

华安核心优选混合型证券投资基金
2017年年度报告摘要
2017年12月31日

基金管理人：华安基金管理有限公司
基金托管人：中国建设银行股份有限公司
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。

基金托管人中国建设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	华安核心优选混合	
基金主代码	040011	
交易代码	040011(前端)	041011(后端)
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2008年10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	72,223,035.13份	
基金合同存续期	不定期	

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采取“核心—卫星”股票投资策略，通过“核心”资产—沪深300指数成份股的投资力求获取股票市场整体增长的收益，通过“卫星”资产—非沪深300指数成份股的投资力求获取超额收益。
投资策略	本基金将采用自上而下和自下而上相结合的方法构建投资组合，并在投资流程中采用公司开发的数量分析模型进行支持，使其更为科学和客观。
业绩比较基准	80%×沪深300指数收益率+20%×中债国债总财富指数收益率。
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

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层、32层

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2017年	2016年	2015年
本期已实现收益	41,443,811.53	10,168,767.09	63,391,488.02
本期利润	43,903,493.66	6,797,786.03	35,486,896.90
加权平均基金份额本期利润	0.3307	0.1110	0.5298
本期基金份额净值增长率	18.68%	5.42%	29.30%
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	1.1628	0.8224	0.7287
期末基金资产净值	156,202,727.80	117,249,173.11	79,465,124.28
期末基金份额净值	2.1628	1.8224	1.7287

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	2.65%	0.48%	4.00%	0.64%	-1.35%	-0.16%
过去六个月	5.97%	0.46%	7.89%	0.56%	-1.92%	-0.10%
过去一年	18.68%	0.44%	17.05%	0.51%	1.63%	-0.07%
过去三年	61.77%	1.40%	12.29%	1.35%	49.48%	0.05%
过去五年	134.04%	1.29%	50.32%	1.24%	83.72%	0.05%
自基金合同生效起至今	211.01%	1.32%	97.21%	1.29%	113.80%	0.03%

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

华安核心优选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

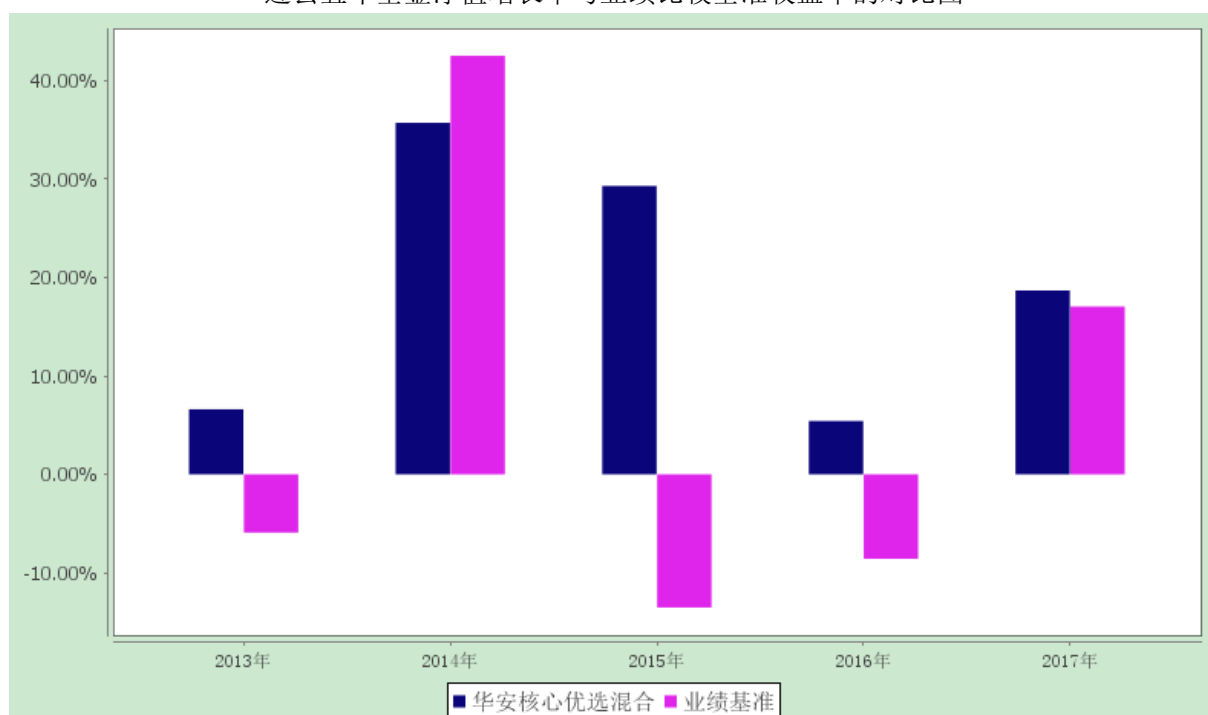
(2008年10月22日至2017年12月31日)



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

华安核心优选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



注：合同生效日当年的净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率按实际存续期计算，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

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
2017年	-	-	-	-	-
2016年	-	-	-	-	-
2015年	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

§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		
杨鑫鑫	本基金的基金经理	2013-06-05	-	9年	硕士研究生，具有基金从业资格，9年基金行业从业资格。2008年7月应届进入华安基金管理有限公司，先后担任研究发展部行业研究员、基金投资部基金经理助理。2013年6月起担任本基金的基金经理。2014年12月至2016年9月同时担任华安创新证券投资基金的基金经理。2015年3月至2017年7月担任华安新动力灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2015年4月起担任华安新丝路主题股票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交易的投资品种、进行场外的非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购、不同投资组合同日和临近交易日的反向交易以及可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控，根据市场公认的第三方信息（如：中债登的债券估值），定期对各投资组合与交易对手之间议价交易的交易价格公允性进行审查，对不同投资组合临近交易日的同向交易的交易时机和交易价差进行分析。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

本基金管理人通过统计检验的方法对管理的不同投资组合，在不同时间窗下（日内、3日内、5日内）的本年度同向交易价差进行了专项分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

本报告期内，因组合流动性管理或投资策略调整需要，除指数基金以外的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的次数

为1次，未出现异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2017年市场全年呈现震荡上行态势。沪深300指数上涨 21.8%，而创业板指逆势下跌10.7%，市场风格延续前一年趋势，显著偏向大盘价值。组合投资上，基于对市场的整体考虑，全年仍然保持在较低仓位运作，产生一定负面贡献。报告期净值小幅跑赢基准，相比同行处于平均水平，对基本面趋势的判断能力需要努力提高。

配置层面，本基金在结构上围绕沪深300基准，逐步增加了医疗、TMT等成长性行业，适度超配地产，减持了金融、周期等与宏观经济关系密切的行业。与前一年类似，对行业配置调整的时机依然不够准确，主要由于对基本面和估值的把握存在偏差，需要在未来投资决策中努力改进。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2017年12月31日，本基金份额净值为2.1628元，本报告期份额净值增长率为18.68%，同期业绩比较基准增长率为17.05%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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

市场层面，从16年初熔断开始，在基本面回升的背景下，市场经历了大约两年时间的蓝筹上升行情，缺少业绩支撑的中小盘个股大部分表现平淡。考虑到流动性及经济趋势，未来继续系统性蓝筹行情的难度较大，相对来看，经过去伪存真的中小盘个股中较有可能出现好的投资机会。本基金将保持基本面导向以及稳健投资的原则，继续努力寻找中长期投资标的，力争实现持续的超额收益。

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 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，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(2018)第20813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：华安核心优选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	74,118,773.17	32,249,612.27
结算备付金	197,623.45	145,553.26
存出保证金	55,375.96	16,690.17
交易性金融资产	127,081,170.05	85,288,751.84
其中: 股票投资	127,081,170.05	85,288,751.84
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	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	12,300.32	6,543.23
应收股利	-	-
应收申购款	180,633.67	329,942.21
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	201,645,876.62	118,037,092.98
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	19,767.12	121,617.00
应付赎回款	44,422,106.43	74,635.16
应付管理人报酬	249,280.95	145,596.53
应付托管费	41,546.83	24,266.09
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	248,050.43	85,571.90
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	462,397.06	336,233.19
负债合计	45,443,148.82	787,919.87

所有者权益：	-	-
实收基金	72,223,035.13	64,337,129.87
未分配利润	83,979,692.67	52,912,043.24
所有者权益合计	156,202,727.80	117,249,173.11
负债和所有者权益总计	201,645,876.62	118,037,092.98

注：报告截止日2017年12月31日，基金份额净值2.1628元，基金份额总额72,223,035.13份。

7.2 利润表

会计主体：华安核心优选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	50,088,400.51	9,203,784.89
1.利息收入	587,134.69	202,058.89
其中：存款利息收入	586,993.14	202,058.89
债券利息收入	141.55	-
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）	46,622,387.59	12,341,307.46
其中：股票投资收益	42,205,514.30	10,640,200.46
基金投资收益	-	-
债券投资收益	38,408.25	-
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	4,378,465.04	1,701,107.00
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	2,459,682.13	-3,370,981.06
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	419,196.10	31,399.60
减：二、费用	6,184,906.85	2,405,998.86
1. 管理人报酬	4,005,430.09	1,521,748.34
2. 托管费	667,571.59	253,624.69
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	1,212,373.58	306,197.19

5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	299,531.59	324,428.64
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	43,903,493.66	6,797,786.03
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	43,903,493.66	6,797,786.03

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安核心优选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）	64,337,129.87	52,912,043.24	117,249,173.11
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	43,903,493.66	43,903,493.66
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）	7,885,905.26	-12,835,844.23	-4,949,938.97
其中：1.基金申购款	181,846,664.24	173,743,088.23	355,589,752.47
2.基金赎回款	-173,960,758.98	-186,578,932.46	-360,539,691.44
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）	72,223,035.13	83,979,692.67	156,202,727.80
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）	45,969,206.62	33,495,917.66	79,465,124.28
二、本期经营活动产生	-	6,797,786.03	6,797,786.03

的基金净值变动数（本期利润）			
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）	18,367,923.25	12,618,339.55	30,986,262.80
其中：1.基金申购款	38,039,496.32	25,761,311.81	63,800,808.13
2.基金赎回款	-19,671,573.07	-13,142,972.26	-32,814,545.33
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）	64,337,129.87	52,912,043.24	117,249,173.11

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

华安核心优选混合型证券投资基金(原名为华安核心优选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[2008]839号《关于核准华安核心优选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《华安核心优选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，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币813,364,975.21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(2008)第149号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华安核心优选股票型证券投资基金基金合同》于2008年10月22日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为813,446,720.65份基金份额，其中认购资金利息折合81,745.44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》，华安核心优选股票型证券投资基金于2015年8月6日公告后更名为华安核心优选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《华安核心优选混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，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、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的60%-95%；债券、货币市场工具、现金、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的5%-40%，基金保

留现金或到期日在一年期以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。根据《华安基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金变更业绩比较基准的公告》的规定，自2015年9月8日起本基金的业绩比较基准由“80%×沪深300 指数收益率+20%×中信标普国债指数收益率”变更为“80%×沪深300 指数收益率+20%×中债国债总财富指数收益率”。

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2018年3月22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》、《华安核心优选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2017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2017年12月31日的财务状况以及2017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[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、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》、及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于2016年5月1日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自2016年5月1日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。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。

(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。

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、基金代销机构
上海国际信托有限公司	基金管理人的股东
国泰君安创新投资有限公司	基金管理人的股东
上海工业投资(集团)有限公司	基金管理人的股东
上海锦江国际投资管理有限公司	基金管理人的股东
国泰君安投资管理股份有限公司	基金管理人的股东
华安资产管理（香港）有限公司	基金管理人的全资子公司
华安未来资产管理（上海）有限公司	基金管理人的全资子公司

注：1. 下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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

7.4.8 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

无。

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	4,005,430.09	1,521,748.34
其中：支付销售机构的客户维护费	556,898.17	248,420.45

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1.5%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×1.5%/当年天数。

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	667,571.59	253,624.69

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×0.25%/当年天数。

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

无。

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 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
中国建设银行	74,118,773.17	580,816.83	32,249,612.27	200,428.59

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（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
603080	新疆火炬	2017-12-25	2018-01-03	新股未上市	13.60	13.60	1,187.00	16,143.20	16,143.20	-
603161	科华控股	2017-12-28	2018-01-05	新股未上市	16.75	16.75	1,239.00	20,753.25	20,753.25	-

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	停牌原因	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
002919	名臣健康	2017-12-28	股票交易异常波动	35.26	2018-01-02	38.79	821.00	10,311.76	28,948.46	-

注：本基金截止至2017年12月31日止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

截至报告期末2017年12月31日止，本基金无银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至报告期末2017年12月31日止，本基金无交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

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127,015,325.14元，属于第二层次的余额为65,844.91元，无属于第三层次的余额(2016年12月31日：第一层次85,170,582.64元，第二层次118,169.20元，无第三层次)。

(ii) 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2017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(2016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) 增值税

根据财政部、国家税务总局于2016年12月21日颁布的财税[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》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、国家税务总局于2017年6月30日颁布的财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，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。

此外，财政部、国家税务总局于2017年12月25日颁布的财税[2017]90号《关于租入固定资产进行税额抵扣等增值税政策的通知》对资管产品管理人自2018年1月1日起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的销售额确定做出规定。

上述税收政策对本基金2017年12月31日的财务状况和2017年度的经营成果无影响。

(3) 除公允价值和增值税外，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	127,081,170.05	63.02
	其中：股票	127,081,170.05	63.02
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	74,316,396.62	36.85
7	其他各项资产	248,309.95	0.12
8	合计	201,645,876.62	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	6,592,050.00	4.22

B	采矿业	21,462,930.00	13.74
C	制造业	34,017,608.91	21.78
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,292,143.20	2.11
E	建筑业	9,022,500.00	5.78
F	批发和零售业	858,360.00	0.55
G	交通运输、仓储和邮政业	17,957.94	0.01
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,090,010.00	3.26
J	金融业	16,378,200.00	10.49
K	房地产业	10,038,000.00	6.43
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	10,235,430.00	6.55
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	10,075,980.00	6.45
S	综合	-	-
	合计	127,081,170.05	81.36

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	601328	交通银行	1,620,000	10,060,200.00	6.44
2	002262	恩华药业	705,000	10,053,300.00	6.44
3	000069	华侨城 A	1,080,000	9,169,200.00	5.87
4	601857	中国石油	1,110,000	8,979,900.00	5.75
5	600028	中国石化	1,170,000	7,172,100.00	4.59
6	002041	登海种业	513,000	6,592,050.00	4.22
7	600048	保利地产	465,000	6,579,750.00	4.21
8	601336	新华保险	90,000	6,318,000.00	4.04
9	600479	千金药业	444,000	6,224,880.00	3.99
10	601098	中南传媒	432,000	6,000,480.00	3.84

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600048	保利地产	17,404,889.34	14.84

2	601336	新华保险	17,000,895.13	14.50
3	601988	中国银行	16,557,089.00	14.12
4	601117	中国化学	13,938,936.00	11.89
5	000069	华侨城A	13,086,889.01	11.16
6	601328	交通银行	12,608,561.00	10.75
7	600600	青岛啤酒	11,754,799.80	10.03
8	600479	千金药业	11,298,714.00	9.64
9	601857	中国石油	11,166,234.00	9.52
10	002244	滨江集团	11,031,812.00	9.41
11	600028	中国石化	10,715,092.00	9.14
12	002465	海格通信	10,548,931.62	9.00
13	600718	东软集团	9,752,864.69	8.32
14	601166	兴业银行	9,450,000.00	8.06
15	600170	上海建工	9,243,962.42	7.88
16	002041	登海种业	8,640,265.93	7.37
17	000528	柳 工	8,631,469.74	7.36
18	300251	光线传媒	7,997,446.00	6.82
19	000977	浪潮信息	7,913,505.00	6.75
20	600597	光明乳业	7,751,869.00	6.61
21	000338	潍柴动力	7,361,380.00	6.28
22	000895	双汇发展	7,175,784.81	6.12
23	002029	七 匹 狼	7,175,126.25	6.12
24	603686	龙马环卫	6,887,320.00	5.87
25	300315	掌趣科技	6,862,176.00	5.85
26	002262	恩华药业	6,563,375.70	5.60
27	600489	中金黄金	6,482,968.99	5.53
28	002179	中航光电	6,367,210.86	5.43
29	601021	春秋航空	6,361,689.37	5.43
30	000783	长江证券	6,330,178.00	5.40
31	600795	国电电力	6,030,000.00	5.14
32	600713	南京医药	5,796,766.00	4.94
33	601628	中国人寿	5,171,912.09	4.41
34	601098	中南传媒	5,157,562.42	4.40
35	300494	盛天网络	5,115,790.00	4.36
36	601818	光大银行	4,810,200.00	4.10
37	300367	东方网力	4,771,507.00	4.07
38	300310	宜通世纪	4,759,612.12	4.06
39	600312	平高电气	4,510,096.02	3.85
40	002032	苏 泊 尔	4,048,544.10	3.45
41	000726	鲁 泰 A	3,860,503.00	3.29
42	600737	中粮糖业	3,766,441.00	3.21
43	601333	广深铁路	3,675,051.78	3.13
44	002405	四维图新	3,643,036.00	3.11
45	300017	网宿科技	3,614,766.20	3.08
46	000401	冀东水泥	3,426,883.00	2.92
47	000063	中兴通讯	3,233,722.00	2.76
48	300165	天瑞仪器	3,216,296.00	2.74
49	300188	美亚柏科	3,190,688.88	2.72
50	000888	峨眉山 A	3,139,162.00	2.68
51	002223	鱼跃医疗	2,890,291.76	2.47
52	002279	久其软件	2,634,480.82	2.25

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	601988	中国银行	18,504,927.68	15.78
2	601336	新华保险	18,490,712.39	15.77
3	600048	保利地产	16,170,447.00	13.79
4	600600	青岛啤酒	15,741,842.03	13.43
5	000069	华侨城 A	15,509,824.00	13.23
6	000528	柳 工	14,433,857.01	12.31
7	601117	中国化学	12,253,569.00	10.45
8	601818	光大银行	10,797,984.00	9.21
9	000895	双汇发展	10,741,238.72	9.16
10	000063	中兴通讯	10,544,478.20	8.99
11	601628	中国人寿	10,446,212.75	8.91
12	000977	浪潮信息	9,802,326.47	8.36
13	000338	潍柴动力	9,468,058.72	8.08
14	601166	兴业银行	8,961,254.38	7.64
15	600597	光明乳业	8,801,610.44	7.51
16	002465	海格通信	8,263,397.46	7.05
17	002244	滨江集团	8,091,200.84	6.90
18	600028	中国石化	7,520,218.00	6.41
19	002029	七 匹 狼	6,802,767.37	5.80
20	601328	交通银行	6,495,113.00	5.54
21	002179	中航光电	6,440,915.32	5.49
22	601021	春秋航空	6,399,790.12	5.46
23	300315	掌趣科技	6,096,633.40	5.20
24	601333	广深铁路	6,089,229.00	5.19
25	002142	宁波银行	5,640,736.00	4.81
26	000783	长江证券	5,583,435.00	4.76
27	000401	冀东水泥	5,161,152.00	4.40
28	000538	云南白药	5,016,250.05	4.28
29	002405	四维图新	4,966,967.50	4.24
30	300251	光线传媒	4,901,733.94	4.18
31	600612	老凤祥	4,834,151.01	4.12
32	600713	南京医药	4,654,400.00	3.97
33	300494	盛天网络	4,548,403.00	3.88
34	300367	东方网力	4,454,791.00	3.80
35	600312	平高电气	4,297,224.94	3.67
36	300310	宜通世纪	4,292,006.00	3.66
37	002032	苏 泊 尔	4,280,813.78	3.65
38	600054	黄山旅游	4,236,798.00	3.61
39	600479	千金药业	4,221,257.00	3.60
40	300017	网宿科技	4,182,079.00	3.57
41	600718	东软集团	3,975,503.95	3.39
42	600362	江西铜业	3,686,850.00	3.14
43	002279	久其软件	3,676,225.71	3.14
44	600737	中粮糖业	3,665,881.00	3.13
45	600170	上海建工	3,542,566.53	3.02
46	300188	美亚柏科	3,424,273.72	2.92
47	601636	旗滨集团	3,148,396.00	2.69
48	600428	中远海特	3,090,824.00	2.64
49	300165	天瑞仪器	2,979,386.00	2.54
50	002223	鱼跃医疗	2,969,386.39	2.53

51	600489	中金黄金	2,802,738.21	2.39
52	000926	福星股份	2,790,150.00	2.38
53	600795	国电电力	2,487,655.00	2.12

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	401,545,421.82
卖出股票的收入（成交）总额	404,418,200.04

注：本项“买入股票的成本（成交）总额”和“卖出股票的收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券投资。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的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投资。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证投资。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

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 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。

8.11.2 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	55,375.96
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	12,300.32
5	应收申购款	180,633.67
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	248,309.95

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

本基金本报告期期末前十名股票中未存在流通受限情况。

§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
16,819	4,294.13	2,504.81	0.00%	72,220,530.32	100.00 %

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	218,916.88	0.30%

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(2008年10月22日)基金份额总额	813,446,720.65
本报告期期初基金份额总额	64,337,129.87
本报告期基金总申购份额	181,846,664.24
减：本报告期基金总赎回份额	173,960,758.98
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	72,223,035.13

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本基金管理人重大人事变动如下：

(1) 2017年8月9日，基金管理人发布了《华安基金管理有限公司关于副总经理变更的公告》，章国富先生不再担任本基金管理人的副总经理。

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

2、本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动如下：

2017年9月1日，中国建设银行发布公告，聘任纪伟为中国建设银行资产托管业务部总经理。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内无基金投资策略的改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘为基金审计的会计师事务所。

报告年度应支付给聘任会计师事务所的报酬为人民币55,000.00元。

目前的审计机构已提供审计服务的连续年限：自基金合同生效日起至今。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内无管理人、托管人及其高级管理人员受证券监管部门稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易	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	
万联证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
联讯证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
财富证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
中山证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	154,494,970.56	19.33%	140,791.23	19.10%	-
长江证券	2	114,927,656.04	14.38%	106,763.54	14.49%	-
海通证券	1	88,185,601.38	11.03%	82,126.97	11.14%	-
天风证券	2	85,368,330.15	10.68%	77,931.05	10.57%	-
华泰证券	1	58,281,623.34	7.29%	54,277.96	7.36%	-
广发证券	1	57,960,797.93	7.25%	53,979.15	7.32%	-
中金公司	1	39,173,059.59	4.90%	36,481.50	4.95%	-
国泰君安	1	27,370,558.02	3.42%	24,942.92	3.38%	-
兴业证券	1	26,942,970.66	3.37%	25,092.43	3.40%	-
瑞银证券	1	26,167,615.80	3.27%	23,846.66	3.24%	-
上海证券	2	23,349,656.95	2.92%	21,278.50	2.89%	-
东北证券	1	19,736,696.41	2.47%	18,380.67	2.49%	-
华安证券	1	19,158,908.28	2.40%	17,842.65	2.42%	-
申万宏源	1	14,849,283.01	1.86%	13,532.12	1.84%	-
西南证券	1	12,306,983.96	1.54%	11,215.39	1.52%	-
光大证券	1	10,133,339.52	1.27%	9,234.47	1.25%	-
广州证券	2	8,606,030.30	1.08%	8,015.02	1.09%	-
中信证券	1	8,402,297.68	1.05%	7,824.93	1.06%	-
招商证券	3	3,757,626.20	0.47%	3,499.51	0.47%	-

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；具备健全的内部控制制度，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：

2017年11月完成租用托管在建行的长江证券深圳000510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

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
海通证券	1,280,549.80	100.00%	-	-	-	-

12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20171123-20171227	20,759,775.08	0.00	20,759,775.08	0.00	0.00%

产品特有风险

本基金报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过20%的情形。如该单一投资者大额赎回将可能导致基金份额净值波动风险、基金流动性风险等特定风险。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

华安基金管理有限公司
二〇一八年三月二十七日