

**华安智增精选灵活配置混合型证券投资基金**  
**2016 年年度报告摘要**  
**2016 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：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一七年三月二十八日

## §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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 3 月 24 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 2016 年 9 月 13 日起至 12 月 31 日止。

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	华安智增精选灵活配置混合
场内简称	华安智增
基金主代码	160421
交易代码	160421
基金运作方式	契约型
基金合同生效日	2016 年 9 月 13 日
基金管理人	华安基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,308,431,590.50 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金将灵活运用多种投资策略，充分挖掘和利用市场中潜在的投资机会，力争为基金份额持有人创造长期稳定的投资回报。
投资策略	<p>本基金将通过分析国内外政治经济环境、经济基本面状况、宏观政策变化、金融市场形势等多方面因素，通过对货币市场、债券市场和股票市场的整体估值状况比较分析，对各主要投资品种市场的未来发展趋势进行研判，根据判断结果进行资产配置及组合的构建，确定基金在股票、债券、货币市场工具等资产类别上的投资比例，并随着各类资产风险收益特征的相对变化，适时动态调整各资产类别的投资比例，在控制投资组合整体风险基础上力争提高收益。</p> <p>基金管理人通过密切关注已经实施完定向增发且还处于锁定期的上市公司，当股价跌破定向增发价或者具备投资价值时，通过考虑定向增发数量、发行对象、大股东认购、锁定期、定向增发资金运用目的等因素，结合发行人行业背景、市场地位、核心技、股东和管理层情况、持续经营情况等信息，结合当前股价技术面情况，在定向增发股票达到一定投资价值后择机买入，在定向增发股票解禁日临近或定向增发股票解禁后择机卖出。</p>

业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×50%+中国债券总指数收益率 ×50%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于中高预期收益风险水平的投资品种。

### 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	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	钱鲲	郭明
	联系电话	021-38969999	010-66105799
	电子邮箱	qiankun@huaan.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4008850099	95588
传真		021-68863414	010-66105798

### 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	2016 年 9 月 13 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日
本期已实现收益	9,181,934.24
本期利润	-42,303,382.78
加权平均基金份额本期利润	-0.0323
本期基金份额净值增长率	-3.23%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末

期末可供分配基金份额利润	-0.0323
期末基金资产净值	1,266,128,207.72
期末基金份额净值	0.9677

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、本基金于 2016 年 9 月 13 日成立。截止本报告期末，本基金成立不足一年。

5、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	-3.48%	0.61%	-0.42%	0.40%	-3.06%	0.21%
自基金合同生效起至今	-3.23%	0.56%	-0.40%	0.39%	-2.83%	0.17%

注：本基金业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×50%+中国债券总指数收益率×50%

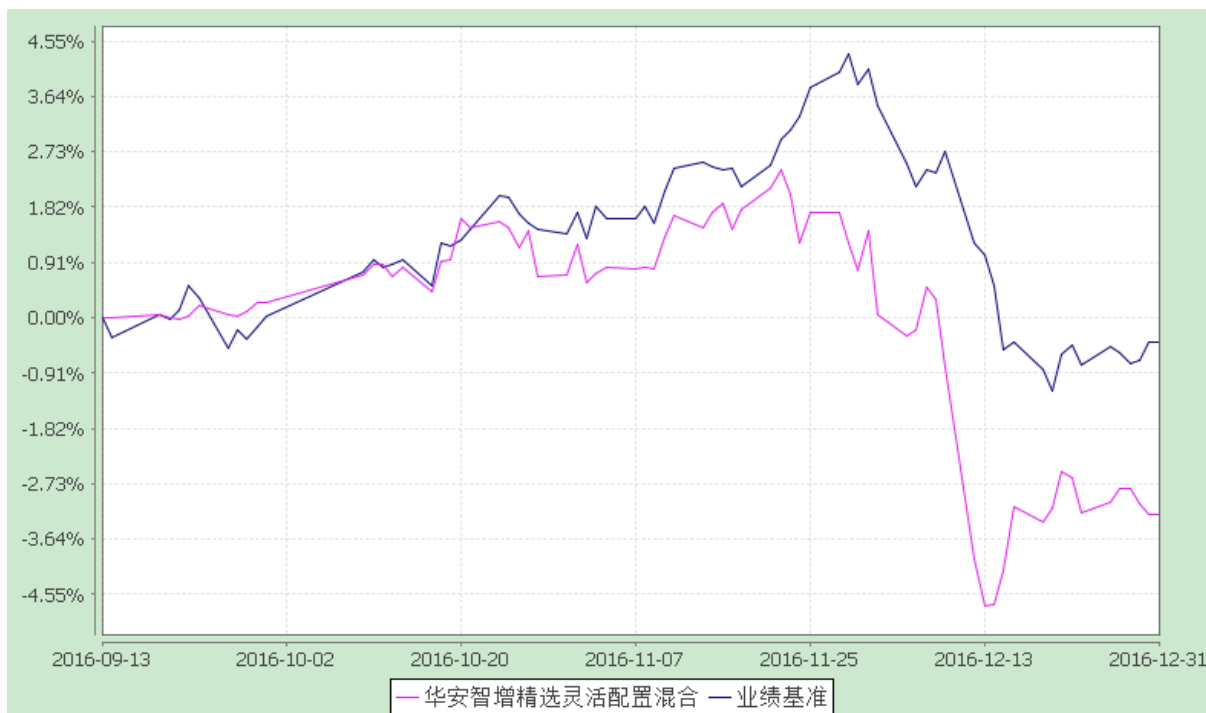
本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票）、权证、股指期货、固定收益资产（国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债券、中小企业私募债、中期票据、可转换债券（含分离交易可转债）、短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单等）以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

本基金组合投资比例为：封闭期内股票资产占基金资产的比例为 0%-100%；转为上市开放式基金（LOF）后股票资产占基金资产的比例为 0%-95%。

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

较

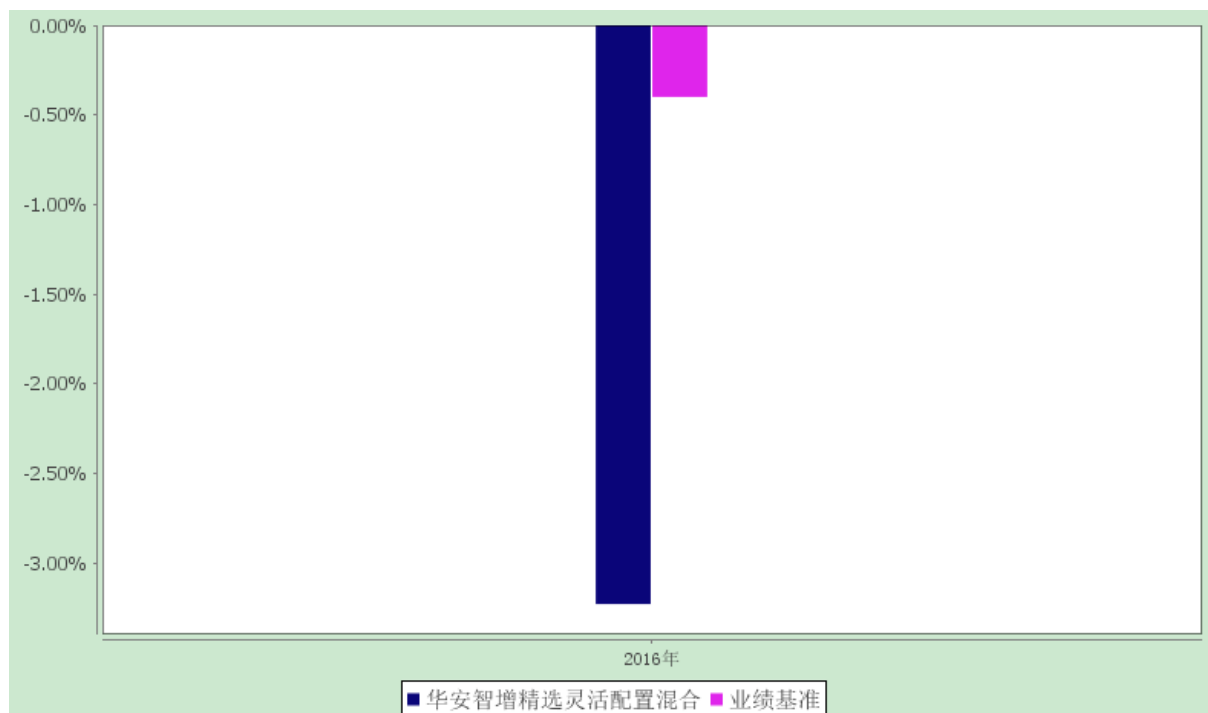
华安智增精选灵活配置混合型证券投资基金  
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图  
(2016 年 9 月 13 日至 2016 年 12 月 31 日)



注：本基金于 2016 年 9 月 13 日成立，2017 年 3 月 12 日建仓期截止。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华安智增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

本基金没有利润分配。

## §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。目前的股东为上海电气（集团）总公司、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投资管理股份有限公司。

截至 2016 年 12 月 31 日，公司旗下共管理华安创新混合、华安中国 A 股增强指数、华安现金富利货币、华安宝利配置混合、华安宏利混合、华安中小盘成长混合、华安策略优选混合、华安核心优选混合、华安稳定收益债券、华安动态灵活混合、华安强化收益债券、华安行业轮动混合、华安上证 180ETF、华安上证 180ETF 联接、华安上证龙头 ETF、华安上证龙头 ETF 联接、华安升级主题混合、华安稳固收益债券、华安可转债、华安深证 300 指数（LOF）、华安科技动力混合、华安信用四季红债券、华安香港精选股票、华安大中华升级股票、华安标普石油指数基金（QDII-

LOF)、华安月月鑫短期理财债券、华安季季鑫短期理财债券、华安月安鑫短期理财债券、华安沪深 300 指数分级、华安逆向策略混合、华安日日鑫货币、华安安心收益债券、华安信用增强债券、华安纯债、华安保本混合、华安双债添利债券、华安安信消费混合、华安纳斯达克 100 指数、华安黄金易 ETF、华安黄金 ETF 联接、华安沪深 300 量化增强、华安年年红债券、华安生态优先混合、华安中证细分医药 ETF、华安大国新经济股票、华安新活力混合、华安安顺灵活配置混合、华安汇财通货币、华安国际龙头 (DAX) ETF、华安国际龙头 (DAX) ETF 联接、华安中证细分医药 ETF 联接、华安安享灵活配置混合、华安年年盈定期开放债券、华安物联网主题股票、华安新丝路主题股票、华安新动力灵活配置混合、华安智能装备主题股票、华安媒体互联网混合、华安新机遇保本混合、华安新优选灵活配置混合、华安新回报灵活配置混合、华安中证全指证券指数分级、华安中证银行指数分级、华安国企改革主题混合、华安添颐养老混合发起式、华安创业板 50 指数分级、华安新乐享保本混合、华安安益保本混合、华安乐惠保本混合、华安安康保本混合、华安安华保本混合、华安沪港深外延增长混合、华安全球美元收益债券、华安安禧保本混合、华安全球美元票息债券、华安创业板 50ETF、华安安进保本混合发起式、华安聚利 18 个月定开债、华安智增精选灵活配置混合、华安新财富灵活配置混合、华安安润灵活配置混合、华安睿享定开混合发起式、华安新希望灵活配置混合、华安鼎丰债券发起式、华安新瑞利灵活配置混合、华安新泰利灵活配置混合、华安新恒利灵活配置混合、华安事件驱动量化策略混合、华安新丰利灵活配置混合等 89 只开放式基金。管理资产规模达到 1632.85 亿元人民币。

#### 4.1.2 基金经理 (或基金经理小组) 及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 (助理) 期限		证券从业 年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘伟亭	本基金的基金 经理	2016-09- 13	-	11 年	硕士研究生, 11 年证券、基金从业经验, 曾任长江巴黎百富勤证券有限公司助理经理、国海富兰克林基金基金经理。2015 年 6 月加入华安基金管理有限公司, 2015 年 9 月起担任华安宝利配置证券投资基金及华安生态优先混合型证券投资基金的基金经理。2016 年 9 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 9 次，未出现异常交易。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金成立于 3 季度末，成立以来，宏观经济环境逐步好转，通胀预期渐起；流动性上，国内以控制系统性金融风险为目的而逐步加力的杠杆管控则进一步压制了国内流动性的改善预期，宽松环境的延续和宽松预期的扭转表明宽松已过最优时。所以市场总体保持一个震荡格局，热点轮动特征较为明显，投资可操作性尚可，由于本基金是以有选择性的参与定增作为核心策略，在建仓期间，我们着眼于投资标的一年后的表现，围绕标的公司所在行业空间大小、内生成长性和估值的性价比进行相应的配置，同时对定增破发公司进行选择性的投资，从结果来看，效果尚可。由于未来一段时间，企业盈利维持低位波动，利率逐步上移，流动性偏紧，暂时市场整体性机会依然较少，因此，我们会更多的自下而上的选择可以较好把握基本面和未来表现的品种，尤其那些好公司，倘若因系统性因素出现定增价格有较大折扣时，我们会加大配置力度。

2016 年本基金业绩主要负责来自于成长股配置和偏高的仓位水平。整体上，由于经济进入新常态，在不同时段会涌现出一些结构性机会，但市场偏好会逐步从估值推动切换到业绩推动，因此在操作上，主要采取自下而上的策略来获取收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止 2016 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 0.9677 元，本报告期份额净值增长率为-3.23%，同期业绩比较基准增长率为-0.40%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从短期静态的视角看，宏观经济基本面逐步企稳，流动性进入偏紧区间，汇率调整也依然还没完全达到均衡水平，外部风险依然存在，无风险收益率逐步上移。未来一段时间只要不出现超预期的风险因素，市场仍存在一定的结构性机会，特别是一些具有时代特征的优质成长股和政策受益标的。因此在操作上，本基金将依据市场阶段特征和主要矛盾，提高投资的灵活性。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

##### 1、估值政策及重大变化

无。

##### 2、估值政策重大变化对基金资产净值及当期损益的影响

无。

##### 3、有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历的描述

###### (1) 公司方面

公司建立基金估值委员会，组成人员包括：基金投资部兼全球投资部高级总监、投资研究部高级总监、固定收益部总监、指数投资部高级总监、基金运营部总经理及相关负责人员。

主要职责包括：证券发行机构发生了严重影响证券价格的重大事件时，负责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；同时将采用确定的方法以及采用该方法对相关证券估值后与基金的托管银行进行沟通。

相关人员专业胜任能力及工作经历：

翁启森，基金投资部兼全球投资部高级总监，总经理助理，工业工程学硕士。曾在台湾 JP 证券任金融产业分析师及投资经理，台湾摩根富林明投信投资管理部任基金经理，台湾中信证券投资总监助理，台湾保德信投信任基金经理。2008 年 4 月加入华安基金管理有限公司，现任华安香港精选股票、华安大中华升级股票、华安大国新经济股票、华安物联网主题股票的基金经理，华安基金管理有限公司总经理助理、基金投资部兼全球投资部高级总监。

杨明，投资研究部高级总监，研究生学历。曾在上海银行从事信贷员、交易员及风险管理。

2004 年 10 月进入华安基金管理有限公司，担任研究发展部宏观研究员，现任华安策略优选混合、华安沪港深外延增长混合、华安安禧保本的基金经理，投资研究部高级总监。

贺涛，金融学硕士，固定收益部总监。曾任长城证券有限责任公司债券研究员，华安基金管理有限公司债券研究员、债券投资风险管理员、固定收益投资经理。现任华安现金富利货币、华安稳定收益债券、华安可转债、华安月月鑫短期理财、华安季季鑫短期理财、华安月安鑫短期理财、华安信用增强债券、华安双债添利债券、华安汇财通货币、华安年年盈定期开放式债券、华安新回报灵活配置、华安新乐享保本、华安乐惠保本、华安安华保本、华安安进保本、华安新希望混合、华安睿享定开混合的基金经理，固定收益部总监。

许之彦，指数投资部高级总监，理学博士，CQF(国际数量金融工程师)。曾在广发证券和中山大学经济管理学院博士后流动站从事金融工程工作，2005 年加入华安基金管理有限公司，曾任研究发展部数量策略分析师，现任华安上证 180ETF 及华安上证 180ETF 联接、华安深证 300 指数（LOF）、华安易富黄金 ETF 及联接、华安中证全指证券公司指数分级、华安中证银行指数分级、华安创业板 50 指数分级、华安创业板 50ETF 的基金经理，指数投资部高级总监。

陈林，基金运营部总经理，工商管理硕士，高级会计师，CPA 中国注册会计师协会非执业会员。曾在安永大华会计师事务所工作，2004 年 11 月加入华安基金管理有限公司，曾任财务核算部副总监、公司财务部总经理，现任基金运营部总经理。

## (2) 托管银行

托管银行根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任，并且认真核查公司采用的估值政策和程序。

## (3) 会计师事务所

对相关估值模型、假设及参数的适当性出具审核意见和报告。

## 4、基金经理参与或决定估值的程度

本基金的基金经理未参与基金的估值。

## 5、参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间无任何重大利益冲突。

6、已签约的任何定价服务的性质与程度等信息  
无。

#### 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，本基金托管人在对华安智增精选证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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

本报告期内，华安智增精选证券投资基金的管理人——华安基金管理有限公司在华安智增精选证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，华安智增精选证券投资基金未对基金份额持有人利润分配。

#### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对华安基金管理有限公司编制和披露的华安智增精选证券投资基金 2016 年年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

### §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、丁鹏飞签字出具了安永华明（2017）审字第 60971571\_B44 号标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：华安智增精选灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 2016 年 12 月 31 日
资 产：	-
银行存款	368,058,324.15
结算备付金	2,770,227.60
存出保证金	214,951.93
交易性金融资产	904,387,361.24
其中：股票投资	904,387,361.24
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	-
应收利息	76,159.33
应收股利	-
应收申购款	-
递延所得税资产	-
其他资产	-
<b>资产总计</b>	<b>1,275,507,024.25</b>
	<b>本期末</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>2016 年 12 月 31 日</b>
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	6,107,611.95
应付赎回款	-
应付管理人报酬	1,628,572.49
应付托管费	271,428.73
应付销售服务费	-
应付交易费用	1,191,203.36
应交税费	-
应付利息	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	180,000.00
<b>负债合计</b>	<b>9,378,816.53</b>
<b>所有者权益：</b>	<b>-</b>
实收基金	1,308,431,590.50
未分配利润	-42,303,382.78
<b>所有者权益合计</b>	<b>1,266,128,207.72</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>	<b>1,275,507,024.25</b>

注：（1）报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.9677 元，基金份额总额 1,308,431,590.50 份。

（2）本基金合同于 2016 年 9 月 13 日生效。

## 7.2 利润表

会计主体：华安智增精选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 9 月 13 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2016 年 9 月 13 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>	<b>-33,276,215.22</b>
1.利息收入	2,810,395.32
其中：存款利息收入	1,229,036.50
债券利息收入	-
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	1,581,358.82
其他利息收入	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	15,394,249.40
其中：股票投资收益	15,394,249.40
基金投资收益	-
债券投资收益	-
资产支持证券投资收益	-
贵金属投资收益	-
衍生工具收益	-
股利收益	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-51,485,317.02
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	4,457.08
<b>减：二、费用</b>	<b>9,027,167.56</b>
1. 管理人报酬	5,847,557.40
2. 托管费	974,592.91
3. 销售服务费	-
4. 交易费用	1,989,130.25
5. 利息支出	-
其中：卖出回购金融资产支出	-
6. 其他费用	215,887.00



三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-42,303,382.78
减：所得税费用	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-42,303,382.78

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安智增精选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 9 月 13 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 9 月 13 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,308,431,590.50	-	1,308,431,590.50
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-42,303,382.78	-42,303,382.78
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）	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	1,308,431,590.50	-42,303,382.78	1,266,128,207.72

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：章国富，会计机构负责人：陈林

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

华安智增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[2016] 1402 号《关于准予华安智增精选灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》的核准，由华安基金管理有限公司作为管理人自 2016 年 8 月 10 日到 2016 年 9 月 6 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\_B17 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 9 月 13 日生效。本基金为契约型，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 1,308,136,763.50 元，在募集期间产生的存款利息为人民币 294,827.00 元，以上实收基金(本息)合计为人民币 1,308,431,590.50 元，折合 1,308,431,590.50 份基金份额。本基金的基金管理人为华安基金管理有限公司，基金的注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

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

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：封闭期内股票资产占基金资产的比例为 0%-100%；转为上市开放式基金(LOF)后股票资产占基金资产的比例为 0%-95%。在封闭期内，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，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；转为上市开放式基金(LOF)后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。

如果法律法规对该比例要求有变更的，以变更后的比例为准，本基金的投资范围会做相应调整。

本基金业绩比较基准：沪深 300 指数收益率×50%+中国债券总指数收益率×50%。

#### 7.4.2 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。

#### 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 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年 9 月 13 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净值变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

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。

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间系 2016 年 9 月 13 日（基金合同生效日）起至 2016 年 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

##### (1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

本基金目前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主要包括股票投资、债券投资和衍生工具；

##### (2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

金融资产转移，是指本基金将金融资产让与或交付给该金融资产发行方以外的另一方(转入方)；本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制

的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债；

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

(1) 股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

卖出股票于成交日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(2) 债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

(3) 权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(4) 股指期货投资

买入或卖出股指期货投资于成交日确认为股指期货投资。股指期货初始合约价值按成交金额确认；

股指期货平仓于成交日确认衍生工具投资收益，股指期货的初始合约价值按移动加权平均法于成交日结转；

(5) 分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

(6) 回购协议

基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异

较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。本基金主要金融工具的估值方法如下：

##### (1) 存在活跃市场的金融工具

存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值的，应对最近交易的市价进行调整，确定公允价值。

##### (2) 不存在活跃市场的金融工具

当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。本基金采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术，优先使用相关可观察输入值，只有在可观察输入值无法取得或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动

分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/(累计亏损)”。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/(损失)于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 权证投资收益/(损失)于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(8) 股指期货投资收益/(损失)于平仓日确认，并按平仓成交金额与其初始合约价值的差额入账；

(9) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(10) 公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失;

(11) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方,经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

(1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 1.50%的年费率逐日计提;

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25%的年费率逐日计提;

(3) 卖出回购金融资产支出,按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时,也可以用合同利率)在回购期内逐日计提;

(4) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定,按实际支出金额,列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的,则采用待摊或预提的方法;

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 在封闭期内,本基金不进行收益分配;

(2) 转为上市开放式基金(LOF)后,在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为 12 次,每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%,若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配;

(3) 本基金收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资。登记在基金份额持有人开放式基金账户下的基金份额,投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资;若投资者不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红。登记在基金份额持有人深圳证券账户下的基金份额,只能选择现金分红的方式,具体权益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定;

(4) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值;即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值;

(5) 每一基金份额享有同等分配权;

(6) 法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

### 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。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]2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》的规定，2017 年 7 月 1 日（含）以后，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，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在 2017 年 7 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。

#### 7.4.6.3 企业所得税

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

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

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

#### 7.4.6.4 个人所得税

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

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

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

### 7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
华安基金管理有限公司 (“华安基金公司”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司 (“中国工商银行”)	基金托管人、基金销售机构
上海国际信托有限公司	基金管理人的股东
上海电气(集团)总公司	基金管理人的股东
上海工业投资(集团)有限公司	基金管理人的股东
上海锦江国际投资管理有限公司	基金管理人的股东
国泰君安投资管理股份有限公司	基金管理人的股东

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。

### 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.8.1.1 股票交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。

##### 7.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期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

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行回购交易。

##### 7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

#### 7.4.8.2 关联方报酬

##### 7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2016年9月13日（基金合同生效日）至2016年12月31日

当期发生的基金应支付的管理费	5,847,557.40
其中：支付销售机构的客户维护费	428,698.74

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

$$H = E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。

#### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2016年9月13日（基金合同生效日）至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	974,592.91

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

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每个月月末，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

本基金本报告期末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

本基金的基金管理人本报告期末运用固有资金投资本基金。

##### 7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末未投资本基金。

#### 7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年9月13日（基金合同生效日）至2016年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
工商银行	368,058,324.15	1,205,849.77

#### 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（2016 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
002494	华斯股份	2016-11-09	2017-11-13	认购非公开发行证券	16.18	13.84	3,708,281	59,999,986.58	51,322,609.04	-
002838	道恩股份	2016-12-28	2017-01-06	认购新发证券	15.28	15.28	682	10,420.96	10,420.96	-
002840	华统股份	2016-12-29	2017-01-10	认购新发证券	6.55	6.55	1,814	11,881.70	11,881.70	-
300458	全志科技	2016-10-19	2017-10-13	认购非公开发行证券	79.93	82.46	1,251,094	99,999,943.42	103,165,211.24	-
300583	赛托生物	2016-12-29	2017-01-06	认购新发证券	40.29	40.29	1,582	63,738.78	63,738.78	-
300586	美联新材	2016-12-26	2017-01-04	认购新发证券	9.30	9.30	1,006	9,355.80	9,355.80	-
300587	天铁股份	2016-12-28	2017-01-05	认购新发证券	14.11	14.11	1,438	20,290.18	20,290.18	-
300588	熙菱信息	2016-12-27	2017-01-05	认购新发证券	4.94	4.94	1,380	6,817.20	6,817.20	-
300591	万里马	2016-12-30	2017-01-10	认购新发证券	3.07	3.07	2,397	7,358.79	7,358.79	-
601375	中原证券	2016-12-20	2017-01-03	认购新发证券	4.00	4.00	26,695	106,780.00	106,780.00	-
60303	德新	2016-	2017-	认购新	5.81	5.81	1,628	9,458.	9,458.	-

2	交运	12-27	01-05	发证券				68	68	
603035	常熟汽饰	2016-12-27	2017-01-05	认购新发证券	10.44	10.44	2,316	24,179.04	24,179.04	-
603186	华正新材	2016-12-26	2017-01-03	认购新发证券	5.37	5.37	1,874	10,063.38	10,063.38	-
603228	景旺电子	2016-12-28	2017-01-06	认购新发证券	23.16	23.16	3,491	80,851.56	80,851.56	-
603266	天龙股份	2016-12-30	2017-01-10	认购新发证券	14.63	14.63	1,562	22,852.06	22,852.06	-
603689	皖天然气	2016-12-30	2017-01-10	认购新发证券	7.87	7.87	4,818	37,917.66	37,917.66	-
603877	太平鸟	2016-12-29	2017-01-09	认购新发证券	21.30	21.30	3,180	67,734.00	67,734.00	-

注：以上“可流通日”是根据上市公司公告估算的流通日期，最终日期以上市公司公告为准。

#### 7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600576	万家文化	2016-11-28	筹划重大事项	16.62	2017-01-12	20.22	3,449,777	64,406,489.15	57,335,293.74	-

#### 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 2016 年 12 月 31 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

##### 7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 12 月 31 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 7.4.14.1 公允价值

##### 7.4.14.1.1 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括贷款和应收款项以及其他金融负债，其因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

#### 7.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

##### 7.4.14.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于 2016 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币 692,074,547.43 元，属于第二层次的余额为人民币 212,312,813.81 元，无属于第三层次余额。

##### 7.4.14.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关股票和可转换债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。

##### 7.4.14.1.2.3 第三层次公允价值余额和本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具第三层次公允价值本期未发生变动。

#### 7.4.14.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

#### 7.4.14.3 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

#### 7.4.14.4 财务报表的批准

本财务报表已于 2017 年 3 月 24 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	904,387,361.24	70.90
	其中：股票	904,387,361.24	70.90

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	370,828,551.75	29.07
7	其他各项资产	291,111.26	0.02
8	合计	1,275,507,024.25	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	60,274,156.98	4.76
B	采矿业	-	-
C	制造业	747,680,925.63	59.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	37,917.66	0.00
E	建筑业	15,592.23	0.00
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	9,458.68	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	241,692.20	0.02
J	金融业	106,780.00	0.01
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-



M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	106,122.72	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	95,914,715.14	7.58
S	综合	-	-
	合计	904,387,361.24	71.43

### 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	300458	全志科技	1,251,094	103,165,211.24	8.15
2	002494	华斯股份	6,646,485	91,987,352.40	7.27
3	002284	亚太股份	6,253,900	87,992,373.00	6.95
4	002510	天汽模	10,843,955	75,365,487.25	5.95
5	600114	东睦股份	4,349,685	74,858,078.85	5.91
6	300196	长海股份	1,925,007	72,418,763.34	5.72
7	603737	三棵树	879,147	64,195,313.94	5.07
8	603718	海利生物	3,396,021	60,517,094.22	4.78
9	002200	云投生态	2,573,619	60,274,156.98	4.76
10	600576	万家文化	3,449,777	57,335,293.74	4.53

### 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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	300458	全志科技	107,992,684.62	8.53
2	002494	华斯股份	105,859,320.68	8.36
3	002284	亚太股份	103,644,833.46	8.19
4	002699	美盛文化	98,234,422.59	7.76
5	002200	云投生态	88,655,212.10	7.00
6	600114	东睦股份	87,166,157.81	6.88

7	300196	长海股份	77,110,994.81	6.09
8	002510	天汽模	76,753,734.65	6.06
9	600576	万家文化	74,962,011.03	5.92
10	603737	三棵树	70,050,441.84	5.53
11	603718	海利生物	65,194,434.32	5.15
12	600686	金龙汽车	51,888,341.00	4.10
13	002303	美盈森	50,502,343.43	3.99
14	002150	通润装备	42,025,038.25	3.32
15	000909	数源科技	34,414,177.20	2.72
16	002503	搜于特	31,630,062.81	2.50
17	300476	胜宏科技	30,924,022.05	2.44
18	002090	金智科技	30,087,609.97	2.38
19	600567	山鹰纸业	26,683,414.00	2.11
20	300011	鼎汉技术	19,771,262.25	1.56

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

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	002699	美盛文化	63,024,322.56	4.98
2	600686	金龙汽车	58,795,259.32	4.64
3	002503	搜于特	32,513,281.67	2.57
4	000909	数源科技	30,842,985.72	2.44
5	300476	胜宏科技	29,779,765.99	2.35
6	002200	云投生态	28,512,223.12	2.25
7	600567	山鹰纸业	27,005,553.54	2.13
8	600114	东睦股份	20,098,010.31	1.59
9	601566	九牧王	19,574,167.39	1.55
10	002303	美盈森	16,055,290.99	1.27
11	600219	南山铝业	15,597,709.50	1.23
12	002072	凯瑞德	14,211,587.26	1.12
13	600576	万家文化	11,430,880.19	0.90
14	002683	宏大爆破	10,967,667.98	0.87
15	300458	全志科技	9,550,721.80	0.75
16	600529	山东药玻	7,329,738.47	0.58
17	603858	步长制药	593,029.00	0.05
18	600909	华安证券	551,503.20	0.04
19	002821	凯莱英	321,192.98	0.03
20	603708	家家悦	235,628.84	0.02

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

### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	1,340,298,800.42
卖出股票的收入（成交）总额	399,820,371.56

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

### 8.5 期末按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。

### 8.6 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。

### 8.7 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。

### 8.8 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。

### 8.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 8.9.1 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。

#### 8.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

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

本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，

谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。

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

## 8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.10.1 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同，本基金不能投资于国债期货。

### 8.10.2 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 投资组合报告附注

8.11.1 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。

8.11.2 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。

### 8.11.3 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	214,951.93
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	76,159.33
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	291,111.26

### 8.11.4 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。

### 8.11.5 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	300458	全志科技	103,165,211.24	8.15	非公开发行流通受限
2	600576	万家文化	57,335,293.74	4.53	重大事项停牌
3	002494	华斯股份	51,322,609.04	4.05	非公开发行流通受限

## §9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例
6,210	210,697.52	300,755,465.06	22.99%	1,007,676,125.44	77.01%

### 9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	易方达资产穗鑫 2 号专项资产管理计划	106,017,260.00	16.06%
2	国电资本控股有限公司	100,017,000.00	15.15%
3	方正东亚信托有限责任公司-方正东亚-方选精品(FOF)1 号证券投资基金	10,003,050.00	1.52%
4	南京巨石创业投资有限公司	10,002,150.00	1.52%
5	张景红	10,000,800.00	1.51%
6	卢立君	4,981,879.68	0.75%
7	陈少玲	4,980,304.68	0.75%
8	许浩涛	4,980,304.68	0.75%
9	关文华	3,987,123.75	0.60%
10	陈喜娥	2,985,347.36	0.45%

### 9.3 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	49,276.92	0.00%

注：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(2016 年 9 月 13 日)基金份额总额	1,308,431,590.50
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	-
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	-
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,308,431,590.50

## §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

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情况为人民币 60,000.00 元。

目前的审计机构已提供审计服务的连续年限：自基金合同生效日起至今。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内无管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或者处罚等情况。

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	
西藏东方财富	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-	-
华信证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
中投证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
宏信证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
民族证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
中天证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
广发华福	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	862,391,352.46	54.66%	785,897.98	54.22%	-
国信证券	1	355,450,653.55	22.53%	331,030.65	22.84%	-
招商证券	1	138,015,056.41	8.75%	125,773.86	8.68%	-

兴业证券	1	99,341,281.27	6.30%	92,515.84	6.38%	-
上海证券	2	68,254,917.62	4.33%	63,566.18	4.39%	-
恒泰证券	1	54,303,389.61	3.44%	50,573.52	3.49%	-

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副总经理审批

公司分管副总经理对相关部门提交的《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：

2016 年 4 月完成租用托管在工商银行的西藏东方财富证券深圳 395395 交易单元

2016 年 8 月完成租用托管在工商银行的天风证券深圳 398013 交易单元

2016 年 11 月完成租用托管在工商银行的宏信证券深圳 002331 深圳交易单元

#### 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	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国信证券	-	-	950,000,000.00	48.72%	-	-
上海证券	-	-	1,000,000,000.00	51.28%	-	-

华安基金管理有限公司

二〇一七年三月二十八日