

华安添颐养老混合型发起式证券投资基金
2017 年年度报告摘要
2017 年 12 月 31 日

基金管理人：华安基金管理有限公司

基金托管人：上海银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一八年三月二十七日

§1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本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。

基金托管人上海银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 3 月 22 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|------------------|
| 基金简称 | 华安添颐养老混合 |
| 基金主代码 | 001485 |
| 交易代码 | 001485 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式、发起式 |
| 基金合同生效日 | 2015 年 6 月 16 日 |
| 基金管理人 | 华安基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 上海银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 946,766,357.00 份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|--|
| 投资目标 | 本基金坚持绝对收益投资理念，在严格控制风险的前提下，采取稳健的投资策略，追求资产的长期稳定增值。 |
| 投资策略 | <p>本基金将在基金资产配置比例限制范围内，动态调整基金资产在股票、债券、现金类资产上的配置比例，控制基金资产净值的波动幅度，追求符合养老金投资需求的绝对回报。</p> <p>在具体大类资产配置过程中，本基金将使用定量与定性相结合的研究方法对宏观经济、国家政策、资金面和市场情绪等可能影响证券市场的重要因素进行研究和预测，结合使用公司自主研发的多因子动态资产配置模型、基于投资时钟理论的资产配置模型等经济模型，分析和比较股票、债券等市场和不同金融工具的风险收益特征，确定合适的资产配置比例，动态优化投资组合。</p> |
| 业绩比较基准 | 中国人民银行公布的一年期定期存款利率（税后）+2% |
| 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 | 上海银行股份有限公司 |
| 信息披露 负责人 | 姓名 | 钱鲲 | 叶忆红 |
| | 联系电话 | 021-38969999 | 021-68475888 |
| | 电子邮箱 | qiankun@huaan.com.cn | zctgb@bankofshanghai.com |
| 客户服务电话 | | 4008850099 | 95594 |
| 传真 | | 021-68863414 | 021-68476936 |

2.4 信息披露方式

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

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 2017 年 | 2016 年 | 2015 年 6 月 16 日 (基金合同生效日) 至 2015 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------------|------------------|---|
| 本期已实现收益 | 9,833,843.85 | 119,136,382.23 | 27,284,432.51 |
| 本期利润 | 23,732,292.28 | 50,016,256.71 | 77,567,322.11 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0165 | 0.0188 | 0.0322 |
| 本期基金份额净值增长率 | 2.60% | 1.57% | 2.20% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2017 年末 | 2016 年末 | 2015 年末 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0651 | 0.0380 | 0.0098 |
| 期末基金资产净值 | 1,008,414,863.13 | 2,540,313,006.42 | 3,082,407,908.65 |
| 期末基金份额净值 | 1.065 | 1.038 | 1.022 |

注：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。

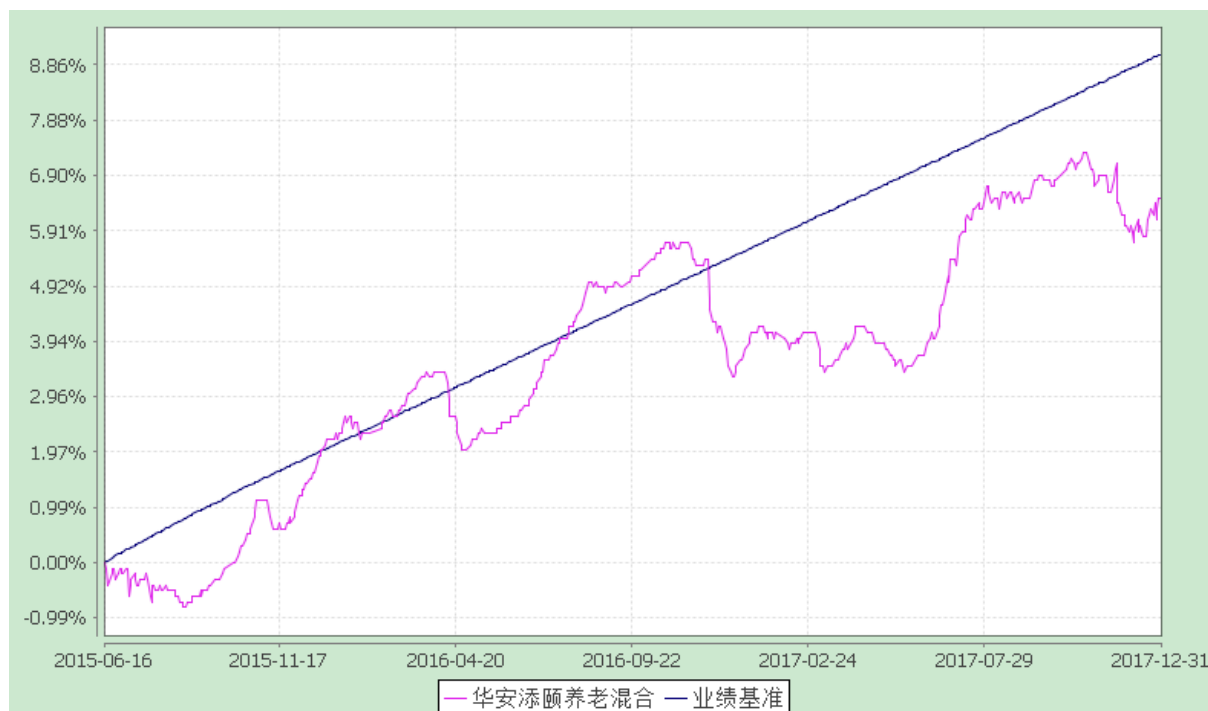
3.2 基金净值表现

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 |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月 | -0.28% | 0.15% | 0.88% | 0.01% | -1.16% | 0.14% |
| 过去六个月 | 1.04% | 0.12% | 1.76% | 0.01% | -0.72% | 0.11% |
| 过去一年 | 2.60% | 0.11% | 3.50% | 0.01% | -0.90% | 0.10% |
| 自基金合同生效起至今 | 6.50% | 0.10% | 9.05% | 0.01% | -2.55% | 0.09% |

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

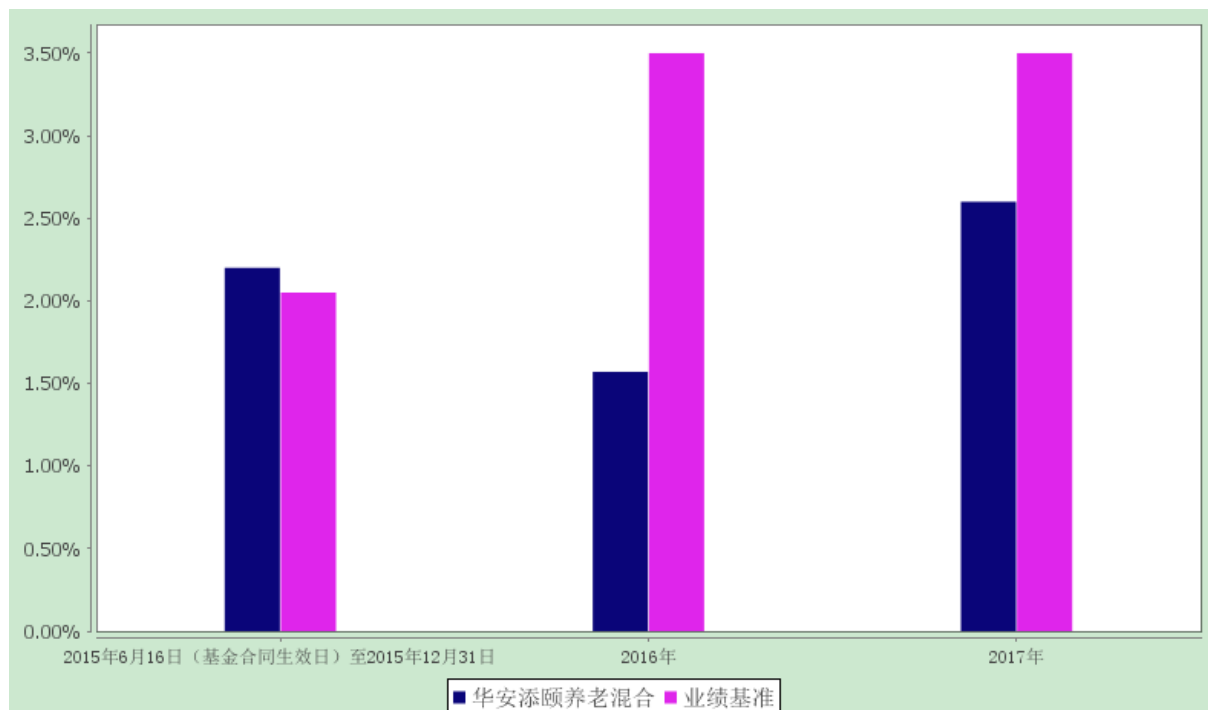
华安添颐养老混合型发起式证券投资基金
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
 (2015年6月16日至2017年12月31日)



3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华安添颐养老混合型发起式证券投资基金

自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



注：合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

无。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

华安基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1998]20 号文批准于 1998 年 6 月设立，是国内首批基金管理公司之一，注册资本 1.5 亿元人民币，公司总部设在上海陆家嘴金融贸易区。目前的股东为国泰君安投资管理股份有限公司、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创新投资有限公司。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 12 月 31 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 98 只开放式基金，管理资产规模达到 1851.32 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 | | |
| 郑可成 | 本基金的基金经理，固定收益部助理总监 | 2015-06-16 | - | 16 年 | <p>硕士研究生，16 年证券基金从业经历。2001 年 7 月至 2004 年 12 月在闽发证券有限责任公司担任研究员，从事债券研究及投资，2005 年 1 月至 2005 年 9 月在福建儒林投资顾问有限公司任研究员，2005 年 10 月至 2009 年 7 月在益民基金管理有限公司任基金经理，2009 年 8 月至今任职于华安基金管理有限公司固定收益部。2010 年 12 月起担任华安稳固收益债券型证券投资基金的基金经理。2012 年 9 月起同时担任华安安心收益债券型证券投资基金的基金经理。2012 年 11 月至 2017 年 7 月同时担任华安日日鑫货币市场基金的基金经理。2012 年 12 月起同时担任华安信用增强债券型证券投资基金的基金经理。2013 年 5 月起同时担任华安保本混合型证券投资基金的基金经理。2014 年 8 月至 2015 年 1 月，同时担任华安七日鑫短期理财债券型证券投资基金的基金经理，2014 年 8 月起，同时担任华安年年红定期开放债券型证券投资基金的基金经理。2015 年 3 月起担任华安新动力灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2015 年 5 月起同时担任华安新机遇保本混合型证券投资基金的基金经理、2015 年 6 月起担任本基金的基金经理。2015 年 11 月起，同时担任华安安益保本混合型证券投资基金的基金经理；2015 年 12 月起，同</p> |

| | | | | | |
|-----|----------|------------|---|-----|---|
| | | | | | 时担任华安乐惠保本混合型证券投资基金的基金经理。2016 年 2 月至 2017 年 7 月，同时担任华安安康保本混合型证券投资基金的基金经理。2016 年 4 月至 2017 年 7 月，同时担任华安安禧保本混合型证券投资基金的基金经理。2016 年 10 月起，同时担任华安安润灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 2 月起，同时担任华安安享灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 3 月起，同时担任华安现金宝货币市场基金的基金经理。 |
| 孙丽娜 | 本基金的基金经理 | 2015-06-16 | - | 7 年 | 硕士研究生，7 年债券、基金行业从业经验。曾任上海国际货币经纪公司债券经纪人。2010 年 8 月加入华安基金管理有限公司，先后担任债券交易员、基金经理助理。2014 年 8 月至 2017 年 7 月，担任华安日日鑫货币市场基金及华安汇财通货币市场基金的基金经理，2014 年 8 月至 2015 年 1 月，同时担任华安七日鑫短期理财债券型证券投资基金的基金经理。2014 年 10 月起同时担任华安现金富利投资基金的基金经理。2015 年 2 月起担任华安年年盈定期开放债券型证券投资基金的基金经理。2015 年 6 月起同时担任本基金的基金经理。2016 年 10 月起，同时担任华安安润灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016 年 12 月起，同时担任华安新丰利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 3 月起，同时担任华安现金宝货币市场基金的基金经理。 |

注：此处的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日，即以公告日为准。证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了《华安基金管理有限公司公平交易管理制度》，将封闭式基金、开放式基金、特定客户资产管理组合及其他投资组合资产在研究分析、投资决策、交易执行等方面全部纳入公平交易管理中。控制措施包括：在研究环节，研究员在为公司管理的各类投资组合提供研究信息、投资建议过程中，使用晨会发言、邮件发送、登录在研究报告管理系统中等方式来确保各类投资组合经理可以公平享有信息获取机会。在投资环节，公司各投资组合经理根据投资组合的风格和投资策略，制定并严格执行交易决策规则，以保证各投资组合交易决策的客观性和独立性。同时严格执行投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体授权机制，投资组合经理在授权范围内自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易环节，公司实行强制公平交易机制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。（1）交易所二级市场业务，遵循价格优先、时间优先、比例分配、综合平衡的控制原则，实现同一时间下达指令的投资组合在交易时机上的公平性。（2）交易所一级市场业务，投资组合经理按意愿独立进行业务申报，集中交易部以投资组合名义对外进行申报。若该业务以公司名义进行申报与中签，则按实际中签情况以价格优先、比例分配原则进行分配。若中签量过小无法合理进行比例分配，且以公司名义获得，则投资部门在合规监察员监督参与下，进行公平协商分配。（3）银行间市场业务遵循指令时间优先原则，先到先询价的控制原则。通过内部共同的 iwind 群，发布询价需求和结果，做到信息公开。若是多个投资组合进行一级市场投标，则各投资组合经理须以各投资组合名义向集中交易部下达投资意向，交易员以此进行投标，以确保中签结果与投资组合投标意向一一对应。若中签量过小无法合理进行比例分配，且以公司名义获得，则投资部门在风险管理部投资监督参与下，进行公平协商分配。交易监控、分析与评估环节，公司风险管理部对公司旗下的各投资组合投资境内证券市场上市交易的投资品种、进行场外的非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购、不同投资组合合同日和临近交易日的反向交易以及可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控，根据市场公认的第三方信息（如：中债登的债券估值），定期对各投资组合与交易对手之间议价交易的交易价格公允性进行审查，对不同投资组合临近交易

日的同向交易的交易时机和交易价差进行分析。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

本报告期内，因组合流动性管理或投资策略调整需要，除指数基金以外的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的次数为 1 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

回顾 2017 年，海外主要经济体温和复苏持续，美欧日从低增长、低通胀向增长回升、通胀略有回升发展。全球货币正常化持续推进，美联储三次加息，10 月启动缩表；欧日央行缩表计划逐步临近议事日程。2017 年，国内宏观经济表现稳中向好，在供给侧改革推动下，工业品价格上涨超预期、企业利润回升，通胀预期有所升温。国民消费较为稳定，且占 GDP 的贡献项不断上升。货币政策逐步趋紧推动金融去杠杆，央行上调公开市场操作利率三次，资金利率大幅提高，流动性紧平衡。三行一会多项监管政策落地，重塑金融业态，商业银行同业负债和同业资产双双回落。债券市场在货币政策趋紧、监管趋严叠加经济改善的影响下，收益率大幅走升，十年国债去年走升 90 个基点。中美利差大幅走阔，外储逐步回升，人民币大幅升值。企业融资需求较旺盛，融资阶段性转向贷款，债券市场净融资额较 2016 年下降 33%，信用债净融资额更是显著回落 92%，信用利差明显走阔。

本基金结合市场特征，灵活调整债券仓位和债券久期。权益方面，组合以低估值蓝筹股为主，着眼 EPS 增长的持续性，分散化投资提升股票仓位，并且积极参与新股申购。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2017 年 12 月 31 日, 本基金份额净值为 1.065 元, 本报告期份额净值增长率为 2.60%, 同期业绩比较基准增长率为 3.50%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2018, 减税落地后美国经济预期向好, 联储加息步伐或将有所加快。日本和欧洲央行将加入回归货币正常化的道路, 外围流动性收紧将成为必然。国内宏观经济平稳, 房地产投资和政府基建投资虽面临下行压力, 但制造业升级和消费升级点燃中国经济新动能。2018 预计 PPI 和 CPI 剪刀差继续收窄, 通胀预期升温, 但总体仍处于良性区间。宏观审慎下, 严监管氛围不改, 金融去杠杆步入下半场, 大资管行业将继续面临负债和资产收缩的局面。货币政策维持中性姿态, 货币政策工具进一步丰富, 精准调控流动性, 资金面将保持紧平衡。债市收益率预期逐步筑顶, 收益率曲线有所走陡但依然偏平坦化。融资环境趋紧、严监管挤泡沫的大环境下, 信用风险仍需高度警惕, 尤其是对于信用资质较差的民企、财政压力明显的地方债以及同业业务激进扩张、脱实向虚的商业银行。转债市场我们仍将关注一级申购机会, 存量券精挑细选, 关注低吸机会。股票市场关注业绩确定性高、符合政策和产业升级方向的个股。

本基金将灵活调整权益仓位, 继续积极参与沪深两市新股申购。债券以获得确定性高票息收益为主要方向, 严格控制个券筛选。

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

本基金为发起式证券投资基金，报告期内不存在基金资产净值低于 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，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、《华安添颐养老混合型发起式证券投资基金基金合同》和《华安添颐养老混合型发起式证券投资基金托管协议》的有关约定，诚实、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

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

本报告期，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，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，认为复核内容真实、准确、完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§6 审计报告

本报告期的基金财务会计报告经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)审计，注册会计师 蒋燕华 蔡玉芝签字出具了安永华明(2018)审字第 60971571_B30 号标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：华安添颐养老混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资产 | 本期末 2017 年 12 月 31 日 | 上年度末 2016 年 12 月 31 日 |
|-----------------|-------------------------|--------------------------|
| 资产： | - | - |
| 银行存款 | 5,510,286.52 | 211,167,389.50 |
| 结算备付金 | 780,595.77 | 4,216,553.56 |
| 存出保证金 | 280,694.15 | 45,875.84 |
| 交易性金融资产 | 981,337,274.69 | 1,620,129,337.83 |
| 其中：股票投资 | 255,510,716.69 | 73,979,486.83 |
| 基金投资 | - | - |
| 债券投资 | 725,826,558.00 | 1,546,149,851.00 |
| 资产支持证券投资 | - | - |
| 贵金属投资 | - | - |
| 衍生金融资产 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 10,000,135.00 | 679,961,479.94 |
| 应收证券清算款 | - | 10,572.72 |
| 应收利息 | 11,654,298.60 | 26,896,133.88 |
| 应收股利 | - | - |
| 应收申购款 | - | - |
| 递延所得税资产 | - | - |
| 其他资产 | - | - |
| 资产总计 | 1,009,563,284.73 | 2,542,427,343.27 |
| | 本期末 | 上年度末 |
| 负债和所有者权益 | 2017 年 12 月 31 日 | 2016 年 12 月 31 日 |
| 负债： | - | - |

| | | |
|-------------------|-------------------------|-------------------------|
| 短期借款 | - | - |
| 交易性金融负债 | - | - |
| 衍生金融负债 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | - | - |
| 应付证券清算款 | - | - |
| 应付赎回款 | - | 14.91 |
| 应付管理人报酬 | 511,636.80 | 1,296,279.78 |
| 应付托管费 | 127,909.17 | 324,069.96 |
| 应付销售服务费 | - | - |
| 应付交易费用 | 128,875.63 | 93,972.20 |
| 应交税费 | - | - |
| 应付利息 | - | - |
| 应付利润 | - | - |
| 递延所得税负债 | - | - |
| 其他负债 | 380,000.00 | 400,000.00 |
| 负债合计 | 1,148,421.60 | 2,114,336.85 |
| 所有者权益： | - | - |
| 实收基金 | 946,766,357.00 | 2,447,370,083.94 |
| 未分配利润 | 61,648,506.13 | 92,942,922.48 |
| 所有者权益合计 | 1,008,414,863.13 | 2,540,313,006.42 |
| 负债和所有者权益总计 | 1,009,563,284.73 | 2,542,427,343.27 |

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.065 元，基金份额总额 946,766,357.00 份。

7.2 利润表

会计主体：华安添颐养老混合型发起式证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017 年 1 月 1 日至 | 上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 |
|----|-----------------------|----------------------------|
| | | |

| | 2017 年 12 月 31 日 | 2016 年 12 月 31 日 |
|--------------------------|----------------------|----------------------|
| 一、收入 | 38,345,185.36 | 74,731,344.36 |
| 1.利息收入 | 62,429,575.06 | 117,101,867.52 |
| 其中：存款利息收入 | 5,396,101.82 | 5,400,909.10 |
| 债券利息收入 | 48,008,092.78 | 105,620,780.63 |
| 资产支持证券利息收入 | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | 9,025,380.46 | 6,080,177.79 |
| 其他利息收入 | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | -37,983,260.11 | 26,749,459.59 |
| 其中：股票投资收益 | 29,884,139.34 | 3,979,069.84 |
| 基金投资收益 | - | - |
| 债券投资收益 | -69,180,390.82 | 22,720,311.45 |
| 资产支持证券投资收益 | - | - |
| 贵金属投资收益 | - | - |
| 衍生工具收益 | - | - |
| 股利收益 | 1,312,991.37 | 50,078.30 |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 13,898,448.43 | -69,120,125.52 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | - | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 421.98 | 142.77 |
| 减：二、费用 | 14,612,893.08 | 24,715,087.65 |
| 1. 管理人报酬 | 9,207,873.63 | 16,548,700.26 |
| 2. 托管费 | 2,301,968.37 | 4,137,175.10 |
| 3. 销售服务费 | - | - |
| 4. 交易费用 | 928,953.53 | 280,485.71 |
| 5. 利息支出 | 1,732,145.82 | 3,287,445.41 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | 1,732,145.82 | 3,287,445.41 |
| 6. 其他费用 | 441,951.73 | 461,281.17 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填 | 23,732,292.28 | 50,016,256.71 |

| | | |
|--------------------------|----------------------|----------------------|
| 列) | | |
| 减：所得税费用 | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | 23,732,292.28 | 50,016,256.71 |

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安添颐养老混合型发起式证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日 | | |
|--|---|----------------|-------------------|
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益 (基金净值) | 2,447,370,083.94 | 92,942,922.48 | 2,540,313,006.42 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 23,732,292.28 | 23,732,292.28 |
| 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) | -1,500,603,726.94 | -55,026,708.63 | -1,555,630,435.57 |
| 其中：1.基金申购款 | 166,203.69 | 7,151.32 | 173,355.01 |
| 2.基金赎回款 | -1,500,769,930.63 | -55,033,859.95 | -1,555,803,790.58 |
| 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) | 946,766,357.00 | 61,648,506.13 | 1,008,414,863.13 |
| 项目 | 上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日 | | |

| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
|--|-------------------|----------------|-------------------|
| 一、期初所有者权益 (基金净值) | 3,014,814,451.49 | 67,593,457.16 | 3,082,407,908.65 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 50,016,256.71 | 50,016,256.71 |
| 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) | -567,444,367.55 | -24,666,791.39 | -592,111,158.94 |
| 其中：1.基金申购款 | 2,436,908,625.77 | 63,360,230.83 | 2,500,268,856.60 |
| 2.基金赎回款 | -3,004,352,993.32 | -88,027,022.22 | -3,092,380,015.54 |
| 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) | 2,447,370,083.94 | 92,942,922.48 | 2,540,313,006.42 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码(序号)从 7.1 至 7.4, 财务报表由下列负责人签署:

基金管理人负责人: 朱学华, 主管会计工作负责人: 赵敏, 会计机构负责人: 陈林

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

华安添颐养老混合型发起式证券投资基金(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]1140 号《关于准予华安添颐养老混合型发起式证券投资基金注册的批复》的核准, 由基金管理人华安基金管理有限公司向社会公开募集, 基金合同于 2015 年 6 月 16 日生效, 首次设立募集规模为 258,004,000.00 份基金份额。本基金为契约型开放式, 存续期限不定。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, 基金托管人为上海银行股份有限公司。

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

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

基金的投资组合比例为：股票占基金资产的比例为 0-30%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

本基金业绩比较基准：中国人民银行公布的一年期定期存款利率（税后）+2%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《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（以下统称“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并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 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 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 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。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

根据中国证券投资基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）>的通知》（以下简称“估值业务指引”），自2017年10月20日起，本基金持有的流通受限股票参考估值业务指引进行估值。该会计估计变更对本基金本期末的基金资产净值及本期损益均无影响。

7.4.5.3 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。

7.4.6 税项

7.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年4月24日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的3‰调整为1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年9月19日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

7.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自2016年5月1日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

7.4.6.3 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的

通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

7.4.6.4 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

7.4.7 关联方关系

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|----------------------|---------------------|
| 华安基金管理有限公司(“华安基金公司”) | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |
| 上海银行股份有限公司(“上海银行”) | 基金托管人 |
| 上海国际信托有限公司 | 基金管理人的股东 |
| 国泰君安创新投资有限公司 | 基金管理人的股东 |
| 上海工业投资(集团)有限公司 | 基金管理人的股东 |
| 上海锦江国际投资管理有限公司 | 基金管理人的股东 |
| 国泰君安投资管理股份有限公司 | 基金管理人的股东 |

| | |
|------------------|-------------|
| 华安资产管理（香港）有限公司 | 基金管理人的全资子公司 |
| 华安未来资产管理（上海）有限公司 | 基金管理人的全资子公司 |

注：1. 下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

2. 经华安基金管理有限公司股东会第四十一次会议审议通过，并经中国证券监督管理委员会证监许可【2017】1809 号文核准，华安基金管理有限公司的原股东上海电气（集团）总公司已变更为国泰君安创新投资有限公司。华安基金管理有限公司已于 2017 年 10 月 17 日就上述股东变更事项进行公告。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.8.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.8.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2017年1月1日至2017年 12月31日 | 上年度可比期间 2016年1月1日至2016年 12月31日 |
|----------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 9,207,873.63 | 16,548,700.26 |

| | | |
|-----------------|------|---|
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 0.00 | - |
|-----------------|------|---|

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.60%的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.60\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。

7.4.8.2 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 12月31日 | 2016年1月1日至2016年 12月31日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 2,301,968.37 | 4,137,175.10 |

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.15%的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.15\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

| 本期 | | | | | | |
|------------------------|----------------|------|-------|------|---------------|----------|
| 2017年1月1日至2017年12月31日 | | | | | | |
| 银行间市场 交易的各关 联方名称 | 债券交易金额 | | 基金逆回购 | | 基金正回购 | |
| | 基金买入 | 基金卖出 | 交易金额 | 利息收入 | 交易金额 | 利息支出 |
| 上海银行 | 109,813,889.04 | - | - | - | 99,000,000.00 | 7,865.75 |

| 上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日 | | | | | | |
|----------------------------------|--------|------|-------|------|-------|------|
| 银行间市场 交易的各关 联方名称 | 债券交易金额 | | 基金逆回购 | | 基金正回购 | |
| | 基金买入 | 基金卖出 | 交易金额 | 利息收入 | 交易金额 | 利息支出 |
| 上海银行 | - | - | - | - | - | - |

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|-----------------------|---------------------------|---------------------------|
| | 2017年1月1日至2017年12月 31日 | 2016年1月1日至2016年12月 31日 |
| 期初持有的基金份额 | 10,000,000.00 | 10,000,000.00 |
| 期间申购/买入总份额 | - | - |
| 期间因拆分变动份额 | - | - |
| 减：期间赎回/卖出总份额 | - | - |
| 期末持有的基金份额 | 10,000,000.00 | 10,000,000.00 |
| 期末持有的基金份额占基金总 份额比例 | 1.06% | 0.41% |

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 | | 上年度可比期间 | |
|-------|-----------------------|------------|-----------------------|--------------|
| | 2017年1月1日至2017年12月31日 | | 2016年1月1日至2016年12月31日 | |
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 上海银行 | 5,510,286.52 | 352,524.77 | 11,167,389.50 | 1,163,266.99 |

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.9 期末（2017 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

| 7.4.9.1.1 受限证券类别：股票 | | | | | | | | | | |
|---------------------|------|------------|------------|--------|--------|--------|----------|------------|------------|----|
| 证券代码 | 证券名称 | 成功认购日 | 可流通日 | 流通受限类型 | 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 |
| 002923 | 润都股份 | 2017-12-28 | 2018-01-05 | 认购新发证券 | 17.01 | 17.01 | 954.00 | 16,227.54 | 16,227.54 | - |
| 300664 | 鹏鹞环保 | 2017-12-28 | 2018-01-05 | 认购新发证券 | 8.88 | 8.88 | 3,640.00 | 32,323.20 | 32,323.20 | - |
| 603080 | 新疆火炬 | 2017-12-25 | 2018-01-03 | 认购新发证券 | 13.60 | 13.60 | 1,187.00 | 16,143.20 | 16,143.20 | - |
| 603161 | 科华控股 | 2017-12-28 | 2018-01-05 | 认购新发证券 | 16.75 | 16.75 | 1,239.00 | 20,753.25 | 20,753.25 | - |
| 7.4.9.1.2 受限证券类别：债券 | | | | | | | | | | |
| 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 |
| 128024 | 宁行转债 | 2017-12-05 | 2018-01-12 | 认购新发证券 | 100.00 | 100.00 | 4,696.00 | 469,600.00 | 469,600.00 | - |

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

| 股票代码 | 股票名称 | 停牌日期 | 停牌原因 | 期末估值单价 | 复牌日期 | 复牌开盘单价 | 数量(单位：股) | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
|------|------|------|------|--------|------|--------|----------|--------|--------|----|
| | | | | | | | | | | |

| | | | | | | | | | | |
|--------|-------|------------|----------|-------|------------|-------|------------|--------------|--------------|---|
| 000022 | 深赤湾 A | 2017-11-20 | 重大资产重组 | 24.14 | - | - | 176,400.00 | 4,301,002.50 | 4,258,296.00 | - |
| 002919 | 名臣健康 | 2017-12-28 | 股票交易异常波动 | 35.26 | 2018-01-02 | 38.79 | 821.00 | 10,311.76 | 28,948.46 | - |
| 300730 | 科创信息 | 2017-12-25 | 股票交易异常波动 | 41.55 | 2018-01-02 | 45.71 | 821.00 | 6,863.56 | 34,112.55 | - |
| 600903 | 贵州燃气 | 2017-12-28 | 股票交易异常波动 | 16.86 | 2018-01-02 | 16.01 | 3,928.00 | 8,680.88 | 66,226.08 | - |

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 12 月 31 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 12 月 31 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1 公允价值

7.4.14.1.1 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括贷款和应收款项以及其他金融负债，其因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

7.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

7.4.14.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于 2017 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币 251,037,686.41 元，属于第二层次的余额为人民币 730,299,588.28 元，无属于第三层次余额。

于 2016 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币 74,692,936.17 元，属于第二层次的余额为人民币 1,545,436,401.66 元，

无属于第三层次余额。

7.4.14.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关股票和可转换债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。

7.4.14.1.2.3 第三层次公允价值余额和本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具第三层次公允价值本期未发生变动。

7.4.14.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

7.4.14.3 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

7.4.14.4 财务报表的批准

本财务报表已于 2018 年 3 月 22 日经本基金的基金管理人批准。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|--------|----------------|---------------|
| 1 | 权益投资 | 255,510,716.69 | 25.31 |
| | 其中：股票 | 255,510,716.69 | 25.31 |
| 2 | 固定收益投资 | 725,826,558.00 | 71.90 |

| | | | |
|---|-------------------|------------------|--------|
| | 其中：债券 | 725,826,558.00 | 71.90 |
| | 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 | 10,000,135.00 | 0.99 |
| | 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 | 6,290,882.29 | 0.62 |
| 7 | 其他各项资产 | 11,934,992.75 | 1.18 |
| 8 | 合计 | 1,009,563,284.73 | 100.00 |

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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 | - | - |
| B | 采矿业 | 8,641,847.00 | 0.86 |
| C | 制造业 | 87,532,028.06 | 8.68 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 21,044,585.13 | 2.09 |
| E | 建筑业 | 6,974,151.50 | 0.69 |
| F | 批发和零售业 | 8,162,150.44 | 0.81 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 38,902,156.94 | 3.86 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 84,751.47 | 0.01 |
| J | 金融业 | 65,573,540.00 | 6.50 |
| K | 房地产业 | 13,801,409.81 | 1.37 |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | 31,668.04 | 0.00 |

| | | | |
|---|---------------|----------------|-------|
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 4,599,880.20 | 0.46 |
| 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 | 162,548.10 | 0.02 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 255,510,716.69 | 25.34 |

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量(股) | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|-------|-----------|--------------|--------------|
| 1 | 000671 | 阳光城 | 638,063 | 5,021,555.81 | 0.50 |
| 2 | 601333 | 广深铁路 | 871,800 | 4,855,926.00 | 0.48 |
| 3 | 000729 | 燕京啤酒 | 707,300 | 4,767,202.00 | 0.47 |
| 4 | 601939 | 建设银行 | 609,600 | 4,681,728.00 | 0.46 |
| 5 | 002311 | 海大集团 | 199,400 | 4,665,960.00 | 0.46 |
| 6 | 000656 | 金科股份 | 937,400 | 4,640,130.00 | 0.46 |
| 7 | 000888 | 峨眉山 A | 424,100 | 4,567,557.00 | 0.45 |
| 8 | 601288 | 农业银行 | 1,180,300 | 4,520,549.00 | 0.45 |
| 9 | 600028 | 中国石化 | 716,900 | 4,394,597.00 | 0.44 |
| 10 | 601006 | 大秦铁路 | 483,700 | 4,387,159.00 | 0.44 |

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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 | 002508 | 老板电器 | 13,551,365.08 | 0.53 |
| 2 | 300146 | 汤臣倍健 | 13,476,038.53 | 0.53 |
| 3 | 000651 | 格力电器 | 13,280,487.03 | 0.52 |
| 4 | 601668 | 中国建筑 | 11,257,213.00 | 0.44 |
| 5 | 002024 | 苏宁易购 | 10,322,646.00 | 0.41 |
| 6 | 601186 | 中国铁建 | 10,085,869.00 | 0.40 |

| | | | | |
|----|--------|-------|--------------|------|
| 7 | 002236 | 大华股份 | 9,942,691.00 | 0.39 |
| 8 | 000630 | 铜陵有色 | 9,720,000.00 | 0.38 |
| 9 | 600547 | 山东黄金 | 8,962,826.00 | 0.35 |
| 10 | 601800 | 中国交建 | 8,649,494.00 | 0.34 |
| 11 | 002241 | 歌尔股份 | 7,664,011.27 | 0.30 |
| 12 | 000970 | 中科三环 | 7,370,956.98 | 0.29 |
| 13 | 000333 | 美的集团 | 7,083,260.00 | 0.28 |
| 14 | 002008 | 大族激光 | 6,699,714.00 | 0.26 |
| 15 | 002051 | 中工国际 | 6,581,235.60 | 0.26 |
| 16 | 000800 | 一汽轿车 | 6,024,593.00 | 0.24 |
| 17 | 600718 | 东软集团 | 5,794,527.89 | 0.23 |
| 18 | 000768 | 中航飞机 | 4,695,243.88 | 0.18 |
| 19 | 000888 | 峨眉山 A | 4,625,335.00 | 0.18 |
| 20 | 000429 | 粤高速 A | 4,595,393.28 | 0.18 |

8.4.2 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 | 601006 | 大秦铁路 | 28,122,158.00 | 1.11 |
| 2 | 000858 | 五粮液 | 14,451,124.00 | 0.57 |
| 3 | 002236 | 大华股份 | 13,992,944.00 | 0.55 |
| 4 | 000630 | 铜陵有色 | 12,789,043.33 | 0.50 |
| 5 | 002508 | 老板电器 | 10,762,337.00 | 0.42 |
| 6 | 300146 | 汤臣倍健 | 10,535,111.36 | 0.41 |
| 7 | 601668 | 中国建筑 | 9,474,470.00 | 0.37 |
| 8 | 601186 | 中国铁建 | 9,364,110.12 | 0.37 |
| 9 | 000970 | 中科三环 | 9,313,516.00 | 0.37 |
| 10 | 000651 | 格力电器 | 9,264,692.00 | 0.36 |
| 11 | 600010 | 包钢股份 | 9,105,008.40 | 0.36 |
| 12 | 601800 | 中国交建 | 7,802,518.00 | 0.31 |
| 13 | 600547 | 山东黄金 | 7,188,295.00 | 0.28 |
| 14 | 000333 | 美的集团 | 6,885,996.00 | 0.27 |
| 15 | 002008 | 大族激光 | 6,864,271.00 | 0.27 |
| 16 | 002024 | 苏宁易购 | 6,585,924.00 | 0.26 |
| 17 | 000800 | 一汽轿车 | 5,700,000.00 | 0.22 |
| 18 | 002542 | 中化岩土 | 5,683,562.36 | 0.22 |
| 19 | 000825 | 太钢不锈 | 5,185,646.30 | 0.20 |
| 20 | 000768 | 中航飞机 | 4,697,527.50 | 0.18 |

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

| | |
|---------------|----------------|
| 买入股票的成本（成交）总额 | 399,375,557.06 |
| 卖出股票的收入（成交）总额 | 240,778,419.62 |

8.5 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 | 59,880,000.00 | 5.94 |
| | 其中：政策性金融债 | 59,880,000.00 | 5.94 |
| 4 | 企业债券 | 209,082,000.00 | 20.73 |
| 5 | 企业短期融资券 | 30,139,000.00 | 2.99 |
| 6 | 中期票据 | 109,860,000.00 | 10.89 |
| 7 | 可转债（可交换债） | 1,052,558.00 | 0.10 |
| 8 | 同业存单 | 315,813,000.00 | 31.32 |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 725,826,558.00 | 71.98 |

8.6 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 | 111770468 | 17 杭州银行 CD245 | 1,400,000 | 138,194,000.00 | 13.70 |
| 2 | 1580002 | 15 潭万楼债 | 800,000 | 81,896,000.00 | 8.12 |
| 3 | 170204 | 17 国开 04 | 600,000 | 59,880,000.00 | 5.94 |
| 4 | 101453006 | 14 杭城投 | 500,000 | 51,035,000.00 | 5.06 |

| | | | | | |
|---|--------|----------|---------|---------------|------|
| | | MTN001 | | | |
| 5 | 112271 | 15 中粮 01 | 500,000 | 49,360,000.00 | 4.89 |

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.10.2 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.11.2 本期国债期货投资评价

无。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。

8.12.2 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。

8.12.3 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 | 280,694.15 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 11,654,298.60 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 11,934,992.75 |

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 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 | 000022 | 深赤湾 A | 4,258,296.00 | 0.42 | 重大资产重组停牌 |
| 2 | 600903 | 贵州燃气 | 66,226.08 | 0.01 | 股价异常波动 |
| 3 | 300730 | 科创信息 | 34,112.55 | 0.00 | 股价异常波动 |
| 4 | 300664 | 鹏鹞环保 | 32,323.20 | 0.00 | 新股流通受限 |
| 5 | 002919 | 名臣健康 | 28,948.46 | 0.00 | 股价异常波动停牌 |
| 6 | 603161 | 科华控股 | 20,753.25 | 0.00 | 新股流通受限 |
| 7 | 002923 | 润都股份 | 16,227.54 | 0.00 | 新股流通受限 |
| 8 | 603080 | 新疆火炬 | 16,143.20 | 0.00 | 新股流通受限 |

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数(户) | 户均持有的 基金份额 | 持有人结构 | | | |
|----------|---------------|----------------|------------|------------|------------|
| | | 机构投资者 | | 个人投资者 | |
| | | 持有份额 | 占总份 额比例 | 持有份额 | 占总份 额比例 |
| 35 | 27,050,467.34 | 946,645,224.17 | 99.99% | 121,132.83 | 0.01% |

9.2 发起式基金发起资金持有份额情况

| 项目 | 持有份额总 数 | 持有份额占 基金总份额 比例 | 发起份额总 数 | 发起份额占 基金总份额 比例 | 发起份额承 诺持有期限 |
|-------------|---------------|----------------------|---------------|----------------------|----------------|
| 基金管理人固有资金 | 10,000,000.00 | 1.06% | 10,000,000.00 | 1.06% | 三年 |
| 基金管理人高级管理人员 | - | - | - | - | - |
| 基金经理等人员 | - | - | - | - | - |
| 基金管理人股东 | - | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - | - |
| 合计 | 10,000,000.00 | 1.06% | 10,000,000.00 | 1.06% | - |

§10 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|---------------------------|------------------|
| 基金合同生效日(2015年6月16日)基金份额总额 | 258,004,000.00 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 2,447,370,083.94 |
| 本报告期基金总申购份额 | 166,203.69 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 1,500,769,930.63 |

| | |
|--------------|----------------|
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 946,766,357.00 |

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本基金管理人重大人事变动如下：

(1) 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) 2018 年 2 月 13 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》，翁启森先生、姚国平先生、谷媛媛女士新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。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内无基金投资策略的改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘为基金审计的会计师事务所。

报告年度应支付给聘任会计师事务所的报酬为人民币 100,000.00 元。

目前的审计机构已提供审计服务的连续年限：自基金合同生效日起至今。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内无管理人、托管人涉及托管业务的部门及其高级管理人员受证券监管部门稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|------|--------|----------------|--------------|------------|------------|----|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 | |
| 海通证券 | 2 | 636,720,012.14 | 100.00% | 585,441.81 | 100.00% | - |

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。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 | | 回购交易 | | 权证交易 | |
|------|----------------|--------------|------------------|--------------|------|--------------|
| | 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 |
| 海通证券 | 321,213,799.49 | 100.00% | 5,940,800,000.00 | 100.00% | - | - |

12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 | | | | | 报告期末持有基金情况 | |
|---|----------------|------------------------|------------------|------|------------------|----------------|--------|
| | 序号 | 持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额 | 份额占比 |
| 机构 | 1 | 20170101-20171231 | 974,657,894.74 | 0.00 | 500,000,000.00 | 474,657,894.74 | 50.13% |
| | 2 | 20170101-20171231 | 1,461,987,329.43 | 0.00 | 1,000,000,000.00 | 461,987,329.43 | 48.80% |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| 本基金报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过20%的情形。如该单一投资者大额赎回将可能导致基金份额净值波动风险、基金流动性风险等特定风险。 | | | | | | | |

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

华安基金管理有限公司

二〇一八年三月二十七日