

华安升级主题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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	8
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	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
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	11
5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	11
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	11
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	11
6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	14
6.4 报表附注	15
7 投资组合报告	31
7.1 期末基金资产组合情况	31
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	31
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	32
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	34
7.5 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	38
7.6 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	38
7.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	38
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	38
7.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	38
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	38
7.11 投资组合报告附注	39
8 基金份额持有人信息	40
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	40
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	40

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	40
9 开放式基金份额变动	40
10 重大事件揭示	41
10.1 基金份额持有人大会决议	41
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	41
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	41
10.4 基金投资策略的改变	41
10.5 报告期内改聘会计师事务所情况	41
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	41
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	41
10.8 其他重大事件	44
11 影响投资者决策的其他重要信息	46
12 备查文件目录	46
12.1 备查文件目录	46
12.2 存放地点	46
12.3 查阅方式	46

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华安升级主题混合型证券投资基金
基金简称	华安升级主题混合
基金主代码	040020
交易代码	040020
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 4 月 22 日
基金管理人	华安基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	243,965,805.72 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金重点投资于受益于产业结构升级、消费升级和技术升级的行业，分享中国经济结构转型过程中的投资收益。在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金将采用“自上而下”与“自下而上”相结合的主动投资管理策略。即：采取“自上而下”的方式选择行业，挖掘并投资于集中代表整个经济发展趋势的行业或主题； 根据上述“自上而下”策略选择行业的基础上，采取“自下而上”的方法，运用基本面分析和实地调研相结合的研究方法选择个股。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×80% + 中国债券总指数收益率×20%
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	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	钱鲲	田青
	联系电话	021-38969999	010-67595096
	电子邮箱	qiankun@huaan.com.cn	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		4008850099	010-67595096
传真		021-68863414	010-66275853
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	北京市西城区金融大街25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	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

邮政编码	200120	100033
法定代表人	朱学华	王洪章

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；北京市西城区金融大街 25 号

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	-39,975,193.72
本期利润	-30,245,328.65
加权平均基金份额本期利润	-0.0536
本期加权平均净值利润率	-4.96%
本期基金份额净值增长率	-2.86%
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	21,173,269.00
期末可供分配基金份额利润	0.0868
期末基金资产净值	265,139,074.72
期末基金份额净值	1.087
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	57.71%

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 1 个月	6.05%	0.74%	4.16%	0.54%	1.89%	0.20%
过去 3 个月	-0.55%	0.83%	4.67%	0.50%	-5.22%	0.33%
过去 6 个月	-2.86%	0.90%	8.13%	0.46%	-10.99%	0.44%
过去一年	-3.29%	0.90%	12.25%	0.54%	-15.54%	0.36%
过去三年	58.02%	2.25%	56.12%	1.40%	1.90%	0.85%
自基金成立起至今	57.71%	1.80%	9.13%	1.23%	48.58%	0.57%

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

华安升级主题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

(2011 年 4 月 22 日至 2017 年 6 月 30 日)



注：根据《华安升级主题混合型证券投资基金基金合同》规定，本基金建仓期不超过 6 个月。截至本报告期末，本基金的投资组合比例已符合基金合同第十二部分“基金的投资”中投资范围、投资限制的有关约定。

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		
饶晓鹏	本基金的基金经理	2015-09-07	-	9 年	硕士，9 年基金行业从业经验，曾任银河基金管理有限公司研究员、国联安基金基金经理。2015 年 5 月加入华安基金管理有限公司，2015 年 9 月起同时担任本基金及华安安信消费服务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

上半年市场整体处于震荡分化的格局，市场主要机会集中在白酒、家电、电子和银行白马品种。相比之下，农业、计算机、传媒、军工等表现较弱。大盘 2.86%，创业板-7.34%。风格上呈现出较大的分化。华安升级主题主要持仓围绕消费升级这个方向，与市场热点行业有一定的偏离。

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 1.087 元，本报告期份额净值增长率为 -2.86%，同期业绩比较基准增长率为 8.13%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从已经公告的数据看，上半年整体经济增长幅度比市场预期的略强。目前的经济景气度情况下，通胀也不高。展望未来，虽然存在一些结构性的不确定性，但整体仍将处于较好的状态。

二级市场目前处于存量博弈的状态，下半年市场的结构性机会可能会比较多。周期性行业虽然整体受宏观经济波动影响较大，但每个行业景气的层次会有差异，在供给侧改革持续推进的背景下，部分行业的景气的时间长度和高度可能不同于以往的经济周期，这个可能存在预期差。消费品行业上半年以可选消费表现强劲，白酒的涨价、空调行业的景气一定程度上体现了经济或地产产业链的周期力量。相比之下，一些更多依靠自身产品升级的非可选消费品上半年表现较差，但展望明年的增长横向比较和目前的估值水平吸引力在增强。这些细分行业可能是下半年重要的阿尔法方向。成长股经历了约一年的调整，估值逐步趋于合理，一些相对优质的品种逐步进入有吸引力的价格区间。我们将继续深入挖掘消费升级过程中的高成长细分行业和公司，争取为投资者创造良好的回报。

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

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，报告期内，本基金未实施利润分配。

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

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组

合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华安升级主题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	16,096,255.79	93,777,422.61
结算备付金		4,286,084.18	10,102,517.67
存出保证金		628,967.38	1,050,533.90
交易性金融资产	6.4.7.2	245,118,198.77	754,811,084.58
其中：股票投资		245,118,198.77	754,811,084.58
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	-	-
应收证券清算款		4,898,253.85	68,825.99
应收利息	6.4.7.5	7,376.55	22,901.60
应收股利		-	-
应收申购款		17,897.22	81,087.21
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		271,053,033.74	859,914,373.56
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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		2,462,376.99	-
应付赎回款		422,180.37	38,631,986.24
应付管理人报酬		422,949.36	1,160,705.45
应付托管费		70,491.57	193,450.91
应付销售服务费		-	-

应付交易费用	6.4.7.7	2,340,899.94	4,289,122.28
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	195,060.79	513,454.25
负债合计		5,913,959.02	44,788,719.13
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.9	243,965,805.72	728,317,546.40
未分配利润	6.4.7.10	21,173,269.00	86,808,108.03
所有者权益合计		265,139,074.72	815,125,654.43
负债和所有者权益总计		271,053,033.74	859,914,373.56

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.087 元，基金份额总额 243,965,805.72 份。

6.2 利润表

会计主体：华安升级主题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	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
一、收入		-14,455,231.39	30,329,657.52
1.利息收入		290,196.95	664,651.80
其中：存款利息收入	6.4.7.11	290,196.95	664,651.80
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		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-25,129,544.70	3,794,261.67
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-26,555,835.08	2,231,580.18
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	1,426,290.38	1,562,681.49
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	9,729,865.07	24,376,517.58
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	654,251.29	1,494,226.47
减：二、费用		15,790,097.26	10,302,574.96

1. 管理人报酬		4,579,849.68	3,027,893.58
2. 托管费		763,308.31	504,648.97
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	10,245,295.56	6,578,750.77
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.19	201,643.71	191,281.64
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-30,245,328.65	20,027,082.56
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-30,245,328.65	20,027,082.56

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安升级主题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）	728,317,546.40	86,808,108.03	815,125,654.43
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-30,245,328.65	-30,245,328.65
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）	-484,351,740.68	-35,389,510.38	-519,741,251.06
其中：1.基金申购款	17,818,579.08	1,470,389.40	19,288,968.48
2.基金赎回款	-502,170,319.76	-36,859,899.78	-539,030,219.54
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）	243,965,805.72	21,173,269.00	265,139,074.72
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）	174,319,163.98	124,364,181.46	298,683,345.44
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	20,027,082.56	20,027,082.56
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）	1,810,334,217.73	1,579,371,984.47	3,389,706,202.20
其中：1.基金申购款	2,873,345,477.79	1,717,895,061.14	4,591,240,538.93
2.基金赎回款	-1,063,011,260.06	-138,523,076.67	-1,201,534,336.73

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）	-	-1,477,895,112.11	-1,477,895,112.11
五、期末所有者权益（基金净值）	1,984,653,381.71	245,868,136.38	2,230,521,518.09

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

华安升级主题混合型证券投资基金(原名为华安升级主题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[2011]317 号《关于核准华安升级主题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《华安升级主题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基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 4,118,599,416.41 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(2011)第 134 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华安升级主题股票型证券投资基金基金合同》于 2011 年 4 月 22 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 4,119,090,620.47 份基金份额，其中认购资金利息折合 491,204.06 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，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据 2014 年中国证监会令第 104 号《公开募集证券投资基金运作管理办法》，华安升级主题股票型证券投资基金于 2015 年 8 月 6 日公告后更名为华安升级主题混合型证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安升级主题混合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、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券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。本基金股票资产的投资比例占基金资产的 60%-95%，其中投资于战略性新兴产业、消费升级行业 and 传统行业中的技术升级相关行业的比例不低于股票投资的 80%；债券、权证、现金、货币市场工具和资产支持证券的投资比例占基金资产的 5%-40%；权证的投资比例占基金资产净值的 0-3%；现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为： $80\% \times \text{沪深 300 指数收益率} + 20\% \times \text{中国债券总指数收益率}$ 。

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》、《华安升级主题混合型证券投资基金基金合同》和中国证监会、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。

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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 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。

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 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	16,096,255.79
定期存款	-
其他存款	-
合计	16,096,255.79

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	236,140,489.57	245,118,198.77	8,977,709.20
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	236,140,489.57	245,118,198.77	8,977,709.20

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

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

无余额。

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	5,386.02
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	1,735.83
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	254.70
合计	7,376.55

6.4.7.6 其他资产

无余额。

6.4.7.7 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	2,340,899.94
银行间市场应付交易费用	-
合计	2,340,899.94

6.4.7.8 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	674.03
预提账户维护费	-
预提审计费	45,621.05
预提信息披露费	148,765.71
合计	195,060.79

6.4.7.9 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	728,317,546.40	728,317,546.40
本期申购	17,818,579.08	17,818,579.08
本期赎回（以“-”号填列）	-502,170,319.76	-502,170,319.76
本期末	243,965,805.72	243,965,805.72

注：申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 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	427,658,940.23	-340,850,832.20	86,808,108.03
本期利润	-39,975,193.72	9,729,865.07	-30,245,328.65
本期基金份额交易产生的变动数	-262,682,331.55	227,292,821.17	-35,389,510.38
其中：基金申购款	10,122,993.05	-8,652,603.65	1,470,389.40
基金赎回款	-272,805,324.60	235,945,424.82	-36,859,899.78

本期已分配利润	-	-	-
本期末	125,001,414.96	-103,828,145.96	21,173,269.00

6.4.7.11 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	237,370.69
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	46,352.22
其他	6,474.04
合计	290,196.95

6.4.7.12 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	3,557,283,875.97
减：卖出股票成本总额	3,583,839,711.05
买卖股票差价收入	-26,555,835.08

6.4.7.13 债券投资收益

无。

6.4.7.14 衍生工具收益

无。

6.4.7.15 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	1,426,290.38
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,426,290.38

6.4.7.16 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	9,729,865.07
——股票投资	9,729,865.07
——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	-
——权证投资	-
3.其他	-
合计	9,729,865.07

6.4.7.17 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	654,251.29
合计	654,251.29

注：基金赎回费收入含赎回费收入和转换费收入。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。基金之间的转换费由赎回费和申购费补差两部分构成，其中赎回费部分的 25% 归入转出基金的基金资产。

6.4.7.18 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	10,245,295.56
银行间市场交易费用	-
合计	10,245,295.56

6.4.7.19 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	45,621.05
信息披露费	148,765.71
银行汇划费用	7,256.95
合计	201,643.71

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。

6.4.9.2 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
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	基金托管人、基金代销机构

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 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	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	4,579,849.68	3,027,893.58
其中：支付销售机构的客户维护费	638,655.15	770,699.23

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：日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.5% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	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
当期发生的基金应支付的托管费	763,308.31	504,648.97

注：支付基金托管人中国建设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 × 0.25% / 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		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
中国建设银行	16,096,255.79	237,370.69	1,139,811,252.19	637,870.70

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

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

无。

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	-
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
002696	百洋股份	2017-06-22	重大资产重组事项	20.87	2017-07-03	21.74	281,589.00	6,486,558.47	5,876,762.43	-
600643	爱建集团	2017-04-17	重大事项	14.98	2017-08-02	16.48	286,500.00	4,273,946.15	4,291,770.00	-
601088	中国神华	2017-06-05	重大事项	22.29	-	-	358,693.00	7,653,207.62	7,995,266.97	-

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高于债券型基金和货币市场基金、低于股票型基金，属于证券投资基金中的中高风险投资品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资等。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争取将以上风险控制在限定的范围之内，本基金重点投资于受益于产业结构升级、消费升级和技术升级的行业，分享中国经济结构转型过程中的投资收益。在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳健增值。

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。

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 中国建设银行，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；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。

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。

于 2017 年 06 月 30 日，本基金未持有信用类债券(2016 年 12 月 31 日： 同)。

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管

理的其他基金共同持有一家公司发行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，因此除附注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。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2017 年 06 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

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。

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、结算备付金和存出保证金等。

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	16,096,255.79	-	-	-	16,096,255.79

结算备付金	4,286,084.18	-	-	-	4,286,084.18
存出保证金	628,967.38	-	-	-	628,967.38
交易性金融资产	245,118,198.77	-	-	-	245,118,198.77
应收利息	-	-	-	7,376.55	7,376.55
应收申购款	-	-	-	17,897.22	17,897.22
应收证券清算款	-	-	-	4,898,253.85	4,898,253.85
资产总计	266,129,506.12	-	-	4,923,527.62	271,053,033.74
负债	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	422,180.37	422,180.37
应付证券清算款	-	-	-	2,462,376.99	2,462,376.99
应付管理人报酬	-	-	-	422,949.36	422,949.36
应付托管费	-	-	-	70,491.57	70,491.57
应付交易费用	-	-	-	2,340,899.94	2,340,899.94
其他负债	-	-	-	195,060.79	195,060.79
负债总计	-	-	-	5,913,959.02	5,913,959.02
利率敏感度缺口	266,129,506.12	-	-	-990,431.40	265,139,074.72
上年度末 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	93,777,422.61	-	-	-	93,777,422.61
结算备付金	10,102,517.67	-	-	-	10,102,517.67
存出保证金	1,050,533.90	-	-	-	1,050,533.90
交易性金融资产	-	-	-	754,811,084.58	754,811,084.58
应收证券清算款	-	-	-	68,825.99	68,825.99
应收利息	-	-	-	22,901.60	22,901.60
应收申购款	-	-	-	81,087.21	81,087.21
资产总计	104,930,474.18	-	-	754,983,899.38	859,914,373.56
负债	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	38,631,986.24	38,631,986.24
应付管理人报酬	-	-	-	1,160,705.45	1,160,705.45
应付托管费	-	-	-	193,450.91	193,450.91
应付交易费用	-	-	-	4,289,122.28	4,289,122.28
其他负债	-	-	-	513,454.25	513,454.25
负债总计	-	-	-	44,788,719.13	44,788,719.13
利率敏感度缺口	104,930,474.18	-	-	710,195,180.25	815,125,654.43

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，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。

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”与“自下而上”相结合的主动投资管理策略，将定性分析与定量分析贯穿于资产配置、行业细分、个券选择以及组合风险管理全过程中，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投资比例为基金总资产的 60%-95%，债券、权证、现金、货币市场工具和资产支持证券为 5%-40%。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	245,118,198.77	92.45	754,811,084.58	92.60
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	245,118,198.77	92.45	754,811,084.58	92.60

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
	2. 业绩比较基准上升 5%	增加约 1,547	增加约 6,216
1. 业绩比较基准下降 5%	减少约 1,547	减少约 6,216	

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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	245,118,198.77	90.43
	其中：股票	245,118,198.77	90.43
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	20,382,339.97	7.52
7	其他各项资产	5,552,495.00	2.05
8	合计	271,053,033.74	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	20,155,939.71	7.60
B	采矿业	23,578,772.97	8.89
C	制造业	129,535,877.80	48.86

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	38,778.24	0.01
F	批发和零售业	15,513,876.50	5.85
G	交通运输、仓储和邮政业	11,427,934.56	4.31
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	15,993,683.70	6.03
J	金融业	8,959,490.49	3.38
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	14,998,322.34	5.66
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	4,915,522.46	1.85
S	综合	-	-
	合计	245,118,198.77	92.45

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	002120	韵达股份	507,058	26,164,192.80	9.87
2	000998	隆平高科	648,464	14,279,177.28	5.39
3	000661	长春高新	103,274	13,333,706.14	5.03
4	600867	通化东宝	669,700	12,215,328.00	4.61
5	002640	跨境通	554,786	11,789,202.50	4.45
6	600233	圆通速递	505,784	9,908,308.56	3.74
7	002027	分众传媒	717,630	9,874,588.80	3.72
8	603660	苏州科达	225,418	9,230,867.10	3.48
9	601088	中国神华	358,693	7,995,266.97	3.02
10	603868	飞科电器	128,284	7,933,082.56	2.99
11	600971	恒源煤电	974,336	7,921,351.68	2.99
12	600188	兖州煤业	625,993	7,662,154.32	2.89
13	600585	海螺水泥	297,100	6,753,083.00	2.55
14	002696	百洋股份	281,589	5,876,762.43	2.22
15	002174	游族网络	178,602	5,672,399.52	2.14

16	300336	新文化	317,951	4,915,522.46	1.85
17	300630	普利制药	135,845	4,904,004.50	1.85
18	002850	科达利	50,931	4,624,025.49	1.74
19	002712	思美传媒	200,749	4,332,163.42	1.63
20	600643	爱建集团	286,500	4,291,770.00	1.62
21	300383	光环新网	296,200	4,016,472.00	1.51
22	300166	东方国信	297,532	3,995,854.76	1.51
23	000807	云铝股份	546,100	3,942,842.00	1.49
24	002468	申通快递	150,943	3,835,461.63	1.45
25	002221	东华能源	341,400	3,724,674.00	1.40
26	600036	招商银行	143,500	3,431,085.00	1.29
27	002831	裕同科技	40,350	3,026,250.00	1.14
28	600703	三安光电	151,646	2,987,426.20	1.13
29	600183	生益科技	215,600	2,660,504.00	1.00
30	601636	旗滨集团	534,500	2,410,595.00	0.91
31	000050	深天马 A	116,800	2,402,576.00	0.91
32	002449	国星光电	144,500	2,391,475.00	0.90
33	300302	同有科技	127,780	2,301,317.80	0.87
34	600809	山西汾酒	61,726	2,141,274.94	0.81
35	603180	金牌厨柜	27,396	1,810,875.60	0.68
36	600990	四创电子	25,251	1,565,309.49	0.59
37	600581	八一钢铁	154,500	1,555,815.00	0.59
38	603167	渤海轮渡	139,800	1,519,626.00	0.57
39	603515	欧普照明	41,842	1,511,333.04	0.57
40	000768	中航飞机	76,700	1,414,348.00	0.53
41	603866	桃李面包	37,763	1,343,607.54	0.51
42	603288	海天味业	32,198	1,313,034.44	0.50
43	002753	永东股份	70,600	1,311,042.00	0.49
44	300061	康耐特	61,828	1,138,871.76	0.43
45	603517	绝味食品	30,244	1,054,608.28	0.40
46	601166	兴业银行	62,200	1,048,692.00	0.40
47	002376	新北洋	64,100	879,452.00	0.33
48	002311	海大集团	47,300	864,171.00	0.33
49	300658	延江股份	21,664	841,213.12	0.32
50	002707	众信旅游	57,100	749,723.00	0.28
51	000756	新华制药	28,000	425,040.00	0.16
52	600338	西藏珠峰	9,300	353,307.00	0.13
53	300458	全志科技	12,200	321,348.00	0.12
54	601878	浙商证券	11,049	187,943.49	0.07
55	603113	金能科技	3,496	81,526.72	0.03
56	300660	江苏雷利	946	74,979.96	0.03
57	603920	世运电路	3,125	70,062.50	0.03
58	603728	鸣志电器	2,719	63,434.27	0.02
59	603197	保隆科技	1,086	57,612.30	0.02

60	600019	宝钢股份	8,200	55,022.00	0.02
61	603801	志邦股份	1,406	47,522.80	0.02
62	603043	广州酒家	1,810	45,738.70	0.02
63	300666	江丰电子	2,276	43,448.84	0.02
64	300662	科锐国际	1,656	41,847.12	0.02
65	603316	诚邦股份	1,824	38,778.24	0.01
66	603380	易德龙	1,298	35,370.50	0.01
67	002870	香山股份	1,046	35,093.30	0.01
68	300637	扬帆新材	1,313	30,619.16	0.01
69	603139	康惠制药	910	27,181.70	0.01
70	603335	迪生力	2,230	24,864.50	0.01
71	002879	长缆科技	1,313	23,660.26	0.01
72	002881	美格智能	989	22,608.54	0.01
73	603679	华体科技	809	21,438.50	0.01
74	603938	三孚股份	1,246	20,932.80	0.01
75	002882	金龙羽	2,966	18,389.20	0.01
76	603933	睿能科技	857	17,311.40	0.01
77	300669	沪宁股份	841	14,650.22	0.01
78	300670	大烨智能	1,259	13,760.87	0.01
79	603286	日盈电子	890	13,528.00	0.01
80	603331	百达精工	999	9,620.37	0.00
81	300671	富满电子	942	7,639.62	0.00
82	603617	君禾股份	832	7,429.76	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	600703	三安光电	48,977,865.56	6.01
2	600990	四创电子	47,730,256.28	5.86
3	600233	圆通速递	46,383,135.33	5.69
4	000001	平安银行	44,674,335.28	5.48
5	601186	中国铁建	44,340,035.54	5.44
6	601988	中国银行	43,470,341.00	5.33
7	603639	海利尔	40,514,032.46	4.97
8	002027	分众传媒	37,803,693.32	4.64
9	601225	陕西煤业	37,268,795.52	4.57
10	600316	洪都航空	35,385,489.83	4.34
11	601328	交通银行	35,367,757.47	4.34
12	600036	招商银行	34,788,421.46	4.27

13	600104	上汽集团	34,646,121.21	4.25
14	300166	东方国信	34,597,041.60	4.24
15	601699	潞安环能	34,277,677.10	4.21
16	300497	富祥股份	32,130,681.13	3.94
17	300336	新文化	31,908,811.26	3.91
18	600971	恒源煤电	31,092,218.31	3.81
19	002376	新北洋	29,652,195.41	3.64
20	601633	长城汽车	28,712,231.54	3.52
21	601336	新华保险	28,377,245.42	3.48
22	002396	星网锐捷	27,633,297.81	3.39
23	002831	裕同科技	27,529,796.62	3.38
24	000039	中集集团	27,457,322.61	3.37
25	600188	兖州煤业	26,927,192.81	3.30
26	002648	卫星石化	26,578,281.77	3.26
27	603579	荣泰健康	26,552,653.68	3.26
28	601666	平煤股份	26,007,809.71	3.19
29	600583	海油工程	25,517,120.52	3.13
30	002589	瑞康医药	25,179,508.35	3.09
31	600585	海螺水泥	24,894,884.33	3.05
32	600348	阳泉煤业	24,293,319.00	2.98
33	300432	富临精工	24,074,991.23	2.95
34	600114	东睦股份	24,047,049.63	2.95
35	601600	中国铝业	24,044,272.03	2.95
36	603868	飞科电器	23,849,098.16	2.93
37	600546	山煤国际	23,795,011.24	2.92
38	000050	深天马 A	23,765,084.62	2.92
39	600372	中航电子	23,181,644.04	2.84
40	603609	禾丰牧业	23,077,011.39	2.83
41	000661	长春高新	22,729,676.89	2.79
42	002517	恺英网络	22,705,837.29	2.79
43	601933	永辉超市	22,469,636.30	2.76
44	601669	中国电建	22,467,582.00	2.76
45	002468	申通快递	21,526,044.11	2.64
46	601818	光大银行	21,273,382.00	2.61
47	600038	中直股份	21,062,606.86	2.58
48	300450	先导智能	20,904,668.33	2.56
49	601006	大秦铁路	20,762,285.06	2.55
50	600023	浙能电力	20,703,292.03	2.54
51	002311	海大集团	20,688,070.57	2.54
52	000975	银泰资源	20,062,352.06	2.46
53	002352	顺丰控股	20,004,984.48	2.45
54	000998	隆平高科	19,993,436.26	2.45
55	601318	中国平安	19,310,255.07	2.37
56	300203	聚光科技	19,238,027.18	2.36

57	000630	铜陵有色	18,319,381.00	2.25
58	300433	蓝思科技	17,874,919.55	2.19
59	603556	海兴电力	17,685,076.31	2.17
60	002466	天齐锂业	17,668,402.73	2.17
61	600795	国电电力	17,212,160.00	2.11
62	000933	神火股份	17,032,370.88	2.09
63	002696	百洋股份	16,424,344.34	2.01
64	002845	同兴达	16,402,080.07	2.01

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	002468	申通快递	83,181,345.29	10.20
2	002640	跨境通	80,018,305.91	9.82
3	002456	欧菲光	72,201,229.94	8.86
4	000661	长春高新	72,108,226.44	8.85
5	600867	通化东宝	60,810,550.75	7.46
6	002511	中顺洁柔	60,513,144.16	7.42
7	002120	韵达股份	54,736,864.43	6.72
8	601699	潞安环能	49,904,575.04	6.12
9	600233	圆通速递	47,879,291.75	5.87
10	600703	三安光电	47,676,129.04	5.85
11	600990	四创电子	46,088,160.07	5.65
12	600038	中直股份	45,735,256.55	5.61
13	000001	平安银行	45,344,839.04	5.56
14	601186	中国铁建	43,927,757.74	5.39
15	601988	中国银行	42,716,595.06	5.24
16	603639	海利尔	41,760,844.83	5.12
17	601225	陕西煤业	37,153,865.19	4.56
18	601328	交通银行	35,250,745.99	4.32
19	603866	桃李面包	35,155,219.57	4.31
20	600316	洪都航空	33,988,920.37	4.17
21	600104	上汽集团	33,809,788.57	4.15
22	300497	富祥股份	31,718,597.15	3.89
23	300166	东方国信	31,561,113.19	3.87
24	600036	招商银行	31,421,973.71	3.85
25	603579	荣泰健康	30,798,574.13	3.78
26	002027	分众传媒	30,573,636.68	3.75
27	000980	众泰汽车	29,745,162.41	3.65

28	601336	新华保险	29,653,338.72	3.64
29	002376	新北洋	28,162,338.14	3.45
30	300287	飞利信	28,052,462.45	3.44
31	000401	冀东水泥	27,804,367.87	3.41
32	601633	长城汽车	27,781,120.11	3.41
33	600546	山煤国际	27,271,792.15	3.35
34	000039	中集集团	27,225,234.62	3.34
35	002352	顺丰控股	26,615,049.39	3.27
36	002396	星网锐捷	26,362,286.90	3.23
37	002589	瑞康医药	26,101,019.24	3.20
38	002648	卫星石化	25,878,284.33	3.17
39	002831	裕同科技	25,844,102.11	3.17
40	002439	启明星辰	25,699,721.58	3.15
41	300336	新文化	24,698,649.69	3.03
42	600583	海油工程	24,429,684.37	3.00
43	601666	平煤股份	23,991,482.93	2.94
44	600348	阳泉煤业	23,568,944.58	2.89
45	600372	中航电子	23,285,814.03	2.86
46	600114	东睦股份	23,192,499.21	2.85
47	300432	富临精工	23,046,939.95	2.83
48	601933	永辉超市	22,919,235.56	2.81
49	601600	中国铝业	22,510,742.64	2.76
50	601006	大秦铁路	22,427,707.61	2.75
51	600971	恒源煤电	22,349,144.49	2.74
52	002517	恺英网络	22,309,034.29	2.74
53	603609	禾丰牧业	22,274,746.36	2.73
54	601669	中国电建	21,895,569.74	2.69
55	601318	中国平安	21,426,717.90	2.63
56	601818	光大银行	21,168,977.05	2.60
57	002570	贝因美	20,446,439.35	2.51
58	002466	天齐锂业	20,322,039.38	2.49
59	600023	浙能电力	20,273,892.97	2.49
60	002311	海大集团	19,971,134.01	2.45
61	300450	先导智能	19,512,834.01	2.39
62	000050	深天马 A	19,469,296.81	2.39
63	300203	聚光科技	18,849,210.21	2.31
64	603868	飞科电器	18,585,130.52	2.28
65	600188	兖州煤业	18,473,354.39	2.27
66	603556	海兴电力	18,325,151.32	2.25
67	300323	华灿光电	18,309,743.33	2.25
68	000975	银泰资源	18,237,658.44	2.24
69	600585	海螺水泥	18,158,649.48	2.23
70	002635	安洁科技	17,868,530.27	2.19
71	000630	铜陵有色	17,341,643.31	2.13

72	300433	蓝思科技	17,322,750.82	2.13
73	300025	华星创业	17,079,528.61	2.10
74	600795	国电电力	16,989,612.00	2.08

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	3,064,416,960.17
卖出股票的收入（成交）总额	3,557,283,875.97

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。

7.6 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。

7.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证投资。

7.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期没有投资股指期货。

7.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.10.1 本期国债期货投资政策

无。

7.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期没有投资国债期货。

7.10.3 本期国债期货投资评价

无。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 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。

7.11.2 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。

7.11.3 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	628,967.38
2	应收证券清算款	4,898,253.85
3	应收股利	-
4	应收利息	7,376.55
5	应收申购款	17,897.22
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,552,495.00

7.11.4 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。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的 公允价值	占基金资产净 值比例(%)	流通受限情况 说明
1	601088	中国神华	7,995,266.97	3.02	重大事项停牌

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
10,440	23,368.37	48,754,471.85	19.98%	195,211,333.87	80.02%

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	49,411.43	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（2011 年 4 月 22 日）基金份额总额	4,119,090,620.47
本报告期期初基金份额总额	728,317,546.40
本报告期基金总申购份额	17,818,579.08
减：本报告期基金总赎回份额	502,170,319.76
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	243,965,805.72

注：总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

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	
中泰证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
中山证券	1	-	-	-	-	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-

联讯证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
财富证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	1,733,208,811.18	26.19%	1,579,476.53	25.89%	-
海通证券	1	1,554,966,210.86	23.50%	1,448,138.61	23.74%	-
广发证券	1	767,546,773.25	11.60%	714,819.41	11.72%	-
华泰证券	1	547,105,121.77	8.27%	509,518.48	8.35%	-
瑞银证券	1	500,434,230.57	7.56%	456,046.82	7.47%	-
中金公司	1	300,823,468.41	4.55%	280,157.70	4.59%	-
天风证券	2	280,628,062.01	4.24%	255,736.76	4.19%	-
光大证券	1	205,692,866.55	3.11%	187,448.94	3.07%	-
东北证券	1	172,436,833.85	2.61%	160,590.27	2.63%	-
申万宏源	2	169,314,090.34	2.56%	154,296.47	2.53%	-
西南证券	1	149,418,831.58	2.26%	136,165.73	2.23%	-
上海证券	2	69,370,260.53	1.05%	63,677.36	1.04%	-
中信建投	1	52,297,002.82	0.79%	48,704.08	0.80%	-
广州证券	2	43,572,096.40	0.66%	40,578.01	0.67%	-
中信证券	1	39,549,838.79	0.60%	36,832.88	0.60%	-
招商证券	3	30,912,082.72	0.47%	28,788.63	0.47%	-

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

2、券商专用交易单元选择程序：

(1) 对交易单元候选券商的综合服务进行评估

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

(2) 填写《新增交易单元申请审核表》

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

(3) 候选交易单元名单提交分管领导审批

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

(4) 协议签署及通知托管人

基金管理人与被选择的券商签订《证券交易单元租用协议》，并通知基金托管人。

3、报告期内基金租用券商交易单元的变更情况：

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
中泰证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
中山证券	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
联讯证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
财富证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-

瑞银证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-

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	关于旗下部分基金增加济安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	2017-01-11
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
6	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
7	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
8	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
9	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
10	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
11	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
12	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
13	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

14	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
15	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
16	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
17	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
18	关于旗下部分基金增加中原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	2017-04-27
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	2017-04-27
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	2017-04-28
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	2017-04-29
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	2017-05-03
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	2017-05-04
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	2017-05-06
25	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
26	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
27	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“东睦股份”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	2017-05-20
28	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
29	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
30	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
31	关于电子直销平台延长“微钱宝”账户交易费率优惠时间的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-06-27
32	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、《华安升级主题混合型证券投资基金基金合同》
- 2、《华安升级主题混合型证券投资基金招募说明书》
- 3、《华安升级主题混合型证券投资基金托管协议》
- 4、中国证监会批准华安升级主题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