

**华安升级主题混合型证券投资基金**  
**2018 年年度报告摘要**  
**2018 年 12 月 31 日**

基金管理人：华安基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一九年三月三十日

## §1 重要提示

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	华安升级主题混合
基金主代码	040020
交易代码	040020
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 4 月 22 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	145,945,720.00 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金重点投资于受益于产业结构升级、消费升级和技术升级的行业，分享中国经济结构转型过程中的投资收益。在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金将采用“自上而下”与“自下而上”相结合的主动投资管理策略。即：采取“自上而下”的方式选择行业，挖掘并投资于集中代表整个经济发展趋势的行业或主题； 根据上述“自上而下”策略选择行业的基础上，采取“自下而上”的方法，运用基本面分析和实地调研相结合的研究方法选择个股。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×80%+中国债券总指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，基金的风险与预期收益高于债券型基金和货币市场基金、低于股票型基金，属于证券投资基金中的中高风险投资品种。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华安基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露	姓名	陆滢	田青

负责人	联系电话	021-38969999	010-67595096
	电子邮箱	luying@huaan.com.cn	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		4008850099	010-67595096
传真		021-68863414	010-66275853

## 2.4 信息披露方式

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

## §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2018 年	2017 年	2016 年
本期已实现收益	-28,275,510.84	2,590,652.41	55,391,237.01
本期利润	-39,073,750.47	7,898,341.33	21,817,137.91
加权平均基金份额本期利润	-0.2622	0.0204	0.0357
本期基金份额净值增长率	-21.84%	10.46%	-5.22%
3.1.2 期末数据和指标	2018 年末	2017 年末	2016 年末
期末可供分配基金份额利润	-0.0344	0.2362	0.1192
期末基金资产净值	140,921,613.30	205,036,699.03	815,125,654.43
期末基金份额净值	0.966	1.236	1.119

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

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

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

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-7.74%	1.76%	-9.38%	1.31%	1.64%	0.45%
过去六个月	-13.44%	1.54%	-10.78%	1.19%	-2.66%	0.35%
过去一年	-21.84%	1.44%	-19.01%	1.07%	-2.83%	0.37%
过去三年	-18.18%	1.57%	-15.48%	0.94%	-2.70%	0.63%
过去五年	36.07%	1.93%	25.79%	1.23%	10.28%	0.70%
自基金合同生效起至今	40.15%	1.72%	-5.82%	1.17%	45.97%	0.55%

#### 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

华安升级主题混合型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

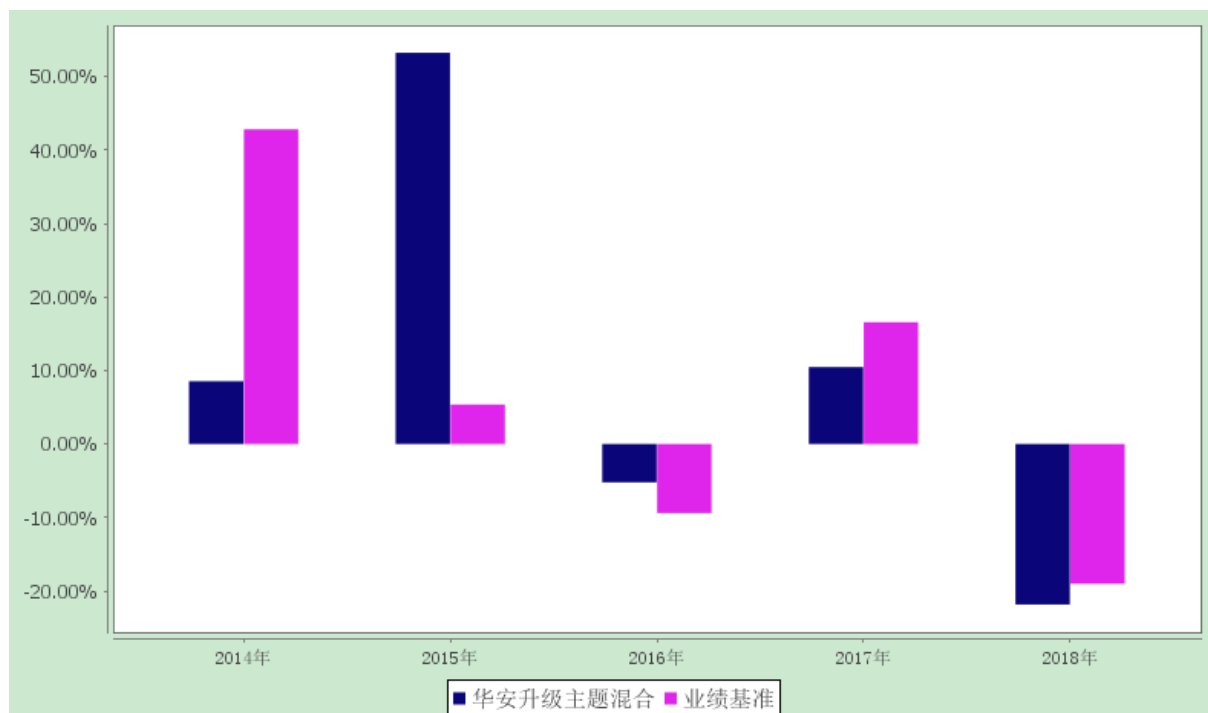
(2011年4月22日至2018年12月31日)



#### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华安升级主题混合型证券投资基金

过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2018年	-	-	-	-	-
2017年	-	-	-	-	-
2016年	5.000	1,442,604,849.13	35,290,262.98	1,477,895,112.11	-
合计	5.000	1,442,604,849.13	35,290,262.98	1,477,895,112.11	-

## §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证券股份有限公司、上海上国投资产管理有限公司、上海锦江国际投资管理有限公司、上海工业投资（集团）有限公司和国泰君安投资管理股份有限公司。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 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 108 只开放式基金，管理资产规模达到 2756.06 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		
饶晓鹏	本基金的基金经理	2015-09-07	-	11 年	硕士，11 年基金行业从业经验，曾任银河基金管理有限公司研究员、国联安基金基金经理。2015 年 5 月加入华安基金管理有限公司，2015 年 9 月起同时担任本基金及华安安信消费服务混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 11 月起，同时担任华安行业轮动混合型证券投资基金的基金经理。

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

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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 4 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

上证指数下跌 24.6%，创业板下跌 28.7%。行业方面，银行、石油石化、食品饮料、农林牧渔相对较强，电子、有色、传媒、机械相对较弱。整体上大小盘风格差异不大。相对收益更多来自个股和细分行业的结构性和阶段性机会。2018 年华安升级主题下跌 21.84%。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2018 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 0.966 元，本报告期份额净值增长率为-21.84%，同期业绩比较基准增长率为-19.01%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从经济数据看，2018 年通胀整体较为平稳，经济增长在三季度以后有一定压力。人民币汇率则经历了一定幅度的波动。

展望 2019 年，机遇和风险并存。由于供给侧改革和环保约束，本轮经济周期中产能扩张力度较弱，库存水平也较前一次景气高峰低，因此本轮经济下行也应该较上一轮调整时间短。2018 年经济面临的困难是对中国经济结构的一次体检。在高质量发展的道路上，中国经济还有非常多需要做加法的地方，也还有不少需要结构性改革的领域。中央经济工作会议注意到了上述这些短期和长期的问题，2019 年经济的尾部风险大幅降低。

中国经济随着人口结构、城市化水平的变化，体现出和过去十年迥异的结构性矛盾。简单依靠居民、政府和企业加杠杆的经济增长模式不可持续。在全球产业分工中，部分要素价格较低的比较优势也在消失。高质量发展很大程度将建立在技术进步推动的供给端生产力水平的提高，以及技术进步带来的新兴消费领域的成长。华安升级主题将继续着力新兴产业投资，2019 年是播种的一年，同时也关注财政、货币逆周期调节受益的符合行业升级的标的。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，负责在证券发行机构发生了严重影响证券价格的重大事件时，评估重大事件对投资品种价值的影响程度、评估对基金估值的影响程度、确定采用的估值方法、确定该证券的公允价值；同时将采用的估值方法以及采用该方法对相关证券的估值与基金的托管银行进行沟通。估值委员会成员由投资总监、研究总监、固定收益部总监、指数投资部总监、基金运营部总经理、风险管理部总监等人员组成，具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备行业研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供银行间同业市场及交易所交易的债券品种的估值数据。

#### **4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

本报告期不进行收益分配。

#### **4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明**

本基金报告期内不存在基金持有人数低于 200 人或基金资产净值低于 5000 万元的情形。

### **§5 托管人报告**

#### **5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明**

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

#### **5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见**

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组

合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## §6 审计报告

本报告期的基金财务会计报告经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计，注册会计师单峰 魏佳亮签字出具了普华永道中天审字(2019)第 23352 号标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：华安升级主题混合型证券投资基金

报告截止日：2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资产：	-	-
银行存款	20,008,036.95	19,244,179.88
结算备付金	1,011,710.95	2,729,611.84
存出保证金	243,377.41	296,640.29
交易性金融资产	122,933,351.68	184,143,106.88
其中：股票投资	122,804,141.69	184,143,106.88
基金投资	-	-
债券投资	129,209.99	-
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	22,456.68	6,072,102.38
应收利息	3,837.40	5,014.21
应收股利	-	-

应收申购款	13,983.69	141,325.99
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
<b>资产总计</b>	<b>144,236,754.76</b>	<b>212,631,981.47</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
	<b>2018 年 12 月 31 日</b>	<b>2017 年 12 月 31 日</b>
负债：	-	-
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	910,188.77	4,997,244.03
应付赎回款	65,198.79	264,733.16
应付管理人报酬	182,553.65	261,097.00
应付托管费	30,425.58	43,516.16
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	1,788,632.02	1,673,191.66
应交税费	1.04	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	338,141.61	355,500.43
<b>负债合计</b>	<b>3,315,141.46</b>	<b>7,595,282.44</b>
<b>所有者权益：</b>	<b>-</b>	<b>-</b>
实收基金	145,945,720.00	165,857,969.75
未分配利润	-5,024,106.70	39,178,729.28
<b>所有者权益合计</b>	<b>140,921,613.30</b>	<b>205,036,699.03</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>	<b>144,236,754.76</b>	<b>212,631,981.47</b>

注：报告截止日 2018 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.966 元，基金份额总额 145,945,720.00 份。

## 7.2 利润表

会计主体：华安升级主题混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>	<b>-28,599,642.02</b>	<b>32,249,832.85</b>
1.利息收入	237,959.95	439,598.49
其中：存款利息收入	237,924.56	439,598.49
债券利息收入	35.39	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	-18,070,153.31	25,654,447.48
其中：股票投资收益	-19,686,814.68	22,815,529.04
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	1,616,661.37	2,838,918.44
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-10,798,239.63	5,307,688.92
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	30,790.97	848,097.96
<b>减：二、费用</b>	<b>10,474,108.45</b>	<b>24,351,491.52</b>
1. 管理人报酬	2,520,319.73	6,612,557.79

2. 托管费	420,053.22	1,102,092.94
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	7,186,388.11	16,268,545.15
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 税金及附加	0.14	-
7. 其他费用	347,347.25	368,295.64
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>-39,073,750.47</b>	<b>7,898,341.33</b>
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>-39,073,750.47</b>	<b>7,898,341.33</b>

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安升级主题混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2018 年 1 月 1 日至 2018 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）	165,857,969.75	39,178,729.28	205,036,699.03
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-39,073,750.47	-39,073,750.47
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）	-19,912,249.75	-5,129,085.51	-25,041,335.26
其中：1.基金申购款	19,152,445.42	2,957,774.41	22,110,219.83
2.基金赎回款	-39,064,695.17	-8,086,859.92	-47,151,555.09

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）	145,945,720.00	-5,024,106.70	140,921,613.30
项目	上年度可比期间		
	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）	728,317,546.40	86,808,108.03	815,125,654.43
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	7,898,341.33	7,898,341.33
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）	-562,459,576.65	-55,527,720.08	-617,987,296.73
其中：1.基金申购款	84,223,274.63	17,150,707.43	101,373,982.06
2.基金赎回款	-646,682,851.28	-72,678,427.51	-719,361,278.79
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）	165,857,969.75	39,178,729.28	205,036,699.03

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

华安升级主题混合型证券投资基金(原名为华安升级主题股票型证券投资基金,以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2011]317号《关于核准华安升级主题股票型证券投资基金募集的批复》核准,由华安基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安升级主题股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集4,118,599,416.41元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2011)第134号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华安升级主题股票型证券投资基金基金合同》于2011年4月22日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为4,119,090,620.47份基金份额,其中认购资金利息折合491,204.06份基金份额。本基金的基金管理人为华安基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安升级主题混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金投资于具有良好流动性的金融工具,包括A股股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、权证、货币市场工具和资产支持证券以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但须符合中国证监会相关规定。本基金股票投资占基金资产的比例范围为60%-95%,其中投资于战略性新兴产业、消费升级行业和传统行业中的技术升级相关行业的比例不低于股票投资的80%;债券、权证、现金、货币市场工具和资产支持证券占基金资产的比例范围为5%-40%,其中权证投资占基金资产净值的比例范围为0-3%;现金或者到期日在1年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金的业绩比较基准为:80%×沪深300指数收益率+20%×中国债券总指数收益率。

本财务报表由本基金的基金管理人华安基金管理有限公司于2019年3月26日批准报出。

### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准



则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华安升级主题混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### **7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

本基金 2018 年度财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### **7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

##### **7.4.5.1 会计政策变更的说明**

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### **7.4.5.2 会计估计变更的说明**

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### **7.4.5.3 差错更正的说明**

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### **7.4.6 税项**

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增

值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，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。

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

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

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

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

#### 7.4.7 关联方关系

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

国泰君安创新投资有限公司	基金管理人的股东（2018 年 12 月 5 日前）
上海国际信托有限公司	基金管理人的股东（2018 年 12 月 5 日前）
国泰君安证券股份有限公司	基金管理人的股东（自 2018 年 12 月 5 日起）、 基金销售机构
上海上国投资产管理有限公司	基金管理人的股东（自 2018 年 12 月 5 日起）
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. 根据华安基金管理有限公司于 2018 年 12 月 7 日发布的公告，经华安基金管理有限公司股东会第五十六次会议决议、第五十九次会议决议及中国证券监督管理委员会证监许可[2018]2012 号文核准，华安基金管理有限公司股东国泰君安创新投资有限公司、上海国际信托有限公司将各持有的华安基金管理有限公司 20% 的股权分别转让给国泰君安证券股份有限公司和上海上国投资产管理有限公司。自 2018 年 12 月 5 日起，华安基金管理有限公司股东变更为国泰君安证券股份有限公司、上海上国投资产管理有限公司、上海锦江国际投资管理有限公司、上海工业投资（集团）有限公司和国泰君安投资管理股份有限公司。

#### 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.8.1.1 股票交易

无。

###### 7.4.8.1.2 权证交易

无。

###### 7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期			
	2018 年 1 月 1 日至 2018 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
国泰君安证券股份有限公司	-	-	25,268.91	1.41%
关联方名称	上年度可比期间			

	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
-	-	-	-	-

注：1.上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2.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等。

3. 关联方交易本年度实际期间为 2018 年 12 月 5 日至 12 月 31 日。

#### 7.4.8.2 关联方报酬

##### 7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年 12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年 12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	2,520,319.73	6,612,557.79
其中：支付销售机构的客户维护费	985,475.93	1,306,393.47

注：支付基金管理人华安基金公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 1.50% / 当年天数。

##### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年 12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年 12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	420,053.22	1,102,092.94

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

**7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况**

**7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

无。

**7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况**

无。

**7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2018年1月1日至2018年12月31日		2017年1月1日至2017年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	20,008,036.95	199,708.94	19,244,179.88	357,161.34

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

**7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

无。

**7.4.8.7 其他关联交易事项的说明**

无。

**7.4.9 期末（2018 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券**

**7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

无。

**7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

无。

**7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**

**7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购**

无。

**7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购**

无。

#### 7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

##### (i) 各层次金融工具公允价值

于 2018 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 122,933,351.68 元，无属于第二或第三层次的余额(2017 年 12 月 31 日：第一层次 145,071,227.30 元，第二层次 39,071,879.58 元，无第三层次)。

##### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

##### (iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2018 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2017 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## §8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	122,804,141.69	85.14
	其中：股票	122,804,141.69	85.14
2	固定收益投资	129,209.99	0.09
	其中：债券	129,209.99	0.09
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	21,019,747.90	14.57
7	其他各项资产	283,655.18	0.20
8	合计	144,236,754.76	100.00

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	2,133,799.80	1.51
C	制造业	66,052,561.95	46.87
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,392,675.00	3.12
E	建筑业	3,205,120.00	2.27
F	批发和零售业	2,400,480.00	1.70
G	交通运输、仓储和邮政业	30,300.00	0.02
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	29,082,838.88	20.64
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	6,986,555.06	4.96
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	261,176.50	0.19
R	文化、体育和娱乐业	8,258,634.50	5.86
S	综合	-	-
	合计	122,804,141.69	87.14

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	000977	浪潮信息	445,800	7,097,136.00	5.04



2	002376	新北洋	444,084	6,812,248.56	4.83
3	300383	光环新网	470,228	5,957,788.76	4.23
4	600312	平高电气	669,000	5,405,520.00	3.84
5	300760	迈瑞医疗	44,028	4,808,738.16	3.41
6	300036	超图软件	257,679	4,723,256.07	3.35
7	000063	中兴通讯	232,225	4,549,287.75	3.23
8	300365	恒华科技	217,593	4,547,693.70	3.23
9	600025	华能水电	1,394,500	4,392,675.00	3.12
10	300630	普利制药	97,589	4,299,771.34	3.05

## 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	300383	光环新网	39,897,169.37	19.46
2	300271	华宇软件	38,664,601.79	18.86
3	601336	新华保险	38,012,938.33	18.54
4	002120	韵达股份	36,578,778.03	17.84
5	000858	五 粮 液	35,142,592.62	17.14
6	601398	工商银行	32,629,865.98	15.91
7	601288	农业银行	31,025,201.00	15.13
8	600585	海螺水泥	28,201,256.72	13.75
9	002110	三钢闽光	27,388,383.91	13.36
10	600801	华新水泥	27,069,291.62	13.20
11	300036	超图软件	26,721,484.28	13.03
12	002146	荣盛发展	26,086,153.05	12.72
13	600383	金地集团	25,207,158.00	12.29
14	000063	中兴通讯	23,512,211.36	11.47
15	000932	华菱钢铁	22,468,828.85	10.96
16	601111	中国国航	22,275,508.01	10.86
17	300070	碧水源	22,057,598.69	10.76
18	600782	新钢股份	21,549,800.24	10.51
19	002027	分众传媒	21,280,688.10	10.38
20	600048	保利地产	21,016,853.20	10.25
21	600282	南钢股份	20,506,343.55	10.00
22	300137	先河环保	20,257,548.82	9.88
23	000002	万 科 A	19,432,945.34	9.48
24	601988	中国银行	19,172,850.00	9.35
25	002376	新北洋	18,966,444.20	9.25

26	600519	贵州茅台	18,840,279.30	9.19
27	000717	韶钢松山	18,667,582.49	9.10
28	600740	山西焦化	17,765,116.24	8.66
29	600900	长江电力	17,297,471.49	8.44
30	600236	桂冠电力	17,086,627.06	8.33
31	600867	通化东宝	16,847,750.74	8.22
32	001979	招商蛇口	16,446,074.21	8.02
33	600340	华夏幸福	16,194,171.65	7.90
34	600030	中信证券	15,947,294.50	7.78
35	002044	美年健康	15,086,519.78	7.36
36	300339	润和软件	15,037,236.01	7.33
37	002007	华兰生物	14,934,873.49	7.28
38	600845	宝信软件	14,455,915.58	7.05
39	600521	华海药业	13,995,799.42	6.83
40	002439	启明星辰	13,896,377.44	6.78
41	000568	泸州老窖	13,829,177.78	6.74
42	601328	交通银行	13,822,351.00	6.74
43	601318	中国平安	13,757,221.63	6.71
44	300618	寒锐钴业	13,665,500.17	6.66
45	002456	欧菲科技	13,634,017.00	6.65
46	000961	中南建设	13,497,614.73	6.58
47	600596	新安股份	13,402,454.94	6.54
48	600028	中国石化	13,203,260.04	6.44
49	601699	潞安环能	13,005,963.00	6.34
50	002912	中新赛克	12,906,486.37	6.29
51	600808	马钢股份	12,725,281.22	6.21
52	601233	桐昆股份	12,469,230.07	6.08
53	601899	紫金矿业	12,226,958.00	5.96
54	601599	鹿港文化	12,128,803.00	5.92
55	601601	中国太保	11,791,559.36	5.75
56	601818	光大银行	11,740,704.06	5.73
57	601229	上海银行	11,734,957.90	5.72
58	000776	广发证券	11,698,695.27	5.71
59	600985	淮北矿业	11,653,065.14	5.68
60	600029	南方航空	11,472,593.90	5.60
61	000488	晨鸣纸业	11,248,386.42	5.49
62	601225	陕西煤业	11,135,828.26	5.43
63	601003	柳钢股份	11,073,454.05	5.40
64	600569	安阳钢铁	10,603,871.00	5.17
65	300377	赢时胜	10,470,492.78	5.11
66	600809	山西汾酒	10,270,811.49	5.01
67	603589	口子窖	10,265,517.20	5.01
68	600606	绿地控股	10,067,255.67	4.91
69	300203	聚光科技	10,030,537.24	4.89

70	000977	浪潮信息	9,942,224.20	4.85
71	002279	久其软件	9,908,297.90	4.83
72	300365	恒华科技	9,766,439.00	4.76
73	002127	南极电商	9,633,475.55	4.70
74	002573	清新环境	9,352,963.82	4.56
75	600201	生物股份	9,339,287.40	4.55
76	002508	老板电器	9,200,273.50	4.49
77	300113	顺网科技	9,118,695.16	4.45
78	002458	益生股份	9,032,096.61	4.41
79	600188	兖州煤业	8,938,054.84	4.36
80	600352	浙江龙盛	8,799,028.00	4.29
81	603877	太平鸟	8,691,483.06	4.24
82	002475	立讯精密	8,510,091.06	4.15
83	002460	赣锋锂业	8,495,568.17	4.14
84	002468	申通快递	8,339,939.52	4.07
85	603486	科沃斯	8,286,583.43	4.04
86	002696	百洋股份	8,282,724.97	4.04
87	603056	德邦股份	8,249,677.38	4.02
88	300308	中际旭创	8,233,479.37	4.02
89	000547	航天发展	8,179,861.94	3.99
90	601688	华泰证券	8,173,967.31	3.99
91	002440	闰土股份	8,052,124.13	3.93
92	000825	太钢不锈	8,045,074.34	3.92
93	300136	信维通信	8,005,284.72	3.90
94	600466	蓝光发展	7,969,473.00	3.89
95	300168	万达信息	7,837,693.00	3.82
96	000060	中金岭南	7,790,143.43	3.80
97	000725	京东方 A	7,761,958.00	3.79
98	600104	上汽集团	7,633,969.20	3.72
99	300003	乐普医疗	7,615,444.92	3.71
100	603538	美诺华	7,501,916.70	3.66
101	600547	山东黄金	7,464,021.90	3.64
102	601012	隆基股份	7,389,502.16	3.60
103	600057	厦门象屿	7,348,691.49	3.58
104	002396	星网锐捷	7,238,406.20	3.53
105	600711	盛屯矿业	7,007,770.69	3.42
106	002262	恩华药业	6,900,789.00	3.37
107	603365	水星家纺	6,891,634.43	3.36
108	600036	招商银行	6,782,157.00	3.31
109	603626	科森科技	6,753,378.32	3.29
110	000728	国元证券	6,603,432.12	3.22
111	601857	中国石油	6,530,760.00	3.19
112	000672	上峰水泥	6,529,100.00	3.18
113	300009	安科生物	6,510,842.29	3.18

114	600115	东方航空	6,451,211.64	3.15
115	600837	海通证券	6,434,281.10	3.14
116	600195	中牧股份	6,411,341.32	3.13
117	000963	华东医药	6,387,698.37	3.12
118	002773	康弘药业	6,350,124.00	3.10
119	000661	长春高新	6,331,769.70	3.09
120	601985	中国核电	6,298,532.00	3.07
121	000789	万年青	6,289,745.67	3.07
122	300426	唐德影视	6,246,691.50	3.05
123	601222	林洋能源	6,226,126.28	3.04
124	600661	昂立教育	6,225,298.59	3.04
125	002661	克明面业	6,213,829.70	3.03
126	300760	迈瑞医疗	6,173,083.43	3.01
127	600581	八一钢铁	6,061,810.00	2.96
128	603605	珀莱雅	6,050,870.00	2.95
129	300170	汉得信息	6,027,469.65	2.94
130	603156	养元饮品	6,014,880.60	2.93
131	300630	普利制药	5,938,412.03	2.90
132	002155	湖南黄金	5,902,063.81	2.88
133	601952	苏垦农发	5,837,874.90	2.85
134	600859	王府井	5,790,575.62	2.82
135	002081	金螳螂	5,736,382.93	2.80
136	300017	网宿科技	5,541,507.80	2.70
137	601668	中国建筑	5,508,007.00	2.69
138	002466	天齐锂业	5,505,052.00	2.68
139	600990	四创电子	5,478,118.62	2.67
140	600312	平高电气	5,411,783.08	2.64
141	002366	台海核电	5,378,915.32	2.62
142	300027	华谊兄弟	5,365,919.60	2.62
143	002640	跨境通	5,337,878.68	2.60
144	002304	洋河股份	5,319,186.00	2.59
145	000688	国城矿业	5,233,110.00	2.55
146	000001	平安银行	5,148,943.62	2.51
147	000400	许继电气	5,143,788.57	2.51
148	300481	濮阳惠成	5,096,445.36	2.49
149	002234	民和股份	5,069,709.40	2.47
150	002938	鹏鼎控股	5,035,534.64	2.46
151	002311	海大集团	5,032,852.22	2.45
152	000034	神州数码	5,012,450.58	2.44
153	603108	润达医疗	4,988,000.00	2.43
154	603496	恒为科技	4,938,128.73	2.41
155	600486	扬农化工	4,911,451.54	2.40
156	600141	兴发集团	4,898,083.69	2.39
157	600376	首开股份	4,862,178.25	2.37

158	002368	太极股份	4,600,760.63	2.24
159	600623	华谊集团	4,594,736.00	2.24
160	000538	云南白药	4,591,960.97	2.24
161	603666	亿嘉和	4,519,254.00	2.20
162	603808	歌力思	4,462,535.08	2.18
163	600233	圆通速递	4,433,542.68	2.16
164	603259	药明康德	4,364,991.00	2.13
165	603369	今世缘	4,285,321.22	2.09
166	600025	华能水电	4,272,071.29	2.08
167	300750	宁德时代	4,261,224.86	2.08
168	600681	百川能源	4,247,627.41	2.07
169	603986	兆易创新	4,237,341.80	2.07
170	600754	锦江股份	4,226,741.66	2.06
171	600270	外运发展	4,219,044.20	2.06
172	300532	今天国际	4,189,518.08	2.04

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	002120	韵达股份	47,512,143.37	23.17
2	300383	光环新网	45,639,838.94	22.26
3	300271	华宇软件	39,065,895.88	19.05
4	000932	华菱钢铁	38,267,962.43	18.66
5	601336	新华保险	37,824,055.74	18.45
6	601288	农业银行	36,769,747.00	17.93
7	600782	新钢股份	35,778,724.34	17.45
8	000858	五粮液	34,350,944.71	16.75
9	000717	韶钢松山	31,039,748.88	15.14
10	601398	工商银行	30,916,915.26	15.08
11	002110	三钢闽光	29,953,405.53	14.61
12	600585	海螺水泥	27,260,925.03	13.30
13	600801	华新水泥	26,002,740.82	12.68
14	002146	荣盛发展	25,797,209.14	12.58
15	600383	金地集团	24,297,168.61	11.85
16	600740	山西焦化	23,944,891.51	11.68
17	300036	超图软件	22,119,237.51	10.79

18	300070	碧水源	22,106,998.19	10.78
19	002027	分众传媒	21,707,089.40	10.59
20	601111	中国国航	21,605,330.20	10.54
21	601699	潞安环能	21,255,134.77	10.37
22	000063	中兴通讯	20,610,881.10	10.05
23	600985	淮北矿业	20,373,753.40	9.94
24	600048	保利地产	19,756,371.97	9.64
25	300137	先河环保	19,717,648.71	9.62
26	601003	柳钢股份	19,338,844.19	9.43
27	600282	南钢股份	19,055,055.02	9.29
28	600519	贵州茅台	18,547,323.90	9.05
29	000002	万 科 A	18,531,251.53	9.04
30	601988	中国银行	17,877,890.77	8.72
31	600340	华夏幸福	17,331,727.29	8.45
32	600900	长江电力	17,294,921.36	8.44
33	600236	桂冠电力	16,986,883.33	8.28
34	300339	润和软件	15,276,792.84	7.45
35	600030	中信证券	15,196,875.25	7.41
36	600867	通化东宝	15,099,443.19	7.36
37	001979	招商蛇口	14,737,646.43	7.19
38	600352	浙江龙盛	14,459,681.23	7.05
39	002439	启明星辰	14,299,096.65	6.97
40	002044	美年健康	14,052,808.25	6.85
41	601318	中国平安	13,920,165.24	6.79
42	002440	闰土股份	13,885,782.79	6.77
43	300203	聚光科技	13,699,580.07	6.68
44	000688	国城矿业	13,576,942.80	6.62
45	002456	欧菲科技	13,406,159.18	6.54
46	600596	新安股份	13,295,087.49	6.48
47	002007	华兰生物	13,231,834.98	6.45
48	600028	中国石化	13,118,416.06	6.40
49	000568	泸州老窖	12,780,252.23	6.23
50	600808	马钢股份	12,745,560.13	6.22
51	000961	中南建设	12,709,919.28	6.20
52	601233	桐昆股份	12,640,515.80	6.17
53	002376	新北洋	12,526,371.61	6.11
54	601328	交通银行	12,525,828.60	6.11
55	002912	中新赛克	12,477,174.57	6.09
56	601899	紫金矿业	12,395,944.33	6.05
57	600845	宝信软件	11,955,417.13	5.83
58	000776	广发证券	11,559,115.41	5.64
59	601229	上海银行	11,554,256.94	5.64
60	601601	中国太保	11,544,108.00	5.63
61	601599	鹿港文化	11,454,170.11	5.59

62	600569	安阳钢铁	11,399,326.97	5.56
63	600521	华海药业	11,373,115.47	5.55
64	600029	南方航空	11,219,055.77	5.47
65	601600	中国铝业	11,081,835.00	5.40
66	601225	陕西煤业	11,070,285.60	5.40
67	000488	晨鸣纸业	10,712,896.69	5.22
68	300377	赢时胜	10,637,731.69	5.19
69	601818	光大银行	10,476,037.00	5.11
70	600606	绿地控股	10,395,892.00	5.07
71	002279	久其软件	10,201,696.91	4.98
72	603589	口子窖	9,984,635.26	4.87
73	600809	山西汾酒	9,804,232.17	4.78
74	002508	老板电器	9,580,334.32	4.67
75	600054	黄山旅游	9,545,294.08	4.66
76	600188	兖州煤业	9,399,014.26	4.58
77	603566	普莱柯	9,379,968.77	4.57
78	603486	科沃斯	9,224,124.45	4.50
79	002468	申通快递	9,113,189.21	4.44
80	002127	南极电商	9,064,415.77	4.42
81	002475	立讯精密	8,993,893.60	4.39
82	002573	清新环境	8,943,457.84	4.36
83	600138	中青旅	8,924,829.93	4.35
84	002458	益生股份	8,845,019.04	4.31
85	300113	顺网科技	8,714,774.26	4.25
86	300136	信维通信	8,643,828.40	4.22
87	600201	生物股份	8,394,272.38	4.09
88	300618	寒锐钴业	8,071,658.76	3.94
89	600466	蓝光发展	8,023,894.90	3.91
90	600497	驰宏锌锗	7,959,116.21	3.88
91	000547	航天发展	7,906,939.35	3.86
92	603056	德邦股份	7,889,385.97	3.85
93	000825	太钢不锈	7,837,808.00	3.82
94	603877	太平鸟	7,814,448.73	3.81
95	000725	京东方 A	7,713,440.99	3.76
96	002696	百洋股份	7,705,988.29	3.76
97	600547	山东黄金	7,578,946.76	3.70
98	603538	美诺华	7,562,084.60	3.69
99	300308	中际旭创	7,531,619.43	3.67
100	601688	华泰证券	7,526,394.00	3.67
101	603626	科森科技	7,341,603.00	3.58
102	600057	厦门象屿	7,292,265.12	3.56
103	002460	赣锋锂业	7,287,194.61	3.55
104	603365	水星家纺	7,189,026.17	3.51
105	600104	上汽集团	7,138,241.00	3.48

106	002262	恩华药业	7,072,227.49	3.45
107	600036	招商银行	7,006,960.00	3.42
108	600115	东方航空	6,986,783.15	3.41
109	002396	星网锐捷	6,922,625.21	3.38
110	601012	隆基股份	6,861,168.72	3.35
111	000060	中金岭南	6,801,927.34	3.32
112	000728	国元证券	6,784,382.68	3.31
113	000963	华东医药	6,677,756.38	3.26
114	600837	海通证券	6,609,228.24	3.22
115	600581	八一钢铁	6,450,209.00	3.15
116	002661	克明面业	6,446,869.45	3.14
117	300009	安科生物	6,407,675.32	3.13
118	601222	林洋能源	6,326,120.87	3.09
119	600661	昂立教育	6,298,914.87	3.07
120	600711	盛屯矿业	6,265,531.61	3.06
121	000703	恒逸石化	6,261,519.97	3.05
122	600195	中牧股份	6,141,938.82	3.00
123	300170	汉得信息	6,099,388.00	2.97
124	000789	万年青	6,085,650.11	2.97
125	601857	中国石油	6,061,450.39	2.96
126	300003	乐普医疗	6,024,646.61	2.94
127	002155	湖南黄金	5,945,370.00	2.90
128	000672	上峰水泥	5,938,921.35	2.90
129	002773	康弘药业	5,887,852.37	2.87
130	601952	苏垦农发	5,857,755.20	2.86
131	600388	龙净环保	5,855,893.00	2.86
132	300426	唐德影视	5,849,813.11	2.85
133	000661	长春高新	5,804,072.73	2.83
134	603605	珀莱雅	5,787,199.90	2.82
135	600990	四创电子	5,769,451.08	2.81
136	002081	金螳螂	5,667,291.07	2.76
137	601668	中国建筑	5,585,508.00	2.72
138	601985	中国核电	5,560,921.30	2.71
139	600859	王府井	5,542,859.67	2.70
140	000001	平安银行	5,516,574.20	2.69
141	002938	鹏鼎控股	5,505,256.85	2.69
142	300017	网宿科技	5,468,771.60	2.67
143	603156	养元饮品	5,373,352.98	2.62
144	002311	海大集团	5,284,304.32	2.58
145	300027	华谊兄弟	5,227,797.99	2.55
146	002466	天齐锂业	5,168,213.90	2.52
147	000400	许继电气	5,133,480.39	2.50
148	002304	洋河股份	5,114,002.00	2.49
149	603496	恒为科技	5,047,169.96	2.46



150	300365	恒华科技	5,005,377.41	2.44
151	300168	万达信息	4,840,532.48	2.36
152	600486	扬农化工	4,808,567.05	2.35
153	600623	华谊集团	4,801,690.95	2.34
154	002640	跨境通	4,801,339.30	2.34
155	600376	首开股份	4,733,788.14	2.31
156	603108	润达医疗	4,659,670.00	2.27
157	002234	民和股份	4,598,282.46	2.24
158	600141	兴发集团	4,574,999.20	2.23
159	002368	太极股份	4,530,746.70	2.21
160	300750	宁德时代	4,482,257.32	2.19
161	600233	圆通速递	4,448,160.48	2.17
162	002366	台海核电	4,433,521.44	2.16
163	600270	外运发展	4,295,224.00	2.09
164	603369	今世缘	4,250,824.00	2.07
165	600754	锦江股份	4,141,195.00	2.02

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	2,359,249,009.28
卖出股票的收入（成交）总额	2,390,106,410.17

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-

5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	129,209.99	0.09
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	129,209.99	0.09

**8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细**

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	123017	寒锐转债	1,327	129,209.99	0.09

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

**8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细**

本基金本报告期末未持有贵金属。

**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**

无。

**8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

**8.11.1 本期国债期货投资政策**

无。

**8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

本基金本报告期没有投资国债期货。

**8.11.3 本期国债期货投资评价**

无。

**8.12 投资组合报告附注**

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

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

**8.12.3 期末其他各项资产构成**

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	243,377.41
2	应收证券清算款	22,456.68
3	应收股利	-
4	应收利息	3,837.40
5	应收申购款	13,983.69
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	283,655.18

**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**

本基金本报告期末未持有存在流通受限情况的股票。

## §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
8,418	17,337.34	494,101.15	0.34%	145,451,618.85	99.66%

### 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	49,413.23	0.03%

### 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(2011 年 4 月 22 日)基金份额总额	4,119,090,620.47
本报告期期初基金份额总额	165,857,969.75
本报告期基金总申购份额	19,152,445.42
减：本报告期基金总赎回份额	39,064,695.17
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	145,945,720.00

注：总申购份额含转换入份额。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。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内无基金投资策略的改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘为基金审计的会计师事务所。

报告年度应支付给聘任会计师事务所的报酬情况为人民币 58,000.00 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

2018 年 4 月，针对上海证监局向公司出具的《关于对华安基金管理有限公司采取责令改正措施的决定》，公司高度重视，逐一落实各项整改要求，针对性地制定、实施整改措施，进一步提升公司内部控制和风险管理能力。2018 年 5 月，公司已通过上海证监局的检查验收。

除上述情况外，本报告期内无管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总	佣金	占当期佣金总量的	

			额的比例		比例	
湘财证券	1	-	-	-	-	-
广州证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	1	-	-	-	-	-
财富证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
联讯证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
中山证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	3	-	-	-	-	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	2	747,891,843.14	15.75%	681,557.57	15.58%	-
广发证券	1	696,788,319.12	14.68%	648,919.17	14.83%	-
天风证券	2	483,638,000.65	10.19%	441,542.93	10.09%	-
东北证券	1	397,114,434.23	8.36%	369,828.70	8.45%	-
兴业证券	1	327,861,210.72	6.91%	305,336.04	6.98%	-
申万宏源	2	327,222,265.44	6.89%	298,198.64	6.82%	-
中信证券	1	312,314,503.52	6.58%	290,857.44	6.65%	-
长江证券	2	270,001,136.25	5.69%	249,071.69	5.69%	-
银河证券	1	173,898,413.54	3.66%	161,951.08	3.70%	-
方正证券	3	155,108,784.63	3.27%	141,351.36	3.23%	-
中信建投	1	147,149,684.02	3.10%	137,040.55	3.13%	-
西南证券	1	139,443,035.86	2.94%	127,074.50	2.90%	-
瑞银证券	1	125,512,316.08	2.64%	114,379.43	2.61%	-
中泰证券	1	109,501,557.25	2.31%	99,789.04	2.28%	-
国泰君安	1	109,173,134.10	2.30%	99,489.20	2.27%	-
国盛证券	1	84,543,783.89	1.78%	78,735.15	1.80%	-
新时代证券	1	83,066,302.93	1.75%	77,359.06	1.77%	-
上海证券	2	32,330,367.89	0.68%	29,462.61	0.67%	-
华安证券	1	24,850,384.14	0.52%	23,142.61	0.53%	-

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

#### 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

无。

华安基金管理有限公司

二〇一九年三月三十日