

华安宝利配置证券投资基金
2017 年半年度报告摘要
2017 年 6 月 30 日

基金管理人：华安基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一七年八月二十五日

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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 23 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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | |
|------------|--------------------|------------|
| 基金简称 | 华安宝利配置混合 | |
| 基金主代码 | 040004 | |
| 交易代码 | 040004(前端) | 041004(后端) |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2004 年 8 月 24 日 | |
| 基金管理人 | 华安基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 交通银行股份有限公司 | |
| 报告期末基金份额总额 | 1,496,257,219.80 份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|--|
| 投资目标 | 本基金通过挖掘存在于各相关证券子市场以及不同金融工具之间的投资机会，灵活配置资产，并充分提高基金资产的使用效率，在实现基金资产保值的基础上获取更高的投资收益。 |
| 投资策略 | 基金管理人将通过对中国证券市场进行定量和定性的分析，采用积极的投资组合策略，保留可控制的风险，规避或降低无法控制的风险，发现和捕捉市场机会以实现基金的投资目标。 |
| 业绩比较基准 | 35%×天相转债指数收益率+30%×天相 280 指数收益率+30%×天相国债全价指数收益率+5%×金融同业存款利率 |
| 风险收益特征 | 本基金面临与其他开放式基金相同的风险(例如市场风险、流动性风险、管理风险、技术风险等)，但上述风险在本基金中存在一定的特殊性。本基金主要面临的风险为：利率风险,政策风险，经济周期风险，信用风险，再投资风险，上市公司经营风险，新产品创新带来的风险，购买力风险，流动性风险，现金管理风险，技术风险，管理风险，巨额赎回风险等。 |

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 | 交通银行股份有限公司 |
| 信息披露 负责人 | 姓名 | 钱鲲 | 陆志俊 |
| | 联系电话 | 021-38969999 | 95559 |
| | 电子邮箱 | qiankun@huaan.com.cn | luzj@bankcomm.com |
| 客户服务电话 | | 4008850099 | 95559 |
| 传真 | | 021-68863414 | 021-62701216 |

2.4 信息披露方式

| | |
|----------------------|--------------------------------|
| 登载基金半年度报告摘要的管理人互联网网址 | www.huaan.com.cn |
| 基金半年度报告备置地点 | 上海市世纪大道 8 号上海国金中心二期 31、32 层 |

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期（2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日） |
|---------------|--------------------------------------|
| 本期已实现收益 | -22,802,803.59 |
| 本期利润 | -2,193,149.83 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.0014 |
| 本期基金份额净值增长率 | -0.35% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2017 年 6 月 30 日) |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.1258 |
| 期末基金资产净值 | 1,684,542,647.63 |
| 期末基金份额净值 | 1.126 |

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 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③ | ②—④ |
|--------|----------|-------------|------------|---------------|---------|-------|
| 过去一个月 | 6.23% | 0.94% | 3.08% | 0.33% | 3.15% | 0.61% |
| 过去三个月 | -0.35% | 0.90% | 2.86% | 0.30% | -3.21% | 0.60% |
| 过去六个月 | -0.35% | 0.79% | 4.23% | 0.27% | -4.58% | 0.52% |
| 过去一年 | -3.01% | 0.82% | 6.49% | 0.33% | -9.50% | 0.49% |
| 过去三年 | 67.02% | 1.82% | 24.53% | 1.12% | 42.49% | 0.70% |
| 自基金合同生 | 821.96% | 1.36% | 118.90% | 0.89% | 703.06% | 0.47% |

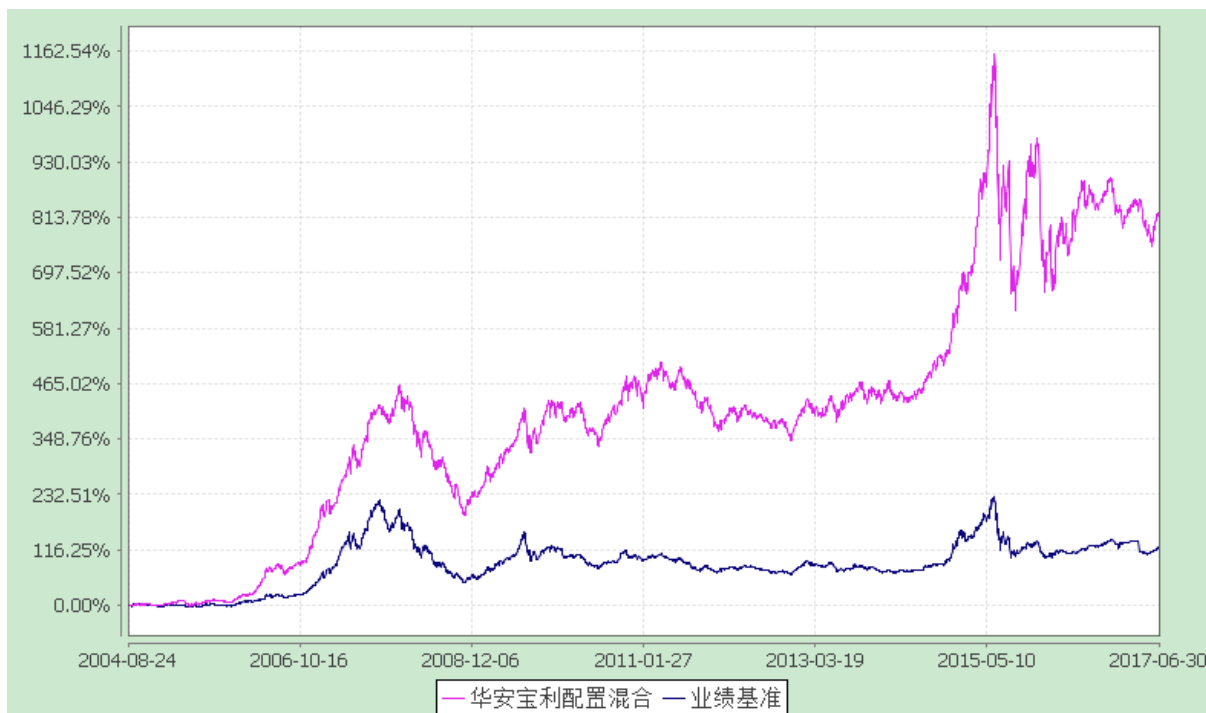
| | | | | | | |
|------|--|--|--|--|--|--|
| 效起至今 | | | | | | |
|------|--|--|--|--|--|--|

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

华安宝利配置证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2004 年 8 月 24 日至 2017 年 6 月 30 日)



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。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 2017 年 6 月 30 日，公司旗下共管理华安创新混合、华安 MSCI 中国 A、华安现金富利货币、华安稳定收益债券、华安黄金易 ETF、华安沪港深外延增长混合、华安全球美元收

益债券等 96 只开放式基金，管理资产规模达到 1478.85 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 | 2015-09- 25 | - | 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 月起担任本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 月起担任华安智增精选灵活配置混合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遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了《华安基金管理有限公司公平交易管理制度》，将封闭式基金、开放式基金、特定客户资产管理组合及其他投资组合资产在研究分析、投资决策、交易执行等方面全部纳入公平交易管理中。控制措施包括：在研究环节，研究员在为公司管理的各类投资组合提供研究信息、投资建议过程中，使用晨会发言、邮件发送、登录在研究报告管理系统中等方式来确保各类投资组合经理可以公平享有信息获取机会。在投资环节，公司各投资组合经理根据投资组合的风格和投资策略，制定并严格执行交易决策规则，以保证各投资组合交易决策的客观性和独立性。同时严格执行投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体授权机制，投资组合经理在授权范围内自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易环节，公司实行强制公平交易机制，确保各投资组合享有公平的交

易执行机会。（1）交易所二级市场业务，遵循价格优先、时间优先、比例分配、综合平衡的控制原则，实现同一时间下达指令的投资组合在交易时机上的公平性。（2）交易所一级市场业务，投资组合经理按意愿独立进行业务申报，集中交易部以投资组合名义对外进行申报。若该业务以公司名义进行申报与中签，则按实际中签情况以价格优先、比例分配原则进行分配。若中签量过小无法合理进行比例分配，且以公司名义获得，则投资部门在合规监察员监督参与下，进行公平协商分配。

（3）银行间市场业务遵循指令时间优先原则，先到先询价的控制原则。通过内部共同的 iwind 群，发布询价需求和结果，做到信息公开。若是多个投资组合进行一级市场投标，则各投资组合经理须以各投资组合名义向集中交易部下达投资意向，交易员以此进行投标，以确保中签结果与投资组合投标意向一一对应。若中签量过小无法合理进行比例分配，且以公司名义获得，则投资部门在风险管理部投资监督参与下，进行公平协商分配。交易监控、分析与评估环节，公司风险管理部对公司旗下的各投资组合投资境内证券市场上市交易的投资品种、进行场外的非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购、不同投资组合同日和临近交易日的反向交易以及可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控，根据市场公认的第三方信息（如：中债登的债券估值），定期对各投资组合与交易对手之间议价交易的交易价格公允性进行审查，对不同投资组合临近交易日的同向交易的交易时机和交易价差进行分析。

本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

本基金管理人通过统计检验的方法对管理的不同投资组合，在不同时间窗下（日内、3 日内、5 日内）的同向交易价差进行了专项分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

本报告期内，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 0 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

一季度 PPI 见顶后，上半年经济基本面缓慢下移；在去杠杆的大方针政策背景下，整个市场在

二季度经历了一次严重的流动性收缩，叠加 IPO 保持一个快速的供给，A 股市场呈现了结构性塌方，很多流动性不佳的小盘股遭遇估值与盈利双杀，但以中国版“漂亮 50”为代表的流动性好的大股票表现却异常优秀。

经历过一年多来市场教育，市场逐步形成有中国特色的投资价值取向，我们也在出现新因素后逐步修正原先的投资框架。本基金由于注重采用自下而上的选股策略，流动性收缩带来的结构性调整幅度远超我们的预期，加之在领先板块配置比重上偏低，导致上半年本基金业绩表现较为一般，但我们对精选的个股有足够的信心和耐心，接下来我们会保持持续跟踪并动态修正对投资标的的预期从而对持仓进行调整。由于未来一段时间，企业盈利分化严重，利率高位盘整，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选择可以较好把握基本面和未来表现的品种，尤其好公司如果存在信息被市场误读而出现错杀带来的投资机会，努力为投资人创造更好的收益。

上半年本基金负贡献主要来自于持仓结构。组合结构上，由于我们年初对流动性收缩力度和进度存在一定的估计不足，成长股持股比例过高，在市场结构性调整过程中，受到的冲击较大。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2017 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.126 元，本报告期份额净值增长率为-0.35%，同期业绩比较基准增长率为 4.23%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从短期静态的视角看，宏观经济韧性超过市场预期，但在去杠杆的大背景下市场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，市场依然存在一定的结构性机会，特别是一些具有时代特征的高质量优质成长股和政策受益标的。因此在操作上，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

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，负责在证券发行机构发生了严重影响证券价格的重大事件时，评估重大事件对投资品种价值的影响程度、评估对基金估值的影响程度、确定采用的估值方法、确定该证券的公允价值；同时将采用的估值方法以及采用该方法对相关证券的估值与基金的托管银行

进行沟通。估值委员会成员由投资总监、研究总监、固定收益部总监、指数投资部总监、基金运营部总经理、风险管理部总监等人员组成，具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备行业研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供银行间同业市场及交易所交易的债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期不进行收益分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金报告期内不存在基金持有人数低于 200 人或基金资产净值低于 5000 万元的情形。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2017 半年度，基金托管人在华安宝利配置证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

2017 半年度，华安基金管理有限公司在华安宝利配置证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配，符合基金合同的规定。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

2017 半年度，由华安基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关华安宝利配置证券投资基金的半年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华安宝利配置证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产 | 本期末 2017 年 6 月 30 日 | 上年度末 2016 年 12 月 31 日 |
|-----------------|--------------------------------|----------------------------------|
| 资产： | - | - |
| 银行存款 | 10,238,192.50 | 35,455,591.52 |
| 结算备付金 | 92,199,583.21 | 82,475,668.15 |
| 存出保证金 | 1,014,144.33 | 1,164,468.62 |
| 交易性金融资产 | 1,537,259,406.73 | 1,813,536,034.66 |
| 其中：股票投资 | 1,314,522,854.03 | 1,536,206,510.64 |
| 基金投资 | - | - |
| 债券投资 | 222,736,552.70 | 277,329,524.02 |
| 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 | 46,990,316.44 | 35,356,538.36 |
| 应收利息 | 4,582,428.20 | 5,079,142.37 |
| 应收股利 | - | - |
| 应收申购款 | 216,128.09 | 595,300.41 |
| 递延所得税资产 | - | - |
| 其他资产 | - | - |
| 资产总计 | 1,692,500,199.50 | 1,973,662,744.09 |
| 负债和所有者权益 | 本期末 2017 年 6 月 30 日 | 上年度末 2016 年 12 月 31 日 |
| 负债： | - | - |
| 短期借款 | - | - |
| 交易性金融负债 | - | - |
| 衍生金融负债 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | - | - |
| 应付证券清算款 | - | - |
| 应付赎回款 | 2,802,364.51 | 1,677,154.32 |
| 应付管理人报酬 | 1,621,881.23 | 2,059,735.61 |
| 应付托管费 | 337,891.91 | 429,111.56 |
| 应付销售服务费 | - | - |
| 应付交易费用 | 2,739,514.75 | 3,938,542.47 |
| 应交税费 | - | - |

| | | |
|-------------------|-------------------------|-------------------------|
| 应付利息 | - | - |
| 应付利润 | - | - |
| 递延所得税负债 | - | - |
| 其他负债 | 455,899.47 | 647,581.13 |
| 负债合计 | 7,957,551.87 | 8,752,125.09 |
| 所有者权益： | - | - |
| 实收基金 | 1,496,257,219.80 | 1,739,587,881.56 |
| 未分配利润 | 188,285,427.83 | 225,322,737.44 |
| 所有者权益合计 | 1,684,542,647.63 | 1,964,910,619.00 |
| 负债和所有者权益总计 | 1,692,500,199.50 | 1,973,662,744.09 |

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.126 元，基金份额总额 1,496,257,219.80 份。

6.2 利润表

会计主体：华安宝利配置证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日 |
|-----------------------|--|---|
| 一、收入 | 20,688,174.31 | -207,552,537.70 |
| 1.利息收入 | 4,859,326.62 | 6,726,745.05 |
| 其中：存款利息收入 | 1,088,838.82 | 1,915,020.41 |
| 债券利息收入 | 3,766,935.71 | 4,343,954.73 |
| 资产支持证券利息收入 | - | 165,737.18 |
| 买入返售金融资产收入 | 3,552.09 | 302,032.73 |
| 其他利息收入 | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | -5,225,661.26 | -144,877,023.02 |
| 其中：股票投资收益 | -13,153,140.54 | -150,835,020.74 |
| 基金投资收益 | - | - |
| 债券投资收益 | 128,600.00 | 245,812.13 |
| 资产支持证券投资收益 | - | 341,546.12 |
| 贵金属投资收益 | - | - |
| 衍生工具收益 | - | - |
| 股利收益 | 7,798,879.28 | 5,370,639.47 |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 20,609,653.76 | -73,045,809.13 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | - | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 444,855.19 | 3,643,549.40 |
| 减：二、费用 | 22,881,324.14 | 34,577,257.84 |
| 1. 管理人报酬 | 10,259,943.53 | 13,171,769.57 |
| 2. 托管费 | 2,137,488.18 | 2,744,118.71 |

| | | |
|----------------------------|----------------------|------------------------|
| 3. 销售服务费 | - | - |
| 4. 交易费用 | 10,265,171.06 | 18,445,038.55 |
| 5. 利息支出 | - | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | - | - |
| 6. 其他费用 | 218,721.37 | 216,331.01 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | -2,193,149.83 | -242,129,795.54 |
| 减：所得税费用 | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | -2,193,149.83 | -242,129,795.54 |

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安宝利配置证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日 | | |
|--|--|------------------|------------------|
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益（基金净值） | 1,739,587,881.56 | 225,322,737.44 | 1,964,910,619.00 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | -2,193,149.83 | -2,193,149.83 |
| 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） | -243,330,661.76 | -34,844,159.78 | -278,174,821.54 |
| 其中：1.基金申购款 | 116,578,431.58 | 13,556,753.79 | 130,135,185.37 |
| 2.基金赎回款 | -359,909,093.34 | -48,400,913.57 | -408,310,006.91 |
| 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） | 1,496,257,219.80 | 188,285,427.83 | 1,684,542,647.63 |
| 项目 | 上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日 | | |
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益（基金净值） | 1,171,351,204.30 | 1,028,473,619.77 | 2,199,824,824.07 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | -242,129,795.54 | -242,129,795.54 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净 | 721,958,794.09 | 1,309,478,946.90 | 2,031,437,740.99 |

| | | | |
|--|-------------------|-------------------|-------------------|
| 值减少以“-”号填列) | | | |
| 其中：1.基金申购款 | 3,635,391,341.06 | 1,340,787,388.07 | 4,976,178,729.13 |
| 2.基金赎回款 | -2,913,432,546.97 | -31,308,441.17 | -2,944,740,988.14 |
| 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) | - | -1,791,718,987.56 | -1,791,718,987.56 |
| 五、期末所有者权益（基金净值) | 1,893,309,998.39 | 304,103,783.57 | 2,197,413,781.96 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：朱学华，主管会计工作负责人：赵敏，会计机构负责人：陈林

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华安宝利配置证券投资基金(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”)证监基金字[2004]第 97 号《关于同意华安宝利配置证券投资基金设立的批复》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《华安宝利配置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人民币 1,130,461,912.15 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(2004)第 161 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华安宝利配置证券投资基金基金合同》于 2004 年 8 月 24 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,130,480,770.08 份基金份额，其中认购资金利息折合 18,857.93 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，基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《华安宝利配置证券投资基金基金合同》和最新发布的《华安宝利配置证券投资基金更新的招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围为国内依法公开发行、上市的股票、债券及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。本基金所持有的可转换债券及其对应的基础股票市值占基金资产净值的目标比例为 45%，最低比例为 10%，最高比例为 70%(其中所对应的基础股票的投资比例不超过基金资产净值的 20%)；除可转换债券外的其它债券市值占基金资产净值的目标比例为 30%，最低比例为 10%，最高比例为 65%；除可转换债券所对应基础股票外的其它股票市值占基金资产净值的目标比例为 20%，最低比例为 10%，最高比例为 65%。本基金的业绩比较基准为：天相转债指数收益率×35%+天相 280 指数收益率×30%+天相国债全价指数收益率×30%+金融同业存款利率×5%。

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 8 月 23 日批准报出。

6.4.2 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 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会公告[2010]5 号《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>》、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华安宝利配置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发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2017 年上半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 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本会计期间不存在会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本会计期间不存在差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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[2012]85 号《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》、财税[2015]101 号《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》、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补充政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，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。管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。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，对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2) 对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。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，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，于 2015 年 9 月 8 日前暂减按 25% 计入应纳税所得额，自 2015 年 9 月 8 日起，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 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。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

无。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|----------------------|---------------------|
| 华安基金管理有限公司(“华安基金公司”) | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |
| 交通银行股份有限公司(“交通银行”) | 基金托管人、基金代销机构 |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

无。

6.4.8.1.2 权证交易

无。

6.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

无。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017年1月1日至2017年6月 30日 | 上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月 30日 |
|-----------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 10,259,943.53 | 13,171,769.57 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 2,138,288.25 | 1,999,951.29 |

注：支付基金管理人华安基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.2%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 X 1.2% / 当年天数。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017年1月1日至2017年6月 30日 | 上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月 30日 |
|----------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 2,137,488.18 | 2,744,118.71 |

注：支付基金托管人交通银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25%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：日托管费=前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.8.4.2 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

基金管理公司主要股东及其控制的机构本报告期末和上年度末均无投资本基金的情况。

6.4.8.5 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 | | 上年度可比期间 | |
|-------|----------------------|-----------|----------------------|------------|
| | 2017年1月1日至2017年6月30日 | | 2016年1月1日至2016年6月30日 | |
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 交通银行 | 10,238,192.50 | 79,955.89 | 25,409,514.62 | 266,846.36 |

注：1. 本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，按银行同业利率计息。

2. 本基金用于证券交易结算的资金通过“交通银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司，按银行同业利率计息。于 2017 年 6 月 30 日的相关余额在资产负债表中的“结算备付金”科目中单独列示(2016 年 6 月 30 日：同)。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.9 期末（2017 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 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

| 6.4.9.1.1 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 | 认购价格 | 期末估值单价 | 数量(单位：股) | 期末成本 | 期末估值 | 备注 |
| | | | | | | | | | | |

| | | | | 限类型 | | | | 总额 | 总额 | |
|--------|------|------------|------------|------|-------|-------|----------|-----------|-----------|---|
| 002879 | 长缆科技 | 2017-06-05 | 2017-07-07 | 网下中签 | 18.02 | 18.02 | 1,313.00 | 23,660.26 | 23,660.26 | - |
| 002882 | 金龙羽 | 2017-06-15 | 2017-07-17 | 网下中签 | 6.20 | 6.20 | 2,966.00 | 18,389.20 | 18,389.20 | - |
| 300670 | 大烨智能 | 2017-06-26 | 2017-07-03 | 网下中签 | 10.93 | 10.93 | 1,259.00 | 13,760.87 | 13,760.87 | - |
| 300671 | 富满电子 | 2017-06-27 | 2017-07-05 | 网下中签 | 8.11 | 8.11 | 942.00 | 7,639.62 | 7,639.62 | - |
| 300672 | 国科微 | 2017-06-30 | 2017-07-12 | 网下中签 | 8.48 | 8.48 | 1,257.00 | 10,659.36 | 10,659.36 | - |
| 603305 | 旭升股份 | 2017-06-30 | 2017-07-20 | 网下中签 | 11.26 | 11.26 | 1,351.00 | 15,212.26 | 15,212.26 | - |
| 603331 | 百达精工 | 2017-06-27 | 2017-07-05 | 网下中签 | 9.63 | 9.63 | 999.00 | 9,620.37 | 9,620.37 | - |
| 603617 | 君禾股份 | 2017-06-23 | 2017-07-03 | 网下中签 | 8.93 | 8.93 | 832.00 | 7,429.76 | 7,429.76 | - |
| 603933 | 睿能科技 | 2017-06-28 | 2017-07-06 | 网下中签 | 20.20 | 20.20 | 857.00 | 17,311.40 | 17,311.40 | - |

6.4.9.2 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 |
|--------|------|------------|--------|--------|------|--------|--------------|---------------|---------------|----|
| 002447 | 壹桥股份 | 2017-05-02 | 重大资产重组 | 8.53 | - | - | 7,000,000.00 | 66,234,157.45 | 59,710,000.00 | - |

注：本基金截至 2017 年 6 月 30 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。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 增值税

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[2016]140 号《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：(1) 金融商品持有期间(含到期)取得的非保本收益(合同中未明确承诺到期本金可全部收回的投资收益)，不征收增值税；(2) 纳税人购入基金、信托、理财产品等各类资产管理产品持有至到期，不属于金融商品转让；(3) 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。上述政策自 2016 年 5 月 1 日起执行。

此外，根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》及 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|------------------|---------------|
| 1 | 权益投资 | 1,314,522,854.03 | 77.67 |
| | 其中：股票 | 1,314,522,854.03 | 77.67 |
| 2 | 固定收益投资 | 222,736,552.70 | 13.16 |
| | 其中：债券 | 222,736,552.70 | 13.16 |
| | 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 | 102,437,775.71 | 6.05 |
| 7 | 其他各项资产 | 52,803,017.06 | 3.12 |
| 8 | 合计 | 1,692,500,199.50 | 100.00 |

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|------------------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | 59,710,000.00 | 3.54 |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 967,615,206.77 | 57.44 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | 60,473,930.00 | 3.59 |
| F | 批发和零售业 | 32,693,376.00 | 1.94 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 50,445,642.00 | 2.99 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 28,321,694.62 | 1.68 |
| J | 金融业 | 115,263,004.64 | 6.84 |
| 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 | - | - |
| 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 | 1,314,522,854.03 | 78.03 |

7.3 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 | 300007 | 汉威电子 | 6,246,668 | 120,310,825.68 | 7.14 |
| 2 | 600686 | 金龙汽车 | 5,553,600 | 73,862,880.00 | 4.38 |
| 3 | 600885 | 宏发股份 | 1,719,087 | 68,574,380.43 | 4.07 |
| 4 | 603517 | 绝味食品 | 1,957,115 | 68,244,600.05 | 4.05 |
| 5 | 603737 | 三棵树 | 1,029,295 | 66,008,688.35 | 3.92 |
| 6 | 000823 | 超声电子 | 4,239,281 | 61,130,432.02 | 3.63 |
| 7 | 002325 | 洪涛股份 | 8,284,100 | 60,473,930.00 | 3.59 |
| 8 | 002447 | 壹桥股份 | 7,000,000 | 59,710,000.00 | 3.54 |
| 9 | 600114 | 东睦股份 | 3,235,134 | 56,614,845.00 | 3.36 |
| 10 | 000858 | 五 粮 液 | 932,250 | 51,889,035.00 | 3.08 |

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于基金管理人网站的半年度报告正文。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2% 或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计买入金额 | 占期初基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|-------|----------------|-----------------|
| 1 | 601336 | 新华保险 | 153,794,913.34 | 7.83 |
| 2 | 600109 | 国金证券 | 126,033,538.82 | 6.41 |
| 3 | 300007 | 汉威科技 | 124,520,786.54 | 6.34 |
| 4 | 601818 | 光大银行 | 107,932,649.19 | 5.49 |
| 5 | 002241 | 歌尔股份 | 89,853,297.61 | 4.57 |
| 6 | 601601 | 中国太保 | 85,225,361.59 | 4.34 |
| 7 | 603517 | 绝味食品 | 83,196,089.06 | 4.23 |
| 8 | 002325 | 洪涛股份 | 75,052,649.27 | 3.82 |
| 9 | 000823 | 超声电子 | 74,375,181.95 | 3.79 |
| 10 | 000970 | 中科三环 | 74,178,319.53 | 3.78 |
| 11 | 600549 | 厦门钨业 | 70,416,041.40 | 3.58 |
| 12 | 600885 | 宏发股份 | 66,355,944.33 | 3.38 |
| 13 | 600686 | 金龙汽车 | 64,341,798.00 | 3.27 |
| 14 | 001979 | 招商蛇口 | 63,204,703.44 | 3.22 |
| 15 | 000858 | 五 粮 液 | 62,720,477.36 | 3.19 |
| 16 | 600185 | 格力地产 | 61,802,789.00 | 3.15 |
| 17 | 002668 | 奥马电器 | 61,611,023.33 | 3.14 |
| 18 | 600004 | 白云机场 | 60,873,531.89 | 3.10 |
| 19 | 600570 | 恒生电子 | 60,818,304.28 | 3.10 |
| 20 | 600563 | 法拉电子 | 57,529,577.16 | 2.93 |
| 21 | 600466 | 蓝光发展 | 56,139,364.05 | 2.86 |

| | | | | |
|----|--------|-------|---------------|------|
| 22 | 002510 | 天汽模 | 53,323,209.68 | 2.71 |
| 23 | 002425 | 凯撒文化 | 53,153,305.29 | 2.71 |
| 24 | 300458 | 全志科技 | 52,600,805.98 | 2.68 |
| 25 | 600039 | 四川路桥 | 50,496,887.92 | 2.57 |
| 26 | 600755 | 厦门国贸 | 50,284,542.65 | 2.56 |
| 27 | 600426 | 华鲁恒升 | 49,052,744.93 | 2.50 |
| 28 | 603737 | 三棵树 | 45,319,170.54 | 2.31 |
| 29 | 000002 | 万 科 A | 44,711,593.69 | 2.28 |
| 30 | 002466 | 天齐锂业 | 43,726,205.29 | 2.23 |
| 31 | 002240 | 威华股份 | 42,452,640.12 | 2.16 |
| 32 | 000639 | 西王食品 | 40,083,247.51 | 2.04 |
| 33 | 600031 | 三一重工 | 39,969,386.76 | 2.03 |

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

7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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 | 600109 | 国金证券 | 199,976,736.70 | 10.18 |
| 2 | 002510 | 天汽模 | 167,637,117.90 | 8.53 |
| 3 | 601336 | 新华保险 | 124,426,595.58 | 6.33 |
| 4 | 601601 | 中国太保 | 112,924,200.57 | 5.75 |
| 5 | 603799 | 华友钴业 | 111,494,016.47 | 5.67 |
| 6 | 601818 | 光大银行 | 106,436,876.15 | 5.42 |
| 7 | 600576 | 万家文化 | 104,463,737.18 | 5.32 |
| 8 | 002200 | 云投生态 | 97,968,554.02 | 4.99 |
| 9 | 600259 | 广晟有色 | 92,510,771.45 | 4.71 |
| 10 | 601186 | 中国铁建 | 85,380,914.59 | 4.35 |
| 11 | 600549 | 厦门钨业 | 77,372,334.30 | 3.94 |
| 12 | 600185 | 格力地产 | 73,874,050.27 | 3.76 |
| 13 | 000970 | 中科三环 | 72,984,999.85 | 3.71 |
| 14 | 300411 | 金盾股份 | 71,078,298.43 | 3.62 |
| 15 | 603737 | 三棵树 | 67,537,454.32 | 3.44 |
| 16 | 600546 | 山煤国际 | 64,321,965.22 | 3.27 |
| 17 | 001979 | 招商蛇口 | 63,487,694.41 | 3.23 |
| 18 | 603718 | 海利生物 | 62,327,117.75 | 3.17 |
| 19 | 600570 | 恒生电子 | 60,680,772.88 | 3.09 |
| 20 | 002668 | 奥马电器 | 60,368,409.09 | 3.07 |
| 21 | 002284 | 亚太股份 | 60,156,104.86 | 3.06 |
| 22 | 002447 | 壹桥股份 | 57,813,711.78 | 2.94 |

| | | | | |
|----|--------|------|---------------|------|
| 23 | 600859 | 王府井 | 56,696,392.86 | 2.89 |
| 24 | 002241 | 歌尔股份 | 54,797,780.13 | 2.79 |
| 25 | 601628 | 中国人寿 | 52,360,587.62 | 2.66 |
| 26 | 300196 | 长海股份 | 51,777,053.57 | 2.64 |
| 27 | 002425 | 凯撒文化 | 51,503,785.34 | 2.62 |
| 28 | 600466 | 蓝光发展 | 49,561,884.86 | 2.52 |
| 29 | 002325 | 洪涛股份 | 49,429,103.57 | 2.52 |
| 30 | 000002 | 万科 A | 44,418,858.06 | 2.26 |
| 31 | 600039 | 四川路桥 | 43,210,872.44 | 2.20 |
| 32 | 600031 | 三一重工 | 39,798,410.01 | 2.03 |
| 33 | 002240 | 威华股份 | 39,311,522.57 | 2.00 |

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。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

| | |
|---------------|------------------|
| 买入股票的成本（成交）总额 | 3,222,344,373.05 |
| 卖出股票的收入（成交）总额 | 3,456,574,904.20 |

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种 | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|----------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | 2,051,200.00 | 0.12 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 149,781,000.00 | 8.89 |
| | 其中：政策性金融债 | 149,781,000.00 | 8.89 |
| 4 | 企业债券 | 26,265,967.10 | 1.56 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债（可交换债） | 44,638,385.60 | 2.65 |
| 8 | 同业存单 | - | - |

| | | | |
|----|----|----------------|-------|
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 222,736,552.70 | 13.22 |

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量(张) | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|----------|---------|---------------|--------------|
| 1 | 150201 | 15 国开 01 | 900,000 | 89,991,000.00 | 5.34 |
| 2 | 128013 | 洪涛转债 | 294,058 | 29,788,075.40 | 1.77 |
| 3 | 140440 | 14 农发 40 | 200,000 | 20,018,000.00 | 1.19 |
| 4 | 150417 | 15 农发 17 | 200,000 | 20,002,000.00 | 1.19 |
| 5 | 150317 | 15 进出 17 | 200,000 | 19,770,000.00 | 1.17 |

7.7 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。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证投资。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期没有投资股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

无。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期没有投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

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

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|----|---------|---------------|
| 1 | 存出保证金 | 1,014,144.33 |
| 2 | 应收证券清算款 | 46,990,316.44 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 4,582,428.20 |
| 5 | 应收申购款 | 216,128.09 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 52,803,017.06 |

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|----------|---------------|--------------|
| 1 | 128010 | 顺昌转债 | 10,988,435.70 | 0.65 |
| 2 | 128013 | 洪涛转债 | 29,788,075.40 | 1.77 |
| 3 | 132002 | 15 天集 EB | 731,493.50 | 0.04 |
| 4 | 132003 | 15 清控 EB | 775,838.00 | 0.05 |
| 5 | 132004 | 15 国盛 EB | 2,354,543.00 | 0.14 |

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值 | 占基金资产净值比例(%) | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|---------------|--------------|----------|
| 1 | 002447 | 壹桥股份 | 59,710,000.00 | 3.54 | 重大资产重组 |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|---|
| | | | | | 组 |
|--|--|--|--|--|---|

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 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 |
| 109,688 | 13,641.03 | 4,774,086.33 | 0.32% | 1,491,483,133. 47 | 99.68% |

8.2 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 | 346,465.64 | 0.02% |

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间为 0；
本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 0。

9 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|--------------------------------|------------------|
| 基金合同生效日（2004 年 8 月 24 日）基金份额总额 | 1,130,480,770.08 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 1,739,587,881.56 |
| 本报告期基金总申购份额 | 116,578,431.58 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 359,909,093.34 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 1,496,257,219.80 |

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本基金管理人重大人事变动如下：

2017 年 8 月 9 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》，章国富先生不再担任本基金管理人的副总经理。

2、本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动如下：

无。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内无基金投资策略的改变。

10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

本报告期内无改聘会计师事务所的情况。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内无管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|------|--------|------------------|--------------|--------------|------------|----|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 | |
| 中投证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东莞证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 渤海证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中信证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中银国际 | 1 | - | - | - | - | - |
| 兴业证券 | 1 | 2,938,193,017.85 | 44.02% | 2,736,339.13 | 44.02% | - |
| 海通证券 | 1 | 2,422,632,987.63 | 36.30% | 2,256,201.66 | 36.30% | - |
| 申万宏源 | 1 | 1,028,167,975.18 | 15.40% | 957,525.61 | 15.40% | - |

| | | | | | | |
|------|---|----------------|-------|------------|-------|---|
| 中信建投 | 1 | 230,972,666.00 | 3.46% | 215,106.19 | 3.46% | - |
| 长城证券 | 1 | 54,488,787.36 | 0.82% | 50,744.39 | 0.82% | - |

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，最大限度地调动物体资源，为基金投资赢取机会；
- (4) 其他有利于基金持有人利益的商业合作考虑。

2、券商专用交易单元选择程序：

(1) 对交易单元候选券商的综合服务进行评估

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

(2) 填写《新增交易单元申请审核表》

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

(3) 候选交易单元名单提交分管领导审批

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

(4) 协议签署及通知托管人

基金管理人与被选择的券商签订《证券交易单元租用协议》，并通知基金托管人。

3、报告期内基金租用券商交易单元的变更情况：

无。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 | | 回购交易 | | 权证交易 | |
|------|------|------|------|------|------|------|
| | 成交金额 | 占当期债 | 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 |
|------|---|--------------|---|--------------|---|--------------|
| 中投证券 | - | - | - | - | - | - |
| 东莞证券 | - | - | - | - | - | - |
| 渤海证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中银国际 | - | - | - | - | - | - |
| 兴业证券 | - | - | - | - | - | - |
| 海通证券 | - | - | - | - | - | - |
| 申万宏源 | - | - | - | - | - | - |
| 中信建投 | - | - | - | - | - | - |
| 长城证券 | - | - | - | - | - | - |

11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 影响投资者决策的其他重要信息

无。

华安基金管理有限公司
二〇一七年八月二十五日