华安安享灵活配置混合型证券投资基金 2017年年度报告摘要

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:二〇一八年三月二十七日

§1 重要提示

1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年3月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告期自2017年1月1日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1基金基本情况

基金简称	华安安享混合
基金主代码	000708
交易代码	000708
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年1月23日
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
报告期末基金份额总额	1,001,070,268.22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。
投资策略	本基金采取相对灵活的资产配置策略,通过将基金资产在权益类、固定收益类工具之间灵活配置,并适当辅用金融衍生品的投资来追求基金资产的长期稳健增值。
业绩比较基准	60%×中证800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。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	钱昶	郭刚
	联系电话	021-38969999	010-66106799
	电子邮箱	qiankun@huaan.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4008850099	95588
传真		021-68863414	010-66106798

2.4 信息披露方式

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

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2017年	2016年	2015年1月23日(基金合同生效日)至2015年12月31日
本期已实现收益	36,844,281.04	59,908,709.47	302,061,524.06
本期利润	36,927,349.66	43,281,504.75	317,740,496.33
加权平均基金份额本期利润	0.0290	0.0195	0.0963
本期基金份额净值增长率	2.48%	1.18%	6.60%
3.1.2 期末数据和指标	2017年末	2016年末	2015年末
期末可供分配基金份额利润	0.0906	0.0623	0.0352
期末基金资产净值	1,114,394,410.61	2,186,825,210.50	2,891,635,745.84
期末基金份额净值	1.113	1.066	1.066

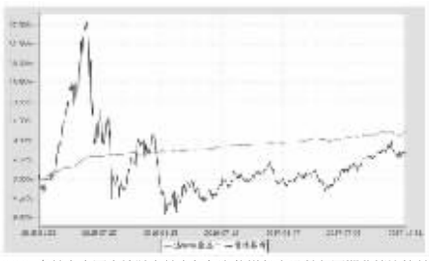
3.2 基金净值表现

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	0.62%	0.14%	0.79%	0.45%	-0.16%	-0.31%
过去六个月	1.46%	0.11%	3.98%	0.41%	-2.52%	-0.30%
过去一年	2.48%	0.09%	7.18%	0.29%	-4.69%	-0.20%
自基金合同生效起至今	11.20%	0.09%	6.19%	1.03%	5.11%	-0.94%

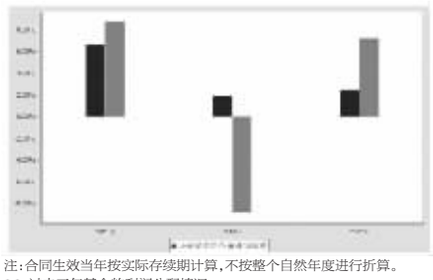
3.2.2自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华安安享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的历史走势对比图
(2015年1月23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

华安安享灵活配置混合型证券投资基金
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(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
苏玉平	本基金的基金经理	2015-01-23	2017-02-08	19年	货币银行硕士,19年证券、基金行业从业经历,曾任海通证券有限责任公司投资银行部项目经理;交通银行托管部内控监督和市场机制部经理;中银安联保险有限公司投资部部长;国泰君安基金管理有限公司基金经理。2011年2月加入华安基金管理有限公司,2011年7月起担任华安强化收益债券型证券投资基金的基金经理;2011年12月起同时担任华安行用四季红债券型证券投资基金的基金经理;2013年2月起担任华安纯债债券型发起式证券投资基金的基金经理,2013年11月起同时担任华安年年红定期开放债券型证券投资基金的基金经理。2014年4月至2017年2月同时担任华安新成为灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016年1月2017年2月担任本基金的基金经理。2016年8月起,同时担任华安新财富灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。
郑可成	本基金的基金经理、固定收益部部门经理	2017-02-08	-	16年	硕士研究生,16年证券基金从业经历。2001年7月至2004年12月在南发证券有限责任公司研究部,从事债券研究及投资,2006年1月至2008年9月在建建国林投资顾问有限公司任研究员,2008年10月至2009年7月在越秀基金管理有限公司任基金经理,2009年8月至今任职于华安基金管理有限公司固定收益部。 2010年12月起担任华安鹏国欣越债券型证券投资基金的基金经理。2012年9月起同时担任华安安心收益债券型证券投资基金的基金经理。2012年11月至2017年7月同时担任华安日日鑫货币市场基金的基金经理。2012年12月起同时担任华安信用增强债券型证券投资基金的基金经理。2013年3月起同时担任华安长丰基金的基金经理。2014年11月至2016年1月同时担任华安七日鑫短期理财债券型证券投资基金的基金经理。2014年8月起,同时担任华安年红定期开放债券型证券投资基金的基金经理。2015年1月起同时担任华安鑫利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2015年6月起同时担任华安鑫享灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2015年11月起,同时担任华安安益保本混合型证券投资基金的基金经理。2016年1月起,同时担任华安乐享保本混合型证券投资基金的基金经理。2016年2月至2017年7月,同时担任华安安盛保本混合型证券投资基金的基金经理。2016年4月至2017年7月,同时担任华安安福保本混合型证券投资基金的基金经理。2016年10月起,同时担任华安纯润两债混合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3月起,同时担任华安现金宝货币市场基金的基金经理。

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年全球经济均表现强势,美国经济持续复苏的背景下,美联储加息三次,美国减税方案获得通过,市场对于经济增长预期继续增强,引起全球债券市场震荡。国内经济呈现一定的韧性,通胀有一定回升,CPI同比增速上行,“供给侧改革”、“环保限产”等措施继续实施,PPI受到大宗商品价格上涨和基数效应影响,同比增幅高位回落。央行继续实行稳健的货币政策,总体中性偏紧,增加28天、63天逆回购对资金面进行削峰填谷,跟随美联储加息上调公开市场操作利率,市场资金成本稳步上升。一行三会制定的新监管措施频频落地,成立金融稳定发展委员会协调监管,央行牵头资管产品管理办法、证监会颁布公募基金流动性管理办法、银监会监管新规征询意见等对于市场的影响巨大。人民币汇率贬值趋势终结,下半年重启升势,汇率双向波动对于外汇占款和国内流动性改善均形成正面影响。A股市场震荡上升,沪深300指数累计涨幅21.78%。其中,食品饮料、家电、银行、保险等板块大幅跑赢市场;而国防军工、纺织、传媒等板块则明显落后市场。

报告期内,本基金投资以中短久期的债券投资为主,对权益市场保持灵活的仓位,取得了稳健收益.

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截止2017年12月31日,本基金份额净值为1.113元,本报告期份额净值增长率为2.49%,同期业绩比较基准增长率为7.18%。

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2018年,美国经济复苏延续性较强,减税落地后美国经济预期向好,通胀预期抬头,美联储加息步伐可能会逐步加快。国内经济的供给侧改革等措施还会继续实施,经济整体仍然处于转型之中。环保限产影响在年初会逐渐减少,供给和需求均会有一定程度释放,对经济产生正面影响。春节因素对一季度的食品价格产生一定影响,通胀有一定的上冲压力,但是整体压力不大。流动性新规正式实施、监管政策会继续落地,金融去杠杆会继续对货币市场和债券市场产生影响,货币市场收益率绝对值保持高位,对于投资者有较大吸引力,央行会继续采取公开市场操作平抑流动性波动。总体来说,货币市场利率中枢会在今年呈现冲高回落,收益率曲线呈现陡峭化,市场在央行护航下亦会有惊无险。预计股票市场总体上将维持震荡趋升走势,结构性机会仍将成为市场主流,消费升级和技术进步将继续成为A股市场的投资热点。

本基金将维持债券组合适度杠杆水平,动态调整组合久期.对权益仓位将采取更灵活的态度,自下而上的把握新经济的红利。本基金将秉承稳健、专业的投资理念,勤勉尽责地维护持有人的利益。

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

本报告期内,本基金托管人在对华安安享灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何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

本报告期内,华安华安安享灵活配置混合型证券投资基金的管理人——华安基金管理有限公司在华安安享灵活配置混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内,华安安享灵活配置混合型证券投资基金未进行利润分配。

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

本托管人依法对华安基金管理有限公司编制和披露的华安安享灵活配置混合型证券投资基金2017年年度报告中财务指标、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进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

§6 审计报告

本报告期的基金财务会计报告经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)审计,注册会计师 蒋燕华 蔡玉芝签字出具了安永华明(2018)审字第60971571_B18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:华安安享灵活配置混合型证券投资基金
报告截止日:2017年12月31日

单位:人民币元

资产	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
资产:	-	-
银行存款	3,130,132.62	63,766,110.57
结算备付金	131,238.22	926,146.63
存出保证金	95,549.32	90,004.20
交易性金融资产	1,069,998,949.48	799,595,446.02
其中:股票投资	286,964,749.48	1,683,446.02
基金投资	-	-
债券投资	783,044,100.00	797,912,000.00
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	30,020,165.03	1,334,963,182.44
应收证券清算款	-	-
应收利息	12,468,869.72	10,141,331.45
应收股利	-	-
应收申购款	495.11	9.94
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,116,835,299.50	2,209,482,230.25
负债和所有者权益	**本期末 2017年12月31日**	**上年度末 2016年12月31日**
负债:	-	-
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	20,000,000.00
应付赎回款	170,844.06	170,510.56
应付管理人报酬	661,596.22	1,296,584.43
应付托管费	236,284.36	463,068.86
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	22,159.88	326,538.37
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	350,004.37	400,320.63
负债合计	1,440,888.89	22,657,019.75
所有者权益:	-	-
实收基金	1,001,070,268.22	2,013,972,691.65
未分配利润	113,324,142.39	172,852,518.85
所有者权益合计	1,114,394,410.61	2,186,825,210.50
负债和所有者权益总计	1,116,835,299.50	2,209,482,230.25

注:报告截止日2017年12月31日,基金份额净值1.113元,基金份额总额1,001,070,268.22份。

7.2 利润表

会计主体:华安安享灵活配置混合型证券投资基金
本报告期:2017年1月1日至2017年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
一、收入	51,922,166.72	67,688,909.39
1.利息收入	51,167,663.76	67,625,573.83
其中:存款利息收入	9,509,896.69	2,805,419.22
债券利息收入	26,580,599.19	50,007,891.81
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	15,077,167.90	14,822,262.80
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	336,941.30	15,615,106.04
其中:股票投资收益	350,464.39	18,364,311.22
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-1,906,450.11	-3,132,902.43
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	1,892,927.02	383,697.25
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	83,068.62	-16,627,204.72
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	334,493.02	1,065,434.24
减:二、费用	14,994,817.06	24,407,404.64
1. 管理人报酬	9,884,313.08	16,699,409.96
2. 托管费	3,530,111.83	5,964,075.04
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	612,223.52	1,120,088.05
5. 利息支出	549,546.10	151,468.57
其中:卖出回购金融资产支出	549,546.10	151,468.57
6. 其他费用	418,622.53	472,363.03
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	36,927,349.66	43,281,504.75
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	36,927,349.66	43,281,504.75

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:华安安享灵活配置混合型证券投资基金
本报告期:2017年1月1日至2017年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	2,013,972,691.65	172,852,518.85	2,186,825,210.50
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	36,927,349.66	36,927,349.66
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)	-1,012,902,423.43	-96,455,726.12	-1,109,358,149.55
其中:1.基金申购款	833,699.88	82,218.44	915,918.32
2.基金赎回款	-1,013,736,123.31	-96,537,944.56	-1,110,274,067.87
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)	1,001,070,268.22	113,324,142.39	1,114,394,410.61
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)	2,713,139,935.39	178,495,810.46	2,891,635,745.84
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	43,281,504.75	43,281,504.75
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-699,167,243.74	-48,924,796.35	-748,092,040.09
其中:1.基金申购款	114,371,439.87	7,520,151.61	121,891,591.48
2.基金赎回款	-813,538,683.61	-56,444,947.96	-869,983,631.57
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)	2,013,972,691.65	172,852,518.85	2,186,825,210.50

注:1.下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

2.经华安基金管理有限公司股东会第四十一次会议审议通过,并经中国证券监督管理委员会证监许可【2017】1809号文核准,华安基金管理有限公司的原股东上海电气(集团)总公司已变更为国泰君安创新投资有限公司。华安基金管理有限公司已于2017年10月17日就上述股东变更事项进行公告。

7.4.8本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1股票交易

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股票交易。

7.4.8.1.2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。

7.4.8.1.3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。

7.4.8.1.4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。

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

7.4.8.2关联方报酬

7.4.8.2.1基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	9,884,313.08	16,699,409.96
其中:支付销售机构的客户维护费	352,300.09	619,367.23

注:基金管理费按前一日的基金资产净值的0.70%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×基金管理费年费率/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。

7.4.8.2.2基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	3,530,111.83	5,964,075.04

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×0.25%/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。

7.4.8.3与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

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

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。

7.4.8.5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 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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	3,130,132.62	400,069.36	63,766,110.57	467,996.89

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。

7.4.9期末(2017年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位:人民币元

7.4.9.1.1受限证券类别:股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002923	润都股份	2017-12-28	2018-01-05	网下中签	17.01	17.01	95,400	16,227,54	16,227,54	-
300664	鹏鹞环保	2017-12-28	2018-01-05	网下中签	8.88	8.88	3,640,000	32,323,20	32,323,20	-
603089	新疆火炬	2017-12-25	2018-01-02	网下中签	13.60	13.60	1,187,000	16,143,20	16,143,20	-
603161	科华控股	2017-12-28	2018-01-05	网下中签	16.75	16.75	1,239,000	20,753,25	20,753,25	-
7.4.9.1.2受限证券类别:债券										
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
128024	宁行转债	2017-12-06	2018-01-12	老股东配债	100.00	100.00	5,286,000	528,600,00	528,600,00	-

7.4.9.2期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位:人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌期限	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000022	深赤湾A	2017-11-20	重大事项停牌	24.14	-	-	139,906.00	3,415,829.00	3,377,186.00	-
002291	名臣健康	2017-12-28	临时停牌	35.26	2018-01-02	38.79	821.00	10,311.76	28,948.46	-
300730	科创信息	2017-12-29	临时停牌	41.56	2018-01-02	45.71	821.00	6,863.66	34,112.66	-
600893	贵州燃气	2017-12-28	临时停牌	16.86	2018-01-02	16.01	3,928.00	8,680.88	66,226.08	-

注:本基金截至2017年12月31日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票,该类股票将在所公布事项的重大影响消除后,经交易所批准复牌。

7.4.9.3期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1银行间市场债券正回购

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证券款余额。

7.4.9.3.2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证券款余额。

7.4.10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283,362,829.20元,属于第二层次的余额为人民币786,636,020.28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1,241,390.13元,属于第二层次的余额为人民币798,354,054.89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	286,964,749.48	25.72
	其中:股票	286,964,749.48	25.72
2	固定收益投资	783,044,100.00	70.18
	其中:债券	783,044,100.00	70.18
	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	30,020,165.03	2.69
	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	3,261,370.84	0.29
7	其他各项资产	12,564,914.15	1.13
8	合计	1,115,835,299.50	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	11,029,311.00	0.99
C	制造业	101,894,495.23	9.14
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	27,227,583.31	2.44
E	建筑业	8,318,616.00	0.75
F	批发和零售业	8,512,508.75	0.76
G	交通运输、仓储和邮政业	42,691,175.59	3.83
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	161,387.59	0.01
J	金融业	69,544,614.74	6.24
K	房地产业	9,976,390.00	0.90
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	59,182.29	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	7,376,942.88	0.66
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	162,548.10	0.01
S	综合	-	-
	合计	286,964,749.48	25.75

8.2.2报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

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	601238	广汽集团	400,000	9,364,000.00	0.89
2	600519	贵州茅台	11,600	8