

华安科技动力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	华安科技动力混合
基金主代码	040025
交易代码	040025
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 12 月 20 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	984,220,670.17 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金重点投资于以科学技术为动力在产业价值链中占据优势地位的行业或企业，关注其科技创新或技术突破后产生的增长动能，在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金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。个股选择中以产业链价值结构为主要判别基准，选取以科学技术为动力在产业价值链中占据优势地位的行业或企业，同时从市场广度、技术深度、产业宽度和政策强度等方面寻找选取财务状况良好、盈利能力较强且资产质量较好的公司并作为重点投资对象。
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	本基金为混合型基金，基金的风险与预期收益高于债券型基金和货币市场基金、低于股票型基金，属于证券投资基金中的中高风险投资品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	华安基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司

信息披露 负责人	姓名	钱鲲	田青
	联系电话	021-38969999	010-67595096
	电子邮箱	qiankun@huaan.com.cn	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		4008850099	010-67595096
传真		021-68863414	010-66275853

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
本期已实现收益	347,926,147.07	97,195,704.47	359,676,887.75
本期利润	393,286,095.12	59,862,107.75	331,755,411.66
加权平均基金份额本期利润	0.5635	0.3331	1.6902
本期基金份额净值增长率	18.02%	6.22%	64.83%
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	2.2981	2.2807	2.0893
期末基金资产净值	3,246,009,376.41	897,614,116.58	367,668,218.82
期末基金份额净值	3.298	3.281	3.089

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
过去三个月	2.87%	0.74%	1.41%	0.61%	1.46%	0.13%
过去六个月	10.95%	0.67%	5.78%	0.55%	5.17%	0.12%
过去一年	18.02%	0.66%	11.28%	0.52%	6.74%	0.14%
过去三年	106.62%	1.83%	11.47%	1.38%	95.15%	0.45%
过去五年	290.73%	1.64%	53.24%	1.25%	237.49%	0.39%
自基金合同生效起至今	287.21%	1.52%	57.45%	1.21%	229.76%	0.31%

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

华安科技动力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

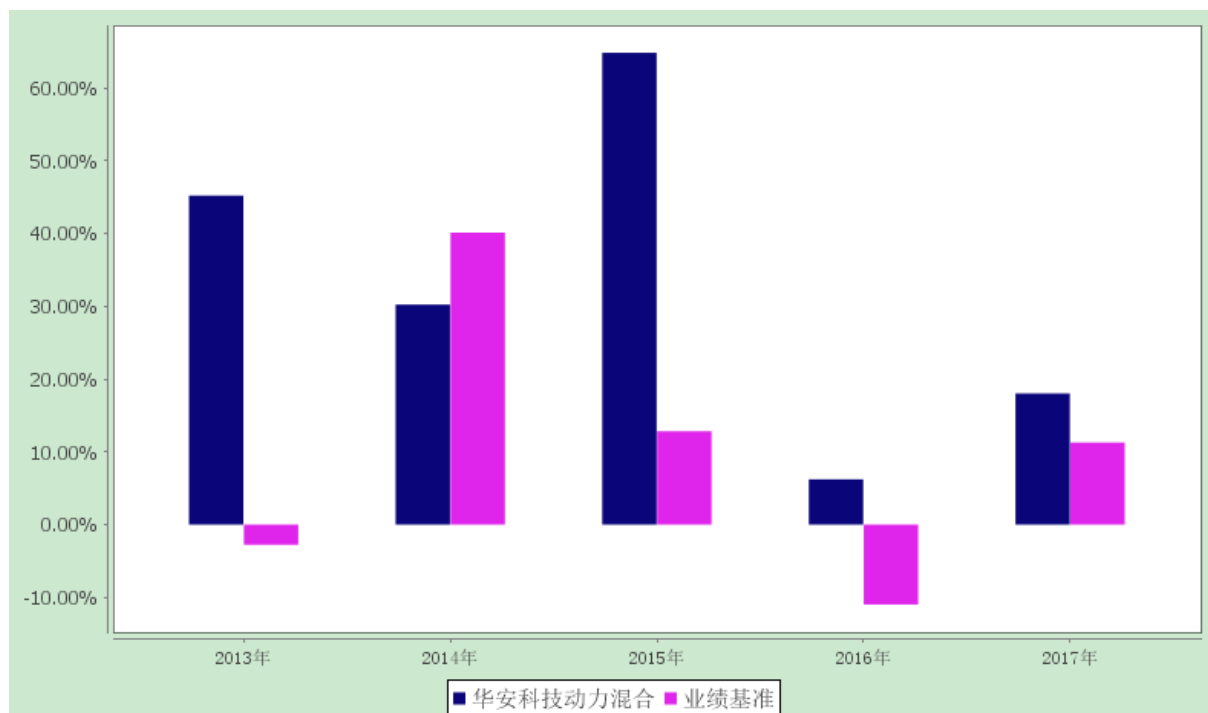
(2011 年 12 月 20 日至 2017 年 12 月 31 日)



3.2.3 过去五年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

华安科技动力混合型证券投资基金

过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2017年	5.550	656,787,953.61	107,603,202.79	764,391,156.40	-
合计	5.550	656,787,953.61	107,603,202.79	764,391,156.40	-

§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		
谢振东	本基金的基金经理	2015-03-25	-	7 年	天津大学理学学士、加州大学洛杉矶分校工学硕士研究生，7 年证券、基金行业从业经验。曾任华泰联合证券行业研究员。2011 年 9 月加入华安基金，曾任投资研究部高级研究员、基金投资部基金经理助理。2015 年 3 月起同时担任本基金、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 月至 2016 年 9 月同时担任华安动态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。

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

报告期内，资本市场表现相对稳定，但结构性差异较大；本基金维持自下而上的选股思路，继续配置在中长期具有安全边际和成长空间，符合新消费、科技创新，以及相关行业的优势公司，整体略跑赢比较基准。期间，新消费、新科技等标的的配置对于基金净值产生了较大正面贡献。

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 3.298 元，本报告期份额净值增长率为 18.02%，同期业绩比较基准增长率为 11.28%。

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 18 年，我们倾向于认为中国经济仍将继续呈现稳健增长的态势，其周期性复苏的驱动力主要来自产能、库存调整到位，使得供需两端回归到相对良性的关系；我们不排除经济出现阶段性下行压力，但在转型背景下，新经济加速发力，增长质量将明显提升，其中制造业投资修复和居民消费需求的释放可能是需求端的主要亮点；

就市场而言，经济的相对平稳和偏紧的资金环境仍然是影响 A 股市场表现的重要因素；基于此，我们对后市持谨慎乐观的观点：股票市场可能继续呈现震荡和分化，结构性机会层出不穷，这对于自下而上选股创造了良好的环境。

本基金将在以下几个方面寻找投资机会：1、持续提高竞争壁垒的行业优势企业：市场对于大行业优势公司基本面的挖掘可能已经相对充分，伴随着的是市场估值体系的优化；同样部分细分行业优势企业在经历了多轮经济周期洗礼后，通过持续的高研发投入、行业整并和市场开拓，不仅实现了远超行业的增速，而且在国内外实现了强大话语权，而其估值优势正在显现；2、符合居民消费升级方向：持续的财富积累和消费年龄结构、区域结构的变化都使得消费升级这一趋势持续发酵，而相关产业的供给能力（背后是中国具有全球比较优势的制造业能力）也在某种程度上实现了供给

创造需求。

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

本报告期内实施了 2017 年度第一次分红，分红方案为：5.550 元/10 份，权益登记日及除息日：2017 年 9 月 19 日；现金红利发放日：2017 年 9 月 20 日。

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，本基金实施利润分配的金额为 764,391,156.40 元。

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普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计，注册会计师单峰 魏佳亮签字出具了普华永道中天审字(2018)第 20811 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：华安科技动力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 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：	-	-
银行存款	426,527,231.38	180,107,782.35
结算备付金	11,808,518.20	5,576,722.23
存出保证金	1,107,830.23	536,528.33
交易性金融资产	2,863,064,675.77	774,357,042.05
其中：股票投资	2,863,064,675.77	774,357,042.05
基金投资	-	-
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-

贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	71,076,274.94	-
应收利息	77,789.94	37,643.74
应收股利	-	-
应收申购款	1,912,454.81	846,710.18
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	3,375,574,775.27	961,462,428.88
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	-	58,902,449.37
应付赎回款	117,406,606.59	675,518.56
应付管理人报酬	4,284,042.05	1,042,652.54
应付托管费	714,007.00	173,775.43
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	6,321,583.98	2,695,780.82
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	839,159.24	358,135.58
负债合计	129,565,398.86	63,848,312.30

所有者权益：	-	-
实收基金	984,220,670.17	273,603,309.27
未分配利润	2,261,788,706.24	624,010,807.31
所有者权益合计	3,246,009,376.41	897,614,116.58
负债和所有者权益总计	3,375,574,775.27	961,462,428.88

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值 3.298 元，基金份额总额 984,220,670.17 份。

7.2 利润表

会计主体：华安科技动力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	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
一、收入	466,501,057.62	84,232,424.74
1.利息收入	7,450,899.92	736,763.10
其中：存款利息收入	2,448,409.96	736,585.99
债券利息收入	-	177.11
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	5,002,489.96	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	410,672,430.85	120,265,839.81
其中：股票投资收益	391,941,819.27	118,618,033.20
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	226,109.25
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	18,730,611.58	1,421,697.36

3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	45,359,948.05	-37,333,596.72
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	3,017,778.80	563,418.55
减：二、费用	73,214,962.50	24,370,316.99
1. 管理人报酬	35,104,468.52	8,083,329.67
2. 托管费	5,850,744.83	1,347,221.55
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	31,809,257.85	14,548,989.17
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	450,491.30	390,776.60
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	393,286,095.12	59,862,107.75
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	393,286,095.12	59,862,107.75

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安科技动力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）	273,603,309.27	624,010,807.31	897,614,116.58
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	393,286,095.12	393,286,095.12
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）	710,617,360.90	2,008,882,960.21	2,719,500,321.11
其中：1.基金申购款	1,474,535,432.58	3,762,654,807.28	5,237,190,239.86
2.基金赎回款	-763,918,071.68	-1,753,771,847.07	-2,517,689,918.75
四、本期向基金份额持有人分配利润	-	-764,391,156.40	-764,391,156.40

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）	984,220,670.17	2,261,788,706.24	3,246,009,376.41
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）	119,011,747.26	248,656,471.56	367,668,218.82
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	59,862,107.75	59,862,107.75
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）	154,591,562.01	315,492,228.00	470,083,790.01
其中：1.基金申购款	311,166,607.52	643,431,312.34	954,597,919.86
2.基金赎回款	-156,575,045.51	-327,939,084.34	-484,514,129.85
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）	273,603,309.27	624,010,807.31	897,614,116.58

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：朱兴华，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

华安科技动力混合型证券投资基金(原名为华安科技动力股票型证券投资基金，以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2011]第 1524 号《关于核准华安科技动力股票型证券投资基金募集的批复》核准，由华安基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安科技动力股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 897,723,871.10 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2011)第 479 号验资报告予以验证。经向中

中国证监会备案,《华安科技动力股票型证券投资基金基金合同》于 2011 年 12 月 20 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 897,813,564.47 份基金份额,其中认购资金利息折合 89,693.37 份基金份额。本基金的基金管理人为华安基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安科技动力混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金投资于具有良好流动性的金融工具,包括 A 股股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、权证、货币市场工具和资产支持证券以及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。本基金股票投资占基金资产的比例范围为 60%-95%,其中投资于以科学技术为动力在产业价值链中占据优势地位的行业或企业的比例不低于股票投资的 80%;债券、权证、现金、货币市场工具和资产支持证券占基金资产的比例范围为 5%-40%,其中权证投资占基金资产净值的比例范围为 0-3%;现金或者到期日在 1 年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为:80%×中证 800 指数收益率+20%×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 2018 年 3 月 22 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华安科技动力混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2017 年度财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2017 年

12 月 31 日的财务状况以及 2017 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

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

无。

7.4.8.1.2 权证交易

无。

7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

无。

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	35,104,468.52	8,083,329.67
其中：支付销售机构的客户维护费	5,383,844.73	2,359,135.65

注：支付基金管理人 华安基金公司 的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50%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×1.50%/当年天数。

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	5,850,744.83	1,347,221.55

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。

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

无。

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

无。

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
中国建设银行	426,527,231.38	2,284,778.82	180,107,782.35	667,222.85

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。

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。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

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	网下中签	17.01	17.01	954.00	16,227.54	16,227.54	-
300664	鹏鹞环保	2017-12-28	2018-01-05	网下中签	8.88	8.88	3,640.00	32,323.20	32,323.20	-
603080	新疆火炬	2017-12-25	2018-01-03	网下中签	13.60	13.60	1,187.00	16,143.20	16,143.20	-
603161	科华控股	2017-12-28	2018-01-05	网下中签	16.75	16.75	1,239.00	20,753.25	20,753.25	-

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
002366	台海核电	2017-12-06	重大资产重组	26.45	-	-	200,000	4,828,078.12	5,290,000.00	-
002507	涪陵榨菜	2017-12-04	重大事项	17.94	-	-	2,000,000	27,784,578.19	35,880,000.00	-
002739	万达电影	2017-07-04	重大资产重组	52.04	-	-	400,000	21,236,752.90	20,816,000.00	-
002919	名臣健康	2017-12-28	重大事项	35.26	2018-01-02	38.79	821	10,311.76	28,948.46	-
300730	科创信息	2017-12-25	重大事项	41.55	2018-01-02	45.71	821	6,863.56	34,112.55	-
600309	万华化学	2017-12-05	重大资产重组	37.94	-	-	200,000	7,039,486.18	7,588,000.00	-
601003	柳钢股份	2017-10-17	重大资产重组	7.73	2018-01-18	7.50	2,000,000	14,829,483.78	15,460,000.00	-

注：本基金截至 2017 年 12 月 31 日止持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。

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

无。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1)公允价值

(a)金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b)持续的以公允价值计量的金融工具

(i)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 2,777,882,167.57 元，属于第二层次的余额为 85,182,508.20 元，无属于第三层次的余额(2016 年 12 月 31 日：第一层次 758,089,272.73 元，第二层次 16,267,769.32 元，无第三层次)。

(ii)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债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会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将相关股票和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，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2017 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2016 年 12 月 31 日：同)。

(d)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应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2)增值税

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[2016]140 号《关于明确金融 房

地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，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、国家税务总局于 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

此外，财政部、国家税务总局于 2017 年 12 月 25 日颁布的财税[2017]90 号《关于租入固定资产进行税额抵扣等增值税政策的通知》对资管产品管理人自 2018 年 1 月 1 日起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的销售额确定做出规定。

上述税收政策对本基金 2017 年 12 月 31 日的财务状况和 2017 年度的经营成果无影响。

(3)除公允价值和增值税外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§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	2,863,064,675.77	84.82
	其中：股票	2,863,064,675.77	84.82
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-

5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	438,335,749.58	12.99
7	其他各项资产	74,174,349.92	2.20
8	合计	3,375,574,775.27	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	77,160,000.00	2.38
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,617,918,025.96	49.84
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	49,712,143.20	1.53
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	163,807,600.00	5.05
G	交通运输、仓储和邮政业	16,437,957.94	0.51
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	53,238,112.55	1.64
J	金融业	553,247,772.96	17.04
K	房地产业	102,168,000.00	3.15
L	租赁和商务服务业	124,140,000.00	3.82
M	科学研究和技术服务业	8,920,000.00	0.27
N	水利、环境和公共设施管理业	48,477,750.96	1.49
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	8,749,312.20	0.27
R	文化、体育和娱乐业	39,088,000.00	1.20

S	综合	-	-
	合计	2,863,064,675.77	88.20

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	601318	中国平安	2,200,000	153,956,000.00	4.74
2	601288	农业银行	26,000,000	99,580,000.00	3.07
3	600297	广汇汽车	12,000,000	96,240,000.00	2.96
4	601398	工商银行	15,500,000	96,100,000.00	2.96
5	000895	双汇发展	3,400,000	90,100,000.00	2.78
6	600867	通化东宝	3,549,920	81,257,668.80	2.50
7	002027	分众传媒	5,700,000	80,256,000.00	2.47
8	300257	开山股份	5,700,035	79,800,490.00	2.46
9	000998	隆平高科	3,000,000	77,160,000.00	2.38
10	300408	三环集团	3,600,000	72,576,000.00	2.24

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	601398	工商银行	276,460,832.28	30.80
2	600803	新奥股份	222,624,025.18	24.80
3	601318	中国平安	200,458,813.86	22.33
4	600048	保利地产	174,680,918.05	19.46
5	601766	中国中车	169,782,359.06	18.91
6	600519	贵州茅台	167,389,653.17	18.65
7	601288	农业银行	166,868,164.22	18.59
8	600297	广汇汽车	162,974,156.38	18.16
9	002027	分众传媒	148,964,079.39	16.60
10	600030	中信证券	146,986,218.95	16.38
11	600066	宇通客车	141,135,612.79	15.72
12	000858	五粮液	132,575,557.68	14.77
13	600782	新钢股份	132,039,783.40	14.71
14	300257	开山股份	131,215,975.46	14.62

15	000998	隆平高科	128,629,859.41	14.33
16	000333	美的集团	127,941,752.63	14.25
17	002126	银轮股份	119,862,457.38	13.35
18	000709	河钢股份	118,466,868.31	13.20
19	601336	新华保险	118,072,682.84	13.15
20	000933	神火股份	117,313,072.16	13.07
21	002001	新 和 成	116,802,075.54	13.01
22	300408	三环集团	116,488,778.35	12.98
23	600019	宝钢股份	108,987,309.53	12.14
24	002456	欧菲科技	104,469,347.23	11.64
25	300336	新文化	101,998,614.45	11.36
26	002110	三钢闽光	101,846,530.00	11.35
27	600808	马钢股份	98,132,976.96	10.93
28	000725	京东方 A	97,374,472.84	10.85
29	600741	华域汽车	97,166,539.49	10.82
30	002517	恺英网络	95,523,440.03	10.64
31	601688	华泰证券	92,982,010.53	10.36
32	000895	双汇发展	91,171,412.34	10.16
33	000002	万 科 A	89,828,730.27	10.01
34	600176	中国巨石	88,774,421.44	9.89
35	600585	海螺水泥	88,248,693.55	9.83
36	600153	建发股份	87,389,231.75	9.74
37	601933	永辉超市	86,484,756.04	9.63
38	600340	华夏幸福	85,309,811.16	9.50
39	002127	南极电商	84,087,548.08	9.37
40	002159	三特索道	83,771,070.78	9.33
41	002081	金 螳 螂	78,077,788.16	8.70
42	603686	龙马环卫	75,358,810.07	8.40
43	600967	内蒙一机	73,450,296.04	8.18
44	000063	中兴通讯	71,362,812.95	7.95
45	002454	松芝股份	67,427,372.50	7.51
46	600705	中航资本	66,796,148.15	7.44
47	600516	方大炭素	66,775,283.51	7.44
48	601996	丰林集团	65,406,294.67	7.29
49	300043	星辉娱乐	65,144,629.48	7.26
50	601601	中国太保	64,336,219.49	7.17
51	600525	长园集团	64,297,075.60	7.16
52	000060	中金岭南	63,005,683.93	7.02
53	000581	威孚高科	62,594,395.67	6.97
54	600362	江西铜业	60,922,638.68	6.79
55	002768	国恩股份	59,578,000.58	6.64
56	600518	康美药业	57,974,351.01	6.46
57	600352	浙江龙盛	57,711,506.48	6.43
58	002479	富春环保	57,495,431.19	6.41

59	601166	兴业银行	56,358,417.50	6.28
60	600498	烽火通信	54,368,765.26	6.06
61	600428	中远海特	54,312,880.39	6.05
62	002507	涪陵榨菜	51,977,368.07	5.79
63	600383	金地集团	51,831,227.61	5.77
64	600497	驰宏锌锗	51,741,130.91	5.76
65	000423	东阿阿胶	51,332,901.04	5.72
66	300017	网宿科技	50,879,511.69	5.67
67	002039	黔源电力	50,877,343.81	5.67
68	600600	青岛啤酒	50,580,901.69	5.64
69	000839	中信国安	49,396,563.88	5.50
70	600456	宝钛股份	48,440,709.43	5.40
71	000630	铜陵有色	45,955,000.00	5.12
72	002436	兴森科技	45,697,372.91	5.09
73	600651	飞乐音响	45,315,349.97	5.05
74	002206	海利得	43,512,664.82	4.85
75	000639	西王食品	43,010,130.91	4.79
76	601233	桐昆股份	42,816,630.43	4.77
77	000717	韶钢松山	42,605,170.13	4.75
78	600875	东方电气	42,049,038.47	4.68
79	300323	华灿光电	41,943,257.54	4.67
80	002466	天齐锂业	41,527,589.41	4.63
81	600885	宏发股份	41,505,785.10	4.62
82	000625	长安汽车	41,391,723.94	4.61
83	600507	方大特钢	41,137,556.01	4.58
84	001979	招商蛇口	41,097,757.97	4.58
85	600305	恒顺醋业	41,056,253.91	4.57
86	600521	华海药业	41,012,520.76	4.57
87	000976	华铁股份	40,776,156.05	4.54
88	600887	伊利股份	40,456,735.30	4.51
89	601600	中国铝业	40,288,449.34	4.49
90	600050	中国联通	40,210,503.00	4.48
91	002640	跨境通	39,757,057.11	4.43
92	000930	中粮生化	39,554,371.52	4.41
93	000932	华菱钢铁	39,208,467.00	4.37
94	002366	台海核电	39,193,694.89	4.37
95	601857	中国石油	38,730,626.60	4.31
96	600867	通化东宝	38,722,589.28	4.31
97	000568	泸州老窖	38,148,952.40	4.25
98	002739	万达电影	37,193,848.33	4.14
99	601003	柳钢股份	37,073,709.46	4.13
100	000800	一汽轿车	36,800,481.42	4.10
101	601117	中国化学	36,494,858.70	4.07
102	002493	荣盛石化	35,923,741.93	4.00

103	000980	众泰汽车	35,187,251.10	3.92
104	600285	羚锐制药	35,133,660.25	3.91
105	603989	艾华集团	35,060,404.36	3.91
106	002812	创新股份	34,372,975.08	3.83
107	300121	阳谷华泰	34,336,922.95	3.83
108	002271	东方雨虹	33,388,040.68	3.72
109	000488	晨鸣纸业	33,106,668.82	3.69
110	000617	中油资本	32,608,720.85	3.63
111	002371	北方华创	32,340,547.26	3.60
112	600939	重庆建工	32,145,262.00	3.58
113	300458	全志科技	32,130,375.33	3.58
114	600179	安通控股	31,872,391.51	3.55
115	600693	东百集团	31,766,525.68	3.54
116	000898	鞍钢股份	31,711,238.16	3.53
117	002701	奥瑞金	31,700,039.60	3.53
118	600976	健民集团	31,579,279.41	3.52
119	000878	云南铜业	31,242,237.00	3.48
120	300285	国瓷材料	31,142,702.78	3.47
121	300003	乐普医疗	31,066,196.78	3.46
122	600366	宁波韵升	29,847,643.44	3.33
123	600282	南钢股份	29,753,949.70	3.31
124	600093	易见股份	29,681,110.89	3.31
125	002285	世联行	29,593,919.72	3.30
126	002241	歌尔股份	29,311,448.28	3.27
127	002244	滨江集团	28,569,973.66	3.18
128	000338	潍柴动力	28,473,949.00	3.17
129	600386	北巴传媒	28,415,671.74	3.17
130	601919	中远海控	28,116,060.15	3.13
131	300070	碧水源	27,990,888.89	3.12
132	300498	温氏股份	27,888,098.33	3.11
133	603355	莱克电气	27,482,664.32	3.06
134	600036	招商银行	27,370,017.02	3.05
135	603589	口子窖	27,076,113.23	3.02
136	300083	劲胜智能	26,581,079.76	2.96
137	002564	天沃科技	25,802,211.87	2.87
138	002008	大族激光	25,349,521.17	2.82
139	002310	东方园林	24,668,621.96	2.75
140	600309	万华化学	24,638,201.66	2.74
141	603801	志邦股份	24,520,826.28	2.73
142	600028	中国石化	24,352,436.00	2.71
143	000920	南方汇通	23,958,209.38	2.67
144	002352	顺丰控股	23,877,287.52	2.66
145	600183	生益科技	23,737,837.40	2.64
146	002511	中顺洁柔	23,630,108.09	2.63

147	600038	中直股份	23,521,666.33	2.62
148	300346	南大光电	23,465,789.59	2.61
149	002410	广联达	23,375,433.56	2.60
150	000547	航天发展	22,595,926.07	2.52
151	002138	顺络电子	22,313,013.85	2.49
152	000606	神州易桥	21,639,787.98	2.41
153	600118	中国卫星	21,553,135.68	2.40
154	300136	信维通信	21,070,655.55	2.35
155	002128	露天煤业	20,975,194.24	2.34
156	000756	新华制药	20,897,124.46	2.33
157	000503	海虹控股	20,885,478.03	2.33
158	601997	贵阳银行	20,859,127.24	2.32
159	002048	宁波华翔	20,660,746.09	2.30
160	300161	华中数控	20,635,382.60	2.30
161	600031	三一重工	20,313,655.81	2.26
162	002073	软控股份	20,061,992.82	2.24
163	000888	峨眉山 A	20,059,440.16	2.23
164	002748	世龙实业	20,039,201.50	2.23
165	603515	欧普照明	19,867,449.19	2.21
166	600751	天海投资	19,710,342.98	2.20
167	600491	龙元建设	19,560,622.28	2.18
168	000786	北新建材	19,502,804.00	2.17
169	002234	民和股份	19,484,105.04	2.17
170	002433	太安堂	19,114,129.34	2.13
171	603799	华友钴业	19,051,249.00	2.12
172	300628	亿联网络	18,919,764.99	2.11
173	603883	老百姓	18,713,942.07	2.08
174	603306	华懋科技	18,634,729.20	2.08
175	000598	兴蓉环境	18,446,748.00	2.06

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	600803	新奥股份	197,575,345.35	22.01
2	601398	工商银行	196,042,166.06	21.84
3	601766	中国中车	183,821,129.04	20.48

4	002001	新 和 成	166,513,599.85	18.55
5	600048	保利地产	144,033,427.20	16.05
6	600782	新钢股份	135,719,124.21	15.12
7	600030	中信证券	121,484,447.56	13.53
8	600519	贵州茅台	121,192,234.00	13.50
9	000933	神火股份	115,421,695.29	12.86
10	002081	金 螳 螂	112,786,891.72	12.57
11	000709	河钢股份	112,554,540.86	12.54
12	002517	恺英网络	112,084,732.07	12.49
13	002110	三钢闽光	110,720,072.91	12.33
14	600741	华域汽车	110,045,071.85	12.26
15	601933	永辉超市	106,839,530.54	11.90
16	601336	新华保险	104,258,163.40	11.62
17	000858	五 粮 液	103,767,400.36	11.56
18	000333	美的集团	102,960,157.17	11.47
19	600019	宝钢股份	102,634,811.59	11.43
20	601318	中国平安	100,372,326.91	11.18
21	002027	分众传媒	98,889,868.36	11.02
22	601688	华泰证券	98,172,795.75	10.94
23	600808	马钢股份	97,338,025.66	10.84
24	002456	欧菲科技	96,462,058.82	10.75
25	600176	中国巨石	95,696,565.89	10.66
26	600153	建发股份	90,654,450.24	10.10
27	000002	万 科 A	90,236,575.33	10.05
28	000725	京东方 A	88,341,847.26	9.84
29	600066	宇通客车	78,598,277.77	8.76
30	600516	方大炭素	78,548,182.85	8.75
31	601288	农业银行	74,923,561.00	8.35
32	600093	易见股份	73,757,612.56	8.22
33	300336	新文化	72,595,858.27	8.09
34	600297	广汇汽车	71,894,242.85	8.01
35	002126	银轮股份	68,772,621.04	7.66
36	600585	海螺水泥	68,554,121.58	7.64
37	600518	康美药业	62,875,595.14	7.00
38	000998	隆平高科	62,204,014.36	6.93
39	300043	星辉娱乐	61,772,804.04	6.88
40	600525	长园集团	61,098,944.60	6.81
41	000630	铜陵有色	60,609,790.99	6.75
42	600362	江西铜业	60,467,118.36	6.74
43	000581	威孚高科	59,744,366.54	6.66
44	600428	中远海特	59,610,251.35	6.64
45	601996	丰林集团	59,376,063.53	6.61
46	600340	华夏幸福	57,006,078.01	6.35
47	002479	富春环保	56,647,301.53	6.31

48	600497	驰宏锌锗	56,503,732.51	6.29
49	000839	中信国安	54,773,319.58	6.10
50	002366	台海核电	54,618,808.28	6.08
51	002466	天齐锂业	54,403,262.62	6.06
52	600600	青岛啤酒	54,308,706.77	6.05
53	000423	东阿阿胶	54,241,475.39	6.04
54	002564	天沃科技	53,510,591.91	5.96
55	002371	北方华创	52,440,006.19	5.84
56	600456	宝钛股份	49,888,681.63	5.56
57	000063	中兴通讯	48,401,539.94	5.39
58	601600	中国铝业	48,289,842.69	5.38
59	001979	招商蛇口	47,713,010.48	5.32
60	600651	飞乐音响	46,455,296.34	5.18
61	600143	金发科技	45,719,398.27	5.09
62	002436	兴森科技	45,311,266.62	5.05
63	000717	韶钢松山	44,899,367.50	5.00
64	000639	西王食品	44,652,218.96	4.97
65	300323	华灿光电	43,749,244.58	4.87
66	601117	中国化学	43,375,283.12	4.83
67	600887	伊利股份	43,227,726.86	4.82
68	600875	东方电气	43,135,236.12	4.81
69	000930	中粮生化	42,970,105.09	4.79
70	000060	中金岭南	42,469,565.94	4.73
71	300408	三环集团	42,189,376.28	4.70
72	000568	泸州老窖	40,581,833.37	4.52
73	000625	长安汽车	40,035,458.57	4.46
74	002048	宁波华翔	39,674,774.88	4.42
75	002008	大族激光	39,054,691.03	4.35
76	600383	金地集团	38,757,784.18	4.32
77	601601	中国太保	38,745,938.56	4.32
78	600507	方大特钢	38,581,506.35	4.30
79	002812	创新股份	38,408,977.52	4.28
80	601857	中国石油	38,048,889.54	4.24
81	300257	开山股份	38,034,818.73	4.24
82	000800	一汽轿车	37,925,713.36	4.23
83	000617	中油资本	37,824,604.82	4.21
84	000606	神州易桥	36,218,268.61	4.03
85	300285	国瓷材料	35,981,038.02	4.01
86	000488	晨鸣纸业	35,896,054.87	4.00
87	002271	东方雨虹	35,496,299.94	3.95
88	000980	众泰汽车	34,626,787.08	3.86
89	300458	全志科技	34,494,041.28	3.84
90	300121	阳谷华泰	34,256,493.67	3.82
91	600967	内蒙一机	33,148,182.91	3.69

92	600179	安通控股	33,120,036.36	3.69
93	002640	跨境通	33,079,300.61	3.69
94	000898	鞍钢股份	32,308,561.14	3.60
95	002127	南极电商	32,002,982.85	3.57
96	601919	中远海控	31,614,833.00	3.52
97	600282	南钢股份	31,186,370.20	3.47
98	300498	温氏股份	30,681,217.59	3.42
99	600366	宁波韵升	30,311,744.17	3.38
100	000338	潍柴动力	30,309,413.96	3.38
101	300129	泰胜风能	29,900,366.00	3.33
102	002409	雅克科技	29,775,859.31	3.32
103	002507	涪陵榨菜	29,576,643.08	3.30
104	300070	碧水源	29,383,888.19	3.27
105	600386	北巴传媒	29,288,413.10	3.26
106	002701	奥瑞金	29,277,892.66	3.26
107	600038	中直股份	29,072,212.95	3.24
108	000878	云南铜业	28,928,030.85	3.22
109	603589	口子窖	28,722,099.00	3.20
110	002244	滨江集团	28,720,385.04	3.20
111	603355	莱克电气	27,846,441.63	3.10
112	002310	东方园林	27,535,692.36	3.07
113	600028	中国石化	27,457,486.00	3.06
114	600477	杭萧钢构	27,083,198.11	3.02
115	002493	荣盛石化	26,100,302.63	2.91
116	600939	重庆建工	26,011,298.32	2.90
117	300083	劲胜智能	25,584,304.22	2.85
118	002511	中顺洁柔	25,321,122.26	2.82
119	600998	九州通	25,104,691.06	2.80
120	603801	志邦股份	24,648,694.42	2.75
121	300017	网宿科技	24,555,518.21	2.74
122	601100	恒立液压	24,531,688.58	2.73
123	002352	顺丰控股	24,487,285.33	2.73
124	600031	三一重工	23,987,106.75	2.67
125	000786	北新建材	23,407,225.14	2.61
126	000756	新华制药	23,378,535.08	2.60
127	000976	华铁股份	23,157,614.30	2.58
128	600068	葛洲坝	23,123,985.42	2.58
129	002138	顺络电子	22,879,393.83	2.55
130	002768	国恩股份	22,771,320.95	2.54
131	002739	万达电影	22,416,423.17	2.50
132	002234	民和股份	22,216,826.00	2.48
133	600801	华新水泥	22,172,580.72	2.47
134	300346	南大光电	21,825,345.60	2.43
135	601003	柳钢股份	21,769,528.99	2.43

136	600309	万华化学	21,380,952.20	2.38
137	300003	乐普医疗	21,245,773.42	2.37
138	000528	柳 工	21,211,749.11	2.36
139	000920	南方汇通	21,128,410.74	2.35
140	002128	露天煤业	21,099,692.50	2.35
141	000503	海虹控股	21,083,750.57	2.35
142	002073	软控股份	21,031,131.47	2.34
143	603799	华友钴业	20,452,418.28	2.28
144	600050	中国联通	20,424,050.00	2.28
145	600693	东百集团	19,937,284.68	2.22
146	600118	中国卫星	19,838,206.21	2.21
147	300273	和佳股份	19,573,543.77	2.18
148	601997	贵阳银行	19,429,074.88	2.16
149	000888	峨眉山 A	19,424,979.19	2.16
150	600751	天海投资	18,989,596.45	2.12
151	600259	广晟有色	18,939,854.80	2.11
152	300628	亿联网络	18,860,303.39	2.10
153	002410	广联达	18,745,245.20	2.09
154	002433	太安堂	18,584,535.43	2.07
155	002159	三特索道	18,571,886.48	2.07
156	600305	恒顺醋业	18,350,472.76	2.04
157	600491	龙元建设	18,336,391.72	2.04
158	000598	兴蓉环境	18,165,107.00	2.02
159	603306	华懋科技	17,984,581.98	2.00
160	001696	宗申动力	17,965,497.56	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	11,633,599,352.38
卖出股票的收入（成交）总额	9,982,193,485.98

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。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

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

本基金本报告期末未持有债券投资。

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

无。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期没有投资国债期货。

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	1,107,830.23
2	应收证券清算款	71,076,274.94
3	应收股利	-
4	应收利息	77,789.94
5	应收申购款	1,912,454.81
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	74,174,349.92

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。

§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
81,488	12,078.11	667,740,438.36	67.84%	316,480,231.81	32.16%

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	573,937.04	0.06%
------------------	------------	-------

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(2011 年 12 月 20 日)基金份额总额	897,813,564.47
本报告期期初基金份额总额	273,603,309.27
本报告期基金总申购份额	1,474,535,432.58
减：本报告期基金总赎回份额	763,918,071.68
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	984,220,670.17

§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。任职公告已在《上海证券报》（9 月 1 日第四版）和我行互联网网站（www.ccb.com“最新公告”栏目）上刊登，请关注。

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情况为人民币 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	
万联证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
联讯证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
广州证券	2	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
财富证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中山证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	4,072,845,102.70	18.85%	3,711,591.07	18.64%	-
天风证券	2	3,431,019,157.85	15.88%	3,132,197.62	15.73%	-
华泰证券	1	3,222,048,316.53	14.91%	3,000,692.03	15.07%	-

长江证券	2	2,681,113,603.39	12.41%	2,493,899.75	12.53%	-
海通证券	1	1,438,602,012.24	6.66%	1,339,767.12	6.73%	-
中金公司	1	1,111,992,489.83	5.15%	1,035,595.20	5.20%	-
广发证券	1	1,010,822,740.52	4.68%	941,378.89	4.73%	-
光大证券	1	995,638,522.68	4.61%	907,326.17	4.56%	-
西南证券	1	706,689,395.74	3.27%	644,006.29	3.23%	-
瑞银证券	1	526,312,400.20	2.44%	479,628.53	2.41%	-
上海证券	2	519,932,556.26	2.41%	473,816.07	2.38%	-
兴业证券	1	485,199,028.96	2.25%	451,864.75	2.27%	-
申万宏源	3	416,724,206.34	1.93%	379,761.12	1.91%	-
华安证券	1	368,063,107.39	1.70%	342,779.22	1.72%	-
中信证券	1	318,899,126.98	1.48%	296,992.14	1.49%	-
国泰君安	1	134,656,496.12	0.62%	122,712.65	0.62%	-
招商证券	3	100,551,409.28	0.47%	93,643.27	0.47%	-
中信建投	1	67,008,720.60	0.31%	62,404.83	0.31%	-

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
中金公司	-	-	80,000,00 0.00	30.77%	-	-
广发证券	-	-	180,000,0 00.00	69.23%	-	-

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	60,613 ,212.7 7	217,44 8,329. 97	47,697,4 92.38	230,364,050 .36	23.41%
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