50	300347	泰格医药	33,269,989.10	20.90
51	01336	新华保险	31,662,985.55	19.89
52	600581	八一钢铁	31,164,711.00	19.58
53	02313	申洲国际	30,588,889.36	19.22
54	601003	柳钢股份	30,107,363.54	18.92
55	00839	中教控股	30,046,322.80	18.88
56	000963	华东医药	29,992,795.25	18.84
57	00570	中国中药	29,817,263.40	18.73
58	002463	沪电股份	29,540,609.95	18.56
59	01398	工商银行	28,740,155.93	18.06
60	000636	风华高科	28,497,269.00	17.90
61	600867	通化东宝	28,394,751.64	17.84
62	01317	枫叶教育	27,620,469.08	17.35

63	600486	扬农化工	26,893,083.00	16.90
64	000703	恒逸石化	26,831,434.90	16.86
65	603605	珀莱雅	26,528,759.03	16.67
66	600282	南钢股份	25,927,808.00	16.29
67	002202	金风科技	25,773,322.93	16.19
68	06169	宇华教育	25,534,496.98	16.04
69	601288	农业银行	24,991,704.00	15.70
70	00998	中信银行	24,902,255.11	15.65
71	000568	泸州老窖	24,346,612.88	15.30
72	03898	中车时代电气	24,342,023.11	15.29
73	002737	葵花药业	24,187,496.12	15.20
74	600048	保利地产	23,814,868.34	14.96
75	02388	中银香港	23,608,691.55	14.83
76	300015	爱尔眼科	23,077,781.82	14.50
77	603799	华友钴业	22,935,574.60	14.41
78	603708	家家悦	22,840,553.94	14.35
79	600720	祁连山	22,383,072.00	14.06
80	002304	洋河股份	22,162,168.66	13.92
81	00813	世茂房地产	22,054,852.55	13.86
82	601233	桐昆股份	21,790,952.53	13.69
83	600519	贵州茅台	21,719,176.98	13.65
84	03380	龙光地产	21,575,060.80	13.55
85	000860	顺鑫农业	21,525,865.18	13.52
86	00268	金蝶国际	21,471,589.77	13.49
87	03883	中国奥园	21,191,215.57	13.31
88	00763	中兴通讯	20,903,982.16	13.13
89	000661	长春高新	20,528,419.00	12.90
90	002044	美年健康	20,260,664.60	12.73
91	601766	中国中车	20,145,693.96	12.66
92	02018	瑞声科技	20,135,158.45	12.65
93	00586	海螺创业	20,073,496.70	12.61
94	02319	蒙牛乳业	19,694,864.58	12.37
95	01658	邮储银行	19,310,210.40	12.13
96	300308	中际旭创	19,293,118.70	12.12
97	00285	比亚迪电子	19,214,310.84	12.07
98	02007	碧桂园	19,175,934.04	12.05
99	000799	酒鬼酒	18,966,723.81	11.92
100	600115	东方航空	18,568,158.78	11.67
101	002916	深南电路	18,449,525.80	11.59
102	02208	金风科技	18,237,221.35	11.46
103	002415	海康威视	18,192,743.61	11.43
104	06869	长飞光纤光缆	17,647,519.07	11.09
105	01813	合景泰富集团	17,364,841.17	10.91
106	600690	青岛海尔	17,174,276.09	10.79

107	02196	复星医药	17,155,126.01	10.78
108	601688	华泰证券	16,975,200.10	10.66
109	00189	东岳集团	16,915,230.80	10.63
110	300207	欣旺达	16,893,549.00	10.61
111	600036	招商银行	16,756,588.00	10.53
112	03888	金山软件	16,742,070.83	10.52
113	01088	中国神华	15,971,010.51	10.03
114	600782	新钢股份	15,962,082.32	10.03
115	002195	二三四五	15,810,092.20	9.93
116	300012	华测检测	15,693,354.66	9.86
117	300146	汤臣倍健	15,294,086.72	9.61
118	002709	天赐材料	15,106,986.00	9.49
119	300059	东方财富	14,931,504.18	9.38
120	01171	兖州煤业股份	14,825,709.36	9.31
121	600196	复星医药	14,818,105.03	9.31
122	01128	永利澳门	14,568,880.16	9.15
123	300567	精测电子	13,771,616.00	8.65
124	00868	信义玻璃	13,603,841.87	8.55
125	000895	双汇发展	13,480,585.28	8.47
126	601006	大秦铁路	13,210,418.30	8.30
127	600062	华润双鹤	13,124,321.24	8.25
128	00347	鞍钢股份	12,999,878.49	8.17
129	00762	中国联通	12,956,138.99	8.14
130	000858	五 粮 液	12,931,489.91	8.12
131	600711	盛屯矿业	12,903,664.00	8.11
132	603313	梦百合	12,890,498.69	8.10
133	002466	天齐锂业	12,881,636.10	8.09
134	002027	分众传媒	12,871,248.20	8.09
135	000002	万 科 A	12,855,247.00	8.08
136	600808	马钢股份	12,842,121.56	8.07
137	002024	苏宁易购	12,722,028.04	7.99
138	002478	常宝股份	12,620,064.92	7.93
139	000961	中南建设	12,588,463.00	7.91
140	600596	新安股份	12,574,233.52	7.90
141	00883	中国海洋石油	12,474,016.92	7.84
142	02202	万科企业	12,443,187.90	7.82
143	300532	今天国际	12,369,244.44	7.77
144	600030	中信证券	12,366,257.00	7.77
145	600507	方大特钢	12,344,270.84	7.76
146	600809	山西汾酒	12,263,382.00	7.70
147	600569	安阳钢铁	12,236,329.28	7.69
148	603359	东珠生态	12,080,901.88	7.59
149	002727	一心堂	12,052,590.00	7.57
150	01099	国药控股	11,939,774.45	7.50

151	603589	口子窖	11,691,624.63	7.35
152	01257	中国光大绿色环保	11,399,948.44	7.16
153	00817	中国金茂	11,305,693.90	7.10
154	601390	中国中铁	11,153,571.84	7.01
155	600007	中国国贸	11,143,794.31	7.00
156	01558	东阳光药	11,141,582.63	7.00
157	601600	中国铝业	11,132,113.00	6.99
158	600298	安琪酵母	11,038,436.83	6.93
159	000968	蓝焰控股	10,940,819.67	6.87
160	000651	格力电器	10,920,739.95	6.86
161	02883	中海油田服务	10,854,344.43	6.82
162	601877	正泰电器	10,813,376.38	6.79
163	300394	天孚通信	10,802,957.09	6.79
164	600498	烽火通信	10,741,552.95	6.75
165	002518	科士达	10,704,772.42	6.73
166	600754	锦江股份	10,703,540.19	6.72
167	002384	东山精密	10,559,853.64	6.63
168	002142	宁波银行	10,496,993.84	6.59
169	600025	华能水电	10,420,423.00	6.55
170	01339	中国人民保险集团	10,381,076.63	6.52
171	00384	中国燃气	10,317,477.39	6.48
172	601186	中国铁建	10,314,857.00	6.48
173	300365	恒华科技	10,242,541.00	6.43
174	601607	上海医药	10,222,867.80	6.42
175	600803	新奥股份	10,175,268.40	6.39
176	000022	深赤湾 A	10,107,204.67	6.35
177	00656	复星国际	10,020,431.65	6.30
178	000629	攀钢钒钛	9,955,952.31	6.25
179	601668	中国建筑	9,917,518.00	6.23
180	01044	恒安国际	9,868,342.31	6.20
181	00011	恒生银行	9,762,331.54	6.13
182	603387	基蛋生物	9,722,056.60	6.11
183	06881	中国银河	9,649,649.53	6.06
184	02607	上海医药	9,604,064.79	6.03
185	600521	华海药业	9,563,985.50	6.01
186	00386	中国石油化工股份	9,532,541.82	5.99
187	300178	腾邦国际	9,371,700.03	5.89
188	600529	山东药玻	9,357,874.00	5.88
189	603156	养元饮品	9,327,089.25	5.86
190	002001	新 和 成	9,268,055.00	5.82
191	300168	万达信息	8,913,942.84	5.60
192	002867	周大生	8,833,269.64	5.55
193	01530	三生制药	8,723,291.03	5.48
194	01186	中国铁建	8,699,102.72	5.47

195	600332	白云山	8,683,868.80	5.46
196	600197	伊力特	8,581,978.00	5.39
197	601111	中国国航	8,540,517.00	5.37
198	002597	金禾实业	8,540,171.00	5.37
199	300377	赢时胜	8,350,699.00	5.25
200	002439	启明星辰	8,056,479.00	5.06
201	000333	美的集团	8,052,240.00	5.06
202	00388	香港交易所	7,979,976.98	5.01
203	01997	九龙仓置业	7,930,680.76	4.98
204	002690	美亚光电	7,890,675.35	4.96
205	00958	华能新能源	7,732,670.57	4.86
206	002033	丽江旅游	7,653,585.34	4.81
207	600216	浙江医药	7,376,438.67	4.63
208	01288	农业银行	7,276,882.13	4.57
209	002648	卫星石化	7,156,071.00	4.50
210	01818	招金矿业	7,079,107.73	4.45
211	00914	海螺水泥	7,003,815.54	4.40
212	03933	联邦制药	6,899,141.90	4.33
213	02869	绿城服务	6,846,359.59	4.30
214	002714	牧原股份	6,740,633.00	4.23
215	603707	健友股份	6,739,266.00	4.23
216	00981	中芯国际	6,728,384.41	4.23
217	002661	克明面业	6,654,208.79	4.18
218	600600	青岛啤酒	6,653,998.00	4.18
219	00004	九龙仓集团	6,548,126.40	4.11
220	002680	*ST 长生	6,478,176.15	4.07
221	002341	新纶科技	6,432,220.00	4.04
222	002851	麦格米特	6,426,352.62	4.04
223	002094	青岛金王	6,424,667.00	4.04
224	01919	中远海控	6,424,568.97	4.04
225	00788	中国铁塔	6,395,181.97	4.02
226	002217	合力泰	6,391,532.00	4.02
227	300326	凯利泰	6,377,662.62	4.01
228	00884	旭辉控股集团	6,311,689.70	3.97
229	002422	科伦药业	6,299,115.00	3.96
230	002707	众信旅游	6,288,325.00	3.95
231	02331	李宁	6,267,177.99	3.94
232	06837	海通证券	6,255,674.83	3.93
233	601228	广州港	6,243,232.32	3.92
234	600188	兖州煤业	6,243,207.00	3.92
235	000852	石化机械	6,208,796.20	3.90
236	000100	TCL 集团	6,176,400.00	3.88
237	002318	久立特材	6,152,556.80	3.87
238	00874	白云山	6,085,038.07	3.82

239	002321	华英农业	6,037,608.21	3.79
240	00688	中国海外发展	6,024,058.15	3.78
241	00066	港铁公司	6,017,052.69	3.78
242	00598	中国外运	5,978,998.86	3.76
243	603986	兆易创新	5,918,574.00	3.72
244	002191	劲嘉股份	5,837,901.00	3.67
245	603288	海天味业	5,764,815.00	3.62
246	00291	华润啤酒	5,721,331.50	3.59
247	603338	浙江鼎力	5,706,742.27	3.59
248	002258	利尔化学	5,562,320.00	3.49
249	002749	国光股份	5,527,199.60	3.47
250	03899	中集安瑞科	5,481,542.29	3.44
251	000709	河钢股份	5,427,505.00	3.41
252	603096	新经典	5,391,666.00	3.39
253	002353	杰瑞股份	5,383,892.00	3.38
254	002673	西部证券	5,378,644.28	3.38
255	601225	陕西煤业	5,331,632.00	3.35
256	600055	万东医疗	5,322,687.00	3.34
257	601857	中国石油	5,269,534.00	3.31
258	603508	思维列控	5,258,481.00	3.30
259	02357	中航科工	5,106,792.09	3.21
260	300257	开山股份	5,100,972.00	3.20
261	01193	华润燃气	5,023,106.06	3.16
262	00968	信义光能	5,003,581.59	3.14
263	002531	天顺风能	4,923,239.22	3.09
264	300226	上海钢联	4,790,563.00	3.01
265	02282	美高梅中国	4,610,747.29	2.90
266	601992	金隅集团	4,276,448.65	2.69
267	002343	慈文传媒	4,207,588.00	2.64
268	06886	HTSC	4,179,441.63	2.63
269	03908	中金公司	4,108,848.02	2.58
270	603659	璞泰来	4,080,610.63	2.56
271	300559	佳发教育	3,979,064.77	2.50
272	002242	九阳股份	3,921,994.00	2.46
273	01458	周黑鸭	3,797,634.49	2.39
274	02689	玖龙纸业	3,709,693.76	2.33
275	600138	中青旅	3,644,233.00	2.29
276	600763	通策医疗	3,628,339.10	2.28
277	600340	华夏幸福	3,594,420.00	2.26
278	01208	五矿资源	3,309,567.49	2.08

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	02382	舜宇光学科技	83,643,125.76	52.55
2	00700	腾讯控股	83,332,548.16	52.35
3	000717	韶钢松山	78,361,012.89	49.23
4	002110	三钢闽光	65,604,873.71	41.22
5	00916	龙源电力	64,632,167.04	40.61
6	601155	新城控股	63,033,129.42	39.60
7	600258	首旅酒店	62,596,100.34	39.33
8	002475	立讯精密	60,347,403.43	37.91
9	01093	石药集团	59,911,092.63	37.64
10	601888	中国国旅	58,497,323.90	36.75
11	03968	招商银行	57,183,316.37	35.93
12	00670	中国东方航空股份	54,299,371.52	34.11
13	600845	宝信软件	52,590,397.77	33.04
14	00753	中国国航	52,538,730.20	33.01
15	01918	融创中国	52,226,244.07	32.81
16	01177	中国生物制药	51,330,534.90	32.25
17	01030	新城发展控股	50,689,265.67	31.85
18	01347	华虹半导体	50,390,144.19	31.66
19	02328	中国财险	48,637,857.10	30.56
20	00880	澳博控股	48,636,172.18	30.56
21	01313	华润水泥控股	47,478,630.23	29.83
22	000063	中兴通讯	46,850,186.83	29.43
23	300122	智飞生物	46,236,600.64	29.05
24	00966	中国太平	44,734,476.51	28.10
25	300017	网宿科技	44,676,402.21	28.07
26	01766	中国中车	44,506,009.39	27.96
27	002236	大华股份	44,482,482.41	27.95
28	01055	中国南方航空股份	42,652,950.21	26.80
29	600276	恒瑞医药	41,043,681.76	25.79
30	300036	超图软件	40,831,446.53	25.65
31	002456	欧菲科技	40,363,481.70	25.36
32	00027	银河娱乐	39,757,737.09	24.98
33	00175	吉利汽车	39,521,560.41	24.83
34	000672	上峰水泥	38,089,764.25	23.93
35	000932	华菱钢铁	37,726,708.13	23.70
36	002507	涪陵榨菜	37,257,553.68	23.41
37	02313	申洲国际	36,848,880.51	23.15
38	03323	中国建材	36,697,240.09	23.06
39	600887	伊利股份	36,610,286.24	23.00

40	02318	中国平安	36,550,566.07	22.96
41	300347	泰格医药	36,515,478.27	22.94
42	00857	中国石油股份	34,741,016.92	21.83
43	00902	华能国际电力股份	34,674,878.65	21.78
44	300618	寒锐钴业	33,747,371.39	21.20
45	001979	招商蛇口	33,585,828.16	21.10
46	00354	中国软件国际	33,399,261.49	20.98
47	600801	华新水泥	33,145,233.72	20.82
48	002281	光迅科技	32,994,723.84	20.73
49	000977	浪潮信息	32,922,370.98	20.68
50	01336	新华保险	31,595,132.38	19.85
51	600581	八一钢铁	31,292,080.32	19.66
52	01398	工商银行	31,203,195.23	19.60
53	600305	恒顺醋业	31,051,491.50	19.51
54	002463	沪电股份	29,870,493.29	18.77
55	600867	通化东宝	29,526,141.12	18.55
56	000963	华东医药	29,436,651.80	18.49
57	601003	柳钢股份	28,963,827.68	18.20
58	000703	恒逸石化	28,614,607.70	17.98
59	000636	风华高科	28,531,950.71	17.93
60	01317	枫叶教育	28,455,143.43	17.88
61	600486	扬农化工	27,821,810.51	17.48
62	600282	南钢股份	27,114,704.00	17.03
63	002202	金风科技	26,514,870.39	16.66
64	01299	友邦保险	24,987,018.68	15.70
65	601288	农业银行	24,775,442.73	15.57
66	002737	葵花药业	24,659,736.19	15.49
67	00998	中信银行	24,263,293.91	15.24
68	300015	爱尔眼科	23,911,805.72	15.02
69	02388	中银香港	23,579,310.18	14.81
70	000568	泸州老窖	23,471,814.56	14.75
71	00839	中教控股	23,303,831.88	14.64
72	603799	华友钴业	21,889,809.76	13.75
73	600720	祁连山	21,718,271.46	13.64
74	000860	顺鑫农业	21,678,094.22	13.62
75	03380	龙光地产	21,579,461.97	13.56
76	00570	中国中药	20,823,185.45	13.08
77	600036	招商银行	20,712,141.33	13.01
78	06169	宇华教育	20,709,834.17	13.01
79	002304	洋河股份	20,242,343.10	12.72
80	601233	桐昆股份	20,221,291.75	12.70
81	600519	贵州茅台	20,131,636.00	12.65
82	01171	兖州煤业股份	19,992,746.65	12.56
83	601766	中国中车	19,978,377.67	12.55

84	600115	东方航空	19,962,197.75	12.54
85	00586	海螺创业	19,786,654.21	12.43
86	03883	中国奥园	19,776,186.75	12.42
87	00813	世茂房地产	19,766,598.91	12.42
88	01658	邮储银行	19,752,842.86	12.41
89	002044	美年健康	19,665,924.30	12.36
90	02319	蒙牛乳业	19,407,853.62	12.19
91	00268	金蝶国际	18,859,181.73	11.85
92	002916	深南电路	18,448,392.48	11.59
93	000799	酒鬼酒	18,420,366.46	11.57
94	02018	瑞声科技	18,395,717.91	11.56
95	300308	中际旭创	18,253,941.20	11.47
96	06869	长飞光纤光缆	17,958,105.66	11.28
97	600048	保利地产	17,570,672.72	11.04
98	600782	新钢股份	17,186,597.07	10.80
99	02196	复星医药	16,940,328.48	10.64
100	002415	海康威视	16,855,017.97	10.59
101	000002	万 科 A	16,748,259.39	10.52
102	03898	中车时代电气	16,373,485.19	10.29
103	300012	华测检测	16,296,760.55	10.24
104	002195	二三四五	15,939,456.70	10.01
105	02208	金风科技	15,877,743.29	9.98
106	300207	欣旺达	15,843,789.28	9.95
107	03888	金山软件	15,841,037.14	9.95
108	600690	青岛海尔	15,432,359.50	9.70
109	00189	东岳集团	15,311,259.62	9.62
110	002001	新 和 成	15,200,305.53	9.55
111	00868	信义玻璃	15,116,843.36	9.50
112	300059	东方财富	15,009,653.08	9.43
113	600196	复星医药	14,912,240.56	9.37
114	01088	中国神华	14,773,615.36	9.28
115	601600	中国铝业	14,709,000.00	9.24
116	01128	永利澳门	14,372,131.36	9.03
117	000895	双汇发展	14,004,648.32	8.80
118	300146	汤臣倍健	13,950,715.00	8.76
119	300567	精测电子	13,945,605.00	8.76
120	603589	口子窖	13,656,113.00	8.58
121	00817	中国金茂	13,605,220.65	8.55
122	00347	鞍钢股份	13,515,311.10	8.49
123	00883	中国海洋石油	13,197,106.26	8.29
124	00763	中兴通讯	13,136,898.69	8.25
125	000961	中南建设	13,110,376.52	8.24
126	600062	华润双鹤	13,043,026.16	8.19
127	600711	盛屯矿业	13,001,651.72	8.17

128	603708	家家悦	12,983,451.65	8.16
129	000858	五 粮 液	12,978,558.99	8.15
130	600596	新安股份	12,958,795.00	8.14
131	002466	天齐锂业	12,817,629.60	8.05
132	600808	马钢股份	12,811,656.00	8.05
133	00762	中国联通	12,805,207.92	8.04
134	01099	国药控股	12,484,445.12	7.84
135	300532	今天国际	12,451,273.36	7.82
136	601688	华泰证券	12,424,476.00	7.81
137	603359	东珠生态	12,375,023.34	7.77
138	000661	长春高新	12,327,280.00	7.74
139	600507	方大特钢	12,197,081.90	7.66
140	01044	恒安国际	12,087,753.06	7.59
141	600569	安阳钢铁	11,982,007.00	7.53
142	002024	苏宁易购	11,914,015.00	7.49
143	002478	常宝股份	11,883,771.21	7.47
144	601006	大秦铁路	11,800,385.00	7.41
145	000333	美的集团	11,779,483.32	7.40
146	01813	合景泰富集团	11,679,498.19	7.34
147	000968	蓝焰控股	11,598,477.95	7.29
148	02202	万科企业	11,578,101.07	7.27
149	002727	一心堂	11,521,410.54	7.24
150	002518	科士达	11,406,986.26	7.17
151	002027	分众传媒	11,396,740.40	7.16
152	600809	山西汾酒	11,314,067.87	7.11
153	601877	正泰电器	11,277,923.00	7.09
154	000651	格力电器	10,899,411.04	6.85
155	600007	中国国贸	10,893,010.50	6.84
156	002142	宁波银行	10,757,705.70	6.76
157	02883	中海油田服务	10,693,694.40	6.72
158	601668	中国建筑	10,505,951.00	6.60
159	600754	锦江股份	10,495,324.35	6.59
160	002384	东山精密	10,425,179.82	6.55
161	601390	中国中铁	10,405,859.00	6.54
162	01257	中国光大绿色环保	10,321,773.18	6.48
163	01339	中国人民保险集团	10,249,351.19	6.44
164	600298	安琪酵母	10,232,785.94	6.43
165	300394	天孚通信	10,221,248.68	6.42
166	000629	攀钢钒钛	10,162,388.00	6.38
167	00656	复星国际	10,128,562.05	6.36
168	06881	中国银河	9,942,498.58	6.25
169	02007	碧桂园	9,894,625.38	6.22
170	601607	上海医药	9,584,530.47	6.02
171	00011	恒生银行	9,533,833.47	5.99

172	300178	腾邦国际	9,378,993.04	5.89
173	600521	华海药业	9,329,883.60	5.86
174	600803	新奥股份	9,296,397.59	5.84
175	00386	中国石油化工股份	9,239,738.15	5.80
176	000022	深赤湾 A	9,116,787.09	5.73
177	603156	养元饮品	9,113,934.47	5.73
178	603387	基蛋生物	9,059,156.20	5.69
179	02607	上海医药	8,856,383.42	5.56
180	603605	珀莱雅	8,697,772.00	5.46
181	01186	中国铁建	8,619,588.85	5.42
182	601111	中国国航	8,552,700.00	5.37
183	002597	金禾实业	8,233,876.57	5.17
184	600332	白云山	8,145,267.26	5.12
185	300168	万达信息	8,097,685.24	5.09
186	002867	周大生	8,053,338.03	5.06
187	603338	浙江鼎力	8,026,631.39	5.04
188	002033	丽江旅游	7,881,600.59	4.95
189	00958	华能新能源	7,847,647.95	4.93
190	600197	伊力特	7,823,398.00	4.92
191	300377	赢时胜	7,795,748.05	4.90
192	01997	九龙仓置业	7,686,234.57	4.83
193	002439	启明星辰	7,556,286.00	4.75
194	00285	比亚迪电子	7,505,666.77	4.72
195	02869	绿城服务	7,334,510.60	4.61
196	02282	美高梅中国	7,256,411.51	4.56
197	00388	香港交易所	7,176,331.51	4.51
198	600216	浙江医药	7,009,883.80	4.40
199	002648	卫星石化	6,975,682.32	4.38
200	002422	科伦药业	6,920,092.05	4.35
201	600600	青岛啤酒	6,876,148.00	4.32
202	01288	农业银行	6,758,481.11	4.25
203	00914	海螺水泥	6,498,112.16	4.08
204	002094	青岛金王	6,483,201.00	4.07
205	00004	九龙仓集团	6,479,161.06	4.07
206	03933	联邦制药	6,461,784.36	4.06
207	603707	健友股份	6,436,221.00	4.04
208	603288	海天味业	6,309,120.89	3.96
209	300326	凯利泰	6,266,402.96	3.94
210	00884	旭辉控股集团	6,233,229.08	3.92
211	002707	众信旅游	6,196,366.19	3.89
212	002680	*ST 长生	6,134,376.00	3.85
213	000100	TCL 集团	6,110,174.00	3.84
214	00874	白云山	6,103,900.53	3.83
215	002851	麦格米特	6,095,781.50	3.83

216	00688	中国海外发展	6,073,694.09	3.82
217	02331	李宁	6,063,467.21	3.81
218	01919	中远海控	6,012,309.27	3.78
219	002661	克明面业	6,006,578.03	3.77
220	002318	久立特材	5,999,662.36	3.77
221	00291	华润啤酒	5,999,105.62	3.77
222	002321	华英农业	5,981,763.00	3.76
223	00981	中芯国际	5,981,197.61	3.76
224	601228	广州港	5,974,116.00	3.75
225	600188	兖州煤业	5,947,331.60	3.74
226	002191	劲嘉股份	5,942,457.46	3.73
227	002714	牧原股份	5,885,997.90	3.70
228	00066	港铁公司	5,869,220.72	3.69
229	002341	新纶科技	5,829,216.79	3.66
230	03899	中集安瑞科	5,687,202.54	3.57
231	002217	合力泰	5,684,400.26	3.57
232	01530	三生制药	5,538,560.65	3.48
233	002353	杰瑞股份	5,535,111.43	3.48
234	603986	兆易创新	5,476,718.00	3.44
235	000709	河钢股份	5,431,598.99	3.41
236	601225	陕西煤业	5,140,754.61	3.23
237	000852	石化机械	5,139,081.73	3.23
238	603508	思维列控	5,098,627.00	3.20
239	603369	今世缘	5,080,675.00	3.19
240	603096	新经典	5,031,575.00	3.16
241	601857	中国石油	5,004,257.52	3.14
242	002258	利尔化学	4,927,227.99	3.10
243	603313	梦百合	4,744,974.24	2.98
244	01193	华润燃气	4,690,741.64	2.95
245	01208	五矿资源	4,641,491.79	2.92
246	600055	万东医疗	4,542,446.40	2.85
247	02357	中航科工	4,541,940.32	2.85
248	002531	天顺风能	4,532,412.79	2.85
249	002709	天赐材料	4,299,952.00	2.70
250	300226	上海钢联	4,231,843.00	2.66
251	601992	金隅集团	4,047,251.00	2.54
252	600340	华夏幸福	3,982,393.00	2.50
253	002343	慈文传媒	3,938,318.00	2.47
254	603659	璞泰来	3,892,558.00	2.45
255	002242	九阳股份	3,878,815.00	2.44
256	03908	中金公司	3,855,632.43	2.42
257	06886	HTSC	3,789,606.47	2.38
258	600763	通策医疗	3,780,995.00	2.38
259	00384	中国燃气	3,650,673.41	2.29

260	02689	玖龙纸业	3,615,452.76	2.27
261	600138	中青旅	3,599,904.00	2.26
262	01513	丽珠医药	3,553,548.77	2.23
263	300559	佳发教育	3,528,326.40	2.22
264	01458	周黑鸭	3,477,819.02	2.18
265	002271	东方雨虹	3,374,918.40	2.12
266	600660	福耀玻璃	3,202,902.00	2.01

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	5,287,248,210.18
卖出股票的收入（成交）总额	5,015,158,117.61

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

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

本基金本报告期末未持有债券投资。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证投资。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金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

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

无。

8.12 投资组合报告附注

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

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

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,169,093.23
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	27,459.25
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,196,552.48

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600030	中信证券	12,638,294.00	2.85	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
18,702	22,026.37	114,881,498.11	27.89%	297,055,677.24	72.11%

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	343,841.31	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(2017 年 2 月 16 日)基金份额总额	397,870,618.87
--------------------------------	----------------

本报告期期初基金份额总额	120,472,440.16
本报告期基金总申购份额	640,999,140.70
减：本报告期基金总赎回份额	349,534,405.51
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	411,937,175.35

§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。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内无基金投资策略的改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘为基金审计的会计师事务所。

报告年度应支付给聘任会计师事务所的报酬为人民币 70,000.00 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

2018 年 4 月，针对上海证监局向公司出具的《关于对华安基金管理有限公司采取责令改正措施的决定》，公司高度重视，逐一落实各项整改要求，针对性地制定、实施整改措施，进一步提升公司内部控制和风险管理能力。2018 年 5 月，公司已通过上海证监局的检查验收。

除上述情况外，本报告期内无管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

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	
财富证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
中山证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	3	-	-	-	-	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
联讯证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
广州证券	2	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	3	3,009,541,707.38	29.22%	2,415,812.89	28.45%	-
国泰君安	1	1,898,180,177.30	18.43%	1,485,883.97	17.50%	-
中泰证券	1	1,041,752,284.60	10.11%	826,668.89	9.74%	-
光大证券	2	1,039,755,339.88	10.09%	814,442.83	9.59%	-
中金公司	1	826,593,185.10	8.03%	755,360.38	8.90%	-
兴业证券	1	654,283,979.09	6.35%	602,386.09	7.09%	-
中信证券	1	584,290,280.00	5.67%	536,178.11	6.31%	-
天风证券	2	503,124,602.51	4.88%	398,455.45	4.69%	-
长江证券	2	304,353,907.51	2.95%	281,495.70	3.31%	-
银河证券	1	138,616,563.42	1.35%	126,726.94	1.49%	-
申万宏源	3	120,533,611.20	1.17%	93,522.56	1.10%	-
广发证券	1	91,851,394.11	0.89%	82,263.65	0.97%	-
中信建投	1	50,603,729.62	0.49%	43,380.68	0.51%	-
上海证券	2	23,458,861.94	0.23%	20,000.51	0.24%	-

华泰证券	1	12,875,415.00	0.13%	9,012.78	0.11%	-
------	---	---------------	-------	----------	-------	---

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：

2018 年 4 月完成租用托管在建设银行的财通证券深圳 006004 交易单元

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债	成交金额	占当期回	成交金额	占当期权

		券成交总 额的比例		购成交总 额的比例		证成交总 额的比例
中信证券	640,834.90	100.00%	-	-	-	-

华安基金管理有限公司

二〇一九年三月三十日