

华安沪港深通精选灵活配置混合型证券投资基金
2018 年半年度报告
2018 年 6 月 30 日

基金管理人：华安基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一八年八月二十四日

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 8 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	12
5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	16
7 投资组合报告	35
7.1 期末基金资产组合情况	35
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	35
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	37
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	46
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	46
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	46
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	46
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	46
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	47
7.12 投资组合报告附注	47
8 基金份额持有人信息	48
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	48

8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	48
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	49
9	开放式基金份额变动	49
10	重大事件揭示	49
10.1	基金份额持有人大会决议	49
10.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	49
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	49
10.4	基金投资策略的改变	49
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	49
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	49
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	49
10.7.2	基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况	51
10.8	其他重大事件	52
11	备查文件目录	55
11.1	备查文件目录	55
11.2	存放地点	55
11.3	查阅方式	55

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华安沪港深通精选灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	华安沪港深通精选灵活配置混合
基金主代码	001581
交易代码	001581
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 2 月 16 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	464,935,813.04 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制投资组合风险的前提下，通过大类资产的优化配置和高安全边际的证券精选，追求超越业绩比较基准的投资回报和资产的长期稳健增值。
投资策略	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。在本合同约定的投资比例范围内，本基金将根据宏观经济、估值水平、资金面、市场情绪等因素，制定并适时调整国内 A 股和香港（港股通标的股票）两地股票配置比例及投资策略。
业绩比较基准	30%×中证 800 指数收益率+30%×恒生综合指数收益率+40%×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。本基金将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。

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
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	北京市西城区金融大街25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	北京市西城区闹市口大街1号 院1号楼
邮政编码	200120	100033
法定代表人	朱学华	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.huaan.com.cn
基金半年度报告备置地点	上海市世纪大道 8 号上海国金中心二期 31 层、32 层

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	华安基金管理有限公司	上海市世纪大道 8 号上海国金中心二期 31 层、32 层

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	-6,748,653.67
本期利润	-4,881,272.01
加权平均基金份额本期利润	-0.0142
本期加权平均净值利润率	-1.04%
本期基金份额净值增长率	4.17%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	115,439,875.38
期末可供分配基金份额利润	0.2483
期末基金资产净值	611,115,113.97
期末基金份额净值	1.314
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2018 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	37.61%

注：1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如：封闭式基金交易佣金、开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-1.94%	1.12%	-3.89%	0.75%	1.95%	0.37%
过去三个月	0.67%	1.08%	-3.95%	0.64%	4.62%	0.44%
过去六个月	4.17%	1.31%	-4.13%	0.68%	8.30%	0.63%
过去一年	29.33%	1.22%	2.10%	0.55%	27.23%	0.67%
自基金合同生效起至今	37.61%	1.09%	5.43%	0.50%	32.18%	0.59%

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

华安沪港深通精选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历史走势对比图
 （2017年2月16日至2018年6月30日）



4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

华安基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1998]20 号文批准于 1998 年 6 月设立，是国内首批基金管理公司之一，注册资本 1.5 亿元人民币，公司总部设在上海陆家嘴金融贸易区。目前的股东为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 2018 年 6 月 30 日，公司旗下共管理华安创新混合、华安 MSCI 中国 A、华安现金富利货币、华安稳定收益债券、华安黄金易 ETF、华安沪港深外延增长混合、华安全球美元收益债券等 103 只开放式基金，管理资产规模达到 2,460.80 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	2017-02-16	-	14 年	博士研究生，14 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

					<p>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基金经理。2016年3月至2018年3月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。2016年3月至2018年2月同时担任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月至2018年2月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，同时担任本基金的基金经理。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，同时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>
高钥群	本基金的基金经理	2017-04-24	-	11年	<p>硕士研究生，11年证券、基金从业经验。历任 Longview Partners 资产管理公司数量分析员，高华证券有限责任公司行业及公司研究分析员，2011年2月加入华安基金，历任全球投资部研究员、助理投资经理。2017年4月起担任本基金的基金经理。</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。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、招募说明书等有关基金法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风

险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益，不存在违法违规或未履行基金合同承诺的情形。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

本基金管理人通过统计检验的方法对管理的不同投资组合，在不同时间窗下（日内、3日内、5

日内)的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。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

本报告期内,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 3 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

上半年,股票市场“过山车”走势明显,波动率加大。2 季度开始,美元指数走强,及美国加息,导致新兴市场风险资产承压。中国内部的金融清理及去杠杆使得国内 AH 市场在 2 季度表现不佳。

期内 S&P500 指数累计上涨 1.67%, 斯托克 50 指数下跌 3.09%, 而 MSCI 新兴市场指数累计下跌 7.60%, 新兴市场显著跑输发达市场。

香港市场,跟随新兴市场出现震荡走势,恒生指数下跌 4.39%,恒生国企指数下跌 5.43%。

在报告期内,基于我们对于市场结构的判断,我们重点配置了消费,医药、教育,半导体、等细分行业龙头的公司,2 季度末配置了受益于进一步供给侧改革的周期类股。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2018 年 6 月 30 日,本基金份额净值为 1.314 元,本报告期份额净值增长率为 4.17%,同期业绩比较基准增长率为-4.13%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市,我们判断下半年市场震荡走势,个股存在机会,因估值已经下跌到偏低水平。我们认为美元走强,及人民币贬值及宏观不确定性为最大的压制因素。在这种宏观环境下,我们认为盈

利确定性较高，现金流较好的行业(如大消费，部分公共事业)可以持续跑赢市场。

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 2018 年度第一次分红，分红方案为：0.630 元/10 份，权益登记日及除息日：2018 年 5 月 29 日；现金红利发放日：2018 年 5 月 30 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金额为 26,749,311.95 元。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华安沪港深通精选灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	268,924,042.47	12,710,483.44
结算备付金		27,987,050.54	5,780,957.32
存出保证金		563,172.66	601,417.66
交易性金融资产	6.4.7.2	363,856,323.61	145,526,006.41
其中：股票投资		363,856,323.61	145,526,006.41
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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	3,641,827.78
应收利息	6.4.7.5	52,176.61	6,790.54
应收股利		612,593.27	45,600.00
应收申购款		669,479.56	616,591.89
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		662,664,838.72	168,929,675.04
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
负 债：		-	-

短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		43,970,681.01	7,979,206.26
应付赎回款		2,628,269.01	703,058.31
应付管理人报酬		739,112.08	187,996.00
应付托管费		123,185.33	31,332.69
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	3,929,441.73	496,318.27
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	159,035.59	361,196.10
负债合计		51,549,724.75	9,759,107.63
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.9	464,935,813.04	120,472,440.16
未分配利润	6.4.7.10	146,179,300.93	38,698,127.25
所有者权益合计		611,115,113.97	159,170,567.41
负债和所有者权益总计		662,664,838.72	168,929,675.04

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.314 元，基金份额总额 464,935,813.04 份。

6.2 利润表

会计主体：华安沪港深通精选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 2 月 16 日（基 金合同生效日）至 2017 年 6 月 30 日
一、收入		7,523,042.01	23,400,936.97
1.利息收入		465,497.46	637,501.24
其中：存款利息收入	6.4.7.11	465,497.46	318,988.46
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	318,512.78
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		4,125,456.94	9,962,718.01
其中：股票投资收益	6.4.7.12	546,141.45	8,022,437.04
基金投资收益	6.4.7.13	-	-
债券投资收益	6.4.7.14	-	-

资产支持证券投资收益	6.4.7.15	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.16	-	-
衍生工具收益	6.4.7.17	-	-
股利收益	6.4.7.18	3,579,315.49	1,940,280.97
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	1,867,381.66	12,143,862.89
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	1,064,705.95	656,854.83
减：二、费用		12,404,314.02	4,663,746.72
1. 管理人报酬		3,479,282.29	1,845,385.34
2. 托管费		579,880.34	307,564.22
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.21	8,184,487.90	2,356,015.29
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.22	160,663.49	154,781.87
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-4,881,272.01	18,737,190.25
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-4,881,272.01	18,737,190.25

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安沪港深通精选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	120,472,440.16	38,698,127.25	159,170,567.41
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-4,881,272.01	-4,881,272.01
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）	344,463,372.88	139,111,757.64	483,575,130.52
其中：1.基金申购款	536,279,498.94	210,529,986.43	746,809,485.37
2.基金赎回款	-191,816,126.06	-71,418,228.79	-263,234,354.85
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	-	-26,749,311.95	-26,749,311.95

填列)			
五、期末所有者权益（基金净值）	464,935,813.04	146,179,300.93	611,115,113.97
项目	上年度可比期间 2017 年 2 月 16 日（基金合同生效日）至 2017 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	397,870,618.87	-	397,870,618.87
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	18,737,190.25	18,737,190.25
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）	-201,155,550.73	-6,199,201.72	-207,354,752.45
其中：1.基金申购款	8,786,107.44	132,678.47	8,918,785.91
2.基金赎回款	-209,941,658.17	-6,331,880.19	-216,273,538.36
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）	196,715,068.14	12,537,988.53	209,253,056.67

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：朱学华，主管会计工作负责人：赵敏，会计机构负责人：陈林

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华安沪港深通精选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]1286 号《关于准予华安沪港深通精选灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》以及机构部函[2016]2905 号《关于华安沪港深通精选灵活配置混合型证券投资基金延期募集备案的回函》的核准，由基金管理人华安基金管理有限公司自 2017 年 1 月 9 日到 2017 年 2 月 13 日止期间向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具安永华明（2017）验字第 60971571_B03 号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2017 年 2 月 16 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 397,659,110.87 元，在募集期间产生的存款利息为人民币 211,508.00 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 397,870,618.87 元，折合 397,870,618.87 份

基金份额。本基金的基金管理人及注册登记机构为华安基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（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%；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。

本基金的业绩比较基准为：30%×中证 800 指数收益率+30%×恒生综合指数收益率+40%×中国债券总指数收益率。

6.4.2 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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2018 年 6 月 30 日的财务状况以及 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

6.4.6.1 印花税

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

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

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

6.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，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。

6.4.6.3 企业所得税

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

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

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

6.4.6.4 个人所得税

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

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

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

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

6.4.6.5 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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
----	------------------------

活期存款	268,924,042.47
定期存款	-
其他存款	-
合计	268,924,042.47

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	352,516,382.83	363,856,323.61	11,339,940.78
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	352,516,382.83	363,856,323.61	11,339,940.78

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	47,469.67
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	4,579.23
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	127.71
合计	52,176.61

6.4.7.6 其他资产

无余额。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	3,929,441.73
银行间市场应付交易费用	-
合计	3,929,441.73

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	5,310.48
预提审计费	24,795.19
预提信息披露费	128,929.92
合计	159,035.59

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	120,472,440.16	120,472,440.16
本期申购	536,279,498.94	536,279,498.94
本期赎回（以“-”号填列）	-191,816,126.06	-191,816,126.06
本期末	464,935,813.04	464,935,813.04

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	36,153,727.21	2,544,400.04	38,698,127.25
本期利润	-6,748,653.67	1,867,381.66	-4,881,272.01
本期基金份额交易产生的变动数	112,784,113.79	26,327,643.85	139,111,757.64
其中：基金申购款	171,801,276.02	38,728,710.41	210,529,986.43
基金赎回款	-59,017,162.23	-12,401,066.56	-71,418,228.79
本期已分配利润	-26,749,311.95	-	-26,749,311.95
本期末	115,439,875.38	30,739,425.55	146,179,300.93

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	369,814.79
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	81,096.99
其他	14,585.68
合计	465,497.46

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	2,297,661,061.01
减：卖出股票成本总额	2,297,114,919.56
买卖股票差价收入	546,141.45

6.4.7.13 基金投资收益

本基金本报告期无基金投资收益。

6.4.7.14 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.15 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.17 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.18 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
股票投资产生的股利收益	3,579,315.49
基金投资产生的股利收益	-
合计	3,579,315.49

6.4.7.19 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
1.交易性金融资产	1,867,381.66
——股票投资	1,867,381.66
——债券投资	-
——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	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	1,867,381.66

6.4.7.20 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
基金赎回费收入	1,064,705.95
合计	1,064,705.95

6.4.7.21 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	8,184,487.90
银行间市场交易费用	-
合计	8,184,487.90

6.4.7.22 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2018年1月1日至2018年6月30日
审计费用	24,795.19
信息披露费	128,929.92
银行汇划费用	6,578.38
其他费用	360.00
合计	160,663.49

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华安基金管理有限公司(“华安基金公司”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	基金托管人、基金代销机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月 30日	上年度可比期间 2017年2月16日(基金合同生 效日)至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	3,479,282.29	1,845,385.34
其中：支付销售机构的客户维护费	1,066,028.78	1,069,796.40

注：基金管理费按前一日基金资产净值的 1.5% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% / \text{当年天数}$$

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月 30日	上年度可比期间 2017年2月16日(基金合同 生效日)至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	579,880.34	307,564.22

注：基金托管费按前一日基金资产净值的 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。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年2月16日（基金合同生效 日）至2017年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	268,924,042.47	369,814.79	12,090,137.11	260,660.89

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日	每 10 份 基金份额	现金形式 发放总额	再投资形 式发放总	利润分配合 计	备注
----	-------	-----	----------------	--------------	--------------	------------	----

		场 内	场 外	分红数		额		
-	2018-05-29	-	2018-05-29	0.630	21,927,451.95	4,821,860.00	26,749,311.95	-
合计				0.630	21,927,451.95	4,821,860.00	26,749,311.95	-

6.4.12 期末（2018 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
603105	芯能科技	2018-06-29	2018-07-09	网下中签	4.83	4.83	3,410.00	16,470.30	16,470.30	-
603693	江苏新能	2018-06-25	2018-07-03	网下中签	9.00	9.00	5,384.00	48,456.00	48,456.00	-
603706	东方环宇	2018-06-29	2018-07-09	网下中签	13.09	13.09	1,765.00	23,103.85	23,103.85	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2018 年 6 月 30 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证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2018 年 6 月 30 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证券款余额。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金为混合型基金，基金的风险与预期收益都要低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金，属于证券投资基金中的中等风险和中等收益投资品种。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。本基金在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报和资产的长期稳健增值。

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。本公司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经中国人民银行和中国证券监督管理委员会所批准的具有基金托管资格和基金代销资格的银行，并根据本公司管理交易对手的经验进行筛选，因而与这些银行存款相关的信用风险不重大。本基金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；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。

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

6.4.13.3 流动性风险

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

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

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持证券均在证券交易所上市，因此除附注中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。

6.4.13.3.1 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、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间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。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。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2018 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	268,924,042.47	-	-	-	268,924,042.4

					7
结算备付金	27,987,050.54	-	-	-	27,987,050.54
存出保证金	563,172.66	-	-	-	563,172.66
交易性金融资产	-	-	-	363,856,323.61	363,856,323.61
应收利息	-	-	-	52,176.61	52,176.61
应收股利	-	-	-	612,593.27	612,593.27
应收申购款	-	-	-	669,479.56	669,479.56
资产总计	297,474,265.67	-	-	365,190,573.05	662,664,838.72
负债					
应付证券清算款	-	-	-	43,970,681.01	43,970,681.01
应付赎回款	-	-	-	2,628,269.01	2,628,269.01
应付管理人报酬	-	-	-	739,112.08	739,112.08
应付托管费	-	-	-	123,185.33	123,185.33
应付交易费用	-	-	-	3,929,441.73	3,929,441.73
其他负债	-	-	-	159,035.59	159,035.59
负债总计	-	-	-	51,549,724.75	51,549,724.75
利率敏感度缺口	297,474,265.67	-	-	313,640,848.30	611,115,113.97
上年度末 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	12,710,483.44	-	-	-	12,710,483.44
结算备付金	5,780,957.32	-	-	-	5,780,957.32
存出保证金	601,417.66	-	-	-	601,417.66
交易性金融资产	-	-	-	145,526,006.41	145,526,006.41
应收证券清算款	-	-	-	3,641,827.78	3,641,827.78
应收利息	-	-	-	6,790.54	6,790.54
应收股利	-	-	-	45,600.00	45,600.00
应收申购款	-	-	-	616,591.89	616,591.89
资产总计	19,092,858.42	-	-	149,836,816.62	168,929,675.04
负债					
应付证券清算款	-	-	-	7,979,206.26	7,979,206.26

应付赎回款	-	-	-	703,058.31	703,058.31
应付管理人报酬	-	-	-	187,996.00	187,996.00
应付托管费	-	-	-	31,332.69	31,332.69
应付交易费用	-	-	-	496,318.27	496,318.27
其他负债	-	-	-	361,196.10	361,196.10
负债总计	-	-	-	9,759,107.63	9,759,107.63
利率敏感度缺口	19,092,858.42	-	-	140,077,708.99	159,170,567.41

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

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。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。本基金投资组合中股票占基金资产的比例为 0-95%；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%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日		上年度末 2017 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	363,856,323.61	59.54	145,526,006.41	91.43
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	363,856,323.61	59.54	145,526,006.41	91.43

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注 7.4.1)以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位: 人民币万元)	
		本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	增加约 5,190	增加约 1,734
	业绩比较基准下降 5%	减少约 5,190	减少约 1,734

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

1 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。

2 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。

3 财务报表的批准

本财务报表已于 2018 年 8 月 23 日经本基金的基金管理人批准。

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	363,856,323.61	54.91
	其中：股票	363,856,323.61	54.91
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	296,911,093.01	44.81
8	其他各项资产	1,897,422.10	0.29
9	合计	662,664,838.72	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	37,368,202.46	6.11
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	71,559.85	0.01
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	24,302,896.40	3.98
G	交通运输、仓储和邮政业	11,953,760.00	1.96

H	住宿和餐饮业	14,186,190.59	2.32
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,708,480.00	1.10
J	金融业	-	-
K	房地产业	12,651,245.00	2.07
L	租赁和商务服务业	15,504,131.10	2.54
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	81,226.14	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	6,470,832.00	1.06
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	129,298,523.54	21.16

7.2.2 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（%）
基础材料	9,520,791.06	1.56
消费者非必需品	49,880,696.27	8.16
消费者常用品	5,914,304.34	0.97
金融	32,521,140.80	5.32
医疗保健	25,139,415.42	4.11
工业	12,098,485.00	1.98
信息技术	73,679,554.44	12.06
房地产	25,803,412.74	4.22
合计	234,557,800.07	38.38

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	00700	腾讯控股	88,300	29,316,728.47	4.80
2	01658	邮储银行	3,983,000	17,159,723.90	2.81
3	01030	新城发展控股	2,828,000	16,928,436.28	2.77
4	01347	华虹半导体	686,000	15,586,979.87	2.55
5	601888	中国国旅	240,710	15,504,131.10	2.54
6	01299	友邦保险	265,600	15,361,416.90	2.51

7	603708	家家悦	675,160	14,846,768.40	2.43
8	02313	申洲国际	180,000	14,697,762.30	2.41
9	600258	首旅酒店	522,127	14,186,190.59	2.32
10	01317	枫叶教育	1,180,000	14,067,292.12	2.30
11	01177	中国生物制药	1,270,000	12,891,673.48	2.11
12	601155	新城控股	408,500	12,651,245.00	2.07
13	01093	石药集团	612,955	12,247,741.94	2.00
14	00586	海螺创业	500,000	12,098,485.00	1.98
15	601006	大秦铁路	1,456,000	11,953,760.00	1.96
16	600809	山西汾酒	189,400	11,911,366.00	1.95
17	00839	中教控股	1,034,000	11,507,303.28	1.88
18	00354	中国软件国际	2,000,000	10,319,544.00	1.69
19	03888	金山软件	490,000	9,832,232.20	1.61
20	00175	吉利汽车	559,000	9,590,810.52	1.57
21	00189	东岳集团	1,711,000	9,520,791.06	1.56
22	002024	苏宁易购	671,600	9,456,128.00	1.55
23	300567	精测电子	115,000	9,154,000.00	1.50
24	00813	世茂房地产	511,000	8,874,976.46	1.45
25	300532	今天国际	384,000	6,708,480.00	1.10
26	002044	美年健康	286,320	6,470,832.00	1.06
27	600596	新安股份	375,600	6,073,452.00	0.99
28	600305	恒顺醋业	593,626	5,437,614.16	0.89
29	000672	上峰水泥	530,000	4,775,300.00	0.78
30	02382	舜宇光学科技	35,200	4,332,859.52	0.71
31	00981	中芯国际	499,000	4,291,210.38	0.70
32	00506	中国食品	866,000	2,986,209.61	0.49
33	06808	高鑫零售	338,500	2,928,094.73	0.48
34	601330	绿色动力	4,971	81,226.14	0.01
35	603693	江苏新能	5,384	48,456.00	0.01
36	603706	东方环宇	1,765	23,103.85	0.00
37	02255	海昌海洋公园	11,000	17,528.05	0.00
38	603105	芯能科技	3,410	16,470.30	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	00700	腾讯控股	57,770,474.72	36.29
2	600258	首旅酒店	51,089,559.03	32.10
3	00670	中国东方航空股份	49,107,245.55	30.85

4	00753	中国国航	43,011,360.11	27.02
5	300017	网宿科技	41,350,680.12	25.98
6	601888	中国国旅	41,334,787.80	25.97
7	01030	新城发展控股	38,586,780.89	24.24
8	601155	新城控股	37,160,317.77	23.35
9	02382	舜宇光学科技	36,870,785.46	23.16
10	01055	中国南方航空股份	35,617,503.12	22.38
11	300122	智飞生物	33,533,400.43	21.07
12	01177	中国生物制药	33,184,108.32	20.85
13	00916	龙源电力	30,549,527.54	19.19
14	00175	吉利汽车	29,677,261.42	18.64
15	01093	石药集团	29,114,811.03	18.29
16	01398	工商银行	28,740,155.93	18.06
17	000636	风华高科	28,497,269.00	17.90
18	300618	寒锐钴业	27,195,769.00	17.09
19	01347	华虹半导体	27,137,791.78	17.05
20	600276	恒瑞医药	26,308,985.85	16.53
21	00998	中信银行	24,902,255.11	15.65
22	000932	华菱钢铁	24,370,243.52	15.31
23	002737	葵花药业	24,187,496.12	15.20
24	01299	友邦保险	23,807,421.61	14.96
25	02388	中银香港	23,608,691.55	14.83
26	000963	华东医药	22,048,303.25	13.85
27	603708	家家悦	21,942,638.04	13.79
28	600867	通化东宝	21,792,102.93	13.69
29	001979	招商蛇口	21,248,817.00	13.35
30	300347	泰格医药	21,241,059.08	13.34
31	03883	中国奥园	21,191,215.57	13.31
32	00354	中国软件国际	20,539,480.02	12.90
33	600887	伊利股份	20,329,367.84	12.77
34	02018	瑞声科技	20,135,158.45	12.65
35	00586	海螺创业	20,073,496.70	12.61
36	01918	融创中国	19,943,201.83	12.53
37	00570	中国中药	19,637,740.70	12.34
38	01658	邮储银行	19,310,210.40	12.13
39	600305	恒顺醋业	19,019,398.41	11.95
40	600115	东方航空	18,568,158.78	11.67
41	000672	上峰水泥	18,501,069.00	11.62
42	000977	浪潮信息	18,478,986.50	11.61
43	02208	金风科技	18,237,221.35	11.46
44	03968	招商银行	17,838,951.96	11.21
45	00839	中教控股	17,652,765.33	11.09
46	02313	申洲国际	17,283,452.15	10.86
47	600690	青岛海尔	17,174,276.09	10.79

48	03888	金山软件	16,742,070.83	10.52
49	00189	东岳集团	16,522,055.38	10.38
50	00880	澳博控股	16,461,031.81	10.34
51	01317	枫叶教育	16,378,823.32	10.29
52	600048	保利地产	15,939,416.06	10.01
53	002195	二三四五	15,810,092.20	9.93
54	600486	扬农化工	15,558,762.68	9.77
55	03380	龙光地产	15,481,062.81	9.73
56	002475	立讯精密	15,396,696.23	9.67
57	300036	超图软件	14,930,588.40	9.38
58	01171	兖州煤业股份	14,825,709.36	9.31
59	01128	永利澳门	14,568,880.16	9.15
60	02318	中国平安	14,378,830.43	9.03
61	02328	中国财险	14,202,002.34	8.92
62	002044	美年健康	14,131,010.20	8.88
63	300015	爱尔眼科	13,861,811.52	8.71
64	300567	精测电子	13,771,616.00	8.65
65	00868	信义玻璃	13,603,841.87	8.55
66	000895	双汇发展	13,480,585.28	8.47
67	601006	大秦铁路	13,210,418.30	8.30
68	600062	华润双鹤	13,124,321.24	8.25
69	002236	大华股份	12,998,504.00	8.17
70	00762	中国联通	12,956,138.99	8.14
71	000858	五 粮 液	12,931,489.91	8.12
72	002110	三钢闽光	12,920,929.00	8.12
73	600711	盛屯矿业	12,903,664.00	8.11
74	002466	天齐锂业	12,881,636.10	8.09
75	002027	分众传媒	12,871,248.20	8.09
76	000961	中南建设	12,588,463.00	7.91
77	600596	新安股份	12,574,233.52	7.90
78	00883	中国海洋石油	12,474,016.92	7.84
79	02202	万科企业	12,443,187.90	7.82
80	300532	今天国际	12,369,244.44	7.77
81	600507	方大特钢	12,344,270.84	7.76
82	02196	复星医药	12,303,833.67	7.73
83	600809	山西汾酒	12,263,382.00	7.70
84	002024	苏宁易购	12,224,212.04	7.68
85	00027	银河娱乐	12,177,895.33	7.65
86	603359	东珠生态	12,080,901.88	7.59
87	002727	一心堂	12,052,590.00	7.57
88	000703	恒逸石化	11,904,685.30	7.48
89	603589	口子窖	11,691,624.63	7.35
90	00817	中国金茂	11,305,693.90	7.10
91	601003	柳钢股份	11,271,257.16	7.08

92	600007	中国国贸	11,143,794.31	7.00
93	601600	中国铝业	11,132,113.00	6.99
94	03323	中国建材	10,987,842.23	6.90
95	601877	正泰电器	10,813,376.38	6.79
96	00966	中国太平	10,355,014.60	6.51
97	00656	复星国际	10,020,431.65	6.30
98	01044	恒安国际	9,868,342.31	6.20
99	00011	恒生银行	9,762,331.54	6.13
100	603387	基蛋生物	9,722,056.60	6.11
101	02607	上海医药	9,604,064.79	6.03
102	600521	华海药业	9,563,985.50	6.01
103	00813	世茂房地产	9,373,905.43	5.89
104	300178	腾邦国际	9,371,700.03	5.89
105	603156	养元饮品	9,327,089.25	5.86
106	002001	新 和 成	9,268,055.00	5.82
107	02007	碧桂园	9,103,292.76	5.72
108	002867	周大生	8,833,269.64	5.55
109	00763	中兴通讯	8,730,060.70	5.48
110	600332	白云山	8,683,868.80	5.46
111	06169	宇华教育	8,659,373.21	5.44
112	06869	长飞光纤光缆	8,658,558.72	5.44
113	600197	伊力特	8,581,978.00	5.39
114	600196	复星医药	8,579,361.00	5.39
115	601233	桐昆股份	8,553,166.00	5.37
116	601111	中国国航	8,540,517.00	5.37
117	002597	金禾实业	8,540,171.00	5.37
118	600519	贵州茅台	8,369,999.00	5.26
119	600720	祁连山	8,271,239.00	5.20
120	002304	洋河股份	8,225,616.00	5.17
121	000333	美的集团	8,052,240.00	5.06
122	00388	香港交易所	7,979,976.98	5.01
123	01997	九龙仓置业	7,930,680.76	4.98
124	600216	浙江医药	7,376,438.67	4.63
125	600282	南钢股份	7,375,789.00	4.63
126	01288	农业银行	7,276,882.13	4.57
127	002648	卫星石化	7,156,071.00	4.50
128	300059	东方财富	7,122,409.18	4.47
129	03933	联邦制药	6,899,141.90	4.33
130	603707	健友股份	6,739,266.00	4.23
131	00981	中芯国际	6,728,384.41	4.23
132	600600	青岛啤酒	6,653,998.00	4.18
133	000799	酒鬼酒	6,534,213.81	4.11
134	00902	华能国际电力股份	6,509,594.28	4.09
135	002680	ST 长生	6,478,176.15	4.07

136	002341	新纶科技	6,432,220.00	4.04
137	002851	麦格米特	6,426,352.62	4.04
138	002094	青岛金王	6,424,667.00	4.04
139	01919	中远海控	6,424,568.97	4.04
140	002217	合力泰	6,391,532.00	4.02
141	300326	凯利泰	6,377,662.62	4.01
142	002422	科伦药业	6,299,115.00	3.96
143	600188	兖州煤业	6,243,207.00	3.92
144	600801	华新水泥	6,243,032.00	3.92
145	002318	久立特材	6,152,556.80	3.87
146	00874	白云山	6,085,038.07	3.82
147	01530	三生制药	6,069,720.58	3.81
148	300012	华测检测	6,063,514.36	3.81
149	002321	华英农业	6,037,608.21	3.79
150	00688	中国海外发展	6,024,058.15	3.78
151	00066	港铁公司	6,017,052.69	3.78
152	01257	中国光大绿色环保	6,011,010.01	3.78
153	603986	兆易创新	5,918,574.00	3.72
154	603288	海天味业	5,764,815.00	3.62
155	600298	安琪酵母	5,703,233.48	3.58
156	002258	利尔化学	5,562,320.00	3.49
157	01088	中国神华	5,516,921.63	3.47
158	600055	万东医疗	5,322,687.00	3.34
159	01313	华润水泥控股	5,289,099.78	3.32
160	00857	中国石油股份	5,143,237.95	3.23
161	02357	中航科工	5,106,792.09	3.21
162	002531	天顺风能	4,923,239.22	3.09
163	00958	华能新能源	4,829,347.30	3.03
164	300226	上海钢联	4,790,563.00	3.01
165	002202	金风科技	4,765,674.50	2.99
166	002709	天赐材料	4,720,729.00	2.97
167	02282	美高梅中国	4,610,747.29	2.90
168	601992	金隅集团	4,276,448.65	2.69
169	002343	慈文传媒	4,207,588.00	2.64
170	601688	华泰证券	4,203,010.70	2.64
171	06886	HTSC	4,179,441.63	2.63
172	03908	中金公司	4,108,848.02	2.58
173	00386	中国石油化工股份	4,084,811.01	2.57
174	002242	九阳股份	3,921,994.00	2.46
175	01458	周黑鸭	3,797,634.49	2.39
176	02689	玖龙纸业	3,709,693.76	2.33
177	600138	中青旅	3,644,233.00	2.29
178	600763	通策医疗	3,628,339.10	2.28
179	600340	华夏幸福	3,594,420.00	2.26

180	01208	五矿资源	3,309,567.49	2.08
-----	-------	------	--------------	------

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	00670	中国东方航空股份	54,299,371.52	34.11
2	300017	网宿科技	44,676,402.21	28.07
3	00753	中国国航	44,468,070.49	27.94
4	01055	中国南方航空股份	42,652,950.21	26.80
5	600258	首旅酒店	38,166,806.59	23.98
6	02382	舜宇光学科技	36,097,898.21	22.68
7	00700	腾讯控股	35,919,784.49	22.57
8	300122	智飞生物	35,407,557.64	22.25
9	00916	龙源电力	34,243,914.57	21.51
10	01398	工商银行	31,203,195.23	19.60
11	601888	中国国旅	30,064,791.55	18.89
12	000636	风华高科	28,531,950.71	17.93
13	600276	恒瑞医药	28,330,860.76	17.80
14	300618	寒锐钴业	27,480,742.39	17.26
15	000932	华菱钢铁	25,678,078.34	16.13
16	601155	新城控股	24,969,541.00	15.69
17	002737	葵花药业	24,659,736.19	15.49
18	00998	中信银行	24,263,293.91	15.24
19	02388	中银香港	23,579,310.18	14.81
20	300347	泰格医药	23,429,304.92	14.72
21	01093	石药集团	23,338,987.05	14.66
22	600867	通化东宝	23,102,154.06	14.51
23	000963	华东医药	21,904,450.00	13.76
24	600887	伊利股份	21,418,597.85	13.46
25	01030	新城发展控股	21,241,659.43	13.35
26	01177	中国生物制药	21,130,598.91	13.28
27	00175	吉利汽车	20,873,061.40	13.11
28	00570	中国中药	20,823,185.45	13.08
29	01918	融创中国	20,441,326.51	12.84
30	00880	澳博控股	20,293,416.78	12.75
31	01171	兖州煤业股份	19,992,746.65	12.56
32	600115	东方航空	19,962,197.75	12.54
33	01347	华虹半导体	19,938,422.57	12.53
34	001979	招商蛇口	19,907,071.00	12.51

35	03883	中国奥园	19,776,186.75	12.42
36	000977	浪潮信息	19,506,256.00	12.25
37	02018	瑞声科技	18,395,717.91	11.56
38	600048	保利地产	17,570,672.72	11.04
39	03968	招商银行	17,454,738.02	10.97
40	02318	中国平安	17,258,962.75	10.84
41	600486	扬农化工	16,526,673.28	10.38
42	02328	中国财险	16,068,389.16	10.10
43	002195	二三四五	15,939,456.70	10.01
44	02208	金风科技	15,877,743.29	9.98
45	600690	青岛海尔	15,432,359.50	9.70
46	002001	新 和 成	15,200,305.53	9.55
47	03380	龙光地产	15,124,195.18	9.50
48	00868	信义玻璃	15,116,843.36	9.50
49	000703	恒逸石化	14,804,829.32	9.30
50	601600	中国铝业	14,709,000.00	9.24
51	300015	爱尔眼科	14,624,848.43	9.19
52	002475	立讯精密	14,490,524.84	9.10
53	600305	恒顺醋业	14,459,122.34	9.08
54	01128	永利澳门	14,372,131.36	9.03
55	300036	超图软件	14,294,747.17	8.98
56	000895	双汇发展	14,004,648.32	8.80
57	603589	口子窖	13,656,113.00	8.58
58	00817	中国金茂	13,605,220.65	8.55
59	00966	中国太平	13,593,526.35	8.54
60	000672	上峰水泥	13,522,483.00	8.50
61	00883	中国海洋石油	13,197,106.26	8.29
62	000961	中南建设	13,110,376.52	8.24
63	600062	华润双鹤	13,043,026.16	8.19
64	600711	盛屯矿业	13,001,651.72	8.17
65	000858	五 粮 液	12,978,558.99	8.15
66	002236	大华股份	12,965,781.41	8.15
67	03323	中国建材	12,868,166.59	8.08
68	002466	天齐锂业	12,817,629.60	8.05
69	00762	中国联通	12,805,207.92	8.04
70	002110	三钢闽光	12,795,991.01	8.04
71	00027	银河娱乐	12,717,572.66	7.99
72	603359	东珠生态	12,375,023.34	7.77
73	02196	复星医药	12,314,811.68	7.74
74	01317	枫叶教育	12,205,732.01	7.67
75	600507	方大特钢	12,197,081.90	7.66
76	01044	恒安国际	12,087,753.06	7.59
77	000333	美的集团	11,779,483.32	7.40
78	02202	万科企业	11,578,101.07	7.27

79	002727	一心堂	11,521,410.54	7.24
80	002027	分众传媒	11,396,740.40	7.16
81	601877	正泰电器	11,277,923.00	7.09
82	600007	中国国贸	10,893,010.50	6.84
83	601003	柳钢股份	10,861,601.57	6.82
84	00656	复星国际	10,128,562.05	6.36
85	01299	友邦保险	9,649,693.79	6.06
86	00011	恒生银行	9,533,833.47	5.99
87	06869	长飞光纤光缆	9,529,334.59	5.99
88	300178	腾邦国际	9,378,993.04	5.89
89	600521	华海药业	9,329,883.60	5.86
90	603156	养元饮品	9,113,934.47	5.73
91	00763	中兴通讯	9,104,953.96	5.72
92	02313	申洲国际	9,070,042.67	5.70
93	00354	中国软件国际	9,068,681.70	5.70
94	603387	基蛋生物	9,059,156.20	5.69
95	02607	上海医药	8,856,383.42	5.56
96	601233	桐昆股份	8,751,233.65	5.50
97	600196	复星医药	8,594,255.56	5.40
98	601111	中国国航	8,552,700.00	5.37
99	00586	海螺创业	8,355,699.86	5.25
100	06169	宇华教育	8,286,027.34	5.21
101	600720	祁连山	8,274,260.00	5.20
102	002597	金禾实业	8,233,876.57	5.17
103	02007	碧桂园	8,179,754.75	5.14
104	600332	白云山	8,145,267.26	5.12
105	600519	贵州茅台	8,077,411.00	5.07
106	002867	周大生	8,053,338.03	5.06
107	002044	美年健康	7,952,494.50	5.00
108	600197	伊力特	7,823,398.00	4.92
109	002304	洋河股份	7,804,812.00	4.90
110	01997	九龙仓置业	7,686,234.57	4.83
111	603708	家家悦	7,381,499.08	4.64
112	03888	金山软件	7,333,581.43	4.61
113	300059	东方财富	7,298,917.08	4.59
114	02282	美高梅中国	7,256,411.51	4.56
115	00388	香港交易所	7,176,331.51	4.51
116	600282	南钢股份	7,023,232.00	4.41
117	600216	浙江医药	7,009,883.80	4.40
118	002648	卫星石化	6,975,682.32	4.38
119	002422	科伦药业	6,920,092.05	4.35
120	600600	青岛啤酒	6,876,148.00	4.32
121	01288	农业银行	6,758,481.11	4.25
122	000799	酒鬼酒	6,644,116.00	4.17

123	600596	新安股份	6,491,752.00	4.08
124	002094	青岛金王	6,483,201.00	4.07
125	03933	联邦制药	6,461,784.36	4.06
126	603707	健友股份	6,436,221.00	4.04
127	603288	海天味业	6,309,120.89	3.96
128	300326	凯利泰	6,266,402.96	3.94
129	600801	华新水泥	6,175,153.00	3.88
130	00902	华能国际电力股份	6,148,279.76	3.86
131	600036	招商银行	6,142,340.33	3.86
132	002680	长生生物	6,134,376.00	3.85
133	00874	白云山	6,103,900.53	3.83
134	002851	麦格米特	6,095,781.50	3.83
135	00688	中国海外发展	6,073,694.09	3.82
136	00189	东岳集团	6,044,577.26	3.80
137	300532	今天国际	6,029,440.40	3.79
138	01919	中远海控	6,012,309.27	3.78
139	002318	久立特材	5,999,662.36	3.77
140	00839	中教控股	5,991,218.91	3.76
141	002321	华英农业	5,981,763.00	3.76
142	600188	兖州煤业	5,947,331.60	3.74
143	00066	港铁公司	5,869,220.72	3.69
144	002341	新纶科技	5,829,216.79	3.66
145	300012	华测检测	5,799,808.55	3.64
146	600298	安琪酵母	5,743,812.00	3.61
147	002217	合力泰	5,684,400.26	3.57
148	01530	三生制药	5,538,560.65	3.48
149	603986	兆易创新	5,476,718.00	3.44
150	01257	中国光大绿色环保	5,434,681.62	3.41
151	00857	中国石油股份	5,084,873.62	3.19
152	603369	今世缘	5,080,675.00	3.19
153	00958	华能新能源	4,999,433.66	3.14
154	002258	利尔化学	4,927,227.99	3.10
155	01766	中国中车	4,826,172.26	3.03
156	01088	中国神华	4,765,950.83	2.99
157	002202	金风科技	4,756,550.00	2.99
158	300567	精测电子	4,755,962.00	2.99
159	01313	华润水泥控股	4,752,866.67	2.99
160	01208	五矿资源	4,641,491.79	2.92
161	000002	万科 A	4,612,171.52	2.90
162	600055	万东医疗	4,542,446.40	2.85
163	02357	中航科工	4,541,940.32	2.85
164	002531	天顺风能	4,532,412.79	2.85
165	002709	天赐材料	4,299,952.00	2.70
166	300226	上海钢联	4,231,843.00	2.66

167	601688	华泰证券	4,116,824.00	2.59
168	601992	金隅集团	4,047,251.00	2.54
169	00386	中国石油化工股份	4,034,604.73	2.53
170	600340	华夏幸福	3,982,393.00	2.50
171	002343	慈文传媒	3,938,318.00	2.47
172	002242	九阳股份	3,878,815.00	2.44
173	03908	中金公司	3,855,632.43	2.42
174	06886	HTSC	3,789,606.47	2.38
175	600763	通策医疗	3,780,995.00	2.38
176	02689	玖龙纸业	3,615,452.76	2.27
177	600138	中青旅	3,599,904.00	2.26
178	01513	丽珠医药	3,553,548.77	2.23
179	603338	浙江鼎力	3,515,976.87	2.21
180	01658	邮储银行	3,504,490.70	2.20
181	01458	周黑鸭	3,477,819.02	2.18
182	002271	东方雨虹	3,374,918.40	2.12
183	600660	福耀玻璃	3,202,902.00	2.01

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	2,513,577,855.10
卖出股票的收入（成交）总额	2,297,661,061.01

7.5 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。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券投资。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证投资。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

无。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

无。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查的，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

7.12.2 本基金投资的前十名股票中，不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	563,172.66
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	612,593.27

4	应收利息	52,176.61
5	应收申购款	669,479.56
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,897,422.10

7.12.4 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。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例
16,020	29,022.21	174,970,688.09	37.63%	289,965,124.95	62.37%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	456,856.57	0.10%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

本公司高级管理人员、基金投资和研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。

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2017 年 2 月 16 日）基金份额总额	397,870,618.87
本报告期期初基金份额总额	120,472,440.16
本报告期基金总申购份额	536,279,498.94
减：本报告期基金总赎回份额	191,816,126.06
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	464,935,813.04

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本报告期内本基金管理人重大人事变动如下：

2018 年 2 月 13 日，基金管理人发布了《华安基金管理有限公司关于副总经理变更的公告》，翁启森先生、姚国平先生、谷媛媛女士新任本基金管理人的副总经理。

2、本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动如下：

无。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内无基金投资策略的改变。

10.5 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。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内无管理人、托管人及其高级管理人员受证券监管部门稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	----	------	-----------	----

	单元数量	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	
招商证券	3	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
财富证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
广州证券	2	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	2	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
联讯证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
中山证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	3	-	-	-	-	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	1,850,280,568.19	38.46%	1,447,590.83	36.84%	-
光大证券	1	1,039,755,339.88	21.61%	814,442.83	20.73%	-
中金公司	1	556,283,271.69	11.56%	505,508.26	12.86%	-
中泰证券	1	332,309,981.57	6.91%	261,148.46	6.65%	-
兴业证券	1	245,426,859.74	5.10%	226,026.37	5.75%	-
中信证券	1	235,372,250.26	4.89%	219,202.64	5.58%	-
方正证券	1	144,502,766.24	3.00%	108,126.05	2.75%	-
银河证券	1	138,616,563.42	2.88%	126,726.94	3.23%	-
天风证券	2	138,185,020.69	2.87%	109,334.67	2.78%	-
长江证券	2	59,362,910.10	1.23%	53,335.30	1.36%	-
中信建投	1	50,603,729.62	1.05%	43,380.68	1.10%	-
华泰证券	1	12,875,415.00	0.27%	9,012.78	0.23%	-
广发证券	1	6,931,679.85	0.14%	5,605.92	0.14%	-

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：

2018 年 4 月完成租用托管在建设银行的财通证券深圳 006004 交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
招商证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
财富证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-

国盛证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
联讯证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
中山证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华安基金管理有限公司关于旗下产品实施增值税政策的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2018-01-03
2	关于旗下部分基金增加大河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	2018-01-09
3	关于旗下部分基金增加电盈基金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	2018-01-16
4	关于旗下部分基金增加国金证券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	2018-01-20

		司网站	
5	关于旗下华安沪港深通精选灵活配置混合型证券投资基金增加挖财为销售机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2018-01-26
6	关于旗下部分基金参加华信证券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	2018-02-08
7	华安基金管理有限公司关于华安沪港深通精选灵活配置混合型证券投资基金因处于非港股通交易日暂停申购、赎回、转换和定投的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2018-02-08
8	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	2018-02-13
9	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	2018-03-14
10	关于旗下部分基金增加通华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	2018-03-14
11	华安基金新增蛋卷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	2018-03-14
12	关于电子直销平台开展“微钱宝”账户交易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	2018-03-21
13	关于旗下公开募集证券投资基金根据流动性风险管理规定修改基金合同的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2018-03-24
14	华安沪港深通精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同修改前后对照表	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2018-03-24
15	华安基金管理有限公司关于旗下基金参加东海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	2018-03-27
16	华安基金关于参加华安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	2018-04-12
17	华安基金管理有限公司关于暂停上海华信证券有限责任公司销售旗下基金业务公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2018-04-13
18	关于旗下部分基金增加鑫鼎盛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	2018-04-14

19	关于旗下部分基金增加唐鼎耀华为销售机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2018-04-20
20	华安基金管理有限公司关于华安沪港深通精选灵活配置混合型证券投资基金因处于非港股通交易日暂停申购、赎回、转换和定投	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2018-04-23
21	华安基金管理有限公司关于华安沪港深通精选灵活配置混合型证券投资基金因处于非港股通交易日暂停申购、赎回、转换和定投的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2018-05-17
22	关于旗下部分基金增加钜派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	2018-05-18
23	华安沪港深通精选灵活配置混合型证券投资基金分红公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2018-05-25
24	关于基金电子交易平台汇付天天盈渠道关闭基金支付服务的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2018-06-11
25	关于华安暂停与浙江金观诚开展基金销售合作业务的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2018-06-12
26	关于华安暂停与苏州财路开展基金销售合作业务的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2018-06-13
27	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	2018-06-15
28	关于旗下部分基金增加中银国际证券为销售机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2018-06-21
29	关于旗下部分基金增加泰诚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	2018-06-22
30	关于旗下部分基金增加嘉实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	2018-06-26
31	关于电子直销平台延长“微钱宝”账户交易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	2018-06-27
32	关于基金电子交易平台调整微钱宝快速取现服务限额的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2018-06-27
33	华安基金管理有限公司关于华安沪港深通精	《上海证券报》、《证券时	2018-06-27

	选灵活配置混合型证券投资基金因处于非港股通交易日暂停申购、赎回、转换和定投的公告	报》、《中国证券报》和公司网站	
--	--	-----------------	--

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

11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、《华安沪港深通精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 2、《华安沪港深通精选灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》；
- 3、《华安沪港深通精选灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、中国证监会批准华安沪港深通精选灵活配置混合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；

11.2 存放地点

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

11.3 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

二〇一八年八月二十四日