

华安事件驱动量化策略混合型证券投资基金
2017 年半年度报告
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：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一七年八月二十五日

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业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。

1.2 目录

1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	12
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	12
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	16
7 投资组合报告	38
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	39
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	47
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	47
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	47
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	47
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	47
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	48
7.12 投资组合报告附注	48
8 基金份额持有人信息	49
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	49

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	49
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	49
9 开放式基金份额变动	49
10 重大事件揭示	50
10.1 基金份额持有人大会决议	50
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	50
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	50
10.4 基金投资策略的改变	50
10.5 报告期内改聘会计师事务所情况	50
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	50
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	50
10.8 其他重大事件	52
11 影响投资者决策的其他重要信息	54
12 备查文件目录	54
12.1 备查文件目录	54
12.2 存放地点	55
12.3 查阅方式	55

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华安事件驱动量化策略混合型证券投资基金
基金简称	华安事件驱动量化策略混合
基金主代码	002179
交易代码	002179
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 12 月 14 日
基金管理人	华安基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	225,683,964.80 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制投资组合风险的前提下，利用公开信息，通过量化的方法，发掘可能对上市公司当前或未来价值产生重大影响各类事件，把握投资机会，力争为投资者带来长期超额收益。
投资策略	<p>本基金采取相对灵活的资产配置策略，通过将基金资产在权益类、固定收益类工具之间灵活配置，并适当借用金融衍生品的投资来追求基金资产的长期稳健增值。在具体大类资产配置过程中，本基金将使用定量与定性相结合的研究方法对宏观经济、国家政策、资金面和市场情绪等可能影响证券市场的重要因素进行研究和预测，结合使用公司自主研发的多因子动态资产配置模型、基于投资时钟理论的量化资产配置模型等经济模型，分析和比较股票、债券等市场和不同金融工具的风险收益特征，确定合适的资产配置比例，动态优化投资组合。</p> <p>股票投资方面，在基金合同约定的投资比例范围内，本基金主要根据事件驱动量化策略模型进行投资决策，在模型投资机会较少时，用定量与定性相结合的方法构建补充投资组合。</p>
业绩比较基准	75%×中证 800 指数收益率+25%×中国债券总指数收益率
风险收益特征	本基金为混合型基金，基金的风险与预期收益高于债券型基金和货币市场基金、低于股票型基金，属于证券投资基金中的中高风险投资品种。

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	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	钱鲲	林葛
	联系电话	021-38969999	010-66060069
	电子邮箱	qiankun@huan.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4008850099	95599
传真		021-68863414	010-68121816

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	北京市东城区建国门内大街69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28号凯晨世贸中心东座F9
邮政编码	200120	100031
法定代表人	朱学华	周慕冰

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.huaan.com.cn
基金半年度报告备置地点	上海市世纪大道8号上海国金中心二期31、32层

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	华安基金管理有限公司	上海市世纪大道8号上海国金中心二期31、32层

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2017年1月1日至2017年6月30日）
本期已实现收益	-941,201.25
本期利润	1,962,542.53
加权平均基金份额本期利润	0.0056
本期加权平均净值利润率	0.56%
本期基金份额净值增长率	-1.50%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)
期末可供分配利润	-4,236,376.52
期末可供分配基金份额利润	-0.0188
期末基金资产净值	222,595,121.46
期末基金份额净值	0.986
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-1.40%

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）。

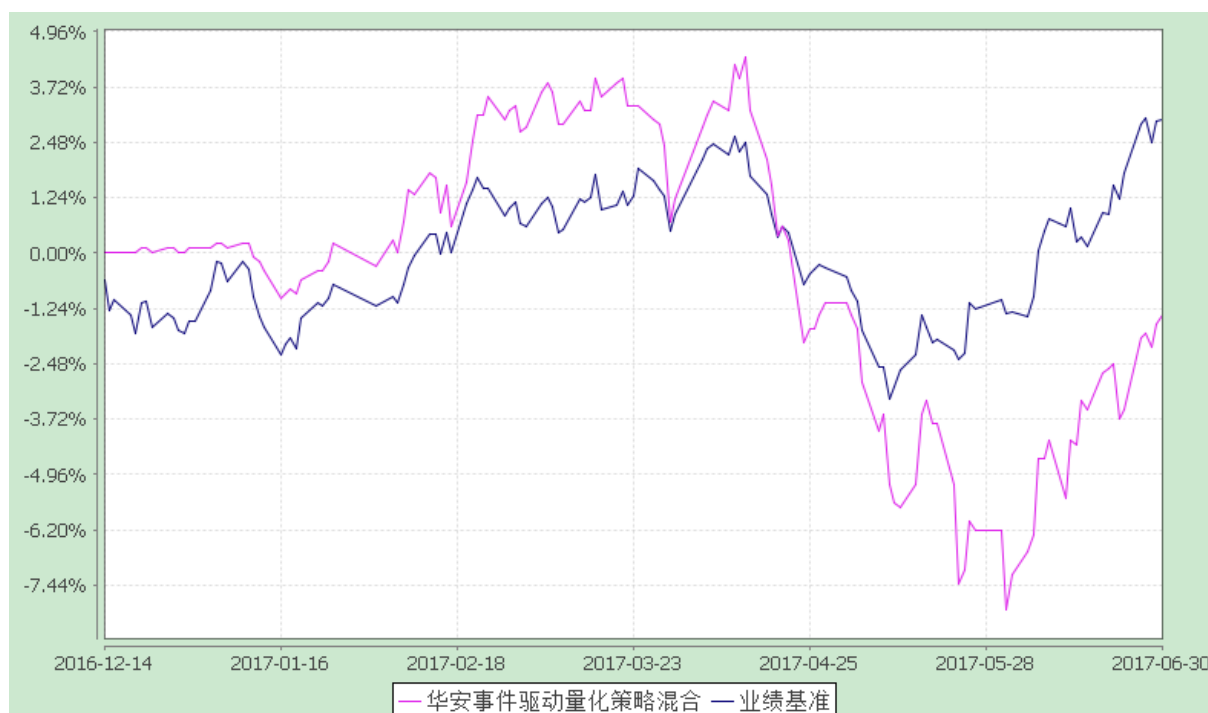
3.2 基金净值表现

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	5.12%	0.91%	4.04%	0.47%	1.08%	0.44%
过去三个月	-2.57%	0.93%	2.05%	0.50%	-4.62%	0.43%
过去六个月	-1.50%	0.74%	4.59%	0.46%	-6.09%	0.28%
自基金合同生效起至今	-1.40%	0.70%	2.97%	0.45%	-4.37%	0.25%

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

华安事件驱动量化策略混合型证券投资基金
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
 （2016 年 12 月 14 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		
牛勇	本基金的基金经理	2016-12-14	-	12 年	复旦大学经济学硕士，FRM（金融风险管理师），12 年证券金融从业经历，曾在泰康人寿保险股份有限公司从事研究工作。2008 年 5 月加入华安基金管理有限公司后任风险管理与金融工程部高级金融工程师，2009 年 7 月至 2010 年 8 月担任华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金的基金经理助理，2010 年 6 月至 2012 年 12 月担任上证 180 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2010 年 9 月起同时担任华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金的基金经理。2010 年 11 月起同时担任上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理。2012 年 6 月至 2015 年 5 月同时担任华安沪深 300 指数分级证券投资基金的基金经理。2014 年 12 月起担任华安沪深 300 量化增强型指数证券投资基金的基金

					经理。2016 年 12 月起，同时担任本基金的基金经理。
孙晨进	本基金的基金经理	2016-12-19	-	6 年	硕士研究生，6 年基金行业从业经验，具有基金从业资格证书。2010 年应届毕业生进入华安基金，先后担任指数投资部数量分析师、投资经理、基金经理助理。2015 年 3 月起担任华安深证 300 指数证券投资基金（LOF）的基金经理。2015 年 3 月至 2015 年 12 月，同时担任华安中证高分红指数增强型证券投资基金的基金经理。2016 年 12 月起，同时担任本基金的基金经理。2017 年 1 月起，同时担任华安新安平灵活配置混合型证券投资基金、华安新泰利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合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了《华安基金管理有限公司公平交易管理制度》，将封闭式基金、开放式基金、特定客户资产管理组合及其他投资组合资产在研究分析、投资决策、交易执行等方面全部纳入公平交易管理中。控制措施包括：在研究环节，研究员在为公司管理的各类投资组合提供研究信息、投资建议过程中，使用晨会发言、邮件发送、登录在研究报告管理系统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

2017 年以来宏观经济增速总体仍处于 L 型区域的底部, 但是未来经济二次探底的可能性已经很

低，可能促使经济继续下行的力量来自去库存、房地产调控、金融去杠杆、财政整顿等，但同时，出口的复苏和制造业投资恢复等因素，也逐渐让投资者看到了经济企稳反弹的迹象。

上半年 A 股市场结构分化明显，从全市场范围看，以消费、金融为代表的少数股票走势较好，而以中小板、创业板为代表的成长股、小盘股经历了大面积趋势性下跌，直至 6 月初才触底反弹。主要原因有投资者对市场缺乏信心、倾向于流动性较好、现金流较稳定的大蓝筹、消费股等。

上半年，本基金逐步建仓后仓位保持较高，持仓较均衡，因持有部分中小市值股票，所以净值受到市场整体下跌的影响。6 月以来，前期错杀的成长股、小盘股迎来了强劲反弹，本基金的净值也随之上涨。期间，本基金用量化的方法和各类事件驱动的投资机会，均衡的配置股票。

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 0.986 元，本报告期份额净值增长率为-1.50%，同期业绩比较基准增长率为 4.59%。

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 2017 年下半年，预计全球经济复苏的态势将会延续，中国出口好转也是大概率事件，从而支撑经济增长。从供给来看，有助于增加国内资本存量，同时提高全要素生产率，重构中长期经济增长路径。从国内货币政策来看，维持紧平衡，逐步边际放松的概率较大，但政策的选择仍受限于国内经济增长和金融风险的权衡。同时，金融监管对实体经济的影响将逐渐体现出来。在名义增速下行，流动性边际上宽松的背景下，无风险利率可能存下行空间。在目前的经济环境下，管理人对下半年 A 股市场的走势较有信心。

作为华安事件驱动量化基金的管理人，我们将勤勉尽责，继续坚持用量化的方法，合理均衡的配置股票仓位，给投资者提供稳健的量化投资收益，为投资者获得长期稳定的回报。

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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人——华安基金管理有限公司 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为,华安基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上,不存在损害基金份额持有人利益的行为;在报告期内,严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认为,华安基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定,基金管理人所编制和披露的本基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整,未发现有损害基金份额持有人利益的行为。

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：华安事件驱动量化策略混合型证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	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	6.4.7.1	22,437,605.50	133,016,710.85
结算备付金		5,783,661.75	-
存出保证金		3,847,586.10	-
交易性金融资产	6.4.7.2	191,091,141.44	48,960,717.84
其中：股票投资		191,091,141.44	48,960,717.84
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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	560,000,000.00
应收证券清算款		1,379,228.38	236,756.89
应收利息	6.4.7.5	4,929.21	131,724.89
应收股利		-	-
应收申购款		3,243.48	-
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		224,547,395.86	742,345,910.47
负债和所有者权益	附注号	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		590,973.11	-
应付管理人报酬		269,465.72	516,586.17
应付托管费		44,910.94	86,097.71
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.6	861,253.86	46,968.58
应交税费		-	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.7	185,670.77	30,000.00
负债合计		1,952,274.40	679,652.46
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.8	225,683,964.80	741,205,803.91
未分配利润	6.4.7.9	-3,088,843.34	460,454.10
所有者权益合计		222,595,121.46	741,666,258.01
负债和所有者权益总计		224,547,395.86	742,345,910.47

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.986 元，基金份额总额 225,683,964.80 份。

6.2 利润表

会计主体：华安事件驱动量化策略混合型证券投资基金

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	附注号	本期	
		2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
一、收入			9,017,063.45
1.利息收入			1,227,933.41
其中：存款利息收入	6.4.7.10		277,337.70
债券利息收入			12.43
资产支持证券利息收入			-
买入返售金融资产收入			950,583.28
其他利息收入			-
2.投资收益（损失以“-”填列）			3,027,198.01
其中：股票投资收益	6.4.7.11		2,657,205.26
基金投资收益			-
债券投资收益	6.4.7.12		876.97
资产支持证券投资收益			-
贵金属投资收益			-
衍生工具收益			-655,794.31
股利收益	6.4.7.13		1,024,910.09
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.14		2,903,743.78
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）			-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.15		1,858,188.25
减：二、费用			7,054,520.92
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1		2,650,041.54
2. 托管费	6.4.10.2.2		441,673.57
3. 销售服务费	6.4.10.2.3		-

4. 交易费用	6.4.7.16	3,767,378.93
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用	6.4.7.17	195,426.88
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,962,542.53
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,962,542.53

注：本基金于 2016 年 12 月 14 日成立，因此无上年度可比期间数据。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安事件驱动量化策略混合型证券投资基金

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）	741,205,803.91	460,454.10	741,666,258.01
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,962,542.53	1,962,542.53
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）	-515,521,839.11	-5,511,839.97	-521,033,679.08
其中：1.基金申购款	6,013,525.91	26,726.14	6,040,252.05
2.基金赎回款	-521,535,365.02	-5,538,566.11	-527,073,931.13
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）	225,683,964.80	-3,088,843.34	222,595,121.46

注：本基金于 2016 年 12 月 14 日成立，因此无上年度可比期间数据。

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

华安事件驱动量化策略混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可〔2015〕2668号《关于准予华安事件驱动量化策略混合型证券投资基金注册的批复》及机构部函〔2016〕1628号《关于华安事件驱动量化策略混合型证券投资基金延期募集备案的回函》的核准，由华安基金管理有限公司作为管理人自2016年11月14日到2016年12月9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_B26号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2016年12月14日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币740,856,612.74元，在募集期间产生的存款利息为人民币349,191.17元，以上实收基金（本息）合计为人民币741,205,803.91元，折合741,205,803.91份基金份额。本基金的基金管理人及注册登记机构为华安基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

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

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：股票占基金资产的比例为30-95%，其中投资于事件驱动量化策略模型得到的证券的比例不低于非现金基金资产的80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%；权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

本基金的业绩比较基准为： $75\% \times \text{中证 800 指数收益率} + 25\% \times \text{中国债券总指数收益率}$ 。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具

体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 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 2017 年 1 月 1 日起至 2017 年 6 月 30 日止。

6.4.4.2 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。

6.4.4.3 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。

6.4.4.4 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。

6.4.4.5 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。

6.4.4.6 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。

6.4.4.7 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。

6.4.4.8 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)”。

6.4.4.9 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。

6.4.4.10 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。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 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 6 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；

(2) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，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；

(3) 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；

(4) 每一基金份额享有同等分配权

(5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在不违背法律法规及基金合同的规定、且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人经与基金托管人协商一致，可按照监管部门要求履行适当程序后调整基金收益的分配原则，不需召开基金份额持有人大会。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

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]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
活期存款	22,437,605.50
定期存款	-
其他存款	-

合计	22,437,605.50
----	---------------

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	188,630,126.86	191,091,141.44	2,461,014.58
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
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	188,630,126.86	191,091,141.44	2,461,014.58

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-	-	-	-
其他衍生工具	17,776,800.00	-	-	-
合计	17,776,800.00	-	-	-

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	4,093.65
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	717.21
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	118.35
合计	4,929.21

6.4.7.6 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	861,253.86
银行间市场应付交易费用	-
合计	861,253.86

6.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	2,192.88
预提账户维护费	-
预提审计费	34,712.18
预提信息披露费	148,765.71
合计	185,670.77

6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	741,205,803.91	741,205,803.91
本期申购	6,013,525.91	6,013,525.91
本期赎回（以“-”号填列）	-521,535,365.02	-521,535,365.02

本期末	225,683,964.80	225,683,964.80
-----	----------------	----------------

6.4.7.9 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	777,468.99	-317,014.89	460,454.10
本期利润	-941,201.25	2,903,743.78	1,962,542.53
本期基金份额交易产生的变动数	-4,072,644.26	-1,439,195.71	-5,511,839.97
其中：基金申购款	81,578.51	-54,852.37	26,726.14
基金赎回款	-4,154,222.77	-1,384,343.34	-5,538,566.11
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-4,236,376.52	1,147,533.18	-3,088,843.34

6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
活期存款利息收入	214,505.68
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	1,878.18
结算备付金利息收入	60,953.84
其他	0.00
合计	277,337.70

6.4.7.11 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出股票成交总额	1,203,490,474.96
减：卖出股票成本总额	1,200,833,269.70
买卖股票差价收入	2,657,205.26

6.4.7.12 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	31,889.40
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	31,000.00

减：应收利息总额	12.43
买卖债券差价收入	876.97

6.4.7.13 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
股指期货	-655,794.31

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,024,910.09
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,024,910.09

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
1.交易性金融资产	2,778,029.47
——股票投资	2,778,029.47
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	125,714.31
——权证投资	-
——股指期货	125,714.31
4.其他	-
合计	2,903,743.78

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
基金赎回费收入	1,858,188.25
合计	1,858,188.25

6.4.7.17 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
交易所市场交易费用	3,765,416.96
银行间市场交易费用	-
中金所交易费用	1,961.97
合计	3,767,378.93

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
审计费用	34,712.18
信息披露费	148,765.71
银行汇划费用	11,752.99
其他费用	196.00
合计	195,426.88

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华安基金管理有限公司(“华安基金公司”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司(“中国农业银行”)	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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

无。

6.4.10.1.4 债券回购交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,650,041.54
其中：支付销售机构的客户维护费	1,037,196.59

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 1.5% 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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.5\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.2 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
当期发生的基金应支付的托管费	441,673.57

注：支付基金托管人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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	22,437,605.50	214,505.68

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本报告期不进行收益分配。

6.4.12 期末（2017 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
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	2017-07-10	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	-

6.4.12.2 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
000862	银星能源	2017-03-13	重大资产重组事项	7.90	-	-	269,740.00	2,166,543.78	2,130,946.00	-
002426	胜利精密	2017-01-16	重大事项	7.68	-	-	133,700.00	1,127,792.00	1,026,816.00	-
002596	海南瑞泽	2017-05-22	重大资产重组事项	8.29	-	-	165,800.00	1,407,528.00	1,374,482.00	-
002693	双成药业	2017-05-25	重大资产重组事项	6.67	2017-07-25	6.88	247,932.00	2,061,097.84	1,653,706.44	-
600460	士兰微	2017-05-22	重大资产重组事项	6.07	-	-	148,100.00	943,879.14	898,967.00	-
600643	爱建集团	2017-04-17	重大事项	14.98	2017-08-02	16.48	43,300.00	603,536.11	648,634.00	-
600657	信达地产	2017-06-19	重大资产重组事项	5.76	2017-08-10	6.19	215,800.00	1,243,515.00	1,243,008.00	-
601717	郑煤机	2017-04-26	资产重组事项	7.79	-	-	110,600.00	960,846.22	861,574.00	-
601989	中国重工	2017-05-29	资产重组事项	6.21	-	-	36,100.00	259,269.54	224,181.00	-

注：本基金截止至 2017 年 6 月 30 日止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。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金为混合型基金，基金的风险与预期收益都要低于股票型基金,高于债券型基金和货币市场基金，属于证券投资基金中的中等风险和中等收益投资品种。本基金在日常经营活动中面临的与这

些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金在严格控制风险的前提下

下，力争为投资者带来长期超额收益。

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部等相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基

金的基金管理人在董事会下设立风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制

制的总体措施等；在管理层层面设立合规与风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险

防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险管理部负责，协调并与各

部门合作完成运作风险管理和投资风险、绩效评估等。监察稽核部和风险管理部对公司执行总

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。

6.4.13.2 信用风险

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

本公司在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在经中国人民银行和中国证券监督管理委员会所批准的具有基金托管资格和基金代销资格的银行，并根据本公司

司管理交易对手的经验进行筛选，因而与这些银行存款相关的信用风险不重大。本基金在银行间同

业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险；

在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违

约风险可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

6.4.13.3 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

的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持证券均在证券交易所

上市，因此除附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能

以合理价格适时变现。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每

个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	22,437,605.50	-	-	-	22,437,605.50
结算备付金	5,783,661.75	-	-	-	5,783,661.75
存出保证金	3,847,586.10	-	-	-	3,847,586.10
交易性金融资产	-	-	-	191,091,141.44	191,091,141.44
买入返售金融资产	-	-	-	-	0.00
应收证券清算款	-	-	-	1,379,228.38	1,379,228.38
应收利息	-	-	-	4,929.21	4,929.21
应收申购款	-	-	-	3,243.48	3,243.48
资产总计	32,068,853.35	-	-	192,478,542.51	224,547,395.86
负债					
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	590,973.11	590,973.11
应付管理人报酬	-	-	-	269,465.72	269,465.72
应付托管费	-	-	-	44,910.94	44,910.94
应付交易费用	-	-	-	861,253.86	861,253.86
其他负债	-	-	-	185,670.77	185,670.77
负债总计	-	-	-	1,952,274.40	1,952,274.40
利率敏感度缺口	32,068,853.35	-	-	190,526,268.11	222,595,121.46

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金于 2017 年 6 月 30 日未持有债券资产，且持有的银行存款均为活期存款，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金

的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市

场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的

影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个

证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理

人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能

发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票占基金资产的比例为 30-95%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持现金或者到期

日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持

有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标

等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日		上年度末 2016 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资	公允价值	占基金资产

		产净值比 例 (%)		净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	191,091,141.44	85.85	48,960,717.84	6.60
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	191,091,141.44	85.85	48,960,717.84	6.60

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注 7.4.1)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 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
	业绩比较基准 (附注 7.4.1) 上升 5%	增加约 1,401	-
	业绩比较基准 (附注 7.4.1) 下降 5%	减少约 1,401	-

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.14.1

截至资产负债表日, 本基金无需要说明的承诺事项。

6.4.14.2 其他事项

截至资产负债表日, 本基金无需要说明的其他重要事项。

6.4.14.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2017 年 8 月 23 日经本基金的基金管理人批准。

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位: 人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	191,091,141.44	85.10
	其中：股票	191,091,141.44	85.10
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	28,221,267.25	12.57
7	其他各项资产	5,234,987.17	2.33
8	合计	224,547,395.86	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	1,546,785.00	0.69
B	采矿业	6,587,937.00	2.96
C	制造业	114,753,299.10	51.55
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,916,717.00	3.56
E	建筑业	6,383,314.32	2.87
F	批发和零售业	16,376,376.16	7.36
G	交通运输、仓储和邮政业	1,498,808.00	0.67
H	住宿和餐饮业	271,320.00	0.12
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,286,270.12	4.17
J	金融业	5,212,924.00	2.34
K	房地产业	14,074,142.20	6.32
L	租赁和商务服务业	498,623.00	0.22

M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	3,198,257.00	1.44
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,847,154.54	0.83
R	文化、体育和娱乐业	1,541,325.00	0.69
S	综合	97,889.00	0.04
	合计	191,091,141.44	85.85

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	600497	驰宏锌锗	531,000	3,478,050.00	1.56
2	600628	新世界	286,500	3,309,075.00	1.49
3	000078	海王生物	469,900	2,833,497.00	1.27
4	300494	盛天网络	122,000	2,829,180.00	1.27
5	600549	厦门钨业	119,400	2,565,906.00	1.15
6	000759	中百集团	289,822	2,544,637.16	1.14
7	000333	美的集团	58,464	2,516,290.56	1.13
8	300141	和顺电气	193,400	2,409,764.00	1.08
9	000761	本钢板材	459,000	2,400,570.00	1.08
10	000797	中国武夷	245,840	2,305,979.20	1.04
11	000938	紫光股份	37,700	2,304,224.00	1.04
12	002445	中南文化	177,300	2,278,305.00	1.02
13	000736	中房地产	146,800	2,178,512.00	0.98
14	000862	银星能源	269,740	2,130,946.00	0.96
15	002435	长江润发	123,944	2,124,400.16	0.95
16	300184	力源信息	168,700	2,098,628.00	0.94
17	300158	振东制药	129,368	2,098,348.96	0.94
18	600267	海正药业	178,300	2,082,544.00	0.94
19	002758	华通医药	147,100	2,065,284.00	0.93
20	600746	江苏索普	188,700	2,034,186.00	0.91
21	600345	长江通信	95,395	1,966,090.95	0.88
22	300422	博世科	121,950	1,963,395.00	0.88
23	600986	科达股份	143,400	1,944,504.00	0.87
24	600351	亚宝药业	247,000	1,931,540.00	0.87
25	600067	冠城大通	276,700	1,900,929.00	0.85
26	600664	哈药股份	324,500	1,885,345.00	0.85

27	002073	软控股份	219,900	1,864,752.00	0.84
28	600896	览海投资	218,082	1,847,154.54	0.83
29	002385	大北农	282,871	1,779,258.59	0.80
30	002313	日海通讯	86,500	1,774,115.00	0.80
31	002288	超华科技	253,800	1,768,986.00	0.79
32	600850	华东电脑	81,350	1,738,449.50	0.78
33	600823	世茂股份	354,200	1,735,580.00	0.78
34	601328	交通银行	276,200	1,701,392.00	0.76
35	002005	德豪润达	351,600	1,677,132.00	0.75
36	002693	双成药业	247,932	1,653,706.44	0.74
37	300179	四方达	243,100	1,589,874.00	0.71
38	300083	劲胜精密	167,900	1,551,396.00	0.70
39	000951	中国重汽	100,900	1,542,761.00	0.69
40	000791	甘肃电投	173,100	1,514,625.00	0.68
41	000525	红太阳	75,900	1,412,499.00	0.63
42	300061	康耐特	76,300	1,405,446.00	0.63
43	300106	西部牧业	130,700	1,399,797.00	0.63
44	600070	浙江富润	115,900	1,376,892.00	0.62
45	002596	海南瑞泽	165,800	1,374,482.00	0.62
46	600348	阳泉煤业	199,200	1,350,576.00	0.61
47	600073	上海梅林	141,300	1,349,415.00	0.61
48	600512	腾达建设	273,300	1,347,369.00	0.61
49	000911	南宁糖业	115,000	1,309,850.00	0.59
50	002064	华峰氨纶	270,300	1,302,846.00	0.59
51	600586	金晶科技	263,700	1,289,493.00	0.58
52	600875	东方电气	133,100	1,275,098.00	0.57
53	600978	宜华生活	124,200	1,248,210.00	0.56
54	600657	信达地产	215,800	1,243,008.00	0.56
55	002354	天神娱乐	57,800	1,242,700.00	0.56
56	000517	荣安地产	266,500	1,239,225.00	0.56
57	000090	天健集团	109,500	1,215,450.00	0.55
58	600166	福田汽车	426,600	1,211,544.00	0.54
59	600199	金种子酒	151,419	1,200,752.67	0.54
60	000800	一汽轿车	115,200	1,171,584.00	0.53
61	600409	三友化工	114,400	1,152,008.00	0.52
62	600219	南山铝业	331,600	1,124,124.00	0.51
63	000543	皖能电力	190,900	1,112,947.00	0.50
64	002668	奥马电器	56,300	1,109,110.00	0.50
65	000783	长江证券	116,900	1,107,043.00	0.50
66	603077	和邦生物	216,300	1,100,967.00	0.49
67	000157	中联重科	245,100	1,100,499.00	0.49
68	000789	万年青	151,500	1,074,135.00	0.48
69	000709	河钢股份	251,000	1,051,690.00	0.47
70	600183	生益科技	85,000	1,048,900.00	0.47

71	600478	科力远	121,800	1,048,698.00	0.47
72	000400	许继电气	57,900	1,039,884.00	0.47
73	600487	亨通光电	36,700	1,029,435.00	0.46
74	600784	鲁银投资	154,000	1,027,180.00	0.46
75	002426	胜利精密	133,700	1,026,816.00	0.46
76	002123	梦网荣信	92,300	1,025,453.00	0.46
77	002440	闰土股份	65,900	1,005,634.00	0.45
78	002680	长生生物	65,500	1,001,495.00	0.45
79	300102	乾照光电	117,000	999,180.00	0.45
80	002106	莱宝高科	98,100	993,753.00	0.45
81	000997	新大陆	43,600	989,284.00	0.44
82	002463	沪电股份	216,300	984,165.00	0.44
83	300026	红日药业	207,300	976,383.00	0.44
84	600325	华发股份	115,020	960,417.00	0.43
85	002582	好想你	79,400	954,388.00	0.43
86	600500	中化国际	99,800	954,088.00	0.43
87	600422	昆药集团	83,200	943,488.00	0.42
88	002078	太阳纸业	128,300	943,005.00	0.42
89	600312	平高电气	68,400	939,816.00	0.42
90	600511	国药股份	25,600	927,744.00	0.42
91	600516	方大炭素	64,900	922,878.00	0.41
92	603567	珍宝岛	54,800	922,284.00	0.41
93	600522	中天科技	76,500	921,825.00	0.41
94	600983	惠而浦	85,000	919,700.00	0.41
95	600460	士兰微	148,100	898,967.00	0.40
96	600601	方正科技	240,200	893,544.00	0.40
97	002118	紫鑫药业	129,800	886,534.00	0.40
98	601717	郑煤机	110,600	861,574.00	0.39
99	000528	柳工	99,100	856,224.00	0.38
100	603999	读者传媒	38,300	854,856.00	0.38
101	002479	富春环保	71,500	850,850.00	0.38
102	000685	中山公用	77,600	849,720.00	0.38
103	002677	浙江美大	60,800	846,944.00	0.38
104	002353	杰瑞股份	52,900	836,878.00	0.38
105	600068	葛洲坝	74,343	835,615.32	0.38
106	600835	上海机电	39,200	828,688.00	0.37
107	000680	山推股份	151,300	824,585.00	0.37
108	600483	福能股份	79,500	824,415.00	0.37
109	600300	维维股份	144,900	773,766.00	0.35
110	002528	英飞拓	129,595	768,498.35	0.35
111	600208	新潮中宝	169,400	762,300.00	0.34
112	000418	小天鹅 A	16,100	753,319.00	0.34
113	600188	兖州煤业	61,400	751,536.00	0.34
114	600180	瑞茂通	53,400	749,736.00	0.34

115	600270	外运发展	39,000	738,270.00	0.33
116	300261	雅本化学	77,538	719,552.64	0.32
117	600708	光明地产	107,900	716,456.00	0.32
118	600031	三一重工	86,500	703,245.00	0.32
119	603800	道森股份	32,300	702,202.00	0.32
120	300187	永清环保	57,600	658,944.00	0.30
121	601818	光大银行	162,400	657,720.00	0.30
122	601607	上海医药	22,500	649,800.00	0.29
123	600643	爱建集团	43,300	648,634.00	0.29
124	000863	三湘印象	87,400	639,768.00	0.29
125	600028	中国石化	104,700	620,871.00	0.28
126	002154	报喜鸟	165,000	612,150.00	0.28
127	002674	兴业科技	48,400	607,904.00	0.27
128	600308	华泰股份	104,800	595,264.00	0.27
129	000652	泰达股份	106,100	562,330.00	0.25
130	603001	奥康国际	29,400	552,426.00	0.25
131	002081	金螳螂	49,600	544,608.00	0.24
132	000338	潍柴动力	37,900	500,280.00	0.22
133	600804	鹏博士	28,100	498,775.00	0.22
134	601800	中国交建	31,200	495,768.00	0.22
135	600879	航天电子	55,200	485,208.00	0.22
136	000925	众合科技	23,100	479,787.00	0.22
137	000725	京东方 A	109,900	457,184.00	0.21
138	603599	广信股份	29,200	441,796.00	0.20
139	002500	山西证券	45,800	438,764.00	0.20
140	002470	金正大	58,100	437,493.00	0.20
141	600703	三安光电	22,000	433,400.00	0.19
142	300567	精测电子	5,400	431,622.00	0.19
143	300618	寒锐钴业	4,500	424,350.00	0.19
144	600061	国投安信	26,300	408,965.00	0.18
145	600153	建发股份	30,900	399,537.00	0.18
146	600674	川投能源	39,600	388,872.00	0.17
147	002800	天顺股份	10,100	387,638.00	0.17
148	601899	紫金矿业	112,800	386,904.00	0.17
149	601333	广深铁路	82,500	372,900.00	0.17
150	000156	华数传媒	23,300	347,403.00	0.16
151	601877	正泰电器	17,200	345,548.00	0.16
152	300251	光线传媒	41,400	339,066.00	0.15
153	000687	华讯方舟	20,600	311,884.00	0.14
154	002514	宝馨科技	38,600	311,502.00	0.14
155	000069	华侨城 A	30,000	301,800.00	0.14
156	600291	西水股份	13,400	294,800.00	0.13
157	300377	赢时胜	25,800	293,862.00	0.13
158	002195	二三四五	39,700	283,855.00	0.13

159	600362	江西铜业	16,700	281,562.00	0.13
160	600019	宝钢股份	41,600	279,136.00	0.13
161	601100	恒立液压	17,000	276,930.00	0.12
162	000428	华天酒店	53,200	271,320.00	0.12
163	300247	乐金健康	40,400	269,064.00	0.12
164	600640	号百控股	15,000	253,500.00	0.11
165	600096	云天化	33,200	245,680.00	0.11
166	600856	中天能源	21,700	244,342.00	0.11
167	300282	汇冠股份	11,500	242,650.00	0.11
168	600749	西藏旅游	13,400	238,118.00	0.11
169	000593	大通燃气	26,800	236,108.00	0.11
170	300583	赛托生物	4,500	233,820.00	0.11
171	601989	中国重工	36,100	224,181.00	0.10
172	000886	海南高速	44,100	218,736.00	0.10
173	300354	东华测试	14,100	218,691.00	0.10
174	000676	智度股份	14,600	218,562.00	0.10
175	002467	二六三	26,800	212,256.00	0.10
176	002759	天际股份	8,100	207,117.00	0.09
177	300233	金城医药	9,500	199,405.00	0.09
178	002335	科华恒盛	5,600	198,464.00	0.09
179	603858	步长制药	2,700	193,428.00	0.09
180	002425	凯撒文化	20,300	185,542.00	0.08
181	000561	烽火电子	18,200	184,366.00	0.08
182	000666	经纬纺机	8,100	184,194.00	0.08
183	002429	兆驰股份	58,250	178,827.50	0.08
184	002247	帝龙文化	13,400	175,808.00	0.08
185	002434	万里扬	10,900	173,528.00	0.08
186	002285	世联行	21,600	173,232.00	0.08
187	601166	兴业银行	10,000	168,600.00	0.08
188	300230	永利股份	9,600	158,784.00	0.07
189	002057	中钢天源	11,500	147,085.00	0.07
190	002714	牧原股份	5,400	146,988.00	0.07
191	000415	渤海金控	20,300	136,619.00	0.06
192	300532	今天国际	5,600	132,272.00	0.06
193	600449	宁夏建材	12,200	117,242.00	0.05
194	600585	海螺水泥	4,800	109,104.00	0.05
195	603986	兆易创新	1,400	108,934.00	0.05
196	601888	中国国旅	3,600	108,504.00	0.05
197	600238	海南椰岛	10,800	107,784.00	0.05
198	000009	中国宝安	12,100	97,889.00	0.04
199	601718	际华集团	8,700	76,473.00	0.03
200	000563	陕国投 A	14,600	75,482.00	0.03
201	600567	山鹰纸业	18,200	65,156.00	0.03
202	000404	华意压缩	7,950	62,566.50	0.03

203	603801	志邦股份	1,406	47,522.80	0.02
204	603043	广州酒家	1,810	45,738.70	0.02
205	300666	江丰电子	2,276	43,448.84	0.02
206	300410	正业科技	1,200	43,320.00	0.02
207	300317	珈伟股份	2,700	39,420.00	0.02
208	002159	三特索道	1,500	36,000.00	0.02
209	603380	易德龙	1,298	35,370.50	0.02
210	300383	光环新网	2,400	32,544.00	0.01
211	603335	迪生力	2,230	24,864.50	0.01
212	002879	长缆科技	1,313	23,660.26	0.01
213	002881	美格智能	989	22,608.54	0.01
214	603679	华体科技	809	21,438.50	0.01
215	603938	三孚股份	1,246	20,932.80	0.01
216	300527	华舟应急	1,155	20,073.90	0.01
217	002882	金龙羽	2,966	18,389.20	0.01
218	603933	睿能科技	857	17,311.40	0.01
219	603305	旭升股份	1,351	15,212.26	0.01
220	300669	沪宁股份	841	14,650.22	0.01
221	300670	大烨智能	1,259	13,760.87	0.01
222	603286	日盈电子	890	13,528.00	0.01
223	300672	国科微	1,257	10,659.36	0.00
224	603331	百达精工	999	9,620.37	0.00
225	300671	富满电子	942	7,639.62	0.00
226	603617	君禾股份	832	7,429.76	0.00
227	601997	贵阳银行	400	6,324.00	0.00

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	000761	本钢板材	8,993,313.64	1.21
2	600515	海航基础	7,686,120.72	1.04
3	000969	安泰科技	7,189,952.80	0.97
4	601318	中国平安	6,975,068.00	0.94
5	600267	海正药业	6,743,167.60	0.91
6	601166	兴业银行	6,549,269.00	0.88
7	600873	梅花生物	6,425,110.35	0.87
8	600751	天海投资	6,398,577.18	0.86
9	601328	交通银行	6,141,125.87	0.83
10	002354	天神娱乐	6,129,901.14	0.83

11	002566	益盛药业	5,555,704.93	0.75
12	000967	盈峰环境	5,531,669.80	0.75
13	300484	蓝海华腾	5,418,261.44	0.73
14	300043	星辉娱乐	5,363,559.67	0.72
15	000056	皇庭国际	5,186,742.26	0.70
16	300337	银邦股份	5,148,029.80	0.69
17	002445	中南文化	5,035,626.81	0.68
18	601688	华泰证券	5,034,071.88	0.68
19	300162	雷曼股份	5,032,541.70	0.68
20	600522	中天科技	5,026,875.00	0.68

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

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	000709	河钢股份	8,131,191.25	1.10
2	600515	海航基础	8,049,634.25	1.09
3	000969	安泰科技	7,579,622.65	1.02
4	601318	中国平安	7,153,513.83	0.96
5	000761	本钢板材	6,954,914.19	0.94
6	601166	兴业银行	6,379,007.10	0.86
7	600873	梅花生物	6,206,991.06	0.84
8	600751	天海投资	6,149,048.54	0.83
9	000783	长江证券	5,812,982.56	0.78
10	000967	盈峰环境	5,763,930.33	0.78
11	601939	建设银行	5,623,852.00	0.76
12	002566	益盛药业	5,621,052.78	0.76
13	600028	XD 中国石	5,547,714.00	0.75
14	300043	星辉娱乐	5,401,381.38	0.73
15	300484	蓝海华腾	5,202,104.40	0.70
16	600893	航发动力	5,070,873.34	0.68
17	601688	华泰证券	5,032,343.00	0.68
18	000056	皇庭国际	4,984,074.40	0.67
19	600221	海航控股	4,907,112.00	0.66
20	300162	雷曼股份	4,900,429.07	0.66

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	1,340,185,663.83
卖出股票的收入（成交）总额	1,203,490,474.96

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

本基金本报告期末未持有债券投资。

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

本基金本报告期末未持有债券投资。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证投资。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量	合约市值	公允价值变动	风险说明
IC1712	IC1712	13.00	15,368,080.00	110,034.31	-
IC1709	IC1709	2.00	2,408,720.00	15,680.00	-
公允价值变动总额合计					125,714.31
股指期货投资本期收益					-655,794.31
股指期货投资本期公允价值变动					125,714.31

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

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。

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

根据本基金基金合同，本基金不能投资于国债期货。

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	3,847,586.10
2	应收证券清算款	1,379,228.38
3	应收股利	-
4	应收利息	4,929.21
5	应收申购款	3,243.48
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,234,987.17

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
4,113	54,870.89	1,089,205.74	0.48%	224,594,759.06	99.52%

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	1,190.22	0.00%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间为 0；

本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 0。

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2016 年 12 月 14 日）基金份额总额	741,205,803.91
本报告期期初基金份额总额	741,205,803.91
本报告期基金总申购份额	6,013,525.91
减：本报告期基金总赎回份额	521,535,365.02
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	225,683,964.80

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

本报告期内本基金未改聘为基金审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内无管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

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	
长江证券	1	992,920,531.80	39.07%	904,849.31	38.73%	-
中信证券	2	549,228,144.02	21.61%	507,830.80	21.73%	-
招商证券	2	513,696,571.42	20.22%	476,553.50	20.40%	-
中信建投	1	252,893,159.33	9.95%	235,519.56	10.08%	-
安信证券	1	232,364,498.93	9.14%	211,754.51	9.06%	-

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
长江证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	1,930,000,	55.00%	-	-

			000.00			
招商证券	-	-	700,000,000.00	19.95%	-	-
中信建投	31,889.40	100.00%	879,300,000.00	25.06%	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于华安事件驱动量化策略混合型证券投资基金开放申购、赎回及转换业务的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-01-12
2	关于旗下部分基金增加泰诚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	2017-01-18
3	关于旗下部分基金增加北京肯特瑞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	2017-02-08
4	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	2017-02-13
5	关于旗下部分基金增加海峡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	2017-02-15
6	关于旗下部分基金增加朝阳永续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	2017-02-22
7	华安基金关于参加平安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	2017-02-22
8	关于旗下部分基金增加华阳众惠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	2017-03-02
9	关于旗下部分基金增加华夏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	2017-03-21
10	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“南都电源”股票估值调整的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-03-21
11	关于旗下部分基金增加同花顺为销售机构并	《上海证券报》、《证券时	2017-03-25

	参加费率优惠活动的公告	报》、《中国证券报》和公司网站	
12	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	2017-03-28
13	关于华安基金管理有限公司旗下基金参加广发证券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	2017-03-30
14	关于旗下部分基金参加中国工商银行股份有限公司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	2017-03-30
15	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加通华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	2017-04-06
16	华安基金关于参加华宝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	2017-04-12
17	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	2017-04-22
18	关于“微钱宝”快速取现服务升级的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-04-25
19	华安基金关于《深圳证券交易所分级基金业务管理指引》实施的风险提示性公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-04-25
20	华安基金关于《深圳证券交易所分级基金业务管理指引》实施的风险提示性公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-04-26
21	华安基金关于《深圳证券交易所分级基金业务管理指引》实施的风险提示性公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-04-27
22	华安基金关于《深圳证券交易所分级基金业务管理指引》实施的风险提示性公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-04-28
23	华安基金关于《深圳证券交易所分级基金业务管理指引》实施的风险提示性公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-04-29
24	华安基金关于《深圳证券交易所分级基金业务管理指引》实施的风险提示性公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-05-03
25	华安基金关于《深圳证券交易所分级基金业务管理指引》实施的风险提示性公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-05-04

26	华安基金关于《深圳证券交易所分级基金业务管理指引》实施的风险提示性公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-05-06
27	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	2017-05-10
28	关于旗下部分基金增加武汉伯嘉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	2017-05-17
29	关于旗下部分基金增加中民财富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	2017-06-07
30	华安基金关于参加上海农商行优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-06-07
31	关于旗下部分基金增加科地瑞富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	2017-06-12
32	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	2017-06-27
33	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	2017-06-30

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。

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。

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、《华安事件驱动量化策略混合型证券投资基金基金合同》
- 2、《华安事件驱动量化策略混合型证券投资基金招募说明书》
- 3、《华安事件驱动量化策略混合型证券投资基金托管协议》
- 4、中国证监会批准华安事件驱动量化策略混合型证券投资基金设立的文件；

- 5、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告原件；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
- 7、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 8、华安基金管理有限公司开放式基金业务规则；

12.2 存放地点

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

12.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站查阅，或在营业时间内至基金管理人或基金托管人的办公场所免费查阅。

华安基金管理有限公司

二〇一七年八月二十五日