

华安沪港深外延增长灵活配置混合型证券投资基金
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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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	华安沪港深外延增长混合
基金主代码	001694
交易代码	001694
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 3 月 9 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	469,498,531.83 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金重点关注企业外延式增长带来的市场投资机会，在严格控制风险的前提下，通过高安全边际的证券精选，力争为投资者带来资产的稳健增值。
投资策略	<p>本基金采取相对灵活的资产配置策略。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。</p> <p>个股选择方面，本基金通过对外延增长相关上市公司的深入分析，挖掘该类型企业的投资价值。</p>
业绩比较基准	50%×中证 800 指数收益率+50%×中国债券总指数收益率。
风险收益特征	<p>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。</p> <p>除此之外，本基金可投资港股通标的股票，还将面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。</p>

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

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 层、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 3 月 9 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日
本期已实现收益	128,129,087.07	50,035,851.87
本期利润	151,114,469.19	32,059,625.62
加权平均基金份额本期利润	0.2587	0.1177
本期基金份额净值增长率	19.76%	25.50%
3.1.2 期末数据和指标	2017 年末	2016 年末
期末可供分配基金份额利润	0.4896	0.2536
期末基金资产净值	705,713,060.19	831,010,339.96
期末基金份额净值	1.503	1.255

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）。

4、本基金于 2016 年 3 月 9 日成立。截止本报告期末，本基金成立不足一年。

5、合同生效日当年的主要会计数据和财务指标按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

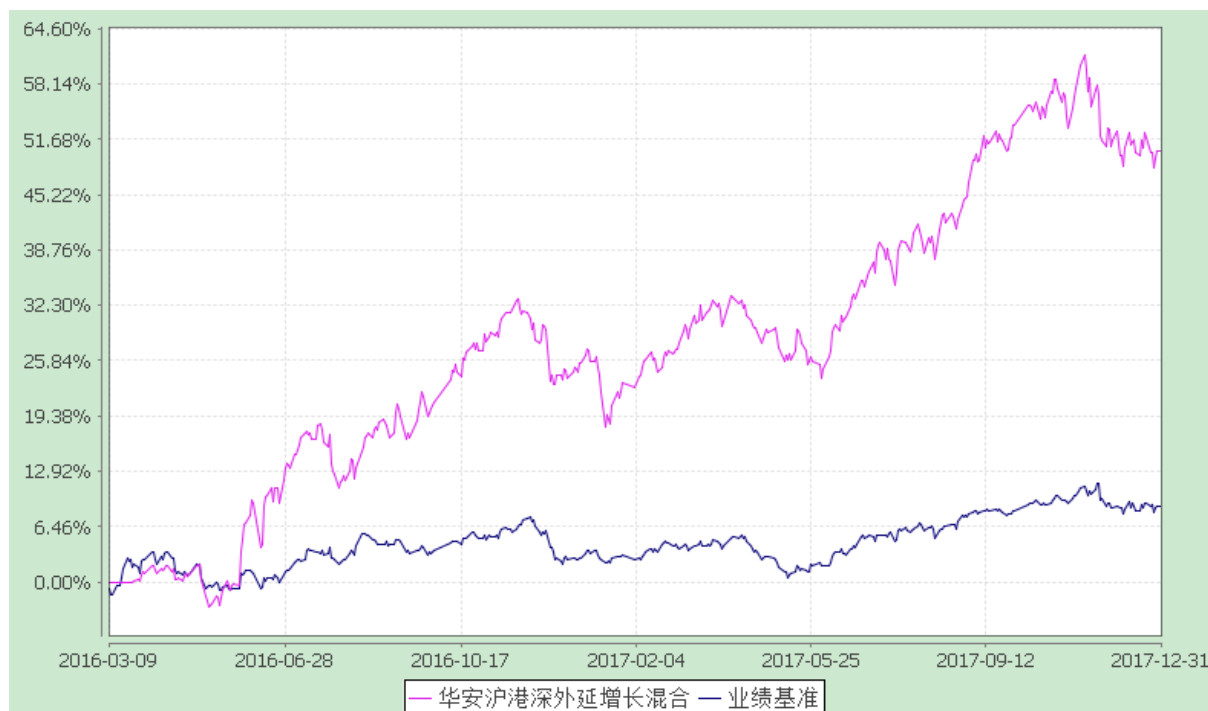
3.2 基金净值表现

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	-2.02%	1.01%	0.35%	0.38%	-2.37%	0.63%
过去六个月	10.27%	0.94%	2.92%	0.34%	7.35%	0.60%
过去一年	19.76%	0.88%	5.45%	0.33%	14.31%	0.55%
自基金成立起至今	50.30%	0.94%	8.86%	0.42%	41.44%	0.52%

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

华安沪港深外延增长灵活配置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的历史走势对比图
 (2016 年 3 月 9 日至 2017 年 12 月 31 日)

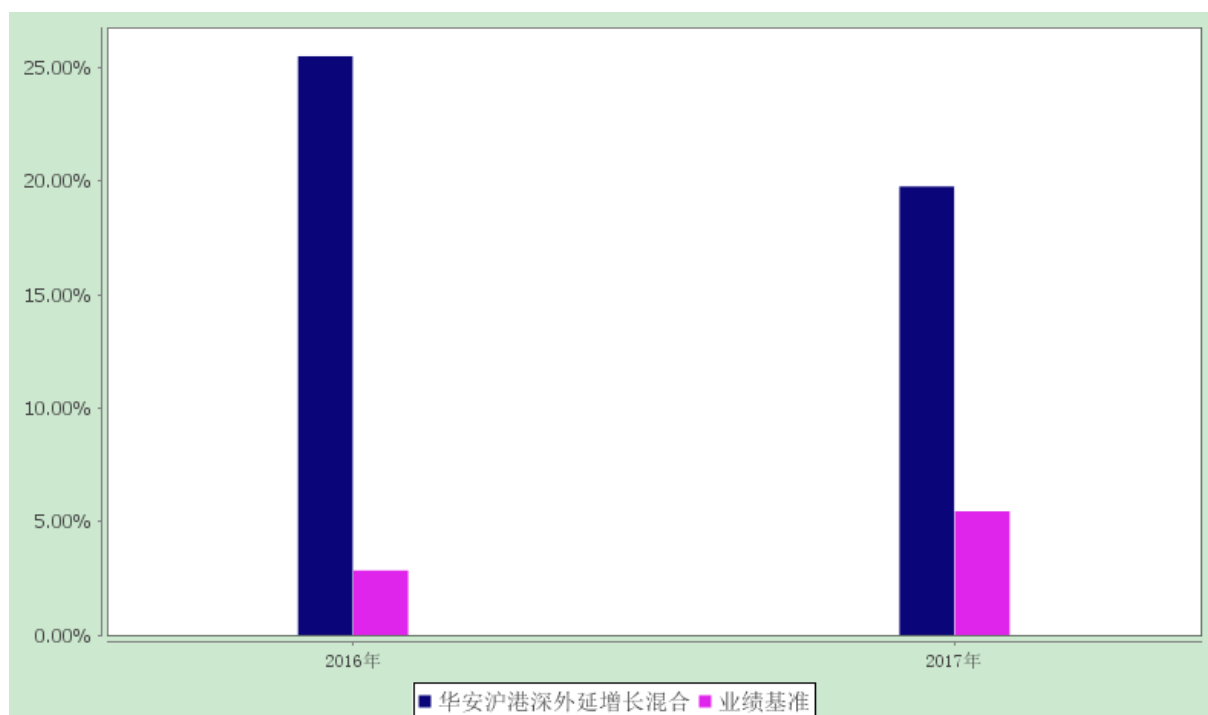


注：本基金于 2016 年 3 月 9 日成立，2016 年 9 月 8 日建仓期截止。建仓期结束日，本基金的各项资产配置比例已符合合同约定。

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

华安沪港深外延增长灵活配置混合型证券投资基金

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

本基金过去三年没有利润分配。

§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		
苏圻涵	本基金的基金经理、全球投资部助理总监	2016-03-09	-	13 年	博士研究生，13 年证券、基金从业经历,持有基金从业执业证书。2004 年 6 月加入华安基金管理有限公司，曾先后于研究发展部、战略策划部工作，担任行业研究员和产品经理职务。目前任职于全球投资部，担任基金经理职务。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。2015 年 6 月至 2016 年 9 月同时担任华安国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金的

					<p>基金经理。2016 年 3 月起同时担任本基金、华安全球美元收益债券型证券投资基金的基金经理。2016 年 6 月起同时担任华安全球美元票息债券型证券投资基金的基金经理。2017 年 2 月起，同时担任华安沪港深通精选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 5 月起，同时担任华安沪港深机会灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 6 月起，同时担任华安文体健康主题灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 8 月起，担任华安大安全主题灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。</p>
杨明	本基金的基金经理、投资研究部高级总监	2016-03-09	-	17 年	<p>中央财经大学硕士研究生，17 年银行、基金从业经历。曾在上海银行从事信贷员、交易员及风险管理。2004 年 10 月加入华安基金管理有限公司，任研究发展部研究员。现任投资研究部总监。2013 年 6 月起担任本基金的基金经理。2014 年 6 月起担任投资研究部高级总监。2015 年 6 月至 2016 年 9 月同时担任华安国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016 年 3 月起同时担任本基金的基金经理。2016 年 5 月起，同时担任华安安禧保本混合型证券投资基金的基金经理。</p>
崔莹	本基金的基金经理	2016-03-09	-	9 年	<p>硕士，9 年从业经历。曾任齐鲁证券有限责任公司项目经理、太平洋保险集团总部资产负债匹配专员、中国中投证券行业分析师。2014 年 3 月加入华安基金管理有限公司，担任投资研究部行业分析师，基金经理助理。2015 年 6 月起担任华安逆向策略混合型证券投资基金的基金经理；2016 年 3 月起，同时担任华安沪港深外延增长灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2015 年 6 月至 2016 年 9 月担任</p>

					<p>华安媒体互联网混合型证券投资基金、华安智能装备主题股票型证券投资基金的基金经理。 2016 年 3 月起担任本基金的基金经理。2017 年 10 月起，同时担任华安幸福生活混合型证券投资基金的基金经理。</p>
--	--	--	--	--	--

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。2018 年 2 月 24 日，基金管理人发布《华安沪港深外延增长灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告》，2018 年 3 月 9 日起，苏圻涵先生、杨明先生不再担任本基金的基金经理。

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。

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

2017 年市场风格分化加剧，市场风险偏好整体持续下降，食品饮料、家用电器和保险等消费类板块表现较好，成长股持续承压。本基金配置上仍然以成长股为主，同时加强了以食品饮料为代表的消费股配置。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止 2017 年 12 月 31 日, 本基金份额净值为 1.503 元, 本报告期份额净值增长率为 19.76%, 同期业绩比较基准增长率为 5.45%。

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 年, 国内经济将呈现温和复苏的态势, 去杠杆持续, 货币政策预计边际仍将收紧, 市场风险偏好预计仍将维持在低位。市场风格上预计白马股仍将维持强势, 但是有业绩的成长股部迎来投资机会。随着投资者结构的变化, 成长股估值除了考虑 PEG 以外, 更需要考虑竞争格局和行业空间, 成长逻辑尽量简单。本基金将坚持消费股和成长股, 特别是符合产业升级与消费升级趋势, 行业配置包括: 1、利率上行收益: 保险股和部分银行股; 2、制造业: 激光, 锂电设备, 面板和半导体设备; 3、消费升级: 必选消费品和电子股; 4、细分领域龙头企业, 特别是具有全球竞争力的细分领域龙头。

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 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_B37 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：华安沪港深外延增长灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末	上年度末
----	-----	------

	2017 年 12 月 31 日	2016 年 12 月 31 日
资产：	-	-
银行存款	134,398,875.24	81,319,291.99
结算备付金	20,683,268.26	7,882,850.26
存出保证金	2,420,667.71	340,533.57
交易性金融资产	558,779,998.84	729,850,543.07
其中：股票投资	556,103,398.84	729,850,543.07
基金投资	-	-
债券投资	2,676,600.00	-
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	-	-
应收证券清算款	39,603,567.96	-
应收利息	31,060.07	20,968.93
应收股利	-	-
应收申购款	975,549.28	36,152,236.91
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	756,892,987.36	855,566,424.73
负债和所有者权益	本期末	上年度末
	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	19,658,249.32	18,880,156.34
应付赎回款	27,610,655.10	1,428,026.69

应付管理人报酬	937,994.91	956,397.14
应付托管费	156,332.51	159,399.53
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	2,404,301.59	2,769,912.02
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	412,393.74	362,193.05
负债合计	51,179,927.17	24,556,084.77
所有者权益：	-	-
实收基金	469,498,531.83	662,011,674.47
未分配利润	236,214,528.36	168,998,665.49
所有者权益合计	705,713,060.19	831,010,339.96
负债和所有者权益总计	756,892,987.36	855,566,424.73

注：(1)报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.503 元，基金份额总额 469,498,531.83 份。

(2)本基金基金合同于 2016 年 3 月 9 日生效。上年度可比期间为 2016 年 3 月 9 日至 2016 年 12 月 31 日。

7.2 利润表

会计主体：华安沪港深外延增长灵活配置混合型证券投资基金

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	上年度可比期间 2016 年 3 月 9 日（基金合 同生效日）至 2016 年 12 月 31 日
一、收入	186,064,899.60	43,706,249.85
1.利息收入	1,202,428.84	521,808.30

其中：存款利息收入	1,201,927.70	521,808.30
债券利息收入	501.14	-
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）	157,020,165.54	58,202,030.95
其中：股票投资收益	151,323,019.96	57,916,312.98
基金投资收益	-	-
债券投资收益	61,646.05	-
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	5,635,499.53	285,717.97
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	22,985,382.12	-17,976,226.25
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	4,856,923.10	2,958,636.85
减：二、费用	34,950,430.41	11,646,624.23
1. 管理人报酬	12,061,887.00	3,825,258.63
2. 托管费	2,010,314.55	637,543.13
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	20,499,999.14	6,810,187.13
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	378,229.72	373,635.34
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	151,114,469.19	32,059,625.62
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	151,114,469.19	32,059,625.62

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安沪港深外延增长灵活配置混合型证券投资基金

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)	662,011,674.47	168,998,665.49	831,010,339.96
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	151,114,469.19	151,114,469.19
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)	-192,513,142.64	-83,898,606.32	-276,411,748.96
其中：1.基金申购款	888,931,028.25	354,750,561.43	1,243,681,589.68
2.基金赎回款	-1,081,444,170.89	-438,649,167.75	-1,520,093,338.64
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)	469,498,531.83	236,214,528.36	705,713,060.19
项目	上年度可比期间		
	2016 年 3 月 9 日(基金合同生效日)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)	344,693,899.20	-	344,693,899.20

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	32,059,625.62	32,059,625.62
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）	317,317,775.27	136,939,039.87	454,256,815.14
其中：1.基金申购款	842,140,510.79	209,936,243.09	1,052,076,753.88
2.基金赎回款	-524,822,735.52	-72,997,203.22	-597,819,938.74
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）	662,011,674.47	168,998,665.49	831,010,339.96

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

华安沪港深外延增长灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)，系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2015]1581 号《关于准予华安沪港深外延增长灵活配置混合型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发行募集，基金合同于 2016 年 3 月 9 日生效，首次设立募集规模为 344,693,899.20 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（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、港股通标的股票、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、中小企业私募债、地方政府债券、中期票据、可转换债券（含分

离交易可转债）、短期融资券、资产支持证券等）、债券回购、银行存款、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。

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

基金的投资组合比例为：股票占基金资产的比例为 0-95%，其中投资于国内依法发行上市的股票比例为基金资产的 0-95%；投资于港股通标的股票比例为基金资产的 0-95%；投资于外延增长主题相关的证券的比例不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

本基金业绩比较基准：50%×中证 800 指数收益率+50%×中国债券总指数收益率。

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。

7.4.6.5 境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127 号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

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
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
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3月9日（基金合同 生效日）至2016年12月 31日
当期发生的基金应支付的管理费	12,061,887.00	3,825,258.63
其中：支付销售机构的客户维护费	5,331,903.84	1,796,160.79

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.50%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{基金管理费率} / \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年 12月31日	上年度可比期间 2016年3月9日（基金合同 生效日）至2016年12月 31日
当期发生的基金应支付的托管费	2,010,314.55	637,543.13

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{基金托管费率} / \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

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

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

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固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2017 年 12 月 31 日		上年度末 2016 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
上海电气集团财务有限责任公司	-	-	14,999,000.00	2.27%

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 2017年1月1日至2017年12月31日		上年度可比期间 2016年3月9日（基金合同生效日） 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
中国建设银行	134,398,875.24	1,065,911.80	81,319,291.99	491,394.90

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	17.01	17.01	954.00	16,227.54	16,227.54	-

				证券						
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
123003	蓝思转债	2017-12-08	2018-01-17	认购新发证券	100.00	100.00	26,766.00	2,676,600.00	2,676,600.00	-

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	复牌开盘价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002919	名臣健康	2017-12-28	重大事项停牌	35.26	2018-01-02	38.79	821.00	10,311.76	28,948.46	-
300730	科创信息	2017-12-25	重大事项停牌	41.55	2018-01-02	45.71	821.00	6,863.56	34,112.55	-

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 555,954,890.64 元，属于第二层次的余额为人民币 2,825,108.20 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 709,908,210.19 元，属于第二层次的余额为人民币 19,942,332.88 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	556,103,398.84	73.47
	其中：股票	556,103,398.84	73.47
2	固定收益投资	2,676,600.00	0.35
	其中：债券	2,676,600.00	0.35
	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	155,082,143.50	20.49
7	其他各项资产	43,030,845.02	5.69
8	合计	756,892,987.36	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	-	-
C	制造业	394,358,475.52	55.88
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,143.20	0.00
E	建筑业	4,250,722.00	0.60
F	批发和零售业	3,436,235.68	0.49
G	交通运输、仓储和邮政业	8,502,342.94	1.20
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	34,112.55	0.00
J	金融业	-	-
K	房地产业	26,814,917.80	3.80
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	41,886.96	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	437,454,836.65	61.99

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
科技	17,556,617.73	2.49
金融	55,316,402.76	7.84
能源	3,590,902.18	0.51
材料	24,872,970.16	3.52

非必需消费	12,308,831.60	1.74
医疗保健	5,002,837.76	0.71
合计	118,648,562.19	16.81

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	300138	晨光生物	3,236,095	41,033,684.60	5.81
2	300433	蓝思科技	1,248,834	37,277,694.90	5.28
3	600183	生益科技	1,984,180	34,246,946.80	4.85
4	300097	智云股份	1,149,733	32,652,417.20	4.63
5	002236	大华股份	1,290,230	29,791,410.70	4.22
6	H00966	中国太平	1,059,200	25,942,099.05	3.68
7	1336	新华保险	551,600	24,622,096.85	3.49
8	300232	洲明科技	1,557,787	22,276,354.10	3.16
9	600641	万业企业	1,656,867	22,202,017.80	3.15
10	600519	贵州茅台	31,800	22,180,182.00	3.14

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	300138	晨光生物	132,369,987.94	15.93
2	300083	劲胜智能	128,979,285.53	15.52
3	002048	宁波华翔	121,626,643.55	14.64
4	002236	大华股份	107,762,329.00	12.97
5	300408	三环集团	82,838,694.42	9.97
6	000498	山东路桥	77,661,708.01	9.35
7	600183	生益科技	77,250,075.05	9.30
8	300450	先导智能	77,220,934.65	9.29
9	002460	赣锋锂业	75,847,628.94	9.13
10	002008	大族激光	71,704,896.72	8.63
11	600114	东睦股份	64,749,987.91	7.79
12	600703	三安光电	62,612,303.07	7.53
13	300433	蓝思科技	61,827,041.19	7.44

14	002126	银轮股份	61,236,014.48	7.37
15	603306	华懋科技	59,992,535.10	7.22
16	002456	欧菲科技	57,925,422.21	6.97
17	002449	国星光电	54,172,308.90	6.52
18	600563	法拉电子	51,109,085.61	6.15
19	000049	德赛电池	50,037,962.77	6.02
20	002340	格林美	49,563,604.38	5.96
21	300097	智云股份	49,182,067.42	5.92
22	300219	鸿利智汇	49,078,874.42	5.91
23	300296	利亚德	48,830,377.60	5.88
24	002635	安洁科技	47,096,533.86	5.67
25	002466	天齐锂业	47,047,394.80	5.66
26	300335	迪森股份	45,611,351.70	5.49
27	000860	顺鑫农业	44,335,235.76	5.34
28	603968	醋化股份	42,560,654.86	5.12
29	601233	桐昆股份	42,110,983.35	5.07
30	300476	胜宏科技	41,404,723.67	4.98
31	600136	当代明诚	38,707,088.27	4.66
32	000739	普洛药业	38,596,263.97	4.64
33	300232	洲明科技	38,455,304.11	4.63
34	002020	京新药业	37,935,907.30	4.57
35	300316	晶盛机电	37,502,621.94	4.51
36	600502	安徽水利	37,300,201.56	4.49
37	002765	蓝黛传动	37,099,248.72	4.46
38	600060	海信电器	35,472,649.54	4.27
39	603929	亚翔集成	34,895,021.00	4.20
40	600507	方大特钢	34,880,084.50	4.20
41	000639	西王食品	34,778,118.21	4.19
42	000786	北新建材	34,520,252.45	4.15
43	000050	深天马 A	34,034,888.45	4.10
44	601888	中国国旅	33,503,442.62	4.03
45	002425	凯撒文化	32,999,788.69	3.97
46	600297	广汇汽车	32,864,220.43	3.95
47	300511	雪榕生物	32,041,676.58	3.86
48	002174	游族网络	31,745,366.53	3.82
49	002139	拓邦股份	31,665,506.48	3.81
50	600197	伊力特	31,301,557.48	3.77
51	002241	歌尔股份	30,404,008.00	3.66
52	002273	水晶光电	30,401,294.97	3.66
53	000970	中科三环	29,425,672.00	3.54
54	300679	电连技术	28,838,571.38	3.47
55	002600	江粉磁材	28,360,919.00	3.41
56	600519	贵州茅台	28,327,348.84	3.41
57	300088	长信科技	28,306,219.45	3.41

58	002074	国轩高科	27,970,458.57	3.37
59	002045	国光电器	27,914,456.26	3.36
60	300418	昆仑万维	27,509,382.63	3.31
61	600977	中国电影	27,049,170.64	3.25
62	603801	志邦股份	26,942,867.91	3.24
63	600270	外运发展	26,634,003.84	3.21
64	002247	帝龙文化	26,363,885.07	3.17
65	002454	松芝股份	25,860,185.00	3.11
66	603996	中新科技	25,856,668.00	3.11
67	601168	西部矿业	25,748,673.00	3.10
68	300207	欣旺达	25,725,539.34	3.10
69	600525	长园集团	25,493,660.48	3.07
70	600201	生物股份	25,271,358.76	3.04
71	600635	大众公用	25,241,026.00	3.04
72	002396	星网锐捷	25,136,838.99	3.02
73	000599	青岛双星	24,810,985.51	2.99
74	603328	依顿电子	24,334,849.60	2.93
75	300237	美晨生态	24,145,031.89	2.91
76	000910	大亚圣象	24,138,338.40	2.90
77	603018	中设集团	23,993,024.57	2.89
78	000980	众泰汽车	23,402,891.92	2.82
79	600172	黄河旋风	23,302,988.20	2.80
80	000926	福星股份	23,294,283.19	2.80
81	300467	迅游科技	23,229,425.00	2.80
82	603337	杰克股份	22,865,867.76	2.75
83	002036	联创电子	22,850,434.72	2.75
84	600352	浙江龙盛	22,342,924.67	2.69
85	600326	西藏天路	22,338,398.98	2.69
86	603010	万盛股份	22,196,813.75	2.67
87	000559	万向钱潮	21,986,945.63	2.65
88	600500	中化国际	21,503,569.33	2.59
89	600641	万业企业	21,172,738.72	2.55
90	002376	新北洋	21,079,495.25	2.54
91	600466	蓝光发展	20,950,829.50	2.52
92	002087	新野纺织	20,905,417.88	2.52
93	300068	南都电源	20,377,013.38	2.45
94	600029	南方航空	20,018,168.00	2.41
95	002245	澳洋顺昌	19,636,057.00	2.36
96	000932	*ST 华菱	19,323,269.00	2.33
97	600195	中牧股份	19,097,242.70	2.30
98	600153	建发股份	19,020,950.41	2.29
99	300303	聚飞光电	18,944,612.52	2.28
100	603639	海利尔	18,833,560.02	2.27
101	600030	中信证券	18,764,274.00	2.26

102	000703	恒逸石化	18,680,372.00	2.25
103	600486	扬农化工	18,340,509.00	2.21
104	300070	碧水源	18,230,223.41	2.19
105	000858	五 粮 液	18,087,855.80	2.18
106	002354	天神娱乐	17,833,182.87	2.15
107	000636	风华高科	17,482,621.00	2.10
108	000779	三毛派神	17,477,319.02	2.10
109	002636	金安国纪	17,366,790.66	2.09
110	600196	复星医药	16,971,863.95	2.04
111	002185	华天科技	16,715,489.10	2.01
112	002056	横店东磁	16,705,410.43	2.01
113	002026	山东威达	16,669,490.00	2.01
114	300182	捷成股份	16,621,792.06	2.00
115	1336	新华保险	73,455,814.48	8.84
116	0966	中国太平	46,629,914.91	5.61
117	2601	中国太保	36,401,595.04	4.38
118	2018	瑞声科技	32,218,557.40	3.88
119	2238	广汽集团	26,858,514.59	3.23

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。

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	002048	宁波华翔	130,189,288.95	15.67
2	300083	劲胜智能	127,527,094.41	15.35
3	300450	先导智能	109,750,368.14	13.21
4	600114	东睦股份	96,234,082.54	11.58
5	300138	晨光生物	94,946,959.71	11.43
6	002460	赣锋锂业	87,569,428.59	10.54
7	300408	三环集团	87,502,702.98	10.53
8	002236	大华股份	85,219,961.94	10.25
9	002008	大族激光	82,937,003.75	9.98
10	000498	山东路桥	79,287,451.11	9.54
11	600502	安徽水利	67,454,845.57	8.12
12	300188	美亚柏科	64,144,840.74	7.72
13	000639	西王食品	64,099,082.19	7.71
14	603968	醋化股份	63,776,237.64	7.67

15	002456	欧菲科技	63,408,706.66	7.63
16	600703	三安光电	63,366,407.75	7.63
17	002126	银轮股份	62,972,738.13	7.58
18	002635	安洁科技	62,657,812.12	7.54
19	002765	蓝黛传动	62,633,338.23	7.54
20	002045	国光电器	57,648,340.33	6.94
21	002466	天齐锂业	56,919,979.27	6.85
22	600563	法拉电子	52,591,314.00	6.33
23	600183	生益科技	52,252,323.79	6.29
24	000049	德赛电池	51,222,220.08	6.16
25	01336	新华保险	50,330,396.50	6.06
26	002519	银河电子	49,698,824.18	5.98
27	300219	鸿利智汇	49,042,256.37	5.90
28	300011	鼎汉技术	49,034,492.11	5.90
29	600240	华业资本	49,004,772.85	5.90
30	300476	胜宏科技	48,733,759.27	5.86
31	300296	利亚德	48,187,369.62	5.80
32	000739	普洛药业	47,309,618.88	5.69
33	002340	格林美	47,002,537.74	5.66
34	603306	华懋科技	45,615,793.73	5.49
35	000860	顺鑫农业	44,878,512.24	5.40
36	300335	迪森股份	43,230,130.51	5.20
37	002068	黑猫股份	42,361,241.40	5.10
38	002020	京新药业	40,133,504.94	4.83
39	300316	晶盛机电	39,526,974.52	4.76
40	603929	亚翔集成	38,782,730.87	4.67
41	600507	方大特钢	38,501,757.08	4.63
42	002564	天沃科技	37,588,622.69	4.52
43	002341	新纶科技	37,378,575.75	4.50
44	600297	广汇汽车	37,197,347.62	4.48
45	601888	中国国旅	36,837,507.03	4.43
46	002139	拓邦股份	36,825,983.83	4.43
47	002449	国星光电	34,854,517.94	4.19
48	300025	华星创业	34,638,695.69	4.17
49	600060	海信电器	34,614,513.88	4.17
50	600136	当代明诚	34,566,251.30	4.16
51	000050	深天马 A	34,271,894.22	4.12
52	002494	华斯股份	32,451,698.34	3.91
53	002425	凯撒文化	32,218,134.34	3.88
54	002273	水晶光电	31,618,107.16	3.80
55	600197	伊力特	31,541,712.13	3.80
56	300088	长信科技	31,449,981.56	3.78
57	300511	雪榕生物	31,321,574.40	3.77
58	300679	电连技术	30,673,479.96	3.69

59	002174	游族网络	30,588,759.03	3.68
60	601233	桐昆股份	30,446,561.00	3.66
61	02601	中国太保	30,437,908.93	3.66
62	002600	江粉磁材	29,968,156.97	3.61
63	000970	中科三环	29,898,108.92	3.60
64	600525	长园集团	29,113,284.60	3.50
65	002087	新野纺织	28,698,338.53	3.45
66	002074	国轩高科	28,651,731.29	3.45
67	600977	中国电影	27,955,009.61	3.36
68	300418	昆仑万维	26,995,906.84	3.25
69	600270	外运发展	26,756,418.60	3.22
70	603801	志邦股份	26,715,111.90	3.21
71	300467	迅游科技	26,174,665.64	3.15
72	002396	星网锐捷	25,667,960.23	3.09
73	002241	歌尔股份	25,458,511.43	3.06
74	600201	生物股份	24,968,257.73	3.00
75	600635	大众公用	24,814,192.84	2.99
76	300207	欣旺达	24,756,908.34	2.98
77	603337	杰克股份	24,606,370.50	2.96
78	601168	西部矿业	24,133,997.57	2.90
79	600172	黄河旋风	23,940,622.02	2.88
80	600889	南京化纤	23,809,359.80	2.87
81	603018	中设集团	23,750,431.57	2.86
82	603010	万盛股份	23,582,503.25	2.84
83	600326	西藏天路	23,537,813.60	2.83
84	000599	青岛双星	23,471,086.99	2.82
85	000559	万向钱潮	23,371,367.42	2.81
86	02238	广汽集团	23,328,075.48	2.81
87	002247	帝龙文化	23,239,107.13	2.80
88	600300	维维股份	23,079,707.61	2.78
89	603328	依顿电子	22,799,938.64	2.74
90	300237	美晨生态	22,476,217.00	2.70
91	600500	中化国际	22,225,534.18	2.67
92	002454	松芝股份	22,182,459.33	2.67
93	000926	福星股份	22,094,468.70	2.66
94	002036	联创电子	22,014,344.31	2.65
95	000980	众泰汽车	21,929,374.48	2.64
96	002376	新北洋	21,920,676.92	2.64
97	300068	南都电源	20,457,742.77	2.46
98	00966	中国太平	20,350,581.25	2.45
99	600196	复星医药	20,348,078.52	2.45
100	600466	蓝光发展	20,278,805.97	2.44
101	600029	南方航空	20,221,496.85	2.43
102	300196	长海股份	20,019,568.00	2.41

103	603996	中新科技	19,888,802.28	2.39
104	002245	澳洋顺昌	19,812,892.02	2.38
105	000932	*ST 华菱	19,718,269.00	2.37
106	300070	碧水源	19,610,375.97	2.36
107	002354	天神娱乐	19,549,643.27	2.35
108	603639	海利尔	19,272,883.86	2.32
109	300303	聚飞光电	18,937,422.16	2.28
110	600030	中信证券	18,601,366.19	2.24
111	600195	中牧股份	18,551,710.16	2.23
112	000703	恒逸石化	18,464,354.58	2.22
113	300299	富春股份	18,388,984.36	2.21
114	300433	蓝思科技	18,351,386.38	2.21
115	002624	完美世界	18,131,428.13	2.18
116	02018	瑞声科技	18,075,463.60	2.18
117	002636	金安国纪	18,019,733.48	2.17
118	600068	葛洲坝	17,600,978.00	2.12
119	600516	方大炭素	17,287,764.07	2.08
120	002172	澳洋科技	17,110,998.55	2.06
121	000065	北方国际	17,109,421.58	2.06
122	600596	新安股份	16,929,080.77	2.04
123	002185	华天科技	16,747,684.30	2.02
124	000636	风华高科	16,660,088.00	2.00

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

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	6,483,777,361.45
卖出股票的收入（成交）总额	6,831,832,907.76

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	-	-

	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）	2,676,600.00	0.38
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,676,600.00	0.38

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	123003	蓝思转债	26,766	2,676,600.00	0.38

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

无。

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 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同，本基金不能投资于国债期货。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.11.3 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	2,420,667.71
2	应收证券清算款	39,603,567.96
3	应收股利	-
4	应收利息	31,060.07
5	应收申购款	975,549.28
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	43,030,845.02

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§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
32,014	14,665.41	60,908,746.57	12.97%	408,589,785.26	87.03%

9.2 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	996,984.79	0.21%

9.3 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。

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2016 年 3 月 9 日)基金份额总额	344,693,899.20
本报告期期初基金份额总额	662,011,674.47
本报告期基金总申购份额	888,931,028.25
减：本报告期基金总赎回份额	1,081,444,170.89
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	469,498,531.83

§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：

2017 年 9 月 1 日，中国建设银行发布公告，聘任纪伟为中国建设银行资产托管业务部总经理。

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 80,000.00 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	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股	佣金	占当期佣	

	数量		票成交总 额的比例		金总量的 比例	
海通证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
中山证券	1	-	-	-	-	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
联讯证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
广州证券	2	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
财富证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	3,734,213,132.37	28.06%	3,396,297.59	28.08%	-
东北证券	1	1,875,882,797.94	14.10%	1,747,010.50	14.44%	-
光大证券	1	1,596,005,842.47	11.99%	1,454,443.83	12.02%	-
中信证券	1	1,124,724,437.61	8.45%	920,774.55	7.61%	-
申万宏源	3	1,030,702,064.14	7.75%	939,280.05	7.76%	-
兴业证券	1	977,764,433.98	7.35%	910,593.37	7.53%	-
瑞银证券	1	621,307,215.41	4.67%	566,197.68	4.68%	-
天风证券	2	553,060,758.58	4.16%	504,004.66	4.17%	-
招商证券	3	527,917,392.75	3.97%	491,649.07	4.06%	-
中泰证券	1	385,961,268.90	2.90%	351,725.47	2.91%	-
广发证券	1	315,088,460.02	2.37%	293,440.47	2.43%	-
华泰证券	1	274,858,807.58	2.07%	255,975.61	2.12%	-
方正证券	1	152,808,183.99	1.15%	139,254.35	1.15%	-
西南证券	1	90,918,626.78	0.68%	82,854.48	0.68%	-
长江证券	1	31,697,517.81	0.24%	29,519.66	0.24%	-
华安证券	1	15,024,876.30	0.11%	13,992.63	0.12%	-

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：

2017 年 11 月完成租用托管在建行（宏利）的长江证券深圳 000510 交易单元。

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
华泰证券	474,724.80	100.00%	-	-	-	-

华安基金管理有限公司

二〇一八年三月二十七日