

基金管理人：华安基金管理有限公司
基金托管人：中国工商银行股份有限公司
报告送出日期：二〇一七年十月二十五日

重要提示

基金管理人的董事会及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、完整性和及时性承担个别及连带责任。

基金托管人和中国工商银行股份有限公司根据本基金合同的规定，于2017年10月20日对本基金进行了中期报告的财务数据、净值表现和资产组合报告等内容，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，请仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告告期2017年7月1日至2017年9月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金名称 华安智增精选灵活配置混合型证券投资基金

基金简称 华安智增

基金代码 160421

交易方式 上市开放式

基金运作方式 灵活配置

基金合同生效日 2016年9月13日

报告期末基金份额总额 1,300,431,600.00份

报告期内基金利润总额 -9,916,890.00元

本期利润 69,-372,816.02元

归属于基金份额持有人的本期利润 69,-372,816.02元

本期基金份额变动 1,271,776,208.00份

期末基金份额净值 0.7920

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、红利再投费、基金转换费等），计算费用后实际收益水平将低于所列数字。
2. 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 基金的收益表现
3.2.1 本基金报告期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 净值增长 率 净值增 长率 标准差 比例基 准收 益率 净值增 长率 准差 (1)~(2) (2)~(3)

过去6个月 0.79% 1.33% 0.21% 0.07% 0.86% 0.04%

3.2.2 本基金合同生效以来基金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
华安智增精选灵活配置混合型证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2016年9月13日至2017年9月30日)

3.3 主要财务指标和基金净值表现

单位：人民币元

主要财务指标 报告期 (2017年7月1日-2017年9月30日)

1.本期利润 9,916,890.00

2.期初利润 69,-372,816.02

3.期初资产负债率(%) 0.0000

4.期末净资产净值 1,271,776,208.00

5.期末总资产净值 1,271,776,208.00

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、红利再投费、基金转换费等），计算费用后实际收益水平将低于所列数字。
2. 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。
3.2.1 本基金报告期份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较
3.2.2 本基金合同生效以来基金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
华安智增精选灵活配置混合型证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2016年9月13日至2017年9月30日)

华安智增精选灵活配置混合型证券投资基金

2017年第三季度报告

交易日的反向交易以及可能不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控，风险管理部定期对各投资组合与交易对手之间协议定价的交易价格公平性进行审查，对不同投资组合在临近交易时段的同向反向的交易时机和交易价差进行分析。本报告期期间，公司公开交易制度总体执行情况良好。

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、交易部门定期制定了交易基金，专户针对股票、债券、回购等投资品种在交易时段及银行间同业反向交易控制规则，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、专户间的同向反向交易的监测，对同向反向交易的同向反向的交易时机和交易价差进行分析。本报告期期间，除指数基金以外的所有投资组合与交易对手公开竞价交易中，出现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，未出现异常情况。

4.4 报告期内基金的估值政策和业绩表现说明

4.4.1 报告期内本基金投资组合运作分析

6月份以后，整个市场的流动性场外有所改善，加之整个经济基本面比预期的好得多，特别供给端给需求端带来了周期行业的盈利状况，在这个因素的推动下，整个市场的投资热情大幅增加。本基金注重采用自下而上的选股策略，在关注到周期行业改善的信号后，通过新能源汽车的发展趋势，从行业角度来看，效果还可以，但是由于新能源汽车的发展势头好，所以行业配置相对集中，这也导致了配置比例的提升，从而影响了整体的业绩表现。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2017年9月30日，本基金的净值为0.9702元，本报告期份额净值增长率为5.77%，即同期业绩比较基准增长率为2.31%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的展望

从短期来看，宏观经济基本面逐步趋稳，流动性进入偏紧区间，汇率调整也依然没有到达均衡点，外险风险依然存在，无风险利率逐步上升。

未来一段时间可能出现超预期的风险因素，市场依然存在一定的结构性机会，特别是具有一定时代特征的高成长优质成长股和政策受益标的。

因此在操作上，将根据市场的阶段性特征和主要矛盾，提高投资的灵活性。

4.6 报告期后本基金持有人数或基金资产净值预警说明

本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。

5.1 报告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组合

序号 股票代码 股票名称 数额(元) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 300466 全志科技 2,500,663 81,764,086.00 6.43

2 000663 旗滨电子 1,276,247 73,382,676.00 5.81

3 002466 天齐锂业 1,042,793 73,207,703.10 5.76

4 300007 汉宇集团 4,011,103 73,202,626.00 5.76

5 600019 宝钢股份 7,722,098 67,009,186.00 4.49

6 600039 万华化学 1,230,696 62,349,140.00 4.11

7 300196 长盈精密 3,062,467 60,907,103.26 4.00

8 600898 宝信软件 1,163,206 47,680,864.00 3.76

9 002044 华能国际 3,708,201 46,724,340.00 3.67

10 600282 南玻A 8,065,000 44,693,424.00 3.51

合计 11,077,907,261.00 1,000.00

5.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明

细

序号 债券代码 债券名称 数额(元) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 100006 全志科技 2,500,663 81,764,086.00 6.43

2 100003 旗滨电子 1,276,247 73,382,676.00 5.81

3 1002466 天齐锂业 1,042,793 73,207,703.10 5.76

4 1000007 汉宇集团 4,011,103 73,202,626.00 5.76

5 1000019 宝钢股份 7,722,098 67,009,186.00 4.49

6 1000039 万华化学 1,230,696 62,349,140.00 4.11

7 10030196 长盈精密 3,062,467 60,907,103.26 4.00

8 1000898 宝信软件 1,163,206 47,680,864.00 3.76

9 10002044 华能国际 3,708,201 46,724,340.00 3.67

10 1000282 南玻A 8,065,000 44,693,424.00 3.51

合计 1,077,907,261.00 1,000.00

5.3 报告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

序号 股票代码 股票名称 数额(元) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 300466 全志科技 2,500,663 81,764,086.00 6.43

2 000663 旗滨电子 1,276,247 73,382,676.00 5.81

3 002466 天齐锂业 1,042,793 73,207,703.10 5.76

4 300007 汉宇集团 4,011,103 73,202,626.00 5.76

5 600019 宝钢股份 7,722,098 67,009,186.00 4.49

6 600039 万华化学 1,230,696 62,349,140.00 4.11

7 300196 长盈精密 3,062,467 60,907,103.26 4.00

8 600898 宝信软件 1,163,206 47,680,864.00 3.76

9 002044 华能国际 3,708,201 46,724,340.00 3.67

10 000282 南玻A 8,065,000 44,693,424.00 3.51

合计 1,077,907,261.00 1,000.00

5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明

细

序号 债券代码 债券名称 数额(元) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 100006 全志科技 2,500,663 81,764,086.00 6.43

2 100003 旗滨电子 1,276,247 73,382,676.00 5.81

3 1002466 天齐锂业 1,042,793 73,207,703.10 5.76

4 1000007 汉宇集团 4,011,103 73,202,626.00 5.76

5 1000019 宝钢股份 7,722,098 67,009,186.00 4.49

6 1000039 万华化学 1,230,696 62,349,140.00 4.11

7 10030196 长盈精密 3,062,467 60,907,103.26 4.00

8 1000898 宝信软件 1,163,206 47,680,864.00 3.76

9 1002044 华能国际 3,708,201 46,724,340.00 3.67

10 1000282 南玻A 8,065,000 44,693,424.00 3.51

合计 1,077,907,261.00 1,000.00

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名贵金属投资明

细

序号 项目 金额(元) 占基金资产净值比例(%)

1 国债 1,000,000 0.09%

2 黄金 1,000,000 0.09%

3 白银 1,000,000 0.09%

4 铂金 1,000,000 0.09%

5 钯金 1,000,000 0.09%

6 其他贵金属 1,000,000 0.09%