

华安物联网主题股票型证券投资基金

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	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	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	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）	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	34
7.1 期末基金资产组合情况	34
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	35
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	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	45
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	46
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	46
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	46
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	46
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	46
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	47
7.12 投资组合报告附注	47
8 基金份额持有人信息	48
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	48

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	48
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	48
9 开放式基金份额变动	48
10 重大事件揭示	49
10.1 基金份额持有人大会决议	49
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	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	49
10.4 基金投资策略的改变	49
10.5 报告期内改聘会计师事务所情况	49
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	49
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	49
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	华安物联网主题股票型证券投资基金
基金简称	华安物联网主题股票
基金主代码	001028
交易代码	001028
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 3 月 17 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	1,911,846,126.83 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金重点投资于与物联网相关的子行业或企业，在严格控制风险的前提下，力争把握该主题投资机会实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金采取相对稳定的资产配置策略，一般情况下将保持股票配置比例的相对稳定，避免因过于主动的仓位调整带来额外的风险。个股选择方面通过对物联网相关子行业的精选以及对行业内相关股票的深入分析，挖掘该类型企业的投资价值。
业绩比较基准	80%×中证 800 指数收益率+20%×中国债券总指数收益率
风险收益特征	本基金为股票型基金，基金的风险与预期收益都要高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金，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@huan.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 层、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	-13,883,763.62
本期利润	-33,946,075.92
加权平均基金份额本期利润	-0.0170
本期加权平均净值利润率	-2.31%
本期基金份额净值增长率	-2.27%
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	-514,754,967.97
期末可供分配基金份额利润	-0.2692
期末基金资产净值	1,397,091,158.86
期末基金份额净值	0.731
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	-26.90%

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	5.18%	0.93%	4.25%	0.51%	0.93%	0.42%
过去三个月	-2.92%	0.98%	2.26%	0.53%	-5.18%	0.45%
过去六个月	-2.27%	0.91%	5.06%	0.49%	-7.33%	0.42%
过去一年	-9.19%	0.93%	8.34%	0.56%	-17.53%	0.37%
自基金成立起至今	-26.90%	2.33%	-2.03%	1.51%	-24.87%	0.82%

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

华安物联网主题股票型证券投资基金

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

(2015 年 3 月 17 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		
翁启森	本基金的基金经理，基金投资部兼全球投资部高级总监，总经理助理	2015-03-17	-	20 年	工业工程学硕士，20 年证券、基金行业从业经历，具有中国大陆基金从业资格。曾在台湾 JP 证券任金融产业分析师及投资经理，台湾摩根富林明投信投资管理部任基金经理，台湾中信证券投资总监助理，台湾保德信投信基金经理。2008 年 4 月加入华安基金管理有限公司，任全球投资部总监。2010 年 9 月起担任华安香港精选股票型证券投资基金的基金经理。2011 年 5 月起同时担任华安大中华升级股票型证券投资基金的基金经理。2014 年 6 月起担任基金投资部兼全球投资部高级总监。2014 年 3 月至 2016 年 9 月同时担任华安宏利混合型证券投资基金的基金经理。2014 年 4 月起同时担任华安大国新经济股票型证券投资基金的基金经理。2014 年 6 月起担任基金投资部兼全球投资部高级总监。2015 年 2 月至 2016 年 9

					月同时担任华安安顺灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2015 年 3 月起担任公司总经理助理。2015 年 3 月起同时担任本基金的基金经理。2015 年 6 月至 2016 年 9 月同时担任华安宝利配置证券投资基金、华安生态优先混合型证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	---

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 年上半年市场风格和结构分化仍然较大，但基本延续了去年四季度的风格导向。消费品表现普遍较好，尤其是受益于列入 MSCI 指标成分的标的。周期方向上，整体表现较为疲弱，但与新能源汽车相关的上游资源表现相对突出；同时，以消费电子为首的价值成长板块表现也较为突出，计算机、传媒方向表现较弱。本基金在合同范围内努力寻找了一批内生增长相对优秀的个股，在新能源汽车上中游领域、消费电子以及消费白马领域进行重点选股和配置，适当参与周期中游和上游的个股，继续回避纯主题、依赖资本外延运作的公司和标的。

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 0.731 元，本报告期份额净值增长率为-2.27%，同期业绩比较基准增长率为 5.06%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

未来一段时间，经济呈现持续温和复苏的概率较大，货币政策可能会主动适应经济复苏的强度，市场整体呈现出在周期和价值成长之间的博弈和切换，指数整体呈现平稳向上。部分内生增长优异的个股将继续跑赢市场并获得绝对收益，本基金将继续在景气度、业绩改善明显的领域，如中游制造、新能源汽车和消费电子等进行重点配置。

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，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

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：华安物联网主题股票型证券投资基金

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	76,181,247.38	89,975,659.16
结算备付金		495,472.93	1,654,452.32
存出保证金		108,128.77	294,215.62
交易性金融资产	6.4.7.2	1,323,989,690.22	1,462,191,722.19
其中：股票投资		1,322,656,864.22	1,461,568,473.57
基金投资		-	-
债券投资		1,332,826.00	623,248.62
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		1,630,098.08	-
应收利息	6.4.7.5	14,798.84	21,722.64
应收股利		-	-
应收申购款		11,477.11	20,424.59
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,402,430,913.33	1,554,158,196.52
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		476,035.78	12.25
应付赎回款		2,394,297.28	658,827.43
应付管理人报酬		1,695,517.34	2,020,862.56
应付托管费		282,586.21	336,810.41
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	302,232.67	831,370.89
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	189,085.19	401,260.55
负债合计		5,339,754.47	4,249,144.09
所有者权益:		-	-
实收基金	6.4.7.9	1,911,846,126.83	2,072,309,603.49
未分配利润	6.4.7.10	-514,754,967.97	-522,400,551.06
所有者权益合计		1,397,091,158.86	1,549,909,052.43
负债和所有者权益总计		1,402,430,913.33	1,554,158,196.52

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.731 元，基金份额总额 1,911,846,126.83 份。

6.2 利润表

会计主体：华安物联网主题股票型证券投资基金

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		-19,955,727.03	-304,309,510.96
1.利息收入	6.4.7.11	304,166.06	420,644.22
其中：存款利息收入		302,546.86	420,161.76
债券利息收入		1,619.20	482.46
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）		-270,189.42	-108,282,537.56
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-6,480,711.99	-112,586,641.70
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	56,507.71	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-	-
股利收益	6.4.7.17	6,154,014.86	4,304,104.14
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-20,062,312.30	-196,706,714.96
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	72,608.63	259,097.34
减：二、费用		13,990,348.89	17,516,008.75
1. 管理人报酬	6.4.10.2	10,937,868.48	12,596,341.39
2. 托管费	6.4.10.2	1,822,978.04	2,099,390.22
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.20	1,029,178.80	2,606,811.33
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.21	200,323.57	213,465.81
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-33,946,075.92	-321,825,519.71
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-33,946,075.92	-321,825,519.71

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安物联网主题股票型证券投资基金

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）	2,072,309,603.49	-522,400,551.06	1,549,909,052.43
二、本期经营活动产生的	-	-33,946,075.92	-33,946,075.92

基金净值变动数（本期利润）			
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）	-160,463,476.66	41,591,659.01	-118,871,817.65
其中：1.基金申购款	25,880,766.20	-6,850,899.93	19,029,866.27
2.基金赎回款	-186,344,242.86	48,442,558.94	-137,901,683.92
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）	1,911,846,126.83	-514,754,967.97	1,397,091,158.86
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）	2,265,142,124.13	-120,983,615.36	2,144,158,508.77
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-321,825,519.71	-321,825,519.71
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）	-34,105,611.52	6,941,150.61	-27,164,460.91
其中：1.基金申购款	108,939,201.23	-28,092,257.65	80,846,943.58
2.基金赎回款	-143,044,812.75	35,033,408.26	-108,011,404.49
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）	2,231,036,512.61	-435,867,984.46	1,795,168,528.15

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

华安物联网主题股票型证券投资基金(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]78 号《关于准予华安物联网主题股票型证券投资基金注册的批

复》的核准，由华安基金管理有限公司作为管理人自 2015 年 2 月 9 日至 2015 年 3 月 13 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（2015）验字第 60971571_B12 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 2015 年 3 月 17 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 4,784,476,959.31 元，在募集期间产生的存款利息为人民币 2,905,281.33 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 4,787,382,240.64 元，折合 4,787,382,240.64 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，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

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等权益类证券（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票、权证等）、股指期货、债券、货币市场工具、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（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。

本基金的投资组合比例为：股票资产投资比例为基金资产的 80%-95%，其中，投资于物联网相关的股票资产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%。本基金业绩比较基准： $80\% \times \text{中证 800 指数收益率} + 20\% \times \text{中国债券总指数收益率}$ 。

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 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

6.4.6.1 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。

6.4.6.2 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。

6.4.6.3 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。

6.4.6.4 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	76,181,247.38
定期存款	-	
其他存款	-	
合计	76,181,247.38	

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	1,641,771,737.78	1,322,656,864.22	-319,114,873.56
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	1,138,000.00	1,332,826.00	194,826.00
交易所市场			

	银行间市场	-	-	-
	合计	1,138,000.00	1,332,826.00	194,826.00
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		1,642,909,737.78	1,323,989,690.22	-318,920,047.56

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

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	13,406.83
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	200.70
应收债券利息	1,147.57
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	43.74
合计	14,798.84

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	302,232.67
银行间市场应付交易费用	-
合计	302,232.67

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	647.90
预提账户维护费	-
预提审计费	49,588.57
预提信息披露费	138,848.72
合计	189,085.19

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	2,072,309,603.49	2,072,309,603.49
本期申购	25,880,766.20	25,880,766.20
本期赎回（以“-”号填列）	-186,344,242.86	-186,344,242.86
本期末	1,911,846,126.83	1,911,846,126.83

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	-181,347,563.82	-341,052,987.24	-522,400,551.06
本期利润	-13,883,763.62	-20,062,312.30	-33,946,075.92
本期基金份额交易产生的变动数	13,844,795.52	27,746,863.49	41,591,659.01
其中：基金申购款	-2,228,920.96	-4,621,978.97	-6,850,899.93
基金赎回款	16,073,716.48	32,368,842.46	48,442,558.94
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-181,386,531.92	-333,368,436.05	-514,754,967.97

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	296,390.52
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	4,647.08
其他	1,509.26
合计	302,546.86

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	384,803,126.51
减：卖出股票成本总额	391,283,838.50
买卖股票差价收入	-6,480,711.99

6.4.7.13 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	492,027.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	435,400.00
减：应收利息总额	119.29
买卖债券差价收入	56,507.71

6.4.7.14 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.15 贵金属投资收益

6.4.7.15.1 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期无贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入。

6.4.7.15.2 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无贵金属投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.15.3 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无贵金属投资收益——申购差价收入。

6.4.7.16 衍生工具收益

6.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

6.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期无衍生工具收益——其他投资收益。

6.4.7.17 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	6,154,014.86
基金投资产生的股利收益	-
合计	6,154,014.86

6.4.7.18 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	-20,062,312.30
——股票投资	-20,181,289.68
——债券投资	118,977.38
——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	-20,062,312.30

6.4.7.19 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	72,608.63
合计	72,608.63

注：1. 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。

2. 本基金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。

6.4.7.20 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	1,029,178.80
银行间市场交易费用	-
合计	1,029,178.80

6.4.7.21 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	49,588.57
信息披露费	138,848.72
银行汇划费用	2,886.28
账户维护费	9,000.00
合计	200,323.57

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 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	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	10,937,868.48	12,596,341.39
其中：支付销售机构的客户维护费	4,732,090.44	6,119,595.38

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 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	1,822,978.04	2,099,390.22

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	76,181,247.38	296,390.52	119,704,902.42	408,738.98

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	-
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
000034	神州数码	2017-03-21	筹划重大资产重组	24.45	2017-07-18	22.01	632,099.00	17,103,657.10	15,454,820.55	-
000503	海虹控股	2017-05-11	筹划重大资产重组	24.93	-	-	69,448.00	4,278,143.14	1,731,338.64	-
000662	天夏智慧	2017-06-05	筹划重大资产重组	17.35	-	-	935,800.00	22,677,117.90	16,236,130.00	-
000673	当代东方	2017-01-18	筹划重大资产重组	13.53	2017-08-22	12.18	297,400.00	5,525,910.00	4,023,822.00	-
000700	模塑科技	2017-06-28	筹划重大事项	8.09	2017-08-16	8.00	383,800.00	4,513,813.93	3,104,942.00	-
002013	中航机电	2017-05-12	筹划重大事项	10.33	2017-08-02	11.36	568,824.00	8,097,243.95	5,875,951.92	-
002127	南极电商	2017-06-29	筹划重大资产重组	12.08	2017-07-06	12.61	295,500.00	3,386,008.00	3,569,640.00	-

002162	悦心健康	2016-12-22	筹划重大资产重组	6.61	2017-07-05	6.80	431,535.00	5,527,910.00	2,852,446.35	-
002358	森源电气	2017-05-12	筹划重大资产重组	17.02	2017-07-12	16.68	75,816.00	1,552,802.80	1,290,388.32	-
002426	胜利精密	2017-01-16	筹划重大事项	7.68	-	-	340,639.00	2,708,364.35	2,616,107.52	-
002642	荣之联	2017-04-10	筹划重大事项	25.06	2017-07-07	22.54	320,736.00	18,182,608.92	8,037,644.16	-
002681	奋达科技	2017-06-22	筹划重大资产重组	12.59	2017-07-03	12.70	275,500.00	3,742,588.00	3,468,545.00	-
002693	双成药业	2017-05-25	筹划重大资产重组	6.67	2017-07-25	6.88	139,259.00	1,473,045.32	928,857.53	-
002766	索菱股份	2017-05-15	筹划重大资产重组	33.18	2017-08-15	16.75	114,445.00	5,539,672.50	3,797,285.10	-
300075	数字政通	2017-06-29	筹划重大事项	20.94	2017-07-17	18.86	284,666.00	16,894,610.14	5,960,906.04	-
300100	双林股份	2017-04-05	筹划重大资产重组	25.96	-	-	547,304.00	21,993,117.12	14,208,011.84	-
300209	天泽信息	2017-02-10	筹划重大资产重组	27.72	-	-	53,656.00	1,593,043.41	1,487,344.32	-
300582	英飞特	2017-06-05	筹划重大资产重组	18.92	2017-08-02	17.50	2,038.00	20,181.15	38,558.96	-
600136	当代明诚	2017-02-13	筹划重大资产重组	16.79	-	-	643,912.00	18,274,690.30	10,811,282.48	-
600146	商赢环球	2017-01-05	筹划重大资产重组	35.73	-	-	124,286.00	4,180,233.41	4,440,738.78	-
600358	国旅联合	2017-06-05	筹划重大事项	7.00	-	-	306,000.00	6,045,894.00	2,142,000.00	-
600603	广汇物流	2017-06-15	筹划重大资产重组	11.81	2017-07-27	11.71	134,900.00	1,959,265.00	1,593,169.00	-
601717	郑煤机	2017-04-24	筹划重大资产重组	7.79	-	-	728,400.00	5,084,934.23	5,674,236.00	-
601989	中国重工	2017-05-31	筹划重大资产重组	6.21	-	-	531,200.00	3,867,305.02	3,298,752.00	-
603501	韦尔股份	2017-06-05	筹划重大资产重组	20.15	-	-	1,657.00	11,632.14	33,388.55	-

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

截至报告期末 2017 年 6 月 30 日止，本基金无银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至报告期末 2017 年 6 月 30 日止，本基金无交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金为股票型基金，基金的风险与预期收益都要高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金，属于证券投资基金中的高风险投资品种。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。本基金重点投资于与物联网相关的子行业或企业，在严格控制风险的前提下，力争把握标的行业投资机会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建设银行，与该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。

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。

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金等，其余金融资产和金融负债均不计息，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。

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	76,181,247.38	-	-	-	76,181,247.38
结算备付金	495,472.93	-	-	-	495,472.93
存出保证金	108,128.77	-	-	-	108,128.77
交易性金融资产	1,332,826.00	-	-	1,322,656,864.22	1,323,989,690.22
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	1,630,098.08	1,630,098.08
应收利息	-	-	-	14,798.84	14,798.84
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	11,477.11	11,477.11
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	78,117,675.08	-	-	1,324,313,238.25	1,402,430,913.33
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	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	476,035.78	476,035.78
应付赎回款	-	-	-	2,394,297.28	2,394,297.28
应付管理人报酬	-	-	-	1,695,517.34	1,695,517.34
应付托管费	-	-	-	282,586.21	282,586.21
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	302,232.67	302,232.67
应付税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-

应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	189,085.19	189,085.19
负债总计	-	-	-	5,339,754.47	5,339,754.47
利率敏感度缺口	78,117,675.08	-	-	1,318,973,483.78	1,397,091,158.86
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	89,975,659.16	-	-	-	89,975,659.16
结算备付金	1,654,452.32	-	-	-	1,654,452.32
存出保证金	294,215.62	-	-	-	294,215.62
交易性金融资产	623,248.62	-	-	1,461,568,473.57	1,462,191,722.19
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资 产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	21,722.64	21,722.64
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	20,424.59	20,424.59
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	92,547,575.72	-	-	1,461,610,620.80	1,554,158,196.52
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	-	-	-	12.25	12.25
应付赎回款	-	-	-	658,827.43	658,827.43
应付管理人报酬	-	-	-	2,020,862.56	2,020,862.56
应付托管费	-	-	-	336,810.41	336,810.41
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	831,370.89	831,370.89
应付税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	401,260.55	401,260.55
负债总计	-	-	-	4,249,144.09	4,249,144.09
利率敏感度缺口	92,547,575.72	-	-	1,457,361,476.71	1,549,909,052.43

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。

本基金采取相对稳定的资产配置策略，一般情况下将保持股票配置比例的相对稳定，避免因过于主动的仓位调整带来额外的风险。在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。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。本基金股票投资占基金资产的比例范围为 80%-95%，其中投资于物联网相关的股票资产的比例不低于非现金基金资产的 80%。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	1,322,656,864.22	94.67	1,461,568,473.57	94.30
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	1,322,656,864.22	94.67	1,461,568,473.57	94.30

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
	业绩比较基准增加 5%	增加约 10,407	增加约 11,402
	业绩比较基准减少 5%	减少约 10,407	减少约 11,402

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

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	1,322,656,864.22	94.31
	其中：股票	1,322,656,864.22	94.31
2	固定收益投资	1,332,826.00	0.10

	其中：债券	1,332,826.00	0.10
	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	76,676,720.31	5.47
7	其他各项资产	1,764,502.80	0.13
8	合计	1,402,430,913.33	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	19,953,369.45	1.43
B	采矿业	35,892,661.20	2.57
C	制造业	827,310,996.06	59.22
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,345,317.66	0.96
E	建筑业	37,692,047.08	2.70
F	批发和零售业	77,855,727.81	5.57
G	交通运输、仓储和邮政业	15,009,018.52	1.07
H	住宿和餐饮业	5,059,084.44	0.36
I	信息传输、软件和信息技术服务业	104,453,665.02	7.48
J	金融业	49,769,052.44	3.56
K	房地产业	15,404,081.42	1.10
L	租赁和商务服务业	18,971,968.92	1.36
M	科学研究和技术服务业	4,925,106.92	0.35
N	水利、环境和公共设施管理业	7,410,959.73	0.53
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	23,954,774.92	1.71

R	文化、体育和娱乐业	60,770,587.23	4.35
S	综合	4,878,445.40	0.35
	合计	1,322,656,864.22	94.67

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

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	002640	跨境通	1,940,267	41,230,673.75	2.95
2	300144	宋城演艺	1,599,077	33,372,736.99	2.39
3	002384	东山精密	1,129,422	27,896,723.40	2.00
4	600259	广晟有色	693,530	27,075,411.20	1.94
5	300450	先导智能	488,973	25,314,132.21	1.81
6	002044	美年健康	1,242,495	21,122,415.00	1.51
7	002371	北方华创	762,600	18,241,392.00	1.31
8	002475	立讯精密	620,808	18,152,425.92	1.30
9	600651	飞乐音响	1,975,776	16,734,822.72	1.20
10	000662	天夏智慧	935,800	16,236,130.00	1.16
11	000034	神州数码	632,099	15,454,820.55	1.11
12	002174	游族网络	479,479	15,228,253.04	1.09
13	002466	天齐锂业	263,106	14,299,811.10	1.02
14	601336	新华保险	276,900	14,232,660.00	1.02
15	300100	双林股份	547,304	14,208,011.84	1.02
16	600110	诺德股份	998,930	14,074,923.70	1.01
17	000725	京东方 A	3,357,385	13,966,721.60	1.00
18	002236	大华股份	609,400	13,900,414.00	0.99
19	603188	亚邦股份	745,795	13,006,664.80	0.93
20	300351	永贵电器	705,843	12,867,517.89	0.92
21	002460	赣锋锂业	270,320	12,502,300.00	0.89
22	000018	神州长城	1,633,665	12,366,844.05	0.89
23	300196	长海股份	388,799	11,566,770.25	0.83
24	002120	韵达股份	221,281	11,418,099.60	0.82
25	600782	新钢股份	3,077,145	11,231,579.25	0.80
26	600136	当代明诚	643,912	10,811,282.48	0.77
27	300458	全志科技	409,164	10,777,379.76	0.77
28	600687	刚泰控股	820,476	10,567,730.88	0.76
29	002035	华帝股份	429,115	10,384,583.00	0.74

30	002831	裕同科技	138,241	10,368,075.00	0.74
31	300223	北京君正	406,212	9,891,262.20	0.71
32	002273	水晶光电	479,178	9,885,442.14	0.71
33	000049	德赛电池	184,560	9,562,053.60	0.68
34	600420	现代制药	585,158	9,181,129.02	0.66
35	600703	三安光电	465,749	9,175,255.30	0.66
36	300097	智云股份	333,657	9,008,739.00	0.64
37	002456	欧菲光	482,962	8,775,419.54	0.63
38	601231	环旭电子	547,995	8,609,001.45	0.62
39	002036	联创电子	516,157	8,516,590.50	0.61
40	300207	欣旺达	715,403	8,434,601.37	0.60
41	300281	金明精机	524,359	8,431,692.72	0.60
42	000915	山大华特	228,206	8,413,955.22	0.60
43	300017	网宿科技	696,052	8,401,347.64	0.60
44	600114	东睦股份	462,366	8,091,405.00	0.58
45	002642	荣之联	320,736	8,037,644.16	0.58
46	002123	梦网荣信	710,086	7,889,055.46	0.56
47	601166	兴业银行	439,430	7,408,789.80	0.53
48	600183	生益科技	598,462	7,385,021.08	0.53
49	600138	中青旅	346,230	7,291,603.80	0.52
50	000971	高升控股	426,794	7,165,871.26	0.51
51	000970	中科三环	481,413	7,115,284.14	0.51
52	002444	巨星科技	455,600	7,098,248.00	0.51
53	601318	中国平安	142,613	7,075,030.93	0.51
54	000963	华东医药	142,200	7,067,340.00	0.51
55	300323	华灿光电	508,425	7,056,939.00	0.51
56	600702	沱牌舍得	260,800	6,939,888.00	0.50
57	601799	星宇股份	156,514	6,921,049.08	0.50
58	000998	隆平高科	306,300	6,744,726.00	0.48
59	002180	纳思达	277,300	6,699,568.00	0.48
60	002279	久其软件	532,852	6,687,292.60	0.48
61	002479	富春环保	560,299	6,667,558.10	0.48
62	600963	岳阳林纸	881,641	6,638,756.73	0.48
63	300140	中环装备	369,782	6,619,097.80	0.47
64	600068	葛洲坝	586,200	6,588,888.00	0.47
65	600826	兰生股份	356,900	6,459,890.00	0.46
66	600580	卧龙电气	935,350	6,379,087.00	0.46
67	002230	科大讯飞	157,994	6,303,960.60	0.45
68	600143	金发科技	1,042,774	6,287,927.22	0.45
69	300075	数字政通	284,666	5,960,906.04	0.43
70	002559	亚威股份	546,602	5,947,029.76	0.43
71	600109	国金证券	506,377	5,934,738.44	0.42
72	603718	海利生物	429,185	5,931,336.70	0.42
73	000603	盛达矿业	436,300	5,924,954.00	0.42

74	600129	太极集团	437,985	5,899,657.95	0.42
75	002013	中航机电	568,824	5,875,951.92	0.42
76	600303	曙光股份	567,720	5,802,098.40	0.42
77	600036	招商银行	239,800	5,733,618.00	0.41
78	600595	中孚实业	1,187,707	5,724,747.74	0.41
79	601717	郑煤机	728,400	5,674,236.00	0.41
80	603929	亚翔集成	248,400	5,593,968.00	0.40
81	600467	好当家	1,638,620	5,587,694.20	0.40
82	603000	人民网	417,970	5,504,664.90	0.39
83	002009	天奇股份	478,598	5,465,589.16	0.39
84	600207	安彩高科	724,604	5,405,545.84	0.39
85	000066	中国长城	591,942	5,333,397.42	0.38
86	002051	中工国际	248,230	5,145,807.90	0.37
87	600571	信雅达	369,146	5,131,129.40	0.37
88	000524	岭南控股	375,303	5,059,084.44	0.36
89	002126	银轮股份	496,975	4,999,568.50	0.36
90	300384	三联虹普	132,788	4,925,106.92	0.35
91	002699	美盛文化	356,745	4,923,081.00	0.35
92	002318	久立特材	585,250	4,787,345.00	0.34
93	300449	汉邦高科	187,930	4,615,560.80	0.33
94	002241	歌尔股份	239,038	4,608,652.64	0.33
95	600048	保利地产	458,909	4,575,322.73	0.33
96	002299	圣农发展	304,300	4,524,941.00	0.32
97	600104	上汽集团	145,044	4,503,616.20	0.32
98	600146	商赢环球	124,286	4,440,738.78	0.32
99	601601	中国太保	130,600	4,423,422.00	0.32
100	600197	伊力特	221,381	4,323,570.93	0.31
101	603898	好莱客	123,700	4,323,315.00	0.31
102	300070	碧水源	231,237	4,312,570.05	0.31
103	002570	贝因美	311,800	4,240,480.00	0.30
104	300232	洲明科技	263,757	4,220,112.00	0.30
105	300242	明家联合	443,110	4,205,113.90	0.30
106	300346	南大光电	183,926	4,187,995.02	0.30
107	000921	海信科龙	241,900	4,163,099.00	0.30
108	600563	法拉电子	83,903	4,145,647.23	0.30
109	000938	紫光股份	67,771	4,142,163.52	0.30
110	600029	南方航空	473,119	4,116,135.30	0.29
111	000673	当代东方	297,400	4,023,822.00	0.29
112	300463	迈克生物	155,800	3,972,900.00	0.28
113	600373	中文传媒	167,600	3,940,276.00	0.28
114	002050	三花智控	237,450	3,875,184.00	0.28
115	002690	美亚光电	201,400	3,862,852.00	0.28
116	002468	申通快递	151,000	3,836,910.00	0.27
117	603626	科森科技	58,822	3,834,017.96	0.27

118	600031	三一重工	469,536	3,817,327.68	0.27
119	002766	索菱股份	114,445	3,797,285.10	0.27
120	601668	中国建筑	389,400	3,769,392.00	0.27
121	300083	劲胜精密	404,700	3,739,428.00	0.27
122	600115	东方航空	545,804	3,711,467.20	0.27
123	600486	扬农化工	86,982	3,671,510.22	0.26
124	000651	格力电器	88,979	3,663,265.43	0.26
125	002179	中航光电	117,126	3,653,159.94	0.26
126	600240	华业资本	403,180	3,652,810.80	0.26
127	600428	中远海特	584,191	3,633,668.02	0.26
128	600491	龙元建设	336,656	3,612,318.88	0.26
129	600273	嘉化能源	380,596	3,569,990.48	0.26
130	002127	南极电商	295,500	3,569,640.00	0.26
131	603555	贵人鸟	158,932	3,553,719.52	0.25
132	601333	广深铁路	784,900	3,547,748.00	0.25
133	600060	海信电器	233,045	3,535,292.65	0.25
134	002152	广电运通	422,070	3,507,401.70	0.25
135	600584	长电科技	216,944	3,481,951.20	0.25
136	600168	武汉控股	385,886	3,476,832.86	0.25
137	600309	万华化学	121,135	3,469,306.40	0.25
138	600030	中信证券	203,800	3,468,676.00	0.25
139	002681	奋达科技	275,500	3,468,545.00	0.25
140	000820	神雾节能	91,300	3,467,574.00	0.25
141	002367	康力电梯	293,700	3,430,416.00	0.25
142	600038	中直股份	73,841	3,379,702.57	0.24
143	300468	四方精创	75,050	3,346,479.50	0.24
144	002281	光迅科技	149,970	3,332,333.40	0.24
145	601989	中国重工	531,200	3,298,752.00	0.24
146	600777	新潮能源	860,020	3,285,276.40	0.24
147	300302	同有科技	181,928	3,276,523.28	0.23
148	002055	得润电子	143,993	3,272,960.89	0.23
149	601607	上海医药	113,323	3,272,768.24	0.23
150	600363	联创光电	230,245	3,225,732.45	0.23
151	300129	泰胜风能	445,700	3,160,013.00	0.23
152	300336	新文化	201,700	3,118,282.00	0.22
153	300210	森远股份	320,562	3,109,451.40	0.22
154	000700	模塑科技	383,800	3,104,942.00	0.22
155	300190	维尔利	209,918	3,098,389.68	0.22
156	002041	登海种业	233,661	3,096,008.25	0.22
157	300406	九强生物	183,411	3,018,945.06	0.22
158	600588	用友网络	175,674	3,007,538.88	0.22
159	000027	深圳能源	446,400	3,004,272.00	0.22
160	603968	醋化股份	133,400	2,996,164.00	0.21
161	000959	首钢股份	418,569	2,925,797.31	0.21

162	300120	经纬电材	220,623	2,898,986.22	0.21
163	603993	洛阳钼业	571,600	2,892,296.00	0.21
164	002162	悦心健康	431,535	2,852,446.35	0.20
165	002667	鞍重股份	152,500	2,841,075.00	0.20
166	600960	渤海活塞	371,255	2,832,675.65	0.20
167	600763	通策医疗	112,888	2,832,359.92	0.20
168	002177	御银股份	498,503	2,831,497.04	0.20
169	002045	国光电器	177,099	2,814,103.11	0.20
170	002405	四维图新	142,282	2,811,492.32	0.20
171	002196	方正电机	245,665	2,807,950.95	0.20
172	002501	利源精制	246,834	2,806,502.58	0.20
173	000661	长春高新	21,700	2,801,687.00	0.20
174	000980	众泰汽车	224,080	2,702,404.80	0.19
175	601908	京运通	554,800	2,663,040.00	0.19
176	300078	思创医惠	244,894	2,627,712.62	0.19
177	002426	胜利精密	340,639	2,616,107.52	0.19
178	603766	隆鑫通用	357,523	2,602,767.44	0.19
179	000925	众合科技	122,981	2,554,315.37	0.18
180	002400	省广股份	310,777	2,495,539.31	0.18
181	300436	广生堂	66,200	2,489,782.00	0.18
182	600285	羚锐制药	214,747	2,411,608.81	0.17
183	000638	万方发展	194,111	2,395,329.74	0.17
184	000657	中钨高新	187,851	2,314,324.32	0.17
185	603026	石大胜华	81,800	2,311,668.00	0.17
186	000800	一汽轿车	226,200	2,300,454.00	0.16
187	600198	大唐电信	179,732	2,295,177.64	0.16
188	002494	华斯股份	155,100	2,261,358.00	0.16
189	000636	风华高科	260,036	2,212,906.36	0.16
190	002027	分众传媒	158,100	2,175,456.00	0.16
191	600358	国旅联合	306,000	2,142,000.00	0.15
192	002612	朗姿股份	157,654	2,134,635.16	0.15
193	300231	银信科技	158,999	2,098,786.80	0.15
194	002215	诺普信	237,163	2,006,398.98	0.14
195	600735	新华锦	157,240	1,776,812.00	0.13
196	000503	海虹控股	69,448	1,731,338.64	0.12
197	300409	道氏技术	46,082	1,715,172.04	0.12
198	600487	亨通光电	60,508	1,697,249.40	0.12
199	603883	老百姓	34,486	1,677,743.90	0.12
200	600376	首开股份	145,781	1,667,734.64	0.12
201	000513	丽珠集团	24,158	1,645,159.80	0.12
202	001979	招商蛇口	76,766	1,639,721.76	0.12
203	600603	广汇物流	134,900	1,593,169.00	0.11
204	002517	恺英网络	44,478	1,565,180.82	0.11
205	002078	太阳纸业	205,755	1,512,299.25	0.11

206	300209	天泽信息	53,656	1,487,344.32	0.11
207	600436	片仔癀	24,331	1,485,164.24	0.11
208	002745	木林森	39,300	1,469,427.00	0.11
209	002510	天汽模	198,600	1,441,836.00	0.10
210	002001	新 和 成	74,204	1,440,299.64	0.10
211	002709	天赐材料	34,900	1,436,833.00	0.10
212	600538	国发股份	204,296	1,415,771.28	0.10
213	002108	沧州明珠	105,505	1,408,491.75	0.10
214	002048	宁波华翔	67,489	1,407,820.54	0.10
215	002110	三钢闽光	105,823	1,356,650.86	0.10
216	002176	江特电机	153,613	1,339,505.36	0.10
217	300378	鼎捷软件	84,512	1,336,134.72	0.10
218	300297	蓝盾股份	120,626	1,320,854.70	0.09
219	000863	三湘印象	179,331	1,312,702.92	0.09
220	600565	迪马股份	236,900	1,305,319.00	0.09
221	600958	东方证券	93,758	1,304,173.78	0.09
222	002707	众信旅游	98,837	1,297,729.81	0.09
223	600869	智慧能源	192,795	1,297,510.35	0.09
224	002358	森源电气	75,816	1,290,388.32	0.09
225	600105	永鼎股份	156,728	1,264,794.96	0.09
226	600621	华鑫股份	103,089	1,250,469.57	0.09
227	002491	通鼎互联	90,369	1,214,559.36	0.09
228	002349	精华制药	112,914	1,061,391.60	0.08
229	000948	南天信息	83,048	1,009,863.68	0.07
230	002693	双成药业	139,259	928,857.53	0.07
231	603186	华正新材	18,600	795,522.00	0.06
232	300400	劲拓股份	52,486	783,091.12	0.06
233	002503	搜于特	100,775	708,448.25	0.05
234	002280	联络互动	59,101	643,018.88	0.05
235	600295	鄂尔多斯	50,473	514,824.60	0.04
236	600977	中国电影	23,298	436,138.56	0.03
237	601611	中国核建	36,303	434,546.91	0.03
238	603888	新华网	8,030	260,091.70	0.02
239	603833	欧派家居	2,329	255,863.94	0.02
240	300616	尚品宅配	1,858	251,870.48	0.02
241	601878	浙商证券	11,049	187,943.49	0.01
242	603986	兆易创新	2,266	176,317.46	0.01
243	300618	寒锐钴业	1,600	150,880.00	0.01
244	601952	苏垦农发	10,425	144,594.75	0.01
245	002522	浙江众成	8,000	130,800.00	0.01
246	300558	贝达药业	2,172	129,538.08	0.01
247	300625	三雄极光	3,934	129,035.20	0.01
248	603839	安正时尚	4,550	123,396.00	0.01
249	601366	利群股份	8,400	116,760.00	0.01

250	603225	新风鸣	3,197	115,667.46	0.01
251	601985	中国核电	14,600	114,026.00	0.01
252	603337	杰克股份	2,833	109,637.10	0.01
253	002867	周大生	3,444	106,350.72	0.01
254	603098	森特股份	4,293	99,082.44	0.01
255	002852	道道全	1,271	96,596.00	0.01
256	603980	吉华集团	3,449	91,846.87	0.01
257	601858	中国科传	7,280	91,145.60	0.01
258	603358	华达科技	1,769	89,617.54	0.01
259	603877	太平鸟	3,180	89,008.20	0.01
260	300568	星源材质	2,096	88,975.20	0.01
261	603517	绝味食品	2,425	84,559.75	0.01
262	300623	捷捷微电	1,242	83,462.40	0.01
263	300569	天能重工	2,365	83,129.75	0.01
264	603689	皖天然气	4,818	82,628.70	0.01
265	603658	安图生物	1,911	82,364.10	0.01
266	300583	赛托生物	1,582	82,200.72	0.01
267	603113	金能科技	3,496	81,526.72	0.01
268	603717	天域生态	2,490	81,198.90	0.01
269	603303	得邦照明	2,392	79,868.88	0.01
270	603823	百合花	3,762	79,679.16	0.01
271	300641	正丹股份	4,020	77,586.00	0.01
272	603298	杭叉集团	3,641	75,477.93	0.01
273	300660	江苏雷利	946	74,979.96	0.01
274	002872	天圣制药	2,003	74,050.91	0.01
275	603630	拉芳家化	1,985	73,881.70	0.01
276	603385	惠达卫浴	2,750	73,672.50	0.01
277	603768	常青股份	2,755	70,087.20	0.01
278	603920	世运电路	3,125	70,062.50	0.01
279	603586	金麒麟	2,046	69,666.30	0.00
280	603208	江山欧派	1,221	65,970.63	0.00
281	603906	龙蟠科技	2,816	63,557.12	0.00
282	603728	鸣志电器	2,719	63,434.27	0.00
283	603197	保隆科技	1,086	57,612.30	0.00
284	300580	贝斯特	2,489	56,251.40	0.00
285	002869	金溢科技	1,255	54,592.50	0.00
286	603096	新经典	1,270	53,822.60	0.00
287	603803	瑞斯康达	2,245	52,016.65	0.00
288	002861	瀛通通讯	1,664	51,201.28	0.00
289	603081	大丰实业	2,582	49,006.36	0.00
290	603665	康隆达	1,185	47,577.75	0.00
291	603801	志邦股份	1,406	47,522.80	0.00
292	603043	广州酒家	1,810	45,738.70	0.00
293	603758	秦安股份	2,441	45,036.45	0.00

294	300639	凯普生物	1,046	44,894.32	0.00
295	300666	江丰电子	2,276	43,448.84	0.00
296	300658	延江股份	1,110	43,101.30	0.00
297	603855	华荣股份	2,728	41,792.96	0.00
298	002875	安奈儿	1,158	41,514.30	0.00
299	603326	我乐家居	1,452	40,612.44	0.00
300	603033	三维股份	1,624	40,096.56	0.00
301	002866	传艺科技	1,488	40,071.84	0.00
302	603767	中马传动	1,785	39,751.95	0.00
303	300582	英飞特	2,038	38,558.96	0.00
304	603926	铁流股份	1,082	36,712.26	0.00
305	002863	今飞凯达	2,249	36,343.84	0.00
306	603383	顶点软件	811	36,138.16	0.00
307	002868	绿康生化	1,234	35,872.38	0.00
308	603380	易德龙	1,298	35,370.50	0.00
309	002870	香山股份	1,046	35,093.30	0.00
310	603042	华脉科技	1,232	35,013.44	0.00
311	603501	韦尔股份	1,657	33,388.55	0.00
312	603196	日播时尚	2,083	32,682.27	0.00
313	603488	展鹏科技	1,837	32,074.02	0.00
314	603496	恒为科技	912	31,354.56	0.00
315	603041	美思德	1,034	31,340.54	0.00
316	300652	雷迪克	966	30,863.70	0.00
317	300647	超频三	1,244	30,602.40	0.00
318	603226	菲林格尔	872	29,892.16	0.00
319	603139	康惠制药	910	27,181.70	0.00
320	603229	奥翔药业	1,340	26,558.80	0.00
321	603335	迪生力	2,230	24,864.50	0.00
322	002879	长缆科技	1,313	23,660.26	0.00
323	002881	美格智能	989	22,608.54	0.00
324	603679	华体科技	809	21,438.50	0.00
325	603938	三孚股份	1,246	20,932.80	0.00
326	002882	金龙羽	2,966	18,389.20	0.00
327	603933	睿能科技	857	17,311.40	0.00
328	603305	旭升股份	1,351	15,212.26	0.00
329	300669	沪宁股份	841	14,650.22	0.00
330	300670	大烨智能	1,259	13,760.87	0.00
331	603286	日盈电子	890	13,528.00	0.00
332	300672	国科微	1,257	10,659.36	0.00
333	603331	百达精工	999	9,620.37	0.00
334	300671	富满电子	942	7,639.62	0.00
335	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	600651	飞乐音响	17,479,466.52	1.13
2	002174	游族网络	14,618,032.37	0.94
3	000725	京东方 A	14,443,661.00	0.93
4	300450	先导智能	11,705,471.48	0.76
5	002236	大华股份	11,254,765.88	0.73
6	002460	赣锋锂业	9,419,944.00	0.61
7	002831	裕同科技	9,167,613.08	0.59
8	000915	山大华特	7,974,119.09	0.51
9	002479	富春环保	7,744,880.19	0.50
10	002466	天齐锂业	7,600,623.22	0.49
11	603929	亚翔集成	7,574,676.44	0.49
12	000603	盛达矿业	7,282,778.00	0.47
13	600702	沱牌舍得	7,004,373.00	0.45
14	300232	洲明科技	5,644,391.14	0.36
15	600036	招商银行	5,512,647.39	0.36
16	600309	万华化学	4,627,359.00	0.30
17	600782	新钢股份	4,512,360.00	0.29
18	600114	东睦股份	4,276,620.88	0.28
19	603898	好莱客	4,176,051.00	0.27
20	000921	海信科龙	4,112,606.08	0.27

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	600110	诺德股份	29,737,893.13	1.92
2	300097	智云股份	18,092,605.91	1.17
3	000921	海信科龙	16,362,372.55	1.06
4	000558	莱茵体育	14,689,008.00	0.95
5	002494	华斯股份	14,026,577.49	0.90
6	002120	韵达股份	11,214,515.68	0.72
7	300420	五洋科技	9,779,644.26	0.63
8	300017	网宿科技	9,655,860.91	0.62

9	600436	片仔癀	8,911,524.29	0.57
10	000839	中信国安	8,780,648.49	0.57
11	000925	众合科技	7,820,654.98	0.50
12	601333	广深铁路	7,332,869.16	0.47
13	002522	浙江众成	7,176,598.96	0.46
14	600687	刚泰控股	6,708,129.98	0.43
15	002503	搜于特	6,660,744.90	0.43
16	300323	华灿光电	6,313,589.92	0.41
17	000863	三湘印象	6,273,626.52	0.40
18	600240	华业资本	6,176,943.17	0.40
19	603766	隆鑫通用	6,069,353.26	0.39
20	600303	曙光股份	5,727,979.65	0.37

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	272,553,518.83
卖出股票的收入（成交）总额	384,803,126.51

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	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	1,332,826.00	0.10
8	同业存单	-	-

9	其他	-	-
10	合计	1,332,826.00	0.10

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	128015	久其转债	5,906	672,161.86	0.05
2	110032	三一转债	4,460	529,848.00	0.04
3	128011	汽模转债	1,014	130,816.14	0.01

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

无。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，有选择地投资于流动性好、交易活跃的股指期货合约。

本基金在进行股指期货投资时，首先将基于对证券市场总体行情的判断和组合风险收益的分析确定投资时机以及套期保值的类型（多头套期保值或空头套期保值），并根据风险资产投资（或拟投资）的总体规模和风险系数决定股指期货的投资比例；其次，本基金将在综合考虑证券市场和期货市场运行趋势以及股指期货流动性、收益性、风险特征和估值水平的基础上进行投资品种选择，以对冲风险资产组合的系统性风险和流动性风险。

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。

7.11.3 本期国债期货投资评价

无。

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	108,128.77
2	应收证券清算款	1,630,098.08
3	应收股利	-
4	应收利息	14,798.84
5	应收申购款	11,477.11
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,764,502.80

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	128011	汽模转债	130,816.14	0.01
2	110032	三一转债	529,848.00	0.04

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	000662	天夏智慧	16,236,130.00	1.16	筹划重大资 产重组

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
33,339	57,345.64	926,992.31	0.05%	1,910,919,134.52	99.95%

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	130,102.95	0.01%

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（2015 年 3 月 17 日）基金份额总额	4,787,382,240.64
--------------------------------	------------------

本报告期期初基金份额总额	2,072,309,603.49
本报告期基金总申购份额	25,880,766.20
减：本报告期基金总赎回份额	186,344,242.86
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,911,846,126.83

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	
光大证券	1	-	-	-	-	-

万联证券	1	-	-	-	-	-
中山证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	3	-	-	-	-	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
财富证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
联讯证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	2	264,672,519.86	41.10%	241,195.79	40.77%	-
海通证券	1	129,327,406.39	20.08%	120,442.43	20.36%	-
西南证券	1	73,393,034.98	11.40%	66,883.13	11.30%	-
广发证券	1	61,622,113.52	9.57%	57,388.19	9.70%	-
国泰君安	1	47,039,436.71	7.30%	42,867.23	7.25%	-
广州证券	2	40,528,787.53	6.29%	37,744.38	6.38%	-
申万宏源	1	14,417,346.23	2.24%	13,138.84	2.22%	-
中金公司	1	5,792,735.42	0.90%	5,394.72	0.91%	-
方正证券	1	5,606,882.50	0.87%	5,109.55	0.86%	-
上海证券	2	1,632,136.00	0.25%	1,487.35	0.25%	-

注：1、券商专用交易单元选择标准：

基金管理人负责选择证券经营机构，选用其交易单元供本基金证券买卖专用，选择标准为：

- (1) 内部管理规范、严谨；具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- (2) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能够针对本基金业务需要，提供高质量的研究报告和较为全面的服务；
- (3) 具有战略规划和定位，能够积极推动多边业务合作，最大限度地调动整体资源，为基金投资赢取机会；
- (4) 其他有利于基金持有人利益的商业合作考虑。

2、券商专用交易单元选择程序：

(1) 对交易单元候选券商的综合服务进行评估

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

(2) 填写《新增交易单元申请审核表》

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

(3) 候选交易单元名单提交分管领导审批

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
光大证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
中山证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
财富证券	-	-	-	-	-	-

申万宏源	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
联讯证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	492,027.00	100.00%	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-

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	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	2017-03-28
10	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
11	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
12	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
13	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
14	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
15	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
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	2017-04-28
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	2017-04-29
18	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
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	2017-05-04
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	2017-05-06

		司网站	
21	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
22	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
23	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
24	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
25	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
26	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“天夏智慧”、“长信科技”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	2017-06-10
27	7 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	2017-06-02
28	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、《华安物联网主题股票型证券投资基金基金合同》
- 2、《华安物联网主题股票型证券投资基金招募说明书》
- 3、《华安物联网主题股票型证券投资基金托管协议》

- 4、中国证监会批准华安物联网主题股票型证券投资基金设立的文件
- 5、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告原件
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 7、基金托管人业务资格批件和营业执照
- 8、华安基金管理有限公司开放式基金业务规则

12.2 存放地点

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

12.3 查阅方式

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

华安基金管理有限公司
二〇一七年八月二十五日