

华安香港精选股票型证券投资基金
2016 年年度报告
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。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 12 月 31 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 境外投资顾问和境外资产托管人	6
2.5 信息披露方式	6
2.6 其他相关资料	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
§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合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	17
4.9 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	17
§5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	17
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	17
§6 审计报告	17
6.1 管理层对财务报表的责任	18
6.2 注册会计师的责任	18
6.3 审计意见	18
§7 年度财务报表	19
7.1 资产负债表	19
7.2 利润表	20
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	22
7.4 报表附注	23
§8 投资组合报告	46
8.1 期末基金资产组合情况	46
8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布	47
8.3 期末按行业分类的权益投资组合	47
8.4 指数投资期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细	47
8.5 报告期内权益投资组合的重大变动	58

8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合	60
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细	60
8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细	60
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细	60
8.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细	60
8.11 投资组合报告附注	60
§9 基金份额持有人信息	61
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	61
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	61
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	61
§10 开放式基金份额变动	61
§11 重大事件揭示	62
11.1 基金份额持有人大会决议	62
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	62
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	62
11.4 基金投资策略的改变	62
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	62
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	62
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	62
11.8 其他重大事件	66
§12 备查文件目录	72
12.1 备查文件目录	72
12.2 存放地点	72
12.3 查阅方式	72

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华安香港精选股票型证券投资基金
基金简称	华安香港精选股票（QDII）
基金主代码	040018
交易代码	040018
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010 年 9 月 19 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	1,019,392,124.48 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在合理控制投资风险和保障基金资产流动性的基础上，追求中长期资本增值，力求为投资者获取超越业绩比较基准的回报。
投资策略	本基金以价值和成长投资理念为导向，采用“自上而下”和“自下而上”相结合的选股策略。通过对于经济周期的跟踪和研究，以及对于地区资源禀赋比较，对各行各业的发展趋势和发展阶段进行预期，选择优势行业作为主要投资目标。同时通过对香港市场和具有中国概念的股票基本面的分析和研究，考察公司的产业竞争环境、业务模式、盈利模式和增长模式、公司治理结构以及公司股票的估值水平，挖掘具备中长期持续增长或阶段性高速增长、且股票估值水平偏低的上市公司进行投资。
业绩比较基准	MSCI 中华指数（MSCI Zhong Hua Index）
风险收益特征	本基金是一只主动投资的股票型基金，基金的风险与预期收益都要高于混合型基金和债券型基金，属于证券投资基金中的中高风险品种。

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
注册地址	上海市世纪大道8号上海国金中心二期31层、32层		北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址	上海市世纪大道8号上海国金中心二期31层、32层		北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码	200120		100140
法定代表人	朱学华		易会满

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外资产托管人
名称	英文	The Hong Kong and Shanghai Banking Corporation Limited
	中文	香港上海汇丰银行有限公司
注册地址		香港中环皇后大道中一号汇丰总行大厦
办公地址		香港九龙深旺道一号，汇丰中心一座六楼
邮政编码		-

2.5 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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.huaan.com.cn
基金年度报告备置地点	上海市世纪大道8号上海国金中心二期31、32层

2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼

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、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	2015 年	2014 年
本期已实现收益	-92,752,895.04	-454,740,647.16	28,064,557.72
本期利润	30,747,486.35	-617,406,621.49	7,475,189.72
加权平均基金份额本期利润	0.0272	-0.5008	0.0773
本期加权平均净值利润率	2.56%	-40.36%	6.99%
本期基金份额净值增长率	0.27%	-2.54%	6.93%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
期末可供分配利润	-176,990,329.95	-91,791,401.62	9,775,733.48
期末可供分配基金份额利润	-0.1736	-0.0796	0.1421
期末基金资产净值	1,137,588,322.85	1,284,021,848.68	78,584,795.14
期末基金份额净值	1.116	1.113	1.142
3.1.3 累计期末指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
基金份额累计净值增长率	11.60%	11.30%	14.20%

注：1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如：封闭式基金交易佣金、开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增	份额净值增	业绩比较基	业绩比较基	①—③	②—④
----	-------	-------	-------	-------	-----	-----

	长率①	长率标准差 ②	准收益率③	准收益率标 准差④		
过去 3 个月	-1.93%	0.86%	-4.14%	0.86%	2.21%	0.00%
过去 6 个月	8.56%	0.87%	8.83%	0.89%	-0.27%	-0.02%
过去 1 年	0.27%	1.10%	5.46%	1.13%	-5.19%	-0.03%
过去 3 年	4.49%	1.45%	7.17%	1.19%	-2.68%	0.26%
过去 5 年	44.00%	1.29%	28.76%	1.13%	15.24%	0.16%
成立起至今	11.60%	1.30%	1.42%	1.21%	10.18%	0.09%

注：本基金业绩比较基准：MSCI 中华指数（MSCI Zhong Hua Index）

根据基金合同的规定：本基金投资于依法发行在香港证券市场交易的股票；同时为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于美国、新加坡、台湾等证券市场交易的在中国地区有重要经营活动（主营业务收入或利润的至少 50%来自于中国）的企业发行的股票或存托凭证；投资范围亦包括债券、货币市场工具和中国证监会允许基金投资的其他金融工具。股票资产不低于基金资产的 60%，其中不低于 80%的股票资产投资于香港证券市场；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%。

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

华安香港精选股票型证券投资基金

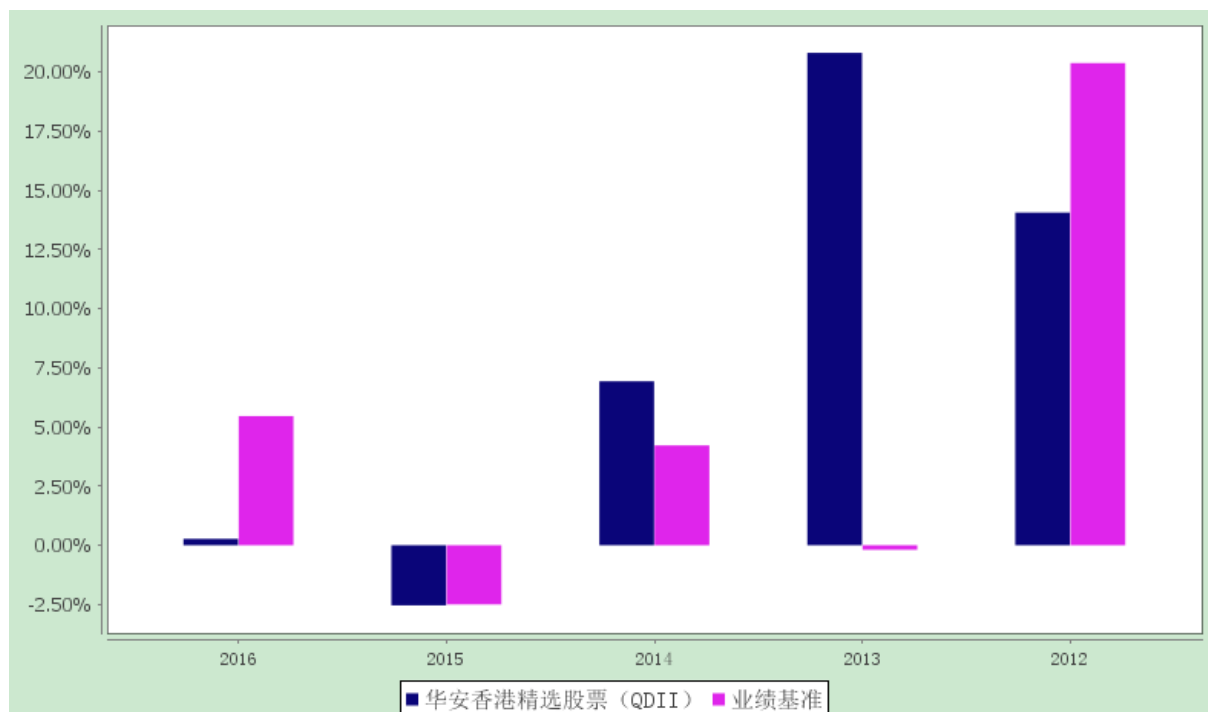
自基金合同生效以来份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2010 年 9 月 19 日至 2016 年 12 月 31 日)



3.2.3 过去五年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

华安香港精选股票型证券投资基金
过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金于 2010 年 9 月 19 日成立，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

无。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

华安基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1998]20 号文批准于 1998 年 6 月设立，是国内首批基金管理公司之一，注册资本 1.5 亿元人民币，公司总部设在上海陆家嘴金融贸易区。目前的股东为上海电气（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		
翁启森	本基金的基金 经理, 基金投 资部兼全球投 资部高级总 监, 总经理助	2010-09-19	-	20 年	工业工程学硕士, 20 年证券、 基金行业从业经历, 具有中国大 陆基金从业资格。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

	理				<p>管理部任基金经理,台湾中信证券投资总监助理,台湾保德信信任基金经理。2008年4月加入华安基金管理有限公司,任全球投资部总监。2010年9月起担任本基金的基金经理。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。2014年6月起担任基金投资部兼全球投资部高级总监。2014年3月至2016年9月同时担任华安宏利混合型证券投资基金的基金经理。2014年4月起同时担任华安大国新经济股票型证券投资基金的基金经理。2014年6月起担任基金投资部兼全球投资部高级总监。2015年2月至2016年9月同时担任华安安顺灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2015年3月起担任公司总经理助理。2015年3月起同时担任华安物联网主题股票型证券投资基金的基金经理。2015年6月至2016年9月同时担任华安宝利配置证券投资基金、华安生态优先混合型证券投资基金的基金经理。</p>
苏圻涵	本基金的基金经理、全球投资部助理总监	2010-09-19	-	12年	<p>博士研究生,12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月起担任本基金的基金经理。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月起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、华安全球美元收益债券型证券投资基金</p>

					的基金经理。2016 年 6 月起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。
--	--	--	--	--	--

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 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

全年来看，全球资本市场美元指数温和，商品价格复苏成为主线。全球商品指数（CRB Index）全年上涨接近 10%，其中能源，工业金属等涨幅靠前。商品的复苏和美元的温和，导致资源品国家货币和股市出现大幅上涨，从汇率来看，巴西，南非，加拿大等兑美元升值靠前，同时巴西，俄罗斯，哈萨克斯坦等国家股市涨幅靠前。全年黑天鹅事件导致资本市场波动剧烈，外部不确定性也导致美联储加息频率低于年初市场预期。

期内 S&P500 指数累计上涨 9.54%，纳斯达克综合指数累计上涨 7.50%，斯托克 50 指数下跌 2.89%，而 MSCI 新兴市场指数累计上涨 8.58%，欧洲市场由于英国脱欧等黑天鹅事件，显著跑输其他市场。

香港市场，再次体现出其开放性市场的脆弱性，在外部不确定性事件影响下，以及年初人民币

大幅贬值的冲击下，恒生指数上涨 0.39%，恒生国企指数下跌 2.75%。

在报告期内，基于我们对于市场结构的判断，我们增持基本面确定，半年报业绩仍有增长，以及可能纳入深港通标的，处于医药、软件、互联网、新兴消费等细分行业龙头的公司，同时加仓部分受益价格上涨，成本下降的周期类股。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2016 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 1.116 元，本报告期份额净值增长率为 0.27%，同期业绩比较基准增长率为 5.46%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，2017 年，在人民币贬值预期和资产荒的背景下，我们认为国内机构资金仍有配置港股的需求。同时我们认为 2017 年，自上而下看，宏观上确定性比较大的事件，人民币继续贬值，收益率曲线上行，通胀上行。因此我们看好，符合国内机构投资者需求的低估值，高分红类股；人民币贬值受益类股；利率上行收益品种；涨价品种；混改主题。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，公司合规监察稽核部从维护基金份额持有人利益、保障基金的合规运作出发，重点在法律事务、合规管理、内部稽核、信息披露、反洗钱、员工行为规范等方面开展工作，深化员工的合规意识，推动公司的合规文化和内部风险控制机制的完善与优化。

监察稽核工作重点集中于以下几个方面：

- (1) 积极配合监管部门新法规的实施，不断完善公司的内部控制制度和业务操作流程；
- (2) 继续深化“主动合规”的管理理念，强化全体员工的合规意识和风险控制意识，通过定期组织员工进行职业道德规范、反洗钱、防范利益冲突、客户信息保密、销售适用性等方面的合规培训和内部审计，推动公司建立良好的内控环境和合规文化。
- (3) 完善公司内控建设，强化基金的公平交易和异常交易的检查与监控，防范内幕交易与操纵市场行为的出现，同时进行投资管理人员合规培训、及定期进行基金经理的合规谈话，建立健全坚守“三条底线”的长效机制；
- (4) 做好在新基金产品开发、新投资品种、及其他创新业务中法律、合规及风险控制方面的支持，坚持定期对投资、研究、交易、核算、销售等相关业务活动的日常合规性检查。
- (5) 推动落实公司投资、运营业务操作流程标准化，细化各相关部门在各业务环节的操作流程及工作职责，降低操作风险发生的概率。

(6) 按照法规的要求, 做好旗下各只基金的信息披露工作, 做到信息披露的真实、完整、准确、及时。

(7) 有计划地对公司投资研究、基金销售、后台运营等相关业务部门进行了多次全面或专项稽核, 强化对公司制度执行和风控措施的落实。

本基金管理人承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产, 不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性, 努力防范和控制各种风险, 保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 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。

4.8 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。

4.9 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香港精选股票型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，华安香港精选股票型证券投资基金的管理人——华安基金管理有限公司在华安香港精选股票型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，华安香港精选股票型证券投资基金未进行利润分配。

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香港精选股票型证券投资基金 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

普华永道中天审字(2017)第 20248 号

华安香港精选股票型证券投资基金全体基金份额持有人：

我们审计了后附的华安香港精选股票型证券投资基金(以下简称“华安香港精选基金”)的财务报表，包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表、2016 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

6.1 管理层对财务报表的责任

编制和公允列报财务报表是华安香港精选基金的基金管理人华安基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括：

(1)按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,并使其实现公允反映;

(2)设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

6.2 注册会计师的责任

我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则,计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断,包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时,注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性,以及评价财务报表的总体列报。

我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。

6.3 审计意见

我们认为,上述 华安香港精选基金 的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了 华安香港精选基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和基金净值变动情况。

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙) 中国注册会计师

单 峰 张 振 波

上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼

2017 年 3 月 24 日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：华安香港精选股票型证券投资基金

报告截止日：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	7.4.7.1	128,170,504.71	207,357,187.02
结算备付金		1,799,278.27	-
存出保证金		521,630.65	-
交易性金融资产	7.4.7.2	1,009,057,907.15	1,083,409,086.09
其中：股票投资		1,009,057,907.15	1,083,409,086.09
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		2,959,819.23	2,095,632.13
应收利息	7.4.7.5	4,366.96	5,060.01
应收股利		982,268.03	102,228.62
应收申购款		223,726.27	177,339.01
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		1,143,719,501.27	1,293,146,532.88
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
负债：		-	-
短期借款		-	-

交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		341,381.97	711,383.49
应付赎回款		3,122,913.34	6,062,873.84
应付管理人报酬		1,544,428.19	1,631,911.62
应付托管费		308,885.65	326,382.34
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	409,277.20	24.38
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	404,292.07	392,108.53
负债合计		6,131,178.42	9,124,684.20
所有者权益：		-	-
实收基金	7.4.7.9	1,019,392,124.48	1,153,167,866.96
未分配利润	7.4.7.10	118,196,198.37	130,853,981.72
所有者权益合计		1,137,588,322.85	1,284,021,848.68
负债和所有者权益总计		1,143,719,501.27	1,293,146,532.88

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.116 元，基金份额总额 1,019,392,124.48 份。

7.2 利润表

会计主体：华安香港精选股票型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

一、收入		58,794,899.62	-576,692,728.10
1.利息收入		705,282.01	748,135.55
其中：存款利息收入	7.4.7.11	343,461.37	748,135.55
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		361,820.64	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-71,908,628.21	-402,638,166.06
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-95,868,504.15	-436,858,268.89
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	43,438.30
股利收益	7.4.7.15	23,959,875.94	34,176,664.53
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	123,500,381.39	-162,665,974.33
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		5,749,860.34	-15,644,280.43
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	748,004.09	3,507,557.17
减：二、费用		28,047,413.27	40,713,893.39
1. 管理人报酬		18,030,336.79	22,435,107.46
2. 托管费		3,606,067.31	4,487,021.50
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	5,879,411.80	12,918,156.95
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.19	531,597.37	873,607.48
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		30,747,486.35	-617,406,621.49
减：所得税费用		-	-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		30,747,486.35	-617,406,621.49
-------------------	--	---------------	-----------------

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安香港精选股票型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,153,167,866.96	130,853,981.72	1,284,021,848.68
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 （本期利润）	-	30,747,486.35	30,747,486.35
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）	-133,775,742.48	-43,405,269.70	-177,181,012.18
其中：1.基金申购款	491,617,312.91	21,166,125.60	512,783,438.51
2.基金赎回款	-625,393,055.39	-64,571,395.30	-689,964,450.69
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）	1,019,392,124.48	118,196,198.37	1,137,588,322.85
项目	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 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）	68,809,061.66	9,775,733.48	78,584,795.14
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 （本期利润）	-	-617,406,621.49	-617,406,621.49
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）	1,084,358,805.30	738,484,869.73	1,822,843,675.03
其中：1.基金申购款	3,394,729,759.93	1,267,594,907.80	4,662,324,667.73
2.基金赎回款	-2,310,370,954.63	-529,110,038.07	-2,839,480,992.70
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）	1,153,167,866.96	130,853,981.72	1,284,021,848.68

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

华安香港精选股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)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[2010]第 809 号《关于核准华安香港精选股票型证券投资基金募集的批复》核准，由华安基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安香港精选股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 740,818,736.04 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2010)第 239 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华安香港精选股票型证券投资基金基金合同》于 2010 年 9 月 19 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 740,895,365.72 份基金份额，其中认购资金利息折合 76,629.68 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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司，境外资产托管人为香港上海汇丰银行有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安香港精选股票型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为依法发行在香港证券市场交易的股票；同时为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于美国、新加坡、台湾等证券市场交易的在中国地区有重要经营活动(主营业务收入或利润的至少 50% 来自于中国)的企业发行的股票或存托凭证；投资范围亦包括债券、货币市场工具和中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金的投资组合为：股票资产不低于基金资产的 60%，其中不低于 80% 的股票资产投资于香港证券市场；现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为：MSCI 中华指数。

本财务报表由本基金的基金管理人华安基金管理有限公司于 2017 年 3 月 24 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华安香港精选股票型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2016 年度 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 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度 的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1)金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资和衍生工具投资(主要为权证投资)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2)金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

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

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金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；或者(3) 该金融资产已转移，虽然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，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和衍生工具投资(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 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。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，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。

(3) 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。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现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损益占基金净值比例计算的金额。未实现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损益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认列，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

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除股票交易所在地适用的预缴所得税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；处置时其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按红利发放日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

7.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现

现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

无。

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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会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]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《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》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》及其他相关境内外税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2) 目前基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内不予征收营业税(于 2016 年 5 月 1 日前)或增值税(自 2016 年 5 月 1 日起)且暂不征收企业所得税。

(3) 目前基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。

对基金通过沪港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20%的税率代扣个人所得税。

(4) 基金通过沪港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
活期存款	128,170,504.71	207,357,187.02
定期存款	-	-
其他存款	-	-
合计	128,170,504.71	207,357,187.02

注：于 2016 年 12 月 31 日，活期存款包括人民币活期存款 11,896,905.86 元，美元活期存款 187,477.90 元(折合人民币 1,300,534.19 元)、港币活期存款 120,809,243.71 元(折合人民币 108,065,076.59 元)和新台币活期存款 32,158,940.00 元(折合人民币 6,907,988.07 元)。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末		
		2016 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		1,043,734,927.72	1,009,057,907.15	-34,677,020.57
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		1,043,734,927.72	1,009,057,907.15	-34,677,020.57
项目		上年度末		
		2015 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		1,241,586,488.05	1,083,409,086.09	-158,177,401.96
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		1,241,586,488.05	1,083,409,086.09	-158,177,401.96

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

7.4.7.4 买入返售金融资产

无余额。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	3,158.23	5,060.01
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	1,208.73	-
应收债券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
其他	-	-
合计	4,366.96	5,060.01

7.4.7.6 其他资产

无余额。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	409,277.20	24.38
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	409,277.20	24.38

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	7,292.07	22,108.53
预提费用	397,000.00	370,000.00
合计	404,292.07	392,108.53

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,153,167,866.96	1,153,167,866.96
本期申购	491,617,312.91	491,617,312.91
本期赎回（以“-”号填列）	-625,393,055.39	-625,393,055.39
本期末	1,019,392,124.48	1,019,392,124.48

7.4.7.10 未分配利润

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	-91,791,401.62	222,645,383.34	130,853,981.72
本期利润	-92,752,895.04	123,500,381.39	30,747,486.35
本期基金份额交易产生的变动数	7,553,966.71	-50,959,236.41	-43,405,269.70
其中：基金申购款	-91,280,045.11	112,446,170.71	21,166,125.60
基金赎回款	98,834,011.82	-163,405,407.12	-64,571,395.30
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-176,990,329.95	295,186,528.32	118,196,198.37

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月 31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12 月31日
	活期存款利息收入	273,148.36
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	44,589.94	-

其他	25,723.07	15,438.08
合计	343,461.37	748,135.55

7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
卖出股票成交总额	1,720,719,989.07	3,073,229,025.41
减：卖出股票成本总额	1,816,588,493.22	3,510,087,294.30
买卖股票差价收入	-95,868,504.15	-436,858,268.89

7.4.7.13 债券投资收益

无。

7.4.7.14 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
卖出权证成交总额	0.00	43,438.30
减：卖出权证成本总额	-	-
买卖权证差价收入	0.00	43,438.30

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
股票投资产生的股利收益	23,959,875.94	34,176,664.53
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	23,959,875.94	34,176,664.53

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
1.交易性金融资产	123,500,381.39	-162,665,974.33
——股票投资	123,500,381.39	-162,665,974.33
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3.其他	-	-
合计	123,500,381.39	-162,665,974.33

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
基金赎回费收入	748,004.09	3,507,557.17
合计	748,004.09	3,507,557.17

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
交易所市场交易费用	5,879,411.80	12,918,156.95
银行间市场交易费用	-	-
合计	5,879,411.80	12,918,156.95

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
审计费用	117,000.00	110,000.00
信息披露费	280,000.00	240,000.00
银行汇划费	116,710.03	72,870.40
开户费	-	400.00
其他	17,887.34	450,337.08
合计	531,597.37	873,607.48

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布《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》(财税[2016]140 号)，要求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，自 2016 年 5 月 1 日起执行。

根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》(财税[2017]2 号)，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。资管产品运营过程中发生增值税应税行为的具体征收管理办法，由国家税务总局另行制定。截至本财务报表批准报出日止，上述税收政策对本基金 2016 年度的财务状况和经营成果无影响。

7.4.9 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
香港上海汇丰银行有限公司(The Hong kong and Shanghai Banking Corporation Limited, “汇丰银行”)	境外资产托管人
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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

无。

7.4.10.1.2 权证交易

无。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

无。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	18,030,336.79	22,435,107.46
其中：支付销售机构的客户维护费	5,500,974.34	6,437,476.01

注：支付基金管理人华安基金公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.50% / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	3,606,067.31	4,487,021.50

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.3%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.3\% / \text{当年天数}。$$

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
期初持有的基金份额	49,617,809.60	13,611,755.96
期间申购/买入总份额	-	36,006,053.64
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	49,617,809.60	49,617,809.60
期末持有的基金份额占基金总份额比例	4.87%	4.30%

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 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		上年度可比期间	
	2016年1月1日至2016年12月31日		2015年1月1日至2015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
中国工商银行	11,900,034.76	270,324.18	25,919,795.31	732,697.47
汇丰银行	116,270,469.95	2,824.18	181,437,391.71	-
合计	128,170,504.71	273,148.36	207,357,187.02	732,697.47

注：本基金的银行存款分别由基金托管人中国工商银行和境外资产托管人汇丰银行保管，按适用利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

无。

7.4.12 期末（2016 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

7.4.12.2 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
2168 HK	YING DE GASES GROU P COMP ANY	2016-12 -23	重大事 项	2.57	2017-0 1-09	2.66	960,000.00	2,632,721.43	2,464,553.95	

注：本基金截至 2016 年 12 月 31 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

本基金为区域性股票型证券投资基金，基金投资风险收益水平高于债券型基金和平衡型基金。由于投资国家与地区市场的分散，风险低于投资单一市场的股票型基金。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。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是在合理控制投资风险和保障基金资产流动性的基础上，追求中长期资本增值，力求为投资者获取超越业绩比较基准的回报。

7.4.13.1 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管理委员会，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执行总裁负责，并由督察长分管。

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。

7.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国工商银行以及境外次托管行汇丰银行，因而与银行存款相关的信用风险不

重大。本基金在交易所进行的交易均通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，违约风险发生的可能性很小；在场外交易市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种的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。

7.4.13.3 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%。本基金所持全部证券在证券交易所上市，均能以合理价格适时变现。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016 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	128,170,504.71	-	-	-	128,170,504.71
结算备付金	1,799,278.27	-	-	-	1,799,278.27
存出保证金	521,630.65	-	-	-	521,630.65
交易性金融资产	-	-	-	1,009,057,907.15	1,009,057,907.15
应收证券清算款	-	-	-	2,959,819.23	2,959,819.23
应收利息	-	-	-	4,366.96	4,366.96
应收股利	-	-	-	982,268.03	982,268.03
应收申购款	601.15	-	-	223,125.12	223,726.27
资产总计	130,492,014.78	-	-	1,013,227,486.49	1,143,719,501.27
负债					
应付证券清算款	-	-	-	341,381.97	341,381.97
应付赎回款	-	-	-	3,122,913.34	3,122,913.34
应付管理人报酬	-	-	-	1,544,428.19	1,544,428.19
应付托管费	-	-	-	308,885.65	308,885.65
应付交易费用	-	-	-	409,277.20	409,277.20
其他负债	-	-	-	404,292.07	404,292.07
负债总计	-	-	-	6,131,178.42	6,131,178.42
利率敏感度缺口	130,492,014.78	-	-	1,007,096,308.07	1,137,588,322.85
上年度末 2015 年 12 月 31 日					
资产					
银行存款	207,357,187.02	-	-	-	207,357,187.02

交易性金融资产	-	-	-	1,083,409,086.09	1,083,409,086.09
应收证券清算款	-	-	-	2,095,632.13	2,095,632.13
应收利息	-	-	-	5,060.01	5,060.01
应收股利	-	-	-	102,228.62	102,228.62
应收申购款	601.79	-	-	176,737.22	177,339.01
资产总计	207,357,788.81	-	-	1,085,788,744.07	1,293,146,532.88
负债					
应付证券清算款	-	-	-	711,383.49	711,383.49
应付赎回款	-	-	-	6,062,873.84	6,062,873.84
应付管理人报酬	-	-	-	1,631,911.62	1,631,911.62
应付托管费	-	-	-	326,382.34	326,382.34
应付交易费用	-	-	-	24.38	24.38
其他负债	-	-	-	392,108.53	392,108.53
负债总计	-	-	-	9,124,684.20	9,124,684.20
利率敏感度缺口	207,357,788.81	-	-	1,076,664,059.87	1,284,021,848.68

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予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金于 2016 年 12 月 31 日未持有债券资产(2015 年 12 月 31 日：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2015 年 12 月 31 日：同)。

7.4.13.4.2 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。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末			
	2016年12月31日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
银行存款	1,300,534.19	108,065,076.59	6,907,988.07	116,273,598.85

交易性金融资产	-	933,869,848.59	75,188,058.56	1,009,057,907.15
应收股利	-	679,255.11	-	679,255.11
应收证券清算款	-	-	493,092.16	493,092.16
资产合计	1,300,534.19	1,042,614,180.29	82,589,138.79	1,126,503,853.27
以外币计价的负债				
应付证券清算款	-	341,381.97	-	341,381.97
负债合计	-	341,381.97	-	341,381.97
资产负债表外汇风险敞口净额	1,300,534.19	1,042,272,798.32	82,589,138.79	1,126,162,471.30
项目	上年度末			
	2015年12月31日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
银行存款	438,248.00	171,477,609.62	9,524,293.77	181,440,151.39
交易性金融资产	-	1,012,863,436.02	70,545,650.07	1,083,409,086.09
应收股利	-	102,228.62	-	102,228.62
应收利息	-	6.98	-	6.98
应收证券清算款	-	2,095,632.13	-	2,095,632.13
资产合计	438,248.00	1,186,538,913.37	80,069,943.84	1,267,047,105.21
以外币计价的负债				
应付证券清算款	-	-	711,383.49	711,383.49
负债合计	-	-	711,383.49	711,383.49
资产负债表外汇风险敞口净额	438,248.00	1,186,538,913.37	79,358,560.35	1,266,335,721.72

7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除该单一汇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 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
	所有外币相对人民币升值 5%	增加约 5,631	增加约 6,332
	所有外币相对人民币贬值 5%	减少约 5,631	减少约 6,332

7.4.13.4.3 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的股票，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”和“自下而上”相结合的选股策略。通过对于经济结构调整的跟踪和研究，以及对于地区资源禀赋比较，对各行业的发展趋势和发展阶段进行预期，选择优势行业作为主要投资目标；通过对单个证券的定性分析及定量分析，对上市公司进行筛选，并通过估值模型精选出投入产出效率得到提升和经营效率得到提高的优势企业进行重点投资。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投资比例不低于基金资产的 60%，其中不低于 80% 的股票资产投资于香港证券市场。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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日		上年度末 2015 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	1,009,057,907.15	88.70	1,083,409,086.09	84.38
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,009,057,907.15	88.70	1,083,409,086.09	84.38

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变
----	----------------------

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	增加约 5,057	增加约 7,767
业绩比较基准下降 5%	减少约 5,057	减少约 7,767	

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：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：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 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 1,006,593,353.20 元，属于第二层次的余额为 2,464,553.95 元，无属于第三层次的余额(2015 年 12 月 31 日：第一层次 1,083,409,086.09 元，无第二层次或第三层次)。

(ii) 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债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会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将相关股票和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，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2016 年 12 月 31 日,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2015 年 12 月 31 日:无)。

(d) 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应收款项和其他金融负债,其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§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	1,009,057,907.15	88.23
	其中:普通股	1,009,057,907.15	88.23
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中:远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-

	权证	-	-
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	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	129,969,782.98	11.36
8	其他各项资产	4,691,811.14	0.41
9	合计	1,143,719,501.27	100.00

注：本基金通过沪港通交易机制投资的港股公允价值为88,291,715.04人民币，占期末净值比例7.76%。

8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
中国香港	933,869,848.59	82.09
中国台湾	75,188,058.56	6.61
合计	1,009,057,907.15	88.70

8.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
信息技术	247,745,809.59	21.78
非必需消费品	191,449,453.29	16.83
工业	167,221,686.32	14.70
保健	139,976,607.71	12.30
金融	82,319,532.45	7.24
材料	78,587,766.42	6.91
必需消费品	58,259,856.72	5.12
电信服务	21,615,190.10	1.90
公用事业	21,075,156.53	1.85
能源	806,848.02	0.07
合计	1,009,057,907.15	88.70

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

8.4 指数投资期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称 (英文)	公司名称 (中文)	证券代码	所在证 券市场	所属国家 (地区)	数量 (股)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
1	TENCEN T HOLDIN GS LTD	腾讯控股	700 HK	香港	中国香港	263,400	44,695,963.28	3.93
2	BEIJING URBAN CONSTR UCTION- H	城建设计	1599 HK	香港	中国香港	7,447,000	31,974,796.66	2.81
3	HISENSE KELON ELEC H	海信科龙	921 HK	香港	中国香港	5,411,000	30,638,425.55	2.69
4	TECHNO VATOR INTERN AT	同方泰德	1206 HK	香港	中国香港	8,974,000	23,760,904.91	2.09
5	PHOENI X HEALTH CARE GROUP CO	华润凤凰 医疗	1515 HK	香港	中国香港	2,508,500	22,259,273.08	1.96
6	CHINA UNICOM HONG KO	中国联通	762 HK	香港	中国香港	2,676,000	21,615,190.10	1.90
7	BEIJING ENTERP RISES WATER GR	北控水务 集团	371 HK	香港	中国香港	4,566,000	21,075,156.53	1.85
8	GUANGS HEN RAILWA Y CO	广深铁路	525 HK	香港	中国香港	4,798,000	20,085,900.03	1.77
9	CHINAS OFT INTERN ATIONA L LTD	中国软件 国际	354 HK	香港	中国香港	5,714,000	18,604,877.71	1.64

10	CHINA TRADITI ONAL CHINESE ME	中国中药	570 HK	香港	中国香港	5,684,000	18,252,977.48	1.60
11	AAC TECHNO LOGIES HOL	瑞声科技	2018 HK	香港	中国香港	280,500	17,676,613.37	1.55
12	UNIVER SAL MEDICA L FINANCI AL	环球医疗	2666 HK	香港	中国香港	3,082,000	17,671,599.65	1.55
13	CHINA MAPLE LEAF EDUCAT IONAL	枫叶教育	1317 HK	香港	中国香港	3,838,000	17,646,285.01	1.55
14	LARGAN PRECISI ON CO	大立光	3008 TT	台湾	中国台湾	20,700	16,852,308.82	1.48
15	HAICHA NG OCEAN PARK HOLDIN GS	海昌海洋 公园	2255 HK	香港	中国香港	10,009,000	16,384,265.58	1.44
16	SKYWO RTH DIGITAL HLDGS LTD	创维数码	751 HK	香港	中国香港	3,844,000	15,198,154.26	1.34
17	LEE & MAN PAPER MANUFA CTURIN	理文造纸	2314 HK	香港	中国香港	2,765,000	14,889,387.30	1.31
18	CHAOW EI POWER HOLDIN	超威动力	951 HK	香港	中国香港	2,439,000	14,464,736.57	1.27
19	PING AN INSURA	中国平安	2318 HK	香港	中国香港	416,500	14,455,460.50	1.27

	NCE GR							
20	KINGBO ARD LAMINA TES	建滔积层 板	1888 HK	香港	中国香港	2,092,000	14,259,419.69	1.25
21	WEST CHINA CEMENT LTD	西部水泥	2233 HK	香港	中国香港	17,638,000	13,726,309.62	1.21
22	TENWO W INTERN ATIONA L HOLDIN G	天喔国际	1219 HK	香港	中国香港	6,358,000	13,706,379.94	1.20
23	CHINA EVERBR IGHT INT	中国光大 国际	257 HK	香港	中国香港	1,726,000	13,571,094.25	1.19
24	AVICHIN A INDUST RY & TECH-H	中航科工	2357 HK	香港	中国香港	2,809,000	13,417,703.67	1.18
25	YANGTZ E OPTICAL FIBRE AND-H	长飞光纤 光缆	6869 HK	香港	中国香港	1,018,000	13,313,135.45	1.17
26	HUA HONG SEMICO DUCTO R LTD	华虹半导 体	1347 HK	香港	中国香港	1,715,000	13,285,173.07	1.17
27	CHINA MODER N DAIRY HOLDIN GS	现代牧业	1117 HK	香港	中国香港	7,720,000	13,189,728.85	1.16
28	LUYE PHARMA GROUP LTD	绿叶制药	2186 HK	香港	中国香港	3,191,000	13,130,154.49	1.15
29	GREENT	绿城服务	2869 HK	香港	中国香港	5,504,000	12,948,497.40	1.14

	OWN SERVICE GROUP CO L	集团有限 公司						
30	CHONG QING RURAL COMME RCIAL-H	重庆农村 商业银行	3618 HK	香港	中国香港	3,072,000	12,503,102.98	1.10
31	PACIFIC TEXTILE S HOLDIN GS	互太纺织	1382 HK	香港	中国香港	1,660,000	12,502,745.17	1.10
32	NEW CHINA LIFE INSURA NCE C-H	新华保险	1336 HK	香港	中国香港	389,500	12,403,454.56	1.09
33	SHANGH AI JIN JIANG I	锦江酒店	2006 HK	香港	中国香港	6,764,000	12,403,454.56	1.09
34	CHINA PACIFIC INSURA	中国太保	2601 HK	香港	中国香港	511,600	12,378,927.10	1.09
35	SINOTR ANS LIMITED -H	中国外运	598 HK	香港	中国香港	3,946,000	12,212,888.15	1.07
36	FLEXIU M INTERC ONNECT INC	台郡科技	6269 TT	台湾	中国台湾	646,336	11,773,458.36	1.03
37	NINE DRAGO NS PAPER H	玖龙纸业	2689 HK	香港	中国香港	1,798,000	11,306,552.73	0.99
38	ZHOU HEI YA INTERN ATIONA L HO	周黑鸭国 际	1458 HK	香港	中国香港	1,832,500	11,146,489.11	0.98
39	CHINA RAILWA	中国通号	3969 HK	香港	中国香港	2,199,000	10,995,683.67	0.97

	Y SIGNAL & COM-H							
40	XINJIAN G GOLDWI ND SCI&TEC -H	金风科技	2208 HK	香港	中国香港	918,000	10,757,198.36	0.95
41	DALI FOODS GROUP CO LTD	达利食品	3799 HK	香港	中国香港	2,880,500	10,564,207.83	0.93
42	SINOTR UK HONG KONG L	中国重汽	3808 HK	香港	中国香港	2,134,500	10,558,603.72	0.93
43	ANTA SPORTS PRODUC TS	安踏体育	2020 HK	香港	中国香港	502,000	10,395,369.06	0.91
44	THE UNITED LABORA TOR	联邦制药	3933 HK	香港	中国香港	2,180,000	10,296,167.90	0.91
45	TRAVEL SKY TECHNO LOGY LTD-H	中国民航 信息网络	696 HK	香港	中国香港	705,000	10,279,261.67	0.90
46	GEELY AUTOM OBILE HOLDIN GS LT	吉利汽车	175 HK	香港	中国香港	1,495,000	9,909,337.05	0.87
47	FOSUN INTERN ATIONA L LTD	复星国际	656 HK	香港	中国香港	1,005,000	9,870,828.40	0.87
48	GENERA L INTERFA CE SOLUTI	GIS-KY	6456 TT	台湾	中国台湾	498,000	9,788,142.66	0.86

	ON							
49	CHINA HARMONY AUTO HOLDING GL	和谐汽车	3836 HK	香港	中国香港	3,932,500	9,779,096.40	0.86
50	SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	上海石化	338 HK	香港	中国香港	2,552,000	9,587,715.98	0.84
51	ANGANG STEEL CO LTD-H	鞍钢股份	347 HK	香港	中国香港	2,236,000	9,220,573.30	0.81
52	REGINA MIRACLE INTERNATIONAL	维珍妮	2199 HK	香港	中国香港	1,591,000	9,150,953.59	0.80
53	CHINA MOLYBDENUM CO	洛阳钼业	3993 HK	香港	中国香港	5,218,000	8,821,675.51	0.78
54	LIVZON PHARMACEUTICAL GROU-H	丽珠集团	1513 HK	香港	中国香港	203,420	8,261,039.58	0.73
55	SINOSOFT TECHNOLOGY GROUP LT	中国擎天软件	1297 HK	香港	中国香港	3,609,000	7,909,302.15	0.70
56	KINGBOARD CHEMICALS	建滔化工	148 HK	香港	中国香港	375,500	7,893,379.87	0.69
57	GUANGDONG YUEYUN TRANSP	广东粤运	3399 HK	香港	中国香港	2,050,000	7,720,068.56	0.68

	ORT-H							
58	DAWNRAYS PHARMACEUTI	东瑞制药	2348 HK	香港	中国香港	1,824,000	7,603,191.88	0.67
59	OURGAME INTERNATIONAL HOLDIN	联众	6899 HK	香港	中国香港	2,683,000	7,583,906.24	0.67
60	LIJUN INTL PHARMACET	石四药集团	2005 HK	香港	中国香港	3,372,527	7,451,395.04	0.66
61	EPISTAR CORP	晶元光电股份有限公司	2448 TT	台湾	中国台湾	1,478,000	7,349,795.96	0.65
62	AIA GROUP LTD	友邦保险	1299 HK	香港	中国香港	186,000	7,279,075.13	0.64
63	FAR EAST HORIZON LTD	远东宏信	3360 HK	香港	中国香港	1,218,000	7,245,262.65	0.64
64	CP POKPHAND CO	卜蜂国际	43 HK	香港	中国香港	7,814,000	6,710,113.09	0.59
65	CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD	中海物业	2669 HK	香港	中国香港	5,600,000	6,662,310.48	0.59
66	TIANNE NG POWER INTL	天能动力	819 HK	香港	中国香港	1,028,000	6,547,240.71	0.58
67	PW MEDTECH GROUP LTD	普华和顺	1358 HK	香港	中国香港	3,573,000	6,456,090.14	0.57
68	BEST PACIFIC	超盈国际控股	2111 HK	香港	中国香港	1,200,000	6,397,535.52	0.56

	INTERNATIONALH							
69	CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	康哲药业	867 HK	香港	中国香港	579,000	6,360,073.44	0.56
70	CHINA SANJIANG FINE CHEMICAL	中国三江化工	2198 HK	香港	中国香港	4,338,000	6,053,399.63	0.53
71	FLAT GLASS GROUP CO LTD	福莱特玻璃	6865 HK	香港	中国香港	3,829,000	5,891,135.52	0.52
72	PACIFIC BASIN SHIPPI	太平洋航运	2343 HK	香港	中国香港	5,244,000	5,863,513.05	0.52
73	BOC HONG KONG HOLDIN	中银香港	2388 HK	香港	中国香港	234,500	5,820,912.01	0.51
74	ASPEED TECHNOLOGY INC	信骅科技	5274 TT	台湾	中国台湾	49,000	4,978,598.16	0.44
75	ZHENGZHOU COAL MINING MACH-H	郑煤机	564 HK	香港	中国香港	1,373,800	4,976,955.24	0.44
76	SHANGHAI FUDAN MICROELECT-H	上海复旦	1385 HK	香港	中国香港	948,000	4,960,773.56	0.44
77	NETDRAGON WEBSOFT INC	网龙网络	777 HK	香港	中国香港	254,500	4,894,535.09	0.43
78	CHINA PHARM	石药集团	1093 HK	香港	中国香港	650,000	4,814,252.82	0.42

	ACEUTICAL GROUP							
79	CUB ELECPARTS INC	为升	2231 TT	台湾	中国台湾	83,000	4,484,003.42	0.39
80	TAIWAN LIPOSOME CO LTD	台微体	4152 TT	台湾	中国台湾	177,000	4,391,421.30	0.39
81	BEIJING TONREN TANG CHINESE	同仁堂国药	8138 HK	香港	中国香港	456,000	4,274,755.95	0.38
82	DIGITAL DOMAIN HOLDINGS LTD	数字王国	547 HK	香港	中国香港	9,550,000	4,143,146.69	0.36
83	SUMEEKO INDUSTRIES CO LTD	世德工业	2066 TT	台湾	中国台湾	161,000	3,838,828.48	0.34
84	HOTAL INDUSTRIAL MFG CO LTD	和大工业	1536 TT	台湾	中国台湾	113,000	3,034,158.82	0.27
85	PHARMAESSENTIA CORP	药华医药	6446 TT	台湾	中国台湾	86,000	2,983,464.20	0.26
86	CHINA FOODS LTD	中国食品	506 HK	香港	中国香港	1,000,000	2,942,937.90	0.26
87	BIZLINK HOLDING INC	贸联-KY	3665 TT	台湾	中国台湾	80,783	2,889,242.99	0.25
88	HARMONICARE MEDICAL HOLDINGS	和美医疗	1509 HK	香港	中国香港	553,000	2,542,573.11	0.22

89	YINGDE GASES GROUP CO LTD	盈德气体	2168 HK	香港	中国香港	960,000	2,464,553.95	0.22
90	WEICHA I POWER CO LTD	潍柴动力	2338 HK	香港	中国香港	224,000	2,392,420.67	0.21
91	CHINA HONGQI AO GROUP LTD	中国宏桥	1378 HK	香港	中国香港	339,500	2,071,139.51	0.18
92	CITIC SECURIT IES CO LTD-H	中信证券	6030 HK	香港	中国香港	146,000	2,058,231.73	0.18
93	SHANDO NG XINHUA PHARM ACEUT- H	新华制药	719 HK	香港	中国香港	370,000	1,734,275.99	0.15
94	PICC PROPER TY & CASU	中国财险	2328 HK	香港	中国香港	140,000	1,512,795.31	0.13
95	GENOVA TE BIOTEC HNOLOG Y CO	健亚	4130 TT	台湾	中国台湾	173,000	1,493,901.66	0.13
96	GOMAJI CORP LTD	够麻吉	8472 TT	台湾	中国台湾	140,000	1,330,733.73	0.12
97	TEXWIN CA HOLDIN GS LTD	德永佳集 团	321 HK	香港	中国香港	252,000	1,142,861.76	0.10
98	WISDOM HOLDIN GS GROU	智美体育	1661 HK	香港	中国香港	463,000	1,039,536.91	0.09
99	CHINA PETROL EUM &	中国石化	386 HK	香港	中国香港	164,000	806,848.02	0.07

	CH							
100	FUFENG GROUP LTD	阜丰集团	546 HK	香港	中国香港	131,000	446,458.89	0.04

8.5 报告期内权益投资组合的重大变动

8.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金 资产净值比例 （%）
1	TENCENT HOLDINGS LTD	700 HK	60,251,623.68	4.69
2	AIA GROUP LTD	1299 HK	47,977,754.61	3.74
3	CHINA EVERBRIGHT INT	257 HK	45,226,576.65	3.52
4	CHINA UNICOM HONG KO	762 HK	42,266,386.51	3.29
5	CHINA STATE CONSTRUC	3311 HK	42,108,841.63	3.28
6	NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	1336 HK	36,493,297.82	2.84
7	NINE DRAGONS PAPER H	2689 HK	35,779,686.69	2.79
8	SANDS CHINA LTD	1928 HK	34,173,310.93	2.66
9	ANHUI CONCH CEMENT C	914 HK	32,999,597.25	2.57
10	CHINA PACIFIC INSURA	2601 HK	29,652,883.97	2.31
11	GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	175 HK	27,688,201.76	2.16
12	ANGANG STEEL CO LTD-H	347 HK	27,111,755.37	2.11
13	HAITONG SECURITIES CO LTD-H	6837 HK	26,344,358.04	2.05
14	CHINA SOUTHERN AIRLI	1055 HK	25,568,105.72	1.99
15	HISENSE KELON ELEC H	921 HK	25,375,137.44	1.98
16	LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	2314 HK	25,180,718.04	1.96
17	CHONGQING RURAL	3618 HK	23,711,784.55	1.85

	COMMERCIAL-H			
18	SHENZHEN INTL HOLDIN	152 HK	23,008,227.93	1.79
19	CHINA MOLYBDENUM CO	3993 HK	22,961,871.49	1.79
20	PICC PROPERTY & CASU	2328 HK	21,914,203.02	1.71

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。

8.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	TENCENT HOLDINGS LTD	700 HK	90,831,375.27	7.07
2	CHINA STATE CONSTRUC	3311 HK	46,918,726.53	3.65
3	SHENZHEN INTL HOLDIN	152 HK	46,854,210.80	3.65
4	CHINA EVERBRIGHT INT	257 HK	46,127,525.90	3.59
5	NINE DRAGONS PAPER H	2689 HK	43,432,194.54	3.38
6	PING AN INSURANCE GR	2318 HK	43,112,605.62	3.36
7	AIA GROUP LTD	1299 HK	40,777,323.75	3.18
8	SANDS CHINA LTD	1928 HK	37,757,229.47	2.94
9	ANHUI CONCH CEMENT C	914 HK	35,862,449.35	2.79
10	DONGJIANG ENVIRONMENTAL-H	895 HK	28,613,523.81	2.23
11	HAITONG SECURITIES CO LTD-H	6837 HK	28,202,200.01	2.20
12	CHINA SOUTHERN AIRLI	1055 HK	26,027,328.07	2.03
13	NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	1336 HK	25,800,324.12	2.01
14	CHINA LIANSU GROUP H	2128 HK	23,581,817.47	1.84
15	CHINA UNICOM HONG KO	762 HK	23,023,005.16	1.79
16	GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	175 HK	22,831,511.55	1.78
17	WEST CHINA CEMENT LTD	2233 HK	22,748,412.89	1.77
18	SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG LTD	363 HK	22,678,327.01	1.77
19	SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	2607 HK	22,578,366.93	1.76
20	CHINA PACIFIC INSURA	2601 HK	21,578,857.16	1.68

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。

8.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	1,618,736,932.89
------------	------------------

卖出收入（成交）总额	1,720,719,989.07
------------	------------------

8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

8.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

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	521,630.65
2	应收证券清算款	2,959,819.23
3	应收股利	982,268.03
4	应收利息	4,366.96
5	应收申购款	223,726.27
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,691,811.14

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§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
20,222	50,410.05	293,908,471.40	28.83%	725,483,653.08	71.17%

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	490,539.27	0.05%

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

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	-

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2010年9月19日)基金份额总额	740,895,365.72
---------------------------	----------------

本报告期期初基金份额总额	1,153,167,866.96
本报告期基金总申购份额	491,617,312.91
减：本报告期基金总赎回份额	625,393,055.39
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,019,392,124.48

§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

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 117,000.00 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	
Merrill Lynch	1	426,479,915.37	12.77%	213,239.98	9.96%	-

Pierce Fenner & Smith Incorporated						
Goldman Sachs (Asia) Limited Liability Company	1	362,691,660.10	10.86%	181,345.88	8.47%	-
Credit Suisse(Hong Kong) Limited	1	409,867,793.89	12.27%	204,933.90	9.57%	-
Morgan Stanley & Co. International PLC	1	317,544,374.19	9.51%	225,264.80	10.52%	-
Shenyin Wanguo Securities(HK) Ltd.	1	227,209,214.37	6.80%	181,767.39	-	-
MasterLink Securities Corp	1	79,299,736.73	2.37%	111,019.57	5.18%	-
Guosen Securities(Hong Kong)	1	-	-	-	-	-
SinoPac Securities Corp.	1	-	-	-	-	-
Yuanta Securities Company Limited.	1	-	-	-	-	-
CCB International Securities Limited	1	-	-	-	-	-
Cathay Securities Corporation	1	-	-	-	-	-
Nomura International Plc.	1	-	-	-	-	-
China International Capital Corporation (HKS) Ltd	1	-	-	-	-	-

The Hongkong and Shanghai Banking Corporation Limited	1	-	-	-	-	-
BNP Paribas Securities (Asia) Ltd	1	-	-	-	-	-
Barclays Capital Asia Limited.	1	-	-	-	-	-
BOCI Securities Ltd.	1	-	-	-	-	-
Deutsche Securities Asia Limited	1	185,813,364.69	5.56%	92,906.74	4.00%	-
中金公司	1	885,349,706.95	26.51%	619,747.12	29.00%	-
上海证券	1	445,199,483.20	13.33%	311,639.49	15.00%	-

注：1、券商选择标准：

选择能够提供高质量的研究服务、交易服务和清算支持，具有良好声誉和财务状况的国内外经纪商。具体标准如下：

(1) 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；

(2) 具备高效、安全的通讯条件；可靠、诚信，能够公平对待所有客户，有效执行投资指令，取得较高质量的交易成交结果，交易差错少，并能满足基金运作高度保密的要求；

(3) 交易和清算支持多种方案，软件再开发的能力强，系统稳定安全等；

(4) 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；

(5) 其他有利于基金持有人利益的商业合作考虑。

2、券商选择程序：

(1) 对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选择标准和《券商服务评价办法》，对候选券商服务质量和综合实力进行评估。

(2) 填写《新增券商申请审核表》

牵头部门汇总对各候选券商的综合评估结果，择优选出拟新增券商，填写《新增券商申请审核

表》，对拟新增券商的必要性和合规性进行阐述。

(3) 候选券商名单提交分管领导审批

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

(4) 账户开立及通知托管人

基金管理人 与被选择的券商签署相关文件，办理开户手续，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：

报告期内新增中金公司交易单元。

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		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
Merrill Lynch Pierce Fenner & Smith Incorporated	-	-	-	-	-	-	-	-
Goldman Sachs (Asia) Limited Liability Company	-	-	-	-	-	-	-	-
Credit Suisse(Hong Kong) Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
Morgan Stanley & Co. International PLC	-	-	-	-	-	-	-	-
Shenyin Wanguo Securities(HK) Ltd.	-	-	-	-	-	-	-	-
MasterLink Securities Corp	-	-	-	-	-	-	-	-
Guosen Securities(Hong	-	-	-	-	-	-	-	-

Kong)								
SinoPac Securities Corp.	-	-	-	-	-	-	-	-
Yuanta Securities Company Limited.	-	-	-	-	-	-	-	-
CCB International Securities Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
Cathay Securities Corporation	-	-	-	-	-	-	-	-
Nomura International Plc.	-	-	-	-	-	-	-	-
China International Capital Corporation (HKS) Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
The Hongkong and Shanghai Banking Corporation Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
BNP Paribas Securities (Asia) Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
Barclays Capital Asia Limited.	-	-	-	-	-	-	-	-
BOCI Securities Ltd.	-	-	-	-	-	-	-	-
Deutsche Securities Asia Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	885,349,706.95	25.93%	-	-	-	-
上海证券	-	-	2,528,699,483.20	74.07%	-	-	-	-

11.8 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	华安基金关于 2016 年 1 月 4 日指数熔断期间调整旗下基金相关业务办理时间的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公	2016-01-04

		司网站	
2	华安基金管理有限公司关于旗下场内基金在指数熔断期间暂停申购赎回业务的提示性公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-01-06
3	华安基金管理有限公司关于参加渤海银行费率优惠的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-01-19
4	华安基金管理有限公司关于参加京东淘宝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	2016-01-19
5	关于旗下部分基金增加泰信财富为销售机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-01-25
6	华安基金管理有限公司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	2016-02-03
7	关于旗下部分基金增加上海凯石财富基金销售有限公司为销售机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-02-23
8	关于旗下部分基金增加中正为销售机构并参加费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-02-25
9	华安基金管理有限公司关于华安香港精选股票型证券投资基金因境外主要市场节假日暂停申购、赎回的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-03-22
10	华安基金管理有限公司关于参加深圳新兰德费率优惠的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-03-24
11	华安基金管理有限公司关于电子直销平台延长“微钱宝”账户交易费率优惠活动时间公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-03-28
12	关于华安旗下基金参加工商银行申购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	2016-03-30
13	关于旗下部分基金参加东亚银行(中国)有限公司定期定额申购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	2016-03-30
14	关于旗下部分基金增加苏州银行为销售机构并参加费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-03-30
15	华安基金管理有限公司关于以固有资金购买基金所涉风险资产的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-07-30
16	关于基金电子交易平台暂停部分基金赎回转	《上海证券报》、《证券时	2016-04-06

	申购业务的公告	报》、《中国证券报》和公司网站	
17	华安基金管理有限公司关于参加好买基金网费率优惠的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-04-11
18	关于旗下部分基金增加钱景财富为销售机构并参加费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-04-19
19	关于旗下部分基金增加格上理财为销售机构并参加费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-04-26
20	关于旗下部分基金增加中经北证为销售机构并参加费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-04-29
21	华安基金管理有限公司关于华安基金公司淘宝店关闭申购服务的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-05-05
22	华安基金管理有限公司关于基金电子交易平台支付宝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	2016-05-05
23	关于旗下部分基金增加金观诚为销售机构并参加费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-05-10
24	华安基金管理有限公司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	2016-05-10
25	关于华安旗下部分基金参加民生银行申购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	2016-05-14
26	华安基金管理有限公司关于参加中正费率优惠的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-05-18
27	关于华安基金管理有限公司旗下基金参加泉州银行优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-05-25
28	关于旗下部分基金增加东莞农商行为销售机构并参加费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-06-02
29	关于旗下部分基金增加晟视天下为销售机构并参加费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-06-03
30	华安基金管理有限公司关于电子直销平台延长“微钱宝”账户交易费率优惠活动时间公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-06-08

31	关于旗下部分基金增加奕丰金融为销售机构并参加费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-06-14
32	关于旗下部分基金增加广源达信为销售机构并参加费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-06-21
33	华安基金管理有限公司关于华安香港精选股票型证券投资基金因境外主要市场节假日暂停申购、赎回的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-06-28
34	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加京东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	2016-06-28
35	华安基金关于旗下部分基金增加金斧子为销售机构并参加费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-07-05
36	关于旗下部分基金增加凯恩斯为销售机构并参加费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-07-12
37	华安基金管理有限公司关于旗下基金参加和讯费率优惠的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-07-15
38	关于旗下部分基金增加常熟农商行为销售机构并参加费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-07-20
39	华安基金新增蛋卷基金代销并参加费率优惠的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-07-22
40	华安基金管理有限公司关于华安香港精选股票型证券投资基金因境外主要市场休市暂停申购、赎回的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-08-03
41	华安基金关于旗下部分基金增加大智慧为销售机构并参加费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-08-06
42	关于华安基金管理有限公司旗下基金参加中信证券优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-08-09
43	关于旗下部分基金增加创金启富为销售机构并参加费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-08-13
44	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	2016-08-15
45	关于华安基金管理有限公司旗下基金参加联泰优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-08-19

		司网站	
46	关于旗下部分基金增加新浪仓石为销售机构并参加费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-09-12
47	关于旗下部分基金增加嘉兴银行为销售机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-09-21
48	关于旗下部分基金增加宁波银行为销售机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-09-21
49	关于电子直销平台延长“微钱宝”账户交易费率优惠活动时间公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-09-23
50	华安基金管理有限公司关于华安香港精选股票型证券投资基金因境外主要市场节假日暂停申购、赎回的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-09-28
51	关于旗下部分基金增加万得为销售机构并参加费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-10-11
52	华安基金管理有限公司关于旗下基金参加钱景财富费率优惠的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-10-13
53	华安基金管理有限公司关于华安香港精选股票型证券投资基金因境外主要市场休市暂停申购、赎回的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-10-21
54	关于旗下部分基金增加途牛为销售机构并参加费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-10-27
55	关于旗下部分基金增加和耕为销售机构并参加费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-11-01
56	关于旗下部分基金增加云湾投资为销售机构并参加费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-11-10
57	华安香港精选股票型证券投资基金暂停大额申购及定期定额投资公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-11-10
58	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	2016-11-10
59	华安基金管理有限公司关于统一客户服务热线号的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-11-16
60	关于旗下部分基金增加乾道金融为销售机构	《上海证券报》、《证券时	2016-11-16

	并参加费率优惠活动的公告	报》、《中国证券报》和公司网站	
61	关于电子直销平台延长“微钱宝”账户交易费率优惠活动时间公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-11-29
62	关于华安基金管理有限公司旗下基金参加交通银行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	2016-11-29
63	关于旗下部分基金增加懒猫为销售机构并参加费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-11-30
64	华安基金管理有限公司关于旗下基金参加凯石费率优惠的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-11-30
65	关于旗下部分基金增加华鑫证券为销售机构并参加费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-12-06
66	关于旗下部分基金增加汇付金融为销售机构并参加费率优惠的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-12-13
67	关于旗下部分基金增加东海期货为销售机构并参加费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-12-20
68	华安基金管理有限公司关于华安香港精选股票型证券投资基金因境外主要市场节假日暂停赎回的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-12-21
69	关于华安基金管理有限公司旗下基金参加交通银行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	2016-12-22
70	关于旗下部分基金增加河北银行为销售机构并参加费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-12-27
71	关于华安基金管理有限公司旗下基金参加中国农业银行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	2016-12-28
72	关于旗下部分基金开通并参加中国工商银行股份有限公司基金定期定额投资优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-12-28
73	华安基金管理有限公司关于旗下基金参加苏州银行费率优惠的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-12-28
74	华安基金管理有限公司关于参加东莞银行费率优惠的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-12-30

75	华安基金管理有限公司关于参加烟台银行费率优惠的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-12-30
----	---------------------------	-----------------------------	------------

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。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、《华安香港精选股票型证券投资基金基金合同》
- 2、《华安香港精选股票型证券投资基金招募说明书》
- 3、《华安香港精选股票型证券投资基金托管协议》
- 4、中国证监会批准华安香港精选股票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
二〇一七年三月二十八日