

华安新丝路主题股票型证券投资基金
2017 年年度报告
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 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 3 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	错误! 未定义书签。
1.1 重要提示	错误! 未定义书签。
§2 基金简介	错误! 未定义书签。
2.1 基金基本情况	错误! 未定义书签。
2.2 基金产品说明	错误! 未定义书签。
2.3 基金管理人和基金托管人	错误! 未定义书签。
2.4 信息披露方式	错误! 未定义书签。
2.5 其他相关资料	错误! 未定义书签。
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	错误! 未定义书签。
3.1 主要会计数据和财务指标	错误! 未定义书签。
3.2 基金净值表现	错误! 未定义书签。
3.3 过去三年基金的利润分配情况	错误! 未定义书签。
§4 管理人报告	错误! 未定义书签。
4.1 基金管理人及基金经理情况	错误! 未定义书签。
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	错误! 未定义书签。
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	错误! 未定义书签。
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	错误! 未定义书签。
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	错误! 未定义书签。
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	错误! 未定义书签。
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	错误! 未定义书签。
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	错误! 未定义书签。
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明	错误! 未定义书签。
§5 托管人报告	错误! 未定义书签。
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	错误! 未定义书签。
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	错误! 未定义书签。
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	错误! 未定义书签。
§6 审计报告	错误! 未定义书签。
§7 年度财务报表	错误! 未定义书签。
7.1 资产负债表	错误! 未定义书签。
7.2 利润表	错误! 未定义书签。
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	错误! 未定义书签。
7.4 报表附注	错误! 未定义书签。
§8 投资组合报告	错误! 未定义书签。
8.1 期末基金资产组合情况	50
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	错误! 未定义书签。
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	错误! 未定义书签。
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	错误! 未定义书签。
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	错误! 未定义书签。
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细	错误! 未定义书签。
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细	错误! 未定义书签。
8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细	错误! 未定义书签。
8.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	错误! 未定义书签。

8.10	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	错误! 未定义书签。
8.11	投资组合报告附注	错误! 未定义书签。
§9	基金份额持有人信息	错误! 未定义书签。
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	错误! 未定义书签。
9.2	期末上市基金前十名持有人	错误! 未定义书签。
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	错误! 未定义书签。
9.4	发起式基金发起资金持有份额情况	错误! 未定义书签。
§10	开放式基金份额变动	错误! 未定义书签。
§11	重大事件揭示	错误! 未定义书签。
11.1	基金份额持有人大会决议	错误! 未定义书签。
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	错误! 未定义书签。
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	错误! 未定义书签。
11.4	基金投资策略的改变	错误! 未定义书签。
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	错误! 未定义书签。
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	错误! 未定义书签。
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	错误! 未定义书签。
11.8	其他重大事件	错误! 未定义书签。
§12	发起式基金发起资金持有份额情况	错误! 未定义书签。
§13	影响投资者决策的其他重要信息	错误! 未定义书签。
§14	备查文件目录	错误! 未定义书签。
14.1	备查文件目录	错误! 未定义书签。
14.2	存放地点	错误! 未定义书签。
14.3	查阅方式	错误! 未定义书签。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华安新丝路主题股票型证券投资基金
基金简称	华安新丝路主题股票
基金主代码	001104
交易代码	001104
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 4 月 9 日
基金管理人	华安基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,948,149,533.58 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金重点投资于与新丝路主题相关的子行业或企业，在严格控制风险的前提下，力争把握该主题投资机会实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金采取相对稳定的资产配置策略，一般情况下将保持股票配置比例的相对稳定，避免因过于主动的仓位调整带来额外的风险。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。个股选择方面通过对新丝路主题相关子行业的精选以及对行业内相关股票的深入分析，挖掘该类型企业的投资价值。
业绩比较基准	80%×中证 800 指数收益率+20%×中国债券总指数收益率
风险收益特征	本基金为股票型基金，基金的风险与预期收益都要高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金，属于证券投资基金中的中高风险投资品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华安基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	钱鲲	王永民
	联系电话	021-38969999	010-66594896
	电子邮箱	qiankun@huaan.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		4008850099	95566
传真		021-68863414	010-66594942
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区 世纪大道8号国金中心二期31 -32层	北京西城区复兴门内大街1号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区 世纪大道8号国金中心二期31 -32层	北京西城区复兴门内大街1号
邮政编码		200120	100818
法定代表人		朱学华	陈四清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.huaan.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市世纪大道 100 号环球金融中心 50 楼
注册登记机构	华安基金管理有限公司	上海市世纪大道 8 号上海国金中心二期 31 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	2015 年 4 月 9 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日
本期已实现收益	224,801,080.63	-368,971,361.51	75,840,082.77
本期利润	500,051,772.77	-38,156,292.03	-694,310,560.61
加权平均基金份额本期利润	0.1649	-0.0094	-0.1194
本期加权平均净值利润率	16.62%	-1.15%	-12.60%
本期基金份额净值增长率	14.99%	0.23%	-11.50%
3.1.2 期末数据和指标	2017 年末	2016 年末	2015 年末
期末可供分配利润	-23,904,182.27	-415,641,342.86	-503,796,843.49
期末可供分配基金份额利润	-0.0123	-0.1130	-0.1146
期末基金资产净值	1,987,883,887.23	3,263,910,295.71	3,893,313,537.77
期末基金份额净值	1.020	0.887	0.885
3.1.3 累计期末指标	2017 年末	2016 年末	2015 年末
基金份额累计净值增长率	2.00%	-11.30%	-11.50%

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。

3.2 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	-1.54%	0.53%	1.43%	0.61%	-2.97%	-0.08%
过去六个月	-0.20%	0.52%	5.76%	0.55%	-5.96%	-0.03%
过去一年	14.99%	0.56%	11.08%	0.52%	3.91%	0.04%
自基金合同生效起至今	2.00%	1.44%	-6.91%	1.39%	8.91%	0.05%

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

华安新丝路主题股票型证券投资基金

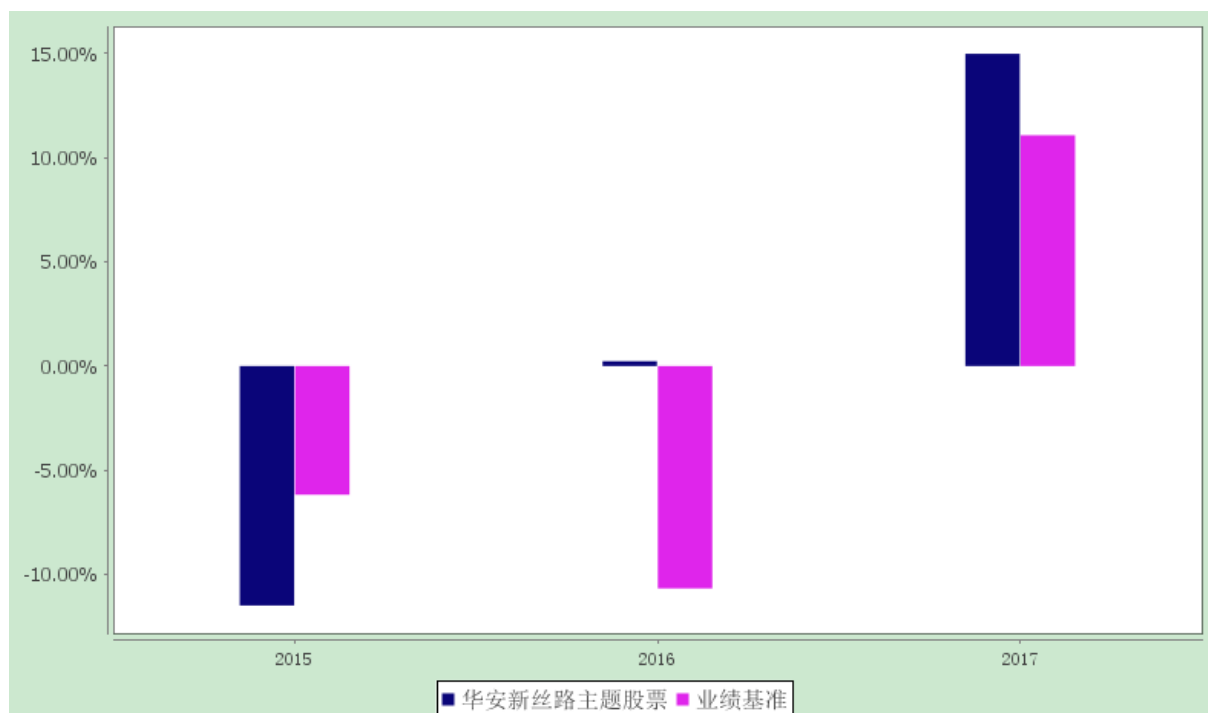
自基金合同生效以来份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2015 年 4 月 9 日至 2017 年 12 月 31 日)



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

华安新丝路主题股票型证券投资基金

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

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	证券从业	说明
----	----	-------------	------	----

		理) 期限		年限	
		任职日期	离任日期		
杨鑫鑫	本基金的基金经理	2015-04-09	-	9 年	硕士研究生，具有基金从业资格，9 年基金行业从业资格。2008 年 7 月应届进入华安基金管理有限公司，先后担任研究发展部行业研究员、基金投资部基金经理助理。2013 年 6 月起担任华安核心优选混合型证券投资基金的基金经理。2014 年 12 月至 2016 年 9 月担任华安创新证券投资基金的基金经理。2015 年 3 月至 2017 年 7 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 4 月起担任本基金的基金经理。

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

2017 年市场全年呈现震荡上行态势。沪深 300 指数上涨 21.8%，而创业板指逆势下跌 10.7%，市场风格延续前一年趋势，显著偏向大盘价值。一带一路主题在一季度有所表现，但二季度以后相对市场有所落后。组合投资上，基于对市场的整体考虑，全年保持在略高于基准的仓位水平运作。报告期净值小幅跑赢基准，相比同行处于平均水平，对基本面趋势的判断能力需要努力提高。

结构方面，本基金继续围绕一带一路主题进行布局，行业配置主要集中在建筑、机械设备、电力设备、大消费等板块。上半年逐步减持了部分周期性行业，下半年主要减持了银行，增持的方向在于长期绝对收益机会较高的大消费以及成长性个股。全年来看，前期布局的金融、消费贡献较大，但对成长股选股成功率较低则形成一定拖累。

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 1.020 元，本报告期份额净值增长率为 14.99%，同期业绩比较基准增长率为 11.08%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2018 年开年以来，宏观经济指标延续四季度的调整态势，主要由于持续偏紧的货币环境以及下游地产汽车调整开始对产业链带来一定影响。从短期来看，春季小旺季有望推动经济出现小幅回升，产品价格敏感的行业有望较为受益。中长期看，海外货币政策从紧仍然是主基调，国内流动性也将难以真正意义上得到宽松，在缺少大规模财政政策刺激的情况下，年内宏观经济较有可能保持缓慢调整的态势。

关于一带一路战略，我们认为中国的国家意志与全球发展中国家对于更好经济增长的需求没有发生改变。这一战略在未来相当长的时期内具备广阔的发展空间。短期来看，也需要关注地缘政治变局可能带来的潜在风险。投资上，组合将继续围绕一带一路主题，同时关注具备高概率绝对收益机会的投资标的，力争为投资者实现稳健回报。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，公司合规监察稽核部从维护基金份额持有人利益、保障基金的合规运作出发，重点在法律事务、合规管理、内部稽核、信息披露、反洗钱、员工行为规范等方面开展工作，深化员工的合规意识，推动公司的合规文化和内部风险控制机制的完善与优化。

监察稽核工作重点集中于以下几个方面：

(1) 继续深化“主动合规”的管理理念，强化全体员工的合规意识和风险控制意识，通过定期组织员工进行职业道德规范、反洗钱、防范利益冲突、客户信息保密、销售适用性等方面的合规培训和内部审计，推动公司建立良好的内控环境和合规文化。

(2) 强化内控建设，持续进行投资管理人员合规培训，坚守“三条底线”；

(3) 做好在新基金产品开发、新投资品种、及其他创新业务中法律、合规及风险控制方面的支持，坚持定期对投资、研究、交易、核算、销售等相关业务活动的日常合规性检查。

(4) 推动落实公司投资、运营业务操作流程标准化，细化各相关部门在各业务环节的操作流程及工作职责，降低操作风险发生的概率。

(5) 按照法规的要求，做好旗下各只基金的信息披露工作，做到信息披露的真实、完整、准确、及时。

(6) 有计划地对公司投资研究、基金销售、后台运营等相关业务部门进行了多次全面或专项稽核，强化对公司制度执行和风控措施的落实。

本基金管理人承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范和控制各种风险，保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 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。

4.8 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。

4.9 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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在华安新丝路主题股票型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§6 审计报告

安永华明(2018)审字第 60971571_B22 号

华安新丝路主题股票型证券投资基金全体基金份额持有人：

我们审计了华安新丝路主题股票型证券投资基金的财务报表，包括 2017 年 12 月 31 日的资产负债表，2017 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。

6.1 审计意见

我们认为，后附的华安新丝路主题股票型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了华安新丝路主题股票型证券投资基金 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。

6.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于华安新丝路主题股票型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

6.3 其他信息

华安新丝路主题股票型证券投资基金管理层（以下简称管理层）对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。

我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。

结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。

基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。

6.4 管理层对财务报表的责任

管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时，管理层负责评估华安新丝路主题股票型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其

他现实的选择。

治理层负责监督华安新丝路主题股票型证券投资基金的财务报告过程。

6.5 注册会计师的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对华安新丝路主题股票型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致华安新丝路主题股票型证券投资基金不能持续经营。

(5) 评价财务报表的总体列报、结构和内容（包括披露），并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)

中国注册会计师

蒋燕华 蔡玉芝

上海市世纪大道 100 号环球金融中心 50 楼

2018 年 3 月 22 日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：华安新丝路主题股票型证券投资基金

报告截止日：2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	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	7.4.7.1	352,932,188.29	291,416,944.69
结算备付金		689,036.84	2,063,476.86
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	1,721,718,066.00	2,718,873,866.07
其中：股票投资		1,721,718,066.00	2,718,873,866.07
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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	300,000,570.00
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	73,606.32	185,120.29
应收股利		-	-
应收申购款		105,866.15	175,416.03
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		2,075,518,763.60	3,312,715,393.94
负债和所有者权益	附注号	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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		77,924,681.96	40,253,018.33
应付赎回款		5,445,428.06	1,937,657.50
应付管理人报酬	7.4.10.2	2,523,493.10	4,229,101.82
应付托管费	7.4.10.2	420,582.19	704,850.29
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	918,549.64	1,276,893.45
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	402,141.42	403,576.84
负债合计		87,634,876.37	48,805,098.23
所有者权益：		-	-
实收基金	7.4.7.9	1,948,149,533.58	3,679,551,638.57
未分配利润	7.4.7.10	39,734,353.65	-415,641,342.86
所有者权益合计		1,987,883,887.23	3,263,910,295.71
负债和所有者权益总计		2,075,518,763.60	3,312,715,393.94

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.020 元，基金份额总额 1,948,149,533.58 份。

7.2 利润表

会计主体：华安新丝路主题股票型证券投资基金

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	附注号	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		560,903,999.30	25,650,396.38
1.利息收入		5,772,208.89	8,104,293.67
其中：存款利息收入	7.4.7.11	3,188,818.92	2,646,013.40
债券利息收入		3,861.96	2,465,044.82
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		2,579,528.01	2,993,235.45
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		277,848,516.71	-314,032,263.18
其中：股票投资收益	7.4.7.12	216,134,230.76	-380,202,206.38
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	1,036,598.14	-249,770.00
资产支持证券投资收益	7.4.7.13	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	60,677,687.81	66,419,713.20
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	275,250,692.14	330,815,069.48
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	2,032,581.56	763,296.41
减：二、费用		60,852,226.53	63,806,688.41
1. 管理人报酬	7.4.10.2	45,282,441.32	49,671,224.46
2. 托管费	7.4.10.2	7,547,073.58	8,278,537.29
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	7,552,582.93	5,395,911.24
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-

6. 其他费用	7.4.7.20	470,128.70	461,015.42
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		500,051,772.77	-38,156,292.03
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		500,051,772.77	-38,156,292.03

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安新丝路主题股票型证券投资基金

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）	3,679,551,638.57	-415,641,342.86	3,263,910,295.71
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	500,051,772.77	500,051,772.77
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）	-1,731,402,104.99	-44,676,076.26	-1,776,078,181.25
其中：1.基金申购款	691,309,928.51	-13,432,525.18	677,877,403.33
2.基金赎回款	-2,422,712,033.50	-31,243,551.08	-2,453,955,584.58
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）	1,948,149,533.58	39,734,353.65	1,987,883,887.23

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）	4,397,110,381.26	-503,796,843.49	3,893,313,537.77
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-38,156,292.03	-38,156,292.03
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）	-717,558,742.69	126,311,792.66	-591,246,950.03
其中：1.基金申购款	155,534,556.83	-24,897,576.25	130,636,980.58
2.基金赎回款	-873,093,299.52	151,209,368.91	-721,883,930.61
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）	3,679,551,638.57	-415,641,342.86	3,263,910,295.71

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

华安新丝路主题股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)，系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2015]284 号《关于准予华安新丝路主题股票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 2015 年 4 月 9

日生效,首次设立募集规模为 7,822,760,569.56 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,基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票等权益类证券(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票、权证等)、股指期货、债券、货币市场工具、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。

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

本基金的投资组合比例为:股票资产投资比例为基金资产的 80%-95%,其中,投资于新丝路主题相关的证券资产的比例不低于非现金基金资产的 80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金业绩比较基准:80%×中证 800 指数收益率+20%×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 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相

关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年自 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

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主要包括股票投资、债券投资和衍生工具等；

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

(1) 股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

卖出股票于成交日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(2) 债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

(3) 权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(4) 股指期货投资

买入或卖出股指期货投资于成交日确认为股指期货投资。股指期货初始合约价值按成交金额确认；

股指期货平仓于成交日确认衍生工具投资收益，股指期货的初始合约价值按移动加权平均法于成交日结转；

(5) 分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价

值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

(6) 回购协议

本基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无

法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行

企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 资产支持证券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(8) 权证收益/（损失）于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(9) 股指期货投资收益/（损失）于平仓日确认，并按平仓成交金额与其初始合约价值的差额入账；

(10) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(11) 公允价值变动收益/（损失）系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、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(12) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 6 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(2) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(3) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(4) 每一基金份额享有同等分配权；

(5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在不违背法律法规及基金合同的规定、且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人经与托管人协商一致，可在中国证监会允许的条件下调整基金收益的分配原则，不需召开基金份额持有人大会。

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 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2017 年 12 月 31 日	2016 年 12 月 31 日
活期存款	352,932,188.29	291,416,944.69
定期存款	-	-
其他存款	-	-
合计	352,932,188.29	291,416,944.69

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末		
	2017 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,885,802,947.76	1,721,718,066.00	-164,084,881.76
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,885,802,947.76	1,721,718,066.00	-164,084,881.76
项目	上年度末		
	2016 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	3,158,209,439.97	2,718,873,866.07	-439,335,573.90
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-

债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		3,158,209,439.97	2,718,873,866.07	-439,335,573.90

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末均无衍生金融资产/负债余额。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
合计	-	-
项目	上年度末 2016 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	300,000,570.00	-
合计	300,000,570.00	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日

应收活期存款利息	73,308.40	61,292.16
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	297.92	928.82
应收债券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	122,880.55
应收申购款利息	-	18.76
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	-	-
合计	73,606.32	185,120.29

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末均无其他资产余额。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	912,263.57	1,249,566.95
银行间市场应付交易费用	6,286.07	27,326.50
合计	918,549.64	1,276,893.45

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	2,141.42	3,576.84
预提账户维护费	-	-
预提信息披露费	300,000.00	300,000.00
预提审计费用	100,000.00	100,000.00

合计	402,141.42	403,576.84
----	------------	------------

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	3,679,551,638.57	3,679,551,638.57
本期申购	691,309,928.51	691,309,928.51
本期赎回（以“-”号填列）	-2,422,712,033.50	-2,422,712,033.50
本期末	1,948,149,533.58	1,948,149,533.58

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-321,073,119.01	-94,568,223.85	-415,641,342.86
本期利润	224,801,080.63	275,250,692.14	500,051,772.77
本期基金份额交易产生的变动数	72,367,856.11	-117,043,932.37	-44,676,076.26
其中：基金申购款	-49,291,099.96	35,858,574.78	-13,432,525.18
基金赎回款	121,658,956.07	-152,902,507.15	-31,243,551.08
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-23,904,182.27	63,638,535.92	39,734,353.65

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
	活期存款利息收入	3,162,854.90

定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	24,273.64	21,110.04
其他	1,690.38	118.01
合计	3,188,818.92	2,646,013.40

7.4.7.12 股票投资收益

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
卖出股票成交总额	2,998,255,142.01	1,963,558,503.99
减：卖出股票成本总额	2,782,120,911.25	2,343,760,710.37
买卖股票差价收入	216,134,230.76	-380,202,206.38

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

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
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	1,036,598.14	-249,770.00
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	1,036,598.14	-249,770.00

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

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
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	34,925,460.10	226,001,465.41
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	33,885,000.00	220,362,760.00
减：应收利息总额	3,861.96	5,888,475.41

买卖债券差价收入	1,036,598.14	-249,770.00
----------	--------------	-------------

7.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益

7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入。

7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益——赎回差价收入。

7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益——申购差价收入。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益——其他投资收益。

7.4.7.16 股利收益

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
股票投资产生的股利收益	60,677,687.81	66,419,713.20
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	60,677,687.81	66,419,713.20

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	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
1.交易性金融资产	275,250,692.14	330,815,069.48
——股票投资	275,250,692.14	331,035,309.48
——债券投资	-	-220,240.00
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3.其他	-	-
合计	275,250,692.14	330,815,069.48

7.4.7.18 其他收入

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
基金赎回费收入	2,032,581.56	763,296.41
基金转换费收入	-	-
合计	2,032,581.56	763,296.41

7.4.7.19 交易费用

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
交易所市场交易费用	7,552,124.43	5,394,536.24
银行间市场交易费用	458.50	1,375.00
交易基金产生的费用	-	-
其中：申购费	-	-
赎回费	-	-

合计	7,552,582.93	5,395,911.24
----	--------------	--------------

7.4.7.20 其他费用

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
审计费用	100,000.00	100,000.00
信息披露费	300,000.00	300,000.00
银行汇划费用	52,128.70	42,815.42
帐户维护费	18,000.00	18,000.00
其他费用	-	200.00
合计	470,128.70	461,015.42

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

7.4.8.2资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，除 7.4.6.2 增值税中披露的事项外，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 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
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：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1月1日至2016年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
国泰君安	1,364,232,578.87	30.31%	-	-

7.4.10.1.2 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。

7.4.10.1.3 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。

7.4.10.1.4 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。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国泰君安	1,243,228.14	29.92%	362,691.65	39.76%

关联方名称	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
-	-	-	-	-

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年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	45,282,441.32	49,671,224.46
其中：支付销售机构的客户维护费	19,609,462.55	22,552,720.96

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

$$H = E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年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	7,547,073.58	8,278,537.29

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：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

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。

7.4.10.3 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
中国银行	-	51,207,370.49	-	-	-	-

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人于本报告期末及上年度末均未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资本基金。

7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2017年1月1日至2017年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

中国银行	352,932,188.29	3,162,854.90	291,416,944.69	2,624,785.35
------	----------------	--------------	----------------	--------------

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末进行利润分配。

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

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
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	-

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
00291	名臣健	2017-12	股票交	35.26	2018-0	38.79	821.00	10,311.76	28,948.46	-

9	康	-28	易异常波动		1-02					
---	---	-----	-------	--	------	--	--	--	--	--

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 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。

7.4.12.3.2 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。

7.4.13 金融工具风险及管理

本基金为股票型基金，基金的风险与预期收益都要高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金，属于证券投资基金中的高风险投资品种。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金重点投资于与新丝路主题相关的子行业或企业，在严格控制风险的前提下，力争把握标的行业投资机会实现基金资产的长期稳健增值。

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部等相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立合规与风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理和投资风险、绩效评估等。监察稽核部和风险管理部对公司执行总裁负责，并由督察长分管。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具，通过特定的风险量化指标、模型，形成常规的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行建设银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司

可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

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

计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017年12月31 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	352,932,188.29	-	-	-	352,932,188.29
结算备付金	689,036.84	-	-	-	689,036.84
交易性金融资产	-	-	-	1,721,718,066.00	1,721,718,066.00
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	73,606.32	73,606.32
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	105,866.15	105,866.15
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	353,621,225.13	-	-	1,721,897,538.47	2,075,518,763.60
负债					
应付托管费	-	-	-	420,582.19	420,582.19
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	918,549.64	918,549.64
应付税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	402,141.42	402,141.42
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	-	-	-	77,924,681.96	77,924,681.96

应付赎回款	-	-	-	5,445,428.06	5,445,428.06
应付管理人报酬	-	-	-	2,523,493.10	2,523,493.10
负债总计	-	-	-	87,634,876.37	87,634,876.37
利率敏感度缺口	353,621,225.13	-	-	1,634,262,662.10	1,987,883,887.23
上年度末 2016 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	291,416,944.69	-	-	-	291,416,944.69
结算备付金	2,063,476.86	-	-	-	2,063,476.86
交易性金融资产	-	-	-	2,718,873,866.07	2,718,873,866.07
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	300,000,570.00	-	-	-	300,000,570.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	185,120.29	185,120.29
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	175,416.03	175,416.03
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	593,480,991.55	-	-	2,719,234,402.39	3,312,715,393.94
负债					
应付托管费	-	-	-	704,850.29	704,850.29
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	1,276,893.45	1,276,893.45
应付税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	403,576.84	403,576.84
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	-	-	-	40,253,018.33	40,253,018.33

应付赎回款	-	-	-	1,937,657.50	1,937,657.50
应付管理人报酬	-	-	-	4,229,101.82	4,229,101.82
负债总计	-	-	-	48,805,098.23	48,805,098.23
利率敏感度缺口	593,480,991.55	-	-	2,670,429,304.16	3,263,910,295.71

注：1、表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早予以分类。

2、本基金于 2015 年 4 月 9 日成立，故无上年度末数据。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金于 2017 年 12 月 31 日未持有债券资产(2016 年 12 月 31 日：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2016 年 12 月 31 日：同)。

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金采取相对稳定的资产配置策略，一般情况下将保持股票配置比例的相对稳定，避免因过于主动的仓位调整带来额外的风险。在大类资产配置过程中，本基金将使用定量与定性相结合的研究方法对宏观经济、国家政策、资金面和市场情绪等可能影响证券市场的重要因素进行研究和预测，结合使用公司自主研发的多因子动态资产配置模型、基于投资时钟理论的资产配置模型等经济模型，分析和比较股票、债券等市场和不同金融工具的风险收益特征，确定合适的资产配置比例，动态优化投资组合。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金股票投资占基金资产的比例范围为 80%-95%，其中投资于新丝路主题相关的股票资产的比例不低于非现金基金资产的 80%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风

险度量，包括 VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日		上年度末 2016 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	1,721,718,066.00	86.61	2,718,873,866.07	83.30
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
合计	1,721,718,066.00	86.61	2,718,873,866.07	83.30

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
	业绩比较基准增加 5%	增加约 83,940,000.00	增加约 170,300,000.00
	业绩比较基准减少 5%	减少约 83,940,000.00	减少约 170,300,000.00

7.4.14 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 1,721,603,670.35 元,属于第二层次的余额为人民币 114,395.65 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 2,718,384,166.28 元,属于第二层次的余额为人民币 489,699.79 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	1,721,718,066.00	82.95
	其中：股票	1,721,718,066.00	82.95
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	353,621,225.13	17.04
8	其他各项资产	179,472.47	0.01
9	合计	2,075,518,763.60	100.00

8.2 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

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	97,084,332.85	4.88
B	采矿业	215,813,943.37	10.86
C	制造业	631,843,141.34	31.78
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,143.20	0.00
E	建筑业	324,947,250.00	16.35
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	17,957.94	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	53,668,574.10	2.70
J	金融业	59,850,900.00	3.01
K	房地产业	82,777,500.00	4.16

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	108,704,323.20	5.47
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	146,994,000.00	7.39
S	综合	-	-
	合计	1,721,718,066.00	86.61

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	002051	中工国际	7,650,000	140,989,500.00	7.09
2	000726	鲁泰A	10,990,000	120,340,500.00	6.05
3	601117	中国化学	17,333,000	116,997,750.00	5.89
4	601098	中南传媒	8,100,000	112,509,000.00	5.66
5	000069	华侨城A	12,800,000	108,672,000.00	5.47
6	002041	登海种业	7,555,201	97,084,332.85	4.88
7	600489	中金黄金	9,000,000	89,010,000.00	4.48
8	002262	恩华药业	6,001,218	85,577,368.68	4.30
9	600048	保利地产	5,850,000	82,777,500.00	4.16
10	000528	柳工	8,250,000	70,372,500.00	3.54
11	601857	中国石油	8,399,993	67,955,943.37	3.42
12	600612	老凤祥	1,649,997	67,913,876.52	3.42
13	600170	上海建工	18,000,000	66,960,000.00	3.37
14	002465	海格通信	6,510,000	62,430,900.00	3.14
15	601328	交通银行	9,570,000	59,429,700.00	2.99
16	600028	中国石化	9,600,000	58,848,000.00	2.96
17	601179	中国西电	13,200,551	57,686,407.87	2.90
18	600718	东软集团	3,660,885	53,668,574.10	2.70
19	000729	燕京啤酒	6,780,000	45,697,200.00	2.30
20	600479	千金药业	3,153,290	44,209,125.80	2.22
21	000895	双汇发展	1,500,000	39,750,000.00	2.00
22	300251	光线传媒	3,300,000	34,485,000.00	1.73
23	603686	龙马环卫	600,000	15,750,000.00	0.79

24	000768	中航飞机	780,000	13,174,200.00	0.66
25	300257	开山股份	300,000	4,200,000.00	0.21
26	002179	中航光电	60,000	2,362,800.00	0.12
27	000063	中兴通讯	30,000	1,090,800.00	0.05
28	000338	潍柴动力	60,000	500,400.00	0.03
29	300203	聚光科技	12,000	426,600.00	0.02
30	601336	新华保险	6,000	421,200.00	0.02
31	002920	德赛西威	4,569	178,784.97	0.01
32	300735	光弘科技	3,764	54,163.96	0.00
33	300664	鹏鹞环保	3,640	32,323.20	0.00
34	002919	名臣健康	821	28,948.46	0.00
35	002922	伊戈尔	1,245	22,248.15	0.00
36	603161	科华控股	1,239	20,753.25	0.00
37	603283	赛腾股份	1,349	19,614.46	0.00
38	603329	上海雅仕	1,183	17,957.94	0.00
39	002923	润都股份	954	16,227.54	0.00
40	603080	新疆火炬	1,187	16,143.20	0.00
41	300684	中石科技	827	11,528.38	0.00
42	603655	朗博科技	881	8,193.30	0.00

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	600048	保利地产	151,934,327.75	4.65
2	002041	登海种业	103,317,410.28	3.17
3	002465	海格通信	77,860,863.68	2.39
4	601117	中国化学	70,633,566.63	2.16
5	601857	中国石油	68,637,798.93	2.10
6	600362	江西铜业	65,755,732.14	2.01
7	002262	恩华药业	63,774,949.34	1.95
8	000069	华侨城 A	62,303,283.47	1.91
9	601336	新华保险	57,876,321.12	1.77
10	600718	东软集团	57,780,488.46	1.77
11	002051	中工国际	54,601,501.14	1.67
12	000726	鲁泰 A	51,319,146.09	1.57
13	601636	旗滨集团	44,205,467.55	1.35
14	600479	千金药业	43,310,938.73	1.33
15	601628	中国人寿	42,780,028.87	1.31

16	601328	交通银行	38,288,401.00	1.17
17	601098	中南传媒	36,062,496.73	1.10
18	600170	上海建工	35,122,541.08	1.08
19	000338	潍柴动力	30,591,516.55	0.94
20	600028	中国石化	29,550,000.00	0.91

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	000069	华侨城 A	207,076,541.84	6.34
2	601939	建设银行	193,622,492.59	5.93
3	601818	光大银行	188,627,988.52	5.78
4	000063	中兴通讯	178,087,406.85	5.46
5	600362	江西铜业	174,847,361.44	5.36
6	002302	西部建设	152,131,707.67	4.66
7	002051	中工国际	131,872,068.57	4.04
8	000528	柳 工	131,639,221.81	4.03
9	600585	海螺水泥	128,676,905.30	3.94
10	600048	保利地产	115,408,288.62	3.54
11	601328	交通银行	113,379,593.09	3.47
12	000338	潍柴动力	103,520,857.79	3.17
13	601628	中国人寿	100,702,980.41	3.09
14	601088	中国神华	94,294,051.41	2.89
15	601336	新华保险	85,095,510.44	2.61
16	600028	中国石化	82,273,397.49	2.52
17	601117	中国化学	82,045,072.46	2.51
18	000538	云南白药	78,247,091.55	2.40
19	000895	双汇发展	74,859,269.31	2.29
20	601668	中国建筑	67,743,072.80	2.08

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

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	1,509,714,419.04
卖出股票的收入（成交）总额	2,998,255,142.01

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所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期没有投资股指期货。

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 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。

8.12 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	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	73,606.32
5	应收申购款	105,866.15
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	179,472.47

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的情况。

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
35,584	54,747.91	76,095,798.35	3.91%	1,872,053,735.23	96.09%

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	273,288.75	0.01%

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、基金投资和研究部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间为 0；

本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 0。

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2015 年 4 月 9 日)基金份额总额	7,822,760,569.56
本报告期期初基金份额总额	3,679,551,638.57
本报告期基金总申购份额	691,309,928.51
减：本报告期基金总赎回份额	2,422,712,033.50
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,948,149,533.58

注：总申购份额含红利再投、转换入份额。总赎回份额含转换出份额。

§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 8 月，陈四清先生担任中国银行股份有限公司董事长、执行董事、董事会战略发展委员会主席及委员等职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

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	
国信证券	1	-	-	-	-	-
中信金通	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	1,430,792,220.87	31.79%	1,332,492.32	32.07%	-
国泰君安	1	1,364,232,578.87	30.31%	1,243,228.14	29.92%	-
中泰证券	1	1,145,556,793.85	25.45%	1,066,857.17	25.68%	-
长江证券	1	475,097,329.15	10.56%	432,956.56	10.42%	-
安信证券	1	84,874,165.67	1.89%	79,043.65	1.90%	-

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
国信证券	-	-	-	-	-	-
中信金通	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	200,000,000.00	58.82%	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	140,000,000.00	41.18%	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	34,925,460.10	100.00%	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华安基金关于增加民生银行为华安旗下部分基金代理销售机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-01-05
2	关于旗下部分基金增加济安财富为销售机构并参加费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-01-11
3	关于旗下部分基金增加泰诚财富为销售机构并参加费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-01-18
4	关于旗下部分基金增加北京肯特瑞为销售机构并参加费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-02-08
5	关于基金电子交易平台延长工行直联结算方式费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-02-13
6	关于旗下部分基金增加海峡银行为销售机构并参加费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》	2017-02-15

		和公司网站	
7	关于旗下部分基金增加朝阳永续为销售机构并参加费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2017-02-22
8	关于华安新丝路主题股票基金增加众升财富为销售机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2017-02-28
9	关于旗下部分基金增加华阳众惠为销售机构并参加费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2017-03-02
10	关于旗下部分基金增加华夏财富为销售机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2017-03-21
11	关于电子直销平台延长“微钱宝”账户交易费率优惠时间的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2017-03-28
12	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加通华财富为销售机构并参加费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2017-04-06
13	华安基金关于参加华宝证券优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2017-04-12
14	关于华安基金管理有限公司旗下基金参加交通银行费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2017-04-22
15	关于“微钱宝”快速取现服务升级的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2017-04-25
16	关于基金电子交易平台延长工行直联结算方式费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2017-05-10
17	关于旗下部分基金增加武汉伯嘉为销售机构并参加费率优惠的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2017-05-17
18	关于旗下部分基金增加江西正融为销售机构并参加费率优惠的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2017-05-24
19	关于旗下部分基金增加中民财富为销售机构并参加费率优惠的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2017-06-07
20	华安基金关于参加上海农商行优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2017-06-07
21	关于旗下部分基金增加科地瑞富为销售机构	《上海证券报》、《证券	2017-06-12

	并参加费率优惠的公告	时报》、《中国证券报》 和公司网站	
22	7 关于电子直销平台延长“微钱宝”账户交易费率优惠活动时间公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2017-06-02
23	关于华安基金管理有限公司旗下基金参加交通银行费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2017-06-30
24	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中大期货为销售机构并参加费率优惠的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2017-07-05
25	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加基煜基金为销售机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2017-07-18
26	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加锦安为销售机构并参加费率优惠的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2017-07-19
27	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加晋商银行为销售机构并参加费率优惠的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2017-07-20
28	华安基金关于旗下部分基金增加财路基金为销售机构并参加费率优惠的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2017-07-25
29	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“西部黄金”股票估值调整的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2017-08-03
30	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中原银行为销售机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2017-08-04
31	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加华信证券为销售机构并参加费率优惠的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2017-08-07
32	华安基金管理有限公司关于副总经理变更的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2017-08-09
33	华安基金关于参加东莞农商行优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2017-08-18
34	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加江南农商行为销售机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2017-08-19
35	华安基金关于参加江南银行优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2017-08-30

36	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加万家财富为销售机构并参加费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-09-05
37	华安基金管理有限公司关于基金电子交易平台延长工行直联结算方式费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-09-13
38	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加宜信普泽为销售机构并参加费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-09-15
39	华安基金关于参加长江证券优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-09-19
40	华安基金管理有限公司关于电子直销平台延长“微钱宝”账户交易费率优惠活动时间公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-09-27
41	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加前海欧中为销售机构并参加费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-09-29
42	关于旗下部分基金增加喜鹊金融为销售机构并参加费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-10-17
43	华安基金管理有限公司关于公司股东变更的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-10-17
44	关于旗下部分基金增加泛华普益为销售机构并参加费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-10-21
45	关于旗下部分基金增加华羿恒信为销售机构并参加费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-11-01
46	关于华安基金电子直销平台开通协助投资者购买合作商户实物黄金业务的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-11-02
47	关于华安旗下部分基金增加工商银行作为销售机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-11-04
48	华安基金管理有限公司关于旗下基金参加光大证券费率优惠的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-11-04
49	华安基金关于参加汇成基金优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-11-10
50	关于华安旗下部分基金增加蚂蚁基金为销售机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》	2017-11-11

		和公司网站	
51	华安基金关于参加中金公司优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2017-12-16
52	关于基金电子交易平台延长工行直联结算方式费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2017-12-19
53	华安基金关于参加苏州银行费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2017-12-26
54	关于华安基金管理有限公司旗下基金参加交通银行费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2017-12-29
55	华安基金关于参加东莞农商行优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2017-12-29

注：前款所涉重大事件已作为临时报告在《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站www.huaan.com.cn上披露。

12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、《华安新丝路主题股票型证券投资基金基金合同》
- 2、《华安新丝路主题股票型证券投资基金招募说明书》
- 3、《华安新丝路主题股票型证券投资基金托管协议》
- 4、中国证监会批准华安新丝路主题股票型证券投资基金设立的文件
- 5、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告原件
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 7、基金托管人业务资格批件和营业执照
- 8、华安基金管理有限公司开放式基金业务规则

13.2 存放地点

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

13.3 查阅方式

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

华安基金管理有限公司
二〇一八年三月二十七日