

华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金
2016 年年度报告
2016 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：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一七年三月二十八日

§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 2017 年 3 月 24 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。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 12 月 31 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	6
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、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
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	16
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	16
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	16
§6 审计报告	17
6.1 管理层对财务报表的责任	17
6.2 注册会计师的责任	17
6.3 审计意见	17
§7 年度财务报表	18
7.1 资产负债表	18
7.2 利润表	20
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	21
7.4 报表附注	22
§8 投资组合报告	45
8.1 期末基金资产组合情况	45
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	46
8.3 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	48
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	60
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	62
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	62

8.7	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	63
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	63
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	63
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	63
8.12	投资组合报告附注	63
§9	基金份额持有人信息	65
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	65
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	65
§10	开放式基金份额变动	65
§11	重大事件揭示	65
11.1	基金份额持有人大会决议	65
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	66
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	66
11.4	基金投资策略的改变	66
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	66
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	66
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	66
11.8	其他重大事件	68
§12	影响投资者决策的其他重要信息	73
§13	备查文件目录	73
13.1	备查文件目录	73
13.2	存放地点	73
13.3	查阅方式	73

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金	
基金简称	华安中国 A 股增强指数	
基金主代码	040002	
交易代码	040002(前端)	041002(后端)
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2002 年 11 月 8 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	4,806,686,210.22 份	
基金合同存续期	不定期	

2.2 基金产品说明

投资目标	运用增强性指数化投资方法,通过控制股票投资组合相对 MSCI 中国 A 股指数有限度的偏离,力求基金收益率适度超越本基金比较基准,并在谋求基金资产长期增值的基础上,择机实现一定的收益和分配。
投资策略	<p>(1) 资产配置: 本基金投资于股票的目标比例为基金资产净值的 95%。本基金在目前中国证券市场缺少规避风险工具的情况下,可以根据开放式基金运作的实际需求和市场的实际情况,适当调整基金资产分配比例。</p> <p>(2) 股票投资: 本基金以 MSCI 中国 A 股指数成分股构成及其权重等指标为基础,通过复制和有限度的增强管理方法,构造指数化投资组合。在投资组合建立后,基金经理定期检验该组合与比较基准的跟踪偏离度,适时对投资组合进行调整,使跟踪偏离度控制在限定的范围内。此外,本基金还将积极参与一级市场的新股申购、股票增发等。</p> <p>(3) 其它投资: 本基金将审慎投资于经中国证监会批准的其它金融工具,减少基金资产的风险并提高基金的收益。</p>
业绩比较基准	95% × MSCI 中国 A 股指数收益率 + 5% × 金融同业存款利率
风险收益特征	本基金为增强型指数基金,通过承担证券市场的系统性风险,来获取市场

	的平均回报，属于中等风险、中等收益的投资产品。
--	-------------------------

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	钱鲲	郭明
	联系电话	021-38969999	010-66105799
	电子邮箱	qiankun@huaan.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4008850099	95588
传真		021-68863414	010-66105798
注册地址		上海市世纪大道8号上海国金中心二期31层、32层	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址		上海市世纪大道8号上海国金中心二期31层、32层	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码		200120	100140
法定代表人		朱学华	易会满

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
登载基金年度报告正文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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼
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、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	2016 年	2015 年	2014 年
本期已实现收益	-64,278,024.03	2,061,351,024.73	597,804,347.70
本期利润	-311,979,374.05	804,736,733.77	2,053,030,764.12
加权平均基金份额本期利润	-0.0779	0.1643	0.2124
本期加权平均净值利润率	-11.26%	20.36%	42.04%
本期基金份额净值增长率	-10.16%	10.07%	48.99%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
期末可供分配利润	1,776,966,501.57	1,363,792,085.40	488,280,471.74
期末可供分配基金份额利润	0.3697	0.3984	0.0549
期末基金资产净值	3,410,446,226.71	2,747,064,819.46	6,572,191,148.22
期末基金份额净值	0.710	0.802	0.739
3.1.3 累计期末指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
基金份额累计净值增长率	312.07%	358.69%	316.72%

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	1.00%	0.74%	0.60%	0.67%	0.40%	0.07%
过去六个月	4.26%	0.82%	3.33%	0.73%	0.93%	0.09%

过去一年	-10.16%	1.58%	-13.97%	1.45%	3.81%	0.13%
过去三年	47.33%	1.86%	36.85%	1.72%	10.48%	0.14%
过去五年	53.13%	1.59%	39.93%	1.51%	13.20%	0.08%
自基金合同生效起至今	312.07%	1.65%	201.67%	1.63%	110.40%	0.02%

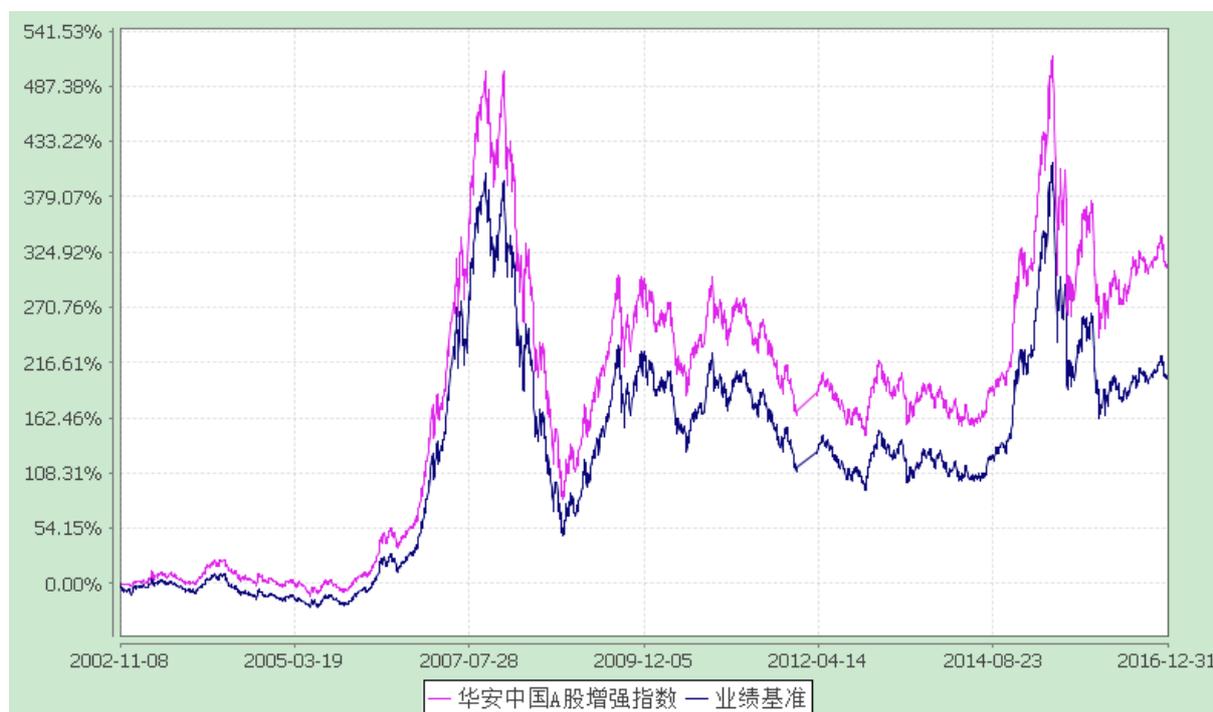
注：业绩比较基准收益率=95%×MSCI 中国 A 股指数+5%×金融同业存款利率，业绩比较基准在每个交易日实现再平衡。

根据基金合同的规定：本基金将基金资产的 70%-95% 投资于股票，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%。本基金可以投资于权证，权证的投资比例不高于基金资产净值的 3%。

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 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金

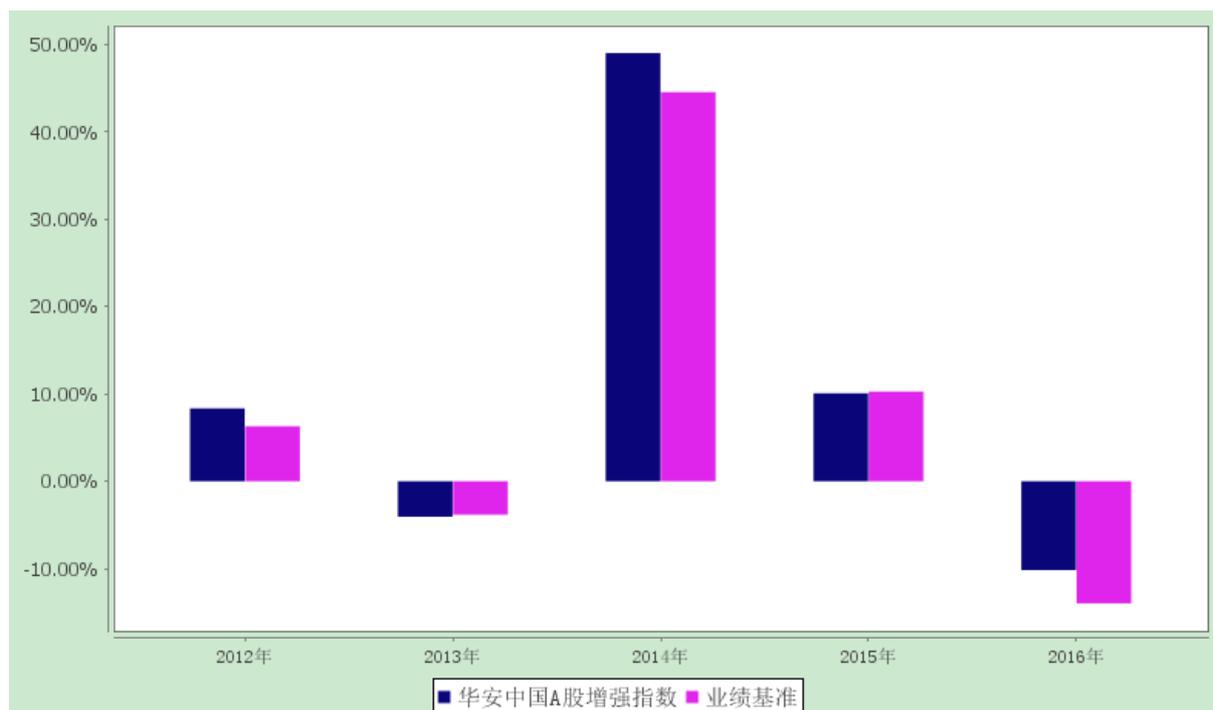
自基金合同生效以来份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2002 年 11 月 8 日至 2016 年 12 月 31 日)



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 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金

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
2014年	-	-	-	-	-
2015年	0.100	33,855,265.71	38,450,368.35	72,305,634.06	-
2016年	0.100	17,264,662.09	19,081,478.55	36,346,140.64	-
合计	0.200	51,119,927.80	57,531,846.90	108,651,774.70	-

§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。目前的股东为上海电气（集团）总公司、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投资管理股份有限公司。

截至2016年12月31日，公司旗下共管理华安创新混合、华安中国A股增强指数、华安现金富利货币、华安宝利配置混合、华安宏利混合、华安中小盘成长混合、华安策略优选混合、华安核

心优选混合、华安稳定收益债券、华安动态灵活混合、华安强化收益债券、华安行业轮动混合、华安上证 180ETF、华安上证 180ETF 联接、华安上证龙头 ETF、华安上证龙头 ETF 联接、华安升级主题混合、华安稳固收益债券、华安可转债、华安深证 300 指数 (LOF)、华安科技动力混合、华安信用四季红债券、华安香港精选股票、华安大中华升级股票、华安标普石油指数基金 (QDII-LOF)、华安月月鑫短期理财债券、华安季季鑫短期理财债券、华安月安鑫短期理财债券、华安沪深 300 指数分级、华安逆向策略混合、华安日日鑫货币、华安安心收益债券、华安信用增强债券、华安纯债、华安保本混合、华安双债添利债券、华安安信消费混合、华安纳斯达克 100 指数、华安黄金易 ETF、华安黄金 ETF 联接、华安沪深 300 量化增强、华安年年红债券、华安生态优先混合、华安中证细分医药 ETF、华安大国新经济股票、华安新活力混合、华安安顺灵活配置混合、华安汇财通货币、华安国际龙头 (DAX) ETF、华安国际龙头 (DAX) ETF 联接、华安中证细分医药 ETF 联接、华安安享灵活配置混合、华安年年盈定期开放债券、华安物联网主题股票、华安新丝路主题股票、华安新动力灵活配置混合、华安智能装备主题股票、华安媒体互联网混合、华安新机遇保本混合、华安新优选灵活配置混合、华安新回报灵活配置混合、华安中证全指证券指数分级、华安中证银行指数分级、华安国企改革主题混合、华安添颐养老混合发起式、华安创业板 50 指数分级、华安新乐享保本混合、华安安益保本混合、华安乐惠保本混合、华安安康保本混合、华安安华保本混合、华安沪港深外延增长混合、华安全球美元收益债券、华安安禧保本混合、华安全球美元票息债券、华安创业板 50ETF、华安安进保本混合发起式、华安聚利 18 个月定开债、华安智增精选灵活配置混合、华安新财富灵活配置混合、华安安润灵活配置混合、华安睿享定开混合发起式、华安新希望灵活配置混合、华安鼎丰债券发起式、华安新瑞利灵活配置混合、华安新泰利灵活配置混合、华安新恒利灵活配置混合、华安事件驱动量化策略混合、华安新丰利灵活配置混合等 89 只开放式基金。管理资产规模达到 1632.85 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		
牛勇	本基金的 基金经理	2010-09-02	-	12 年	复旦大学经济学硕士, FRM (金融风险管理师), 12 年证券金融从业经历, 曾在泰康人寿保险股份有限公司从事研究工作。2008 年 5 月加入华安基金管理有限公司后任风险管理与金融工程部高级金融工程师, 2009 年 7 月至 2010 年 8 月担任本基金的基金经

					理助理，2010 年 6 月至 2012 年 12 月担任上证 180 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2010 年 9 月起同时担任本基金的基金经理。2010 年 11 月起担任上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理。2012 年 6 月至 2015 年 5 月同时担任华安沪深 300 指数分级证券投资基金的基金经理。2014 年 12 月起担任华安沪深 300 量化增强型指数证券投资基金的基金经理。2016 年 12 月起，同时担任华安事件驱动量化策略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 9 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

2016 年宏观经济触底回升，PMI 指数全年基本恢复至荣枯线 50 以上，PPI 环比显著回升；国内黑色大宗商品价格涨幅明显，一方面供给侧改革下去产能加速，另一方面说明真实需求也在触底回

升，中上游产品的供求关系得以显著改善。在经历年初的熔断后，市场中的杠杆资金占比恢复至正常水平，资金面趋于平稳，优质成长股与大部分价值股的估值水平得以恢复，部分产品价格与销量呈现景气特征的周期品与中游品种股价表现强劲。本基金配置风格上偏向价值明显的成长股，在行业上对食品饮料、建筑有所超配。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2016 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 0.710 元，本报告期份额净值增长率为-10.16%，同期业绩比较基准增长率为-13.97。截至 2016 年 12 月 31 日，本基金过去 30 个交易日日均跟踪偏离度为 0.3%（按照基金合同和招募说明书规定）。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下一阶段，我们认为国内宏观经济继续复苏。一方面，从公布的基建投资总额看，可有效对冲地产投资的下滑；另一方面，三四线城市前两月地产销售增速并不低，进而地产投资增速可能会比市场预期好。上半年是美联储加息空窗期，全球新兴市场具有较好的投资机会。而央行提出的“稳健中性”货币政策基调，更多是与当前经济回升相一致，预计对债市影响大于股市，且股市将更加关注基本面变化带来的投资机会。从品种选择上，看好各行业龙头公司的相对表现；以及看好估值水平合理，且子行业具备景气特征的成长股品种。作为 MSCI 中国 A 股增强型指数基金的管理人，我们将在跟踪指数的前提下，通过适度增强操作，勤勉尽责，为投资者获得长期稳定的回报。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，公司合规监察稽核部从维护基金份额持有人利益、保障基金的合规运作出发，重点在法律事务、合规管理、内部稽核、信息披露、反洗钱、员工行为规范等方面开展工作，深化员工的合规意识，推动公司的合规文化和内部风险控制机制的完善与优化。

监察稽核工作重点集中于以下几个方面：

- （1）积极配合监管部门新法规的实施，不断完善公司的内部控制制度和业务操作流程；
- （2）继续深化“主动合规”的管理理念，强化全体员工的合规意识和风险控制意识，通过定期组织员工进行职业道德规范、反洗钱、防范利益冲突、客户信息保密、销售适用性等方面的合规培训和内部审计，推动公司建立良好的内控环境和合规文化。
- （3）完善公司内控建设，强化基金的公平交易和异常交易的检查与监控，防范内幕交易与操纵市场行为的出现，同时进行投资管理人员合规培训、及定期进行基金经理的合规谈话，建立健全坚守“三条底线”的长效机制；

(4) 做好在新基金产品开发、新投资品种、及其他创新业务中法律、合规及风险控制方面的支持，坚持定期对投资、研究、交易、核算、销售等相关业务活动的日常合规性检查。

(5) 推动落实公司投资、运营业务操作流程标准化，细化各相关部门在各业务环节的操作流程及工作职责，降低操作风险发生的概率。

(6) 按照法规的要求，做好旗下各只基金的信息披露工作，做到信息披露的真实、完整、准确、及时。

(7) 有计划地对公司投资研究、基金销售、后台运营等相关业务部门进行了多次全面或专项稽核，强化对公司制度执行和风控措施的落实。

本基金管理人承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范和控制各种风险，保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1、估值政策及重大变化

无。

2、估值政策重大变化对基金资产净值及当期损益的影响

无。

3、有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历的描述

(1) 公司方面

公司建立基金估值委员会，组成人员包括：基金投资部兼全球投资部高级总监、投资研究部高级总监、固定收益部总监、指数投资部高级总监、基金运营部总经理及相关负责人员。

主要职责包括：证券发行机构发生了严重影响证券价格的重大事件时，负责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；同时将采用确定的方法以及采用该方法对相关证券估值后与基金的托管银行进行沟通。

相关人员专业胜任能力及工作经历：

翁启森，基金投资部兼全球投资部高级总监，总经理助理，工业工程学硕士。曾在台湾 JP 证券任金融产业分析师及投资经理，台湾摩根富林明投信投资管理部任基金经理，台湾中信证券投资总监助理，台湾保德信投信基金基金经理。2008 年 4 月加入华安基金管理有限公司，现任华安香港精选

股票、华安大中华升级股票、华安大国新经济股票、华安物联网主题股票的基金经理，华安基金管理有限公司总经理助理、基金投资部兼全球投资部高级总监。

杨明，投资研究部高级总监，研究生学历。曾在上海银行从事信贷员、交易员及风险管理。2004 年 10 月进入华安基金管理有限公司，担任研究发展部宏观研究员，现任华安策略优选混合、华安沪港深外延增长混合、华安安禧保本的基金经理，投资研究部高级总监。

贺涛，金融学硕士，固定收益部总监。曾任长城证券有限责任公司债券研究员，华安基金管理有限公司债券研究员、债券投资风险管理员、固定收益投资经理。现任华安现金富利货币、华安稳定收益债券、华安可转债、华安月月鑫短期理财、华安季季鑫短期理财、华安月安鑫短期理财、华安信用增强债券、华安双债添利债券、华安汇财通货币、华安年年盈定期开放式债券、华安新回报灵活配置、华安新乐享保本、华安乐惠保本、华安安华保本、华安安进保本、华安新希望混合、华安睿享定开混合的基金经理，固定收益部总监。

许之彦，指数投资部高级总监，理学博士，CQF(国际数量金融工程师)。曾在广发证券和中山大学经济管理学院博士后流动站从事金融工程工作，2005 年加入华安基金管理有限公司，曾任研究发展部数量策略分析师，现任华安上证 180ETF 及华安上证 180ETF 联接、华安深证 300 指数 (LOF)、华安易富黄金 ETF 及联接、华安中证全指证券公司指数分级、华安中证银行指数分级、华安创业板 50 指数分级、华安创业板 50ETF 的基金经理，指数投资部高级总监。

陈林，基金运营部总经理，工商管理硕士，高级会计师，CPA 中国注册会计师协会非执业会员。曾在安永大华会计师事务所工作，2004 年 11 月加入华安基金管理有限公司，曾任财务核算部副总监、公司财务部总经理，现任基金运营部总经理。

(2) 托管银行

托管银行根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任，并且认真核查公司采用的估值政策和程序。

(3) 会计师事务所

对相关估值模型、假设及参数的适当性出具审核意见和报告。

4、基金经理参与或决定估值的程度

本基金的基金经理未参与基金的估值。

5、参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间无任何重大利益冲突。

6、已签约的任何定价服务的性质与程度等信息

无。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内共实施一次分红，分红方案为：0.10 元/10 份，权益登记日及除息日：2016 年 1 月 20 日；现金红利发放日：2016 年 1 月 21 日。

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

本报告期内，本基金托管人在对华安 MSCI 中国 A 股指数增强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 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金的管理人——华安基金管理有限公司在华安 MSCI 中国 A 股指数增强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 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金对基金份额持有人进行了 1 次利润分配，分配金额为 36,346,140.64 元。

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 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金 2016 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

普华永道中天审字(2017)第 20241 号

华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金全体基金份额持有人:

我们审计了后附的华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金(以下简称“华安 MSCI 中国 A 股指数基金”)的财务报表,包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表、2016 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

6.1 管理层对财务报表的责任

编制和公允列报财务报表是华安 MSCI 中国 A 股指数基金的基金管理人华安基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括:

(1) 按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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财务报表,并使其实现公允反映;

(2) 设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

6.2 注册会计师的责任

我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则,计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断,包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时,注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性,以及评价财务报表的总体列报。

我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。

6.3 审计意见

我们认为,上述华安 MSCI 中国 A 股指数基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中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,公允反映了华安 MSCI 中国 A 股指数基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和基金净值变动情况。

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙) 中国注册会计师
 单 峰 张 振 波
 上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼
 2017 年 3 月 24 日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金

报告截止日：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	7.4.7.1	184,716,556.67	167,502,417.61
结算备付金		6,935,145.09	4,780,904.44
存出保证金		775,495.80	1,140,217.12
交易性金融资产	7.4.7.2	3,231,662,799.55	2,546,062,841.72
其中：股票投资		3,229,348,451.31	2,544,074,326.04
基金投资		-	-
债券投资		2,314,348.24	1,988,515.68
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		2,795,050.90	4,515,803.35
应收利息	7.4.7.5	41,754.75	34,662.29
应收股利		-	-
应收申购款		2,707,031.32	35,361,731.00
递延所得税资产		-	-

其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		3,429,633,834.08	2,759,398,577.53
负债和所有者权益	附注号	本期末	上年度末
		2016 年 12 月 31 日	2015 年 12 月 31 日
负 债:		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	3,738,944.57
应付赎回款		10,582,822.44	2,145,378.07
应付管理人报酬		2,897,477.43	2,279,228.33
应付托管费		579,495.48	455,845.68
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	4,247,738.64	2,849,361.42
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	880,073.38	865,000.00
负债合计		19,187,607.37	12,333,758.07
所有者权益:		-	-
实收基金	7.4.7.9	1,464,601,883.81	1,042,906,423.93
未分配利润	7.4.7.10	1,945,844,342.90	1,704,158,395.53
所有者权益合计		3,410,446,226.71	2,747,064,819.46
负债和所有者权益总计		3,429,633,834.08	2,759,398,577.53

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.710 元，基金份额总额 4,806,686,210.22 份。

7.2 利润表

会计主体：华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
一、收入		-259,579,808.96	888,781,771.14
1.利息收入		1,269,663.54	2,505,781.75
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,263,171.59	1,932,930.44
债券利息收入		6,491.95	572,851.31
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）		-13,148,122.48	2,142,890,280.35
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-45,232,446.63	2,103,261,168.14
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	145,920.38	407,528.07
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	31,938,403.77	39,221,584.14
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-247,701,350.02	-1,256,614,290.96
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-	-
减：二、费用		52,399,565.09	84,045,037.37
1. 管理人报酬		27,633,922.29	39,574,853.60
2. 托管费		5,526,784.52	7,914,970.74

3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	18,852,218.10	36,171,365.86
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.19	386,640.18	383,847.17
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-311,979,374.05	804,736,733.77
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-311,979,374.05	804,736,733.77

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 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）	1,042,906,423.93	1,704,158,395.53	2,747,064,819.46
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-311,979,374.05	-311,979,374.05
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）	421,695,459.88	590,011,462.06	1,011,706,921.94
其中：1.基金申购款	1,034,798,494.52	1,366,709,285.56	2,401,507,780.08
2.基金赎回款	-613,103,034.64	-776,697,823.50	-1,389,800,858.14
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）	-	-36,346,140.64	-36,346,140.64
五、期末所有者权益（基金净值）	1,464,601,883.81	1,945,844,342.90	3,410,446,226.71

项目	上年度可比期间		
	2015 年 1 月 1 日至 2015 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）	2,709,471,434.56	3,862,719,713.66	6,572,191,148.22
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	804,736,733.77	804,736,733.77
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）	-1,666,565,010.63	-2,890,992,417.84	-4,557,557,428.47
其中：1.基金申购款	1,390,610,857.76	2,206,994,948.15	3,597,605,805.91
2.基金赎回款	-3,057,175,868.39	-5,097,987,365.99	-8,155,163,234.38
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）	-	-72,305,634.06	-72,305,634.06
五、期末所有者权益（基金净值）	1,042,906,423.93	1,704,158,395.53	2,747,064,819.46

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：章国富，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 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金(2006 年 1 月 9 日前原名为华安上证 180 指数增强型证券投资基金，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”)证监基金字[2002]第 70 号《关于同意华安上证 180 指数增强型证券投资基金设立的批复》核准，由华安基金管理有限公司依照《证券投资基金管理暂行办法》及其实施细则、《开放式证券投资基金试点办法》等有关规定和《华安上证 180 指数增强型证券投资基金基金契约》(后变更为《华安上证 180 指数增

强型证券投资基金基金合同》)发起,并于 2002 年 11 月 8 日募集成立。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 3,094,001,258.61 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道验字(2002)第 126 号验资报告予以验证。本基金的基金管理人为华安基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据 2006 年 1 月 14 日发布的《关于华安上证 180 指数增强型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果的公告》,并经中国证监会证监基金字[2006]8 号《关于核准华安上证 180 指数增强型证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复》核准,本基金自 2006 年 1 月 9 日起更名为华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金,跟踪标的的成份指数由上证 180 指数变更为 MSCI 中国 A 股指数。

根据《华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金招募说明书》和《关于华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金基金份额拆分比例的公告》的有关规定,本基金于 2008 年 4 月 29 日进行了基金份额拆分,拆分比例为 3.281806547,并于 2008 年 4 月 30 日进行了变更登记。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金主要投资于由权威机构发布的、代表中国 A 股市场的 MSCI 中国 A 股指数的成份股。本基金投资于股票的目标比例为基金资产净值的 95%,投资标的指数成份股的比重在 50 个交易日内不持续低于股票净值的 80%;此外,本基金可参与股票一级市场的市值配售及标的指数成份股的增发和配股,在成份股之外的股票投资仅限于未售出的配售新股、预期将调整入指数成份股的个股以及增强型投资中替代成份股的其他个股。本基金持有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%。本基金的业绩比较基准为 MSCI 中国 A 股指数收益率 \times 95%+金融同业存款利率 \times 5%。

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 2017 年 3 月 24 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 MSCI 中国 A 股指数增强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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2016 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 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应

收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按红利发放日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。具体收益分配政策请参见本基金合同中的相关章节。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2) 在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

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 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
活期存款	184,716,556.67	167,502,417.61

定期存款	-	-
其他存款	-	-
合计	184,716,556.67	167,502,417.61

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2016 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		3,286,877,913.83	3,229,348,451.31	-57,529,462.52
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	2,025,400.00	2,314,348.24	288,948.24
	银行间市场	-	-	-
	合计	2,025,400.00	2,314,348.24	288,948.24
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		3,288,903,313.83	3,231,662,799.55	-57,240,514.28
项目		上年度末 2015 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		2,354,113,605.98	2,544,074,326.04	189,960,720.06
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	1,488,400.00	1,988,515.68	500,115.68
	银行间市场	-	-	-
	合计	1,488,400.00	1,988,515.68	500,115.68
资产支持证券		-	-	-

基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	2,355,602,005.98	2,546,062,841.72	190,460,835.74

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

7.4.7.4 买入返售金融资产

无余额。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	34,990.29	31,075.89
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	3,120.80	2,151.40
应收债券利息	3,294.76	921.90
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	348.90	513.10
合计	41,754.75	34,662.29

7.4.7.6 其他资产

无余额。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末

	2016 年 12 月 31 日	2015 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	4,245,307.45	2,846,930.23
银行间市场应付交易费用	2,431.19	2,431.19
合计	4,247,738.64	2,849,361.42

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2016 年 12 月 31 日	2015 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	500,000.00	500,000.00
应付赎回费	73.38	-
预提费用	380,000.00	365,000.00
合计	880,073.38	865,000.00

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	3,423,231,890.05	1,042,906,423.93
本期申购	3,395,963,283.02	1,034,798,494.52
本期赎回（以“-”号填列）	-2,012,508,962.85	-613,103,034.64
本期末	4,806,686,210.22	1,464,601,883.81

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

7.4.7.10 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	1,363,792,085.40	340,366,310.13	1,704,158,395.53
本期利润	-64,278,024.03	-247,701,350.02	-311,979,374.05
本期基金份额交易产生的	513,798,580.84	76,212,881.22	590,011,462.06

变动数			
其中：基金申购款	1,231,170,312.68	135,538,972.88	1,366,709,285.56
基金赎回款	-717,371,731.84	-59,326,091.66	-776,697,823.50
本期已分配利润	-36,346,140.64	-	-36,346,140.64
本期末	1,776,966,501.57	168,877,841.33	1,945,844,342.90

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	1,166,932.95	1,722,520.23
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	83,238.94	140,085.39
其他	12,999.70	70,324.82
合计	1,263,171.59	1,932,930.44

7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	5,914,686,605.71	13,532,319,741.12
减：卖出股票成本总额	5,959,919,052.34	11,429,058,572.98
买卖股票差价收入	-45,232,446.63	2,103,261,168.14

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	672,488.67	64,047,267.90
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	526,000.00	60,908,940.00
减：应收利息总额	568.29	2,730,799.83
买卖债券差价收入	145,920.38	407,528.07

7.4.7.14 衍生工具收益

无。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
股票投资产生的股利收益	31,938,403.77	39,221,584.14
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	31,938,403.77	39,221,584.14

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
1.交易性金融资产	-247,701,350.02	-1,256,614,290.96
——股票投资	-247,490,182.58	-1,256,976,899.96
——债券投资	-211,167.44	362,609.00
——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	-	-

合计	-247,701,350.02	-1,256,614,290.96
----	-----------------	-------------------

7.4.7.17 其他收入

无。

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
交易所市场交易费用	18,852,218.10	36,171,365.86
银行间市场交易费用	-	-
合计	18,852,218.10	36,171,365.86

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
审计费用	100,000.00	105,000.00
信息披露费	280,000.00	260,000.00
银行汇划费用	640.18	847.17
帐户维护费	6,000.00	18,000.00
合计	386,640.18	383,847.17

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布《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[2016]140 号)，要求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，自 2016 年 5 月 1 日起执行。

根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》(财税[2017]2 号), 2017 年 7 月 1 日(含)以后, 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, 按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在 2017 年 7 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。资管产品运营过程中发生增值税应税行为的具体征收管理办法, 由国家税务总局另行制定。截至本财务报表批准报出日止, 上述税收政策对本基金 2016 年度的财务状况和经营成果无影响。

7.4.9 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
中国工商银行股份有限公司 (“中国工商银行”)	基金托管人、基金销售机构
上海国际信托有限公司	基金管理人的股东
上海电气(集团)总公司	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

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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位: 人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12 月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12 月31日
当期发生的基金应支付的管理费	27,633,922.29	39,574,853.60
其中: 支付销售机构的客户维护费	1,012,402.60	1,416,493.33

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 1.00% 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 1.00% / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	5,526,784.52	7,914,970.74

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 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 0.20% / 当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 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		上年度可比期间	
	2016年1月1日至2016年12月31日		2015年1月1日至2015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	184,716,556.67	1,166,932.95	167,502,417.61	1,722,520.23

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	利润分配合计	备注
		场内	场外					
1	2016-01-20	-	2016-01-20	0.100	17,264,662.09	19,081,478.55	36,346,140.64	-
合计				0.100	17,264,662.09	19,081,478.55	36,346,140.64	-

7.4.12 期末（2016 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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
002838	道恩股份	2016-12-28	2017-01-06	新股中签	15.28	15.28	682	10,420.96	10,420.96	-
002840	华统股份	2016-12-29	2017-01-10	新股中签	6.55	6.55	1,814	11,881.70	11,881.70	-
300583	赛托生物	2016-12-29	2017-01-06	新股中签	40.29	40.29	1,582	63,738.78	63,738.78	-
300586	美联新材	2016-12-26	2017-01-04	新股中签	9.30	9.30	1,006	9,355.80	9,355.80	-
300587	天铁股份	2016-12-28	2017-01-05	新股中签	14.11	14.11	1,438	20,290.18	20,290.18	-
300588	熙菱	2016-12-28	2017-01-05	新股中签	4.94	4.94	1,380	6,817.16	6,817.16	-

8	信息	2-27	1-05	中签				20	20	
300591	万里马	2016-1 2-30	2017-0 1-10	新股 中签	3.07	3.07	2,397	7,358.79	7,358.79	-
601375	中原证券	2016-1 2-20	2017-0 1-03	新股 中签	4.00	4.00	26,695	106,780.00	106,780.00	-
603032	德新交运	2016-1 2-27	2017-0 1-05	新股 中签	5.81	5.81	1,628	9,458.68	9,458.68	-
603035	常熟汽饰	2016-1 2-27	2017-0 1-05	新股 中签	10.44	10.44	2,316	24,179.04	24,179.04	-
603186	华正新材	2016-1 2-26	2017-0 1-03	新股 中签	5.37	5.37	1,874	10,063.38	10,063.38	-
603228	景旺电子	2016-1 2-28	2017-0 1-06	新股 中签	23.16	23.16	3,491	80,851.56	80,851.56	-
603266	天龙股份	2016-1 2-30	2017-0 1-10	新股 中签	14.63	14.63	1,562	22,852.06	22,852.06	-
603689	皖天燃气	2016-1 2-30	2017-0 1-10	新股 中签	7.87	7.87	4,818	37,917.66	37,917.66	-
603877	太平鸟	2016-1 2-29	2017-0 1-09	新股 中签	21.30	21.30	3,180	67,734.00	67,734.00	-

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

7.4.12.2 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	复牌开盘价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000540	中天城投	2016-11-28	重大资产重组	6.93	2017-01-03	7.00	305,600	2,150,363.80	2,117,808.00	-
000547	航天发展	2016-04-19	重大资产重组	15.36	2017-01-03	16.90	161,500	4,644,800.56	2,480,640.00	-
000750	国海证券	2016-12-15	重大事项	6.97	2017-01-20	6.27	2,550,850	18,436,016.12	17,779,424.50	-
000887	中鼎股份	2016-11-18	重大资产重组	25.94	2017-02-15	23.99	675,500	17,644,324.64	17,522,470.00	-
002122	中环股	2016-04	重大事	8.27	-	-	43,984	387,674.78	363,747.68	-

9	份	-25	项							
002400	省广股份	2016-11-28	重大事项	13.79	-	-	574,943	8,450,297.47	7,928,463.97	-
300150	世纪瑞尔	2016-11-08	重大资产重组	9.97	-	-	899,956	9,052,054.87	8,972,561.32	-
300449	汉邦高科	2016-11-11	重大资产重组	48.44	2017-02-24	43.88	146,000	6,430,429.84	7,072,240.00	-
300526	中潜股份	2016-12-07	重大资产重组	107.03	-	-	984	10,332.00	105,317.52	-
600151	航天机电	2016-11-11	重大资产重组	10.97	-	-	59,845	622,818.07	656,499.65	-
600161	天坛生物	2016-12-06	重大资产重组	39.40	-	-	30,536	638,917.39	1,203,118.40	-
600303	曙光股份	2016-12-15	重大事项未公告	9.02	2017-01-17	9.92	389,600	5,522,839.78	3,514,192.00	-
600406	国电南瑞	2016-12-28	重大事项未公告	16.63	-	-	36,075	597,744.63	599,927.25	-
600645	中源协和	2016-12-13	重大资产重组	26.80	-	-	4,000	121,396.61	107,200.00	-
600649	城投控股	2016-12-06	重大资产重组	20.34	-	-	236,579	1,664,013.82	4,812,016.86	-
600655	豫园商城	2016-12-20	重大事项未公告	11.42	-	-	553,999	6,902,969.86	6,326,668.58	-
600859	王府井	2016-09-27	重大资产重组	16.28	-	-	530,337	9,357,403.88	8,633,886.36	-
600875	东方电气	2016-12-09	重大事项	10.79	-	-	30,209	504,343.11	325,955.11	-
601168	西部矿业	2016-12-19	重大资产重组	7.83	-	-	54,739	765,354.88	428,606.37	-

注：本基金截至 2016 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。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至报告期末 2016 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。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至报告期末 2016 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。

7.4.13 金融工具风险及管理

本基金是一只指数化增强型投资的开放式基金，通过复制和有限度的增强管理方法，构造指数化投资组合，属于高风险品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资等。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。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是通过控制股票投资组合相对 MSCI 中国 A 股指数有限度的偏离，力求基金收益率适度超越本基金比较基准。

7.4.13.1 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管理委员会，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执行总裁负责，并由督察长分管。

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。

7.4.13.2 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。

本基金的基金管理人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本基金的托管行中国工商银行，与银行存款相关的信用风险不重大。本基金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；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。

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。

7.4.13.3 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公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大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，因此除附注 7.4.12 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。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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金

流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016 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	184,716,556.67	-	-	-	184,716,556.67
结算备付金	6,935,145.09	-	-	-	6,935,145.09
存出保证金	775,495.80	-	-	-	775,495.80
交易性金融资产	-	1,765,848.64	548,499.60	3,229,348,451.31	3,231,662,799.55
应收证券清算款	-	-	-	2,795,050.90	2,795,050.90
应收利息	-	-	-	41,754.75	41,754.75
应收申购款	-	-	-	2,707,031.32	2,707,031.32
资产总计	192,427,197.56	1,765,848.64	548,499.60	3,234,892,288.28	3,429,633,834.08
负债					
应付赎回款	-	-	-	10,582,822.44	10,582,822.44
应付管理人报酬	-	-	-	2,897,477.43	2,897,477.43
应付托管费	-	-	-	579,495.48	579,495.48
应付交易费用	-	-	-	4,247,738.64	4,247,738.64
其他负债	-	-	-	880,073.38	880,073.38
负债总计	-	-	-	19,187,607.37	19,187,607.37
利率敏感度缺口	192,427,197.56	1,765,848.64	548,499.60	3,215,704,680.91	3,410,446,226.71
上年度末 2015 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	167,502,417.61	-	-	-	167,502,417.61
结算备付金	4,780,904.44	-	-	-	4,780,904.44
存出保证金	1,140,217.12	-	-	-	1,140,217.12
交易性金融资产	-	830,342.88	1,158,172.80	2,544,074,326.04	2,546,062,841.72
应收证券清算款	-	-	-	4,515,803.35	4,515,803.35
应收利息	-	-	-	34,662.29	34,662.29
应收申购款	-	-	-	35,361,731.00	35,361,731.00
资产总计	173,423,539.17	830,342.88	1,158,172.80	2,583,986,522.68	2,759,398,577.53
负债					

应付证券清算款	-	-	-	3,738,944.57	3,738,944.57
应付赎回款	-	-	-	2,145,378.07	2,145,378.07
应付管理人报酬	-	-	-	2,279,228.33	2,279,228.33
应付托管费	-	-	-	455,845.68	455,845.68
应付交易费用	-	-	-	2,849,361.42	2,849,361.42
其他负债	-	-	-	865,000.00	865,000.00
负债总计	-	-	-	12,333,758.07	12,333,758.07
利率敏感度缺口	173,423,539.17	830,342.88	1,158,172.80	2,571,652,764.61	2,747,064,819.46

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2016 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.07%(2015 年 12 月 31 日：0.07%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2015 年 12 月 31 日：同)。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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。本基金主要投资于 MSCI 中国 A 股指数的成份股，投资组合中股票投资的目标比例为基金资产净值的 95%，投资标的指数成份股的比重在 50 个交易日内不持续低于股票净值的 80%；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，及时对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日		上年度末 2015 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	3,229,348,451.31	94.69	2,544,074,326.04	92.61
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	-	-	-	-
合计	3,229,348,451.31	94.69	2,544,074,326.04	92.61

7.4.13.4.3.2 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：人民币元）	
		本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准上升 5%	增加约 184,310,000.00	增加约 147,060,000.00
2.业绩比较基准下降 5%	减少约 184,310,000.00	减少约 147,060,000.00	

7.4.14 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 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 3,140,222,356.19 元，属于第二层次的余额为 91,440,443.36 元，无属于第三层次的余额(2015 年 12 月 31 日：第一层次 2,376,304,294.74 元，第二层次 169,758,546.98 元，无属于第三层次的余额)。

(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 2016 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(2015 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	3,229,348,451.31	94.16

	其中：股票	3,229,348,451.31	94.16
2	固定收益投资	2,314,348.24	0.07
	其中：债券	2,314,348.24	0.07
	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	191,651,701.76	5.59
7	其他各项资产	6,319,332.77	0.18
8	合计	3,429,633,834.08	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 指数投资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	9,935,769.66	0.29
B	采矿业	88,419,704.73	2.59
C	制造业	1,479,532,429.36	43.38
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	44,642,006.37	1.31
E	建筑业	174,384,390.85	5.11
F	批发和零售业	72,531,437.35	2.13
G	交通运输、仓储和邮政业	82,147,663.47	2.41
H	住宿和餐饮业	5,185,667.04	0.15

I	信息传输、软件和信息技术服务业	108,237,301.94	3.17
J	金融业	700,275,093.69	20.53
K	房地产业	118,894,691.48	3.49
L	租赁和商务服务业	34,936,508.41	1.02
M	科学研究和技术服务业	107,200.00	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	50,660,755.93	1.49
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	3,627,225.00	0.11
R	文化、体育和娱乐业	11,248,713.40	0.33
S	综合	5,820,729.34	0.17
	合计	2,990,587,288.02	87.69

8.2.2 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	1,870,447.95	0.05
B	采矿业	134,604.96	0.00
C	制造业	175,788,877.60	5.15
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,971,117.14	0.12
E	建筑业	10,191,272.23	0.30
F	批发和零售业	5,553,861.26	0.16
G	交通运输、仓储和邮政业	2,256,710.87	0.07
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	21,050,604.63	0.62
J	金融业	106,780.00	0.00
K	房地产业	10,642,253.06	0.31

L	租赁和商务服务业	1,203,606.00	0.04
M	科学研究和技术服务业	59,895.03	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	1,198,368.00	0.04
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	3,534,389.30	0.10
R	文化、体育和娱乐业	1,198,375.26	0.04
S	综合	-	-
	合计	238,761,163.29	7.00

8.3 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

8.3.1 期末指数投资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	601318	中国平安	2,201,738	78,007,577.34	2.29
2	600519	贵州茅台	220,904	73,815,071.60	2.16
3	002475	立讯精密	2,933,809	60,876,536.75	1.79
4	601989	中国重工	7,808,825	55,364,569.25	1.62
5	600000	浦发银行	3,203,815	51,933,841.15	1.52
6	601818	光大银行	12,253,075	47,909,523.25	1.40
7	000858	五粮液	1,368,348	47,180,639.04	1.38
8	601166	兴业银行	2,877,205	46,438,088.70	1.36
9	600038	中直股份	930,314	45,045,803.88	1.32
10	600048	保利地产	4,191,983	38,272,804.79	1.12
11	002008	大族激光	1,581,702	35,746,465.20	1.05
12	600276	恒瑞医药	756,218	34,407,919.00	1.01
13	601328	交通银行	5,900,000	34,043,000.00	1.00
14	600015	华夏银行	3,064,808	33,253,166.80	0.98
15	002142	宁波银行	1,927,691	32,076,778.24	0.94
16	600028	中国石化	5,900,000	31,919,000.00	0.94
17	601688	华泰证券	1,784,702	31,874,777.72	0.93
18	000069	华侨城 A	4,541,325	31,562,208.75	0.93
19	601668	中国建筑	3,357,712	29,749,328.32	0.87
20	000848	承德露露	2,537,710	28,396,974.90	0.83
21	000651	格力电器	1,148,822	28,283,997.64	0.83

22	000333	美的集团	988,801	27,854,524.17	0.82
23	002508	老板电器	716,300	26,359,840.00	0.77
24	000630	铜陵有色	8,477,689	26,111,282.12	0.77
25	000423	东阿阿胶	469,314	25,281,945.18	0.74
26	600517	置信电气	2,521,900	24,538,087.00	0.72
27	600887	伊利股份	1,380,314	24,293,526.40	0.71
28	601628	中国人寿	995,601	23,984,028.09	0.70
29	601998	中信银行	3,733,757	23,933,382.37	0.70
30	002131	利欧股份	1,500,000	23,925,000.00	0.70
31	601390	中国中铁	2,609,576	23,120,843.36	0.68
32	000001	平安银行	2,423,785	22,056,443.50	0.65
33	600409	三友化工	2,303,097	21,626,080.83	0.63
34	600741	华域汽车	1,335,600	21,302,820.00	0.62
35	600521	华海药业	963,961	21,236,060.83	0.62
36	002415	海康威视	872,092	20,764,510.52	0.61
37	601939	建设银行	3,761,400	20,462,016.00	0.60
38	000625	长安汽车	1,362,254	20,352,074.76	0.60
39	002179	中航光电	560,039	20,323,815.31	0.60
40	601169	北京银行	2,074,111	20,243,323.36	0.59
41	002572	索菲亚	361,249	19,565,245.84	0.57
42	000568	泸州老窖	587,900	19,400,700.00	0.57
43	600068	葛洲坝	2,105,008	19,345,023.52	0.57
44	600820	隧道股份	1,685,767	18,560,294.67	0.54
45	000750	国海证券	2,550,850	17,779,424.50	0.52
46	601006	大秦铁路	2,500,000	17,700,000.00	0.52
47	000887	中鼎股份	675,500	17,522,470.00	0.51
48	600500	中化国际	1,450,380	16,911,430.80	0.50
49	600170	上海建工	3,570,813	16,889,945.49	0.50
50	000783	长江证券	1,569,200	16,052,916.00	0.47
51	601788	光大证券	1,000,732	16,001,704.68	0.47
52	600759	洲际油气	1,599,950	15,711,509.00	0.46
53	601901	方正证券	1,917,280	14,571,328.00	0.43
54	002311	海大集团	958,218	14,421,180.90	0.42
55	000089	深圳机场	1,799,960	14,399,680.00	0.42
56	600309	万华化学	668,082	14,383,805.46	0.42
57	601377	兴业证券	1,874,280	14,338,242.00	0.42
58	600612	老凤祥	373,300	13,897,959.00	0.41
59	600376	首开股份	1,175,410	13,881,592.10	0.41
60	600999	招商证券	846,700	13,826,611.00	0.41
61	600009	上海机场	507,364	13,455,293.28	0.39
62	600585	海螺水泥	776,836	13,175,138.56	0.39
63	000060	中金岭南	1,166,569	13,007,244.35	0.38
64	600837	海通证券	821,239	12,934,514.25	0.38
65	601618	中国中冶	2,760,468	12,863,780.88	0.38

66	601988	中国银行	3,719,182	12,793,986.08	0.38
67	600016	民生银行	1,407,900	12,783,732.00	0.37
68	002573	清新环境	730,400	12,760,088.00	0.37
69	600036	招商银行	721,400	12,696,640.00	0.37
70	600498	烽火通信	501,700	12,647,857.00	0.37
71	601186	中国铁建	1,054,696	12,614,164.16	0.37
72	000709	河钢股份	3,689,248	12,322,088.32	0.36
73	000768	中航飞机	577,023	12,267,508.98	0.36
74	002013	中航机电	659,717	12,066,223.93	0.35
75	600143	金发科技	1,545,200	12,021,656.00	0.35
76	002456	欧菲光	348,299	11,939,689.72	0.35
77	600266	北京城建	868,988	11,583,610.04	0.34
78	000100	TCL 集团	3,401,313	11,224,332.90	0.33
79	002405	四维图新	566,950	10,970,482.50	0.32
80	002450	康得新	573,457	10,958,763.27	0.32
81	600958	东方证券	705,000	10,948,650.00	0.32
82	600369	西南证券	1,528,600	10,898,918.00	0.32
83	600023	浙能电力	1,958,600	10,635,198.00	0.31
84	000157	中联重科	2,338,014	10,614,583.56	0.31
85	600098	广州发展	936,537	10,507,945.14	0.31
86	002241	歌尔股份	390,803	10,364,095.56	0.30
87	601633	长城汽车	922,226	10,199,819.56	0.30
88	000895	双汇发展	481,402	10,075,743.86	0.30
89	000876	新希望	1,251,058	10,071,016.90	0.30
90	600282	南钢股份	3,137,834	9,727,285.40	0.29
91	002081	金螳螂	992,257	9,714,196.03	0.28
92	600804	鹏博士	437,111	9,585,844.23	0.28
93	002051	中工国际	417,319	9,564,951.48	0.28
94	600104	上汽集团	399,925	9,378,241.25	0.27
95	601607	上海医药	477,666	9,343,146.96	0.27
96	601800	中国交建	609,083	9,251,970.77	0.27
97	000728	国元证券	459,365	9,141,363.50	0.27
98	600572	康恩贝	1,248,500	9,126,535.00	0.27
99	601899	紫金矿业	2,700,000	9,018,000.00	0.26
100	000726	鲁泰 A	699,901	8,965,731.81	0.26
101	601009	南京银行	816,665	8,852,648.60	0.26
102	000960	锡业股份	672,508	8,823,304.96	0.26
103	600859	王府井	530,337	8,633,886.36	0.25
104	601233	桐昆股份	600,000	8,616,000.00	0.25
105	601336	新华保险	195,515	8,559,646.70	0.25
106	600019	宝钢股份	1,341,358	8,517,623.30	0.25
107	600839	四川长虹	2,000,000	8,360,000.00	0.25
108	600271	航天信息	417,364	8,326,411.80	0.24
109	002439	启明星辰	400,000	8,316,000.00	0.24

110	600415	小商品城	960,386	8,307,338.90	0.24
111	600340	华夏幸福	338,968	8,101,335.20	0.24
112	600383	金地集团	612,500	7,938,000.00	0.23
113	002400	省广股份	574,943	7,928,463.97	0.23
114	002024	苏宁云商	685,786	7,852,249.70	0.23
115	600518	康美药业	433,700	7,741,545.00	0.23
116	600688	上海石化	1,200,000	7,728,000.00	0.23
117	601857	中国石油	954,246	7,586,255.70	0.22
118	601933	永辉超市	1,542,040	7,571,416.40	0.22
119	002470	金正大	919,800	7,266,420.00	0.21
120	600201	生物股份	229,273	7,242,734.07	0.21
121	601600	中国铝业	1,716,000	7,241,520.00	0.21
122	000959	首钢股份	1,081,600	7,160,192.00	0.21
123	601555	东吴证券	520,643	6,908,932.61	0.20
124	600816	安信信托	291,032	6,874,175.84	0.20
125	600096	云天化	722,505	6,856,572.45	0.20
126	000807	云铝股份	1,000,000	6,700,000.00	0.20
127	002368	太极股份	216,792	6,636,003.12	0.19
128	002707	众信旅游	424,503	6,601,021.65	0.19
129	600703	三安光电	489,300	6,551,727.00	0.19
130	000661	长春高新	58,480	6,540,988.00	0.19
131	000501	鄂武商 A	325,330	6,350,441.60	0.19
132	000826	启迪桑德	192,191	6,338,459.18	0.19
133	600655	豫园商城	553,999	6,326,668.58	0.19
134	600426	华鲁恒升	470,097	6,228,785.25	0.18
135	600884	杉杉股份	439,700	6,190,976.00	0.18
136	600111	北方稀土	503,800	6,181,626.00	0.18
137	600031	三一重工	1,000,000	6,100,000.00	0.18
138	600021	上海电力	495,541	6,015,867.74	0.18
139	600066	宇通客车	299,911	5,875,256.49	0.17
140	600637	东方明珠	252,027	5,872,229.10	0.17
141	000027	深圳能源	849,994	5,839,458.78	0.17
142	000401	冀东水泥	488,800	5,816,720.00	0.17
143	600118	中国卫星	183,120	5,720,668.80	0.17
144	001979	招商蛇口	348,826	5,717,258.14	0.17
145	002007	华兰生物	157,557	5,632,662.75	0.17
146	601601	中国太保	200,301	5,562,358.77	0.16
147	600153	建发股份	518,709	5,550,186.30	0.16
148	002367	康力电梯	414,208	5,471,687.68	0.16
149	600885	宏发股份	169,770	5,424,151.50	0.16
150	600372	中航电子	282,906	5,250,735.36	0.15
151	002304	洋河股份	74,200	5,238,520.00	0.15
152	600754	锦江股份	176,024	5,185,667.04	0.15
153	002174	游族网络	194,500	5,144,525.00	0.15

154	600522	中天科技	486,100	5,118,633.00	0.15
155	600056	中国医药	268,400	5,107,652.00	0.15
156	600783	鲁信创投	225,507	5,100,968.34	0.15
157	002223	鱼跃医疗	159,476	4,946,945.52	0.15
158	000686	东北证券	398,970	4,931,269.20	0.14
159	600643	爱建集团	390,751	4,849,219.91	0.14
160	600649	城投控股	236,579	4,812,016.86	0.14
161	601669	中国电建	660,200	4,793,052.00	0.14
162	600270	外运发展	283,484	4,688,825.36	0.14
163	002385	大北农	657,889	4,671,011.90	0.14
164	600269	赣粤高速	922,000	4,637,660.00	0.14
165	002594	比亚迪	92,400	4,590,432.00	0.13
166	002701	奥瑞金	528,560	4,566,758.40	0.13
167	600219	南山铝业	1,475,470	4,559,202.30	0.13
168	600694	大商股份	108,471	4,331,247.03	0.13
169	600729	重庆百货	183,674	4,303,481.82	0.13
170	000882	华联股份	940,900	4,299,913.00	0.13
171	000732	泰禾集团	235,700	4,169,533.00	0.12
172	600089	特变电工	455,008	4,154,223.04	0.12
173	000776	广发证券	245,000	4,130,700.00	0.12
174	000825	太钢不锈	1,043,918	4,113,036.92	0.12
175	600125	铁龙物流	500,000	4,040,000.00	0.12
176	002183	怡亚通	368,900	4,006,254.00	0.12
177	600198	大唐电信	251,831	3,996,557.97	0.12
178	000898	鞍钢股份	786,600	3,964,464.00	0.12
179	002092	中泰化学	320,898	3,882,865.80	0.11
180	000869	张裕 A	107,182	3,858,552.00	0.11
181	600428	中远海特	628,100	3,843,972.00	0.11
182	601088	中国神华	237,137	3,836,876.66	0.11
183	000793	华闻传媒	337,876	3,814,620.04	0.11
184	600872	中炬高新	270,062	3,802,472.96	0.11
185	600352	浙江龙盛	412,002	3,794,538.42	0.11
186	601866	中远海发	928,125	3,786,750.00	0.11
187	002202	金风科技	220,967	3,780,745.37	0.11
188	600587	新华医疗	149,577	3,755,878.47	0.11
189	002230	科大讯飞	137,257	3,718,292.13	0.11
190	600873	梅花生物	569,595	3,713,759.40	0.11
191	002104	恒宝股份	313,400	3,694,986.00	0.11
192	600037	歌华有线	240,956	3,691,445.92	0.11
193	000758	中色股份	458,342	3,662,152.58	0.11
194	600835	上海机电	187,338	3,656,837.76	0.11
195	002219	恒康医疗	304,278	3,645,250.44	0.11
196	002192	融捷股份	166,175	3,635,909.00	0.11
197	000150	宜华健康	117,500	3,627,225.00	0.11

198	600004	白云机场	256,351	3,611,985.59	0.11
199	000059	华锦股份	300,000	3,570,000.00	0.10
200	600085	同仁堂	113,205	3,552,372.90	0.10
201	002065	东华软件	151,398	3,527,573.40	0.10
202	600138	中青旅	167,901	3,520,883.97	0.10
203	600216	浙江医药	275,100	3,488,268.00	0.10
204	600584	长电科技	197,285	3,482,080.25	0.10
205	002603	以岭药业	200,000	3,448,000.00	0.10
206	600900	长江电力	269,554	3,412,553.64	0.10
207	601766	中国中车	346,356	3,383,898.12	0.10
208	600893	中航动力	103,356	3,383,875.44	0.10
209	000999	华润三九	135,663	3,354,945.99	0.10
210	600497	驰宏锌锗	472,004	3,318,188.12	0.10
211	002294	信立泰	113,257	3,311,634.68	0.10
212	600499	科达洁能	427,750	3,233,790.00	0.09
213	000503	海虹控股	76,469	3,215,521.45	0.09
214	600196	复星医药	138,114	3,195,957.96	0.09
215	002050	三花智控	282,800	3,122,112.00	0.09
216	601801	皖新传媒	173,134	3,041,964.38	0.09
217	600685	中船防务	100,000	2,970,000.00	0.09
218	600660	福耀玻璃	158,934	2,960,940.42	0.09
219	601198	东兴证券	146,500	2,938,790.00	0.09
220	600030	中信证券	181,488	2,914,697.28	0.09
221	601179	中国西电	514,482	2,870,809.56	0.08
222	000581	威孚高科	127,358	2,857,913.52	0.08
223	002570	贝因美	217,600	2,854,912.00	0.08
224	600588	用友网络	135,090	2,812,573.80	0.08
225	600150	中国船舶	101,361	2,798,577.21	0.08
226	000792	盐湖股份	144,374	2,753,212.18	0.08
227	002244	滨江集团	393,700	2,748,026.00	0.08
228	600307	酒钢宏兴	1,000,000	2,730,000.00	0.08
229	002460	赣锋锂业	102,500	2,717,275.00	0.08
230	000400	许继电气	149,447	2,712,463.05	0.08
231	000977	浪潮信息	126,200	2,675,440.00	0.08
232	000028	国药一致	39,744	2,658,873.60	0.08
233	600395	盘江股份	328,586	2,651,689.02	0.08
234	600177	雅戈尔	188,589	2,636,474.22	0.08
235	600594	益佰制药	155,998	2,597,366.70	0.08
236	000513	丽珠集团	43,508	2,588,726.00	0.08
237	601992	金隅股份	577,440	2,575,382.40	0.08
238	002410	广联达	175,593	2,563,657.80	0.08
239	600557	康缘药业	147,970	2,505,132.10	0.07
240	000592	平潭发展	368,900	2,493,764.00	0.07
241	000547	航天发展	161,500	2,480,640.00	0.07

242	600535	天士力	59,706	2,477,201.94	0.07
243	600642	申能股份	417,709	2,451,951.83	0.07
244	600867	通化东宝	111,443	2,443,944.99	0.07
245	600635	大众公用	405,350	2,436,153.50	0.07
246	002477	雏鹰农牧	484,177	2,430,568.54	0.07
247	002022	科华生物	119,495	2,389,900.00	0.07
248	600418	江淮汽车	206,406	2,386,053.36	0.07
249	002070	众和股份	170,400	2,365,152.00	0.07
250	600183	生益科技	213,582	2,349,402.00	0.07
251	601877	正泰电器	116,792	2,335,840.00	0.07
252	600073	上海梅林	200,000	2,290,000.00	0.07
253	601898	中煤能源	378,593	2,199,625.33	0.06
254	601929	吉视传媒	522,640	2,189,861.60	0.06
255	600495	晋西车轴	300,000	2,178,000.00	0.06
256	601928	凤凰传媒	207,598	2,173,551.06	0.06
257	002152	广电运通	163,509	2,171,399.52	0.06
258	000988	华工科技	138,500	2,167,525.00	0.06
259	000559	万向钱潮	162,665	2,156,937.90	0.06
260	600718	东软集团	108,956	2,142,074.96	0.06
261	600808	马钢股份	756,536	2,140,996.88	0.06
262	002344	海宁皮城	187,801	2,125,907.32	0.06
263	000540	中天城投	305,600	2,117,808.00	0.06
264	002236	大华股份	154,170	2,109,045.60	0.06
265	600050	中国联通	288,180	2,106,595.80	0.06
266	002500	山西证券	175,000	2,103,500.00	0.06
267	000961	中南建设	200,883	2,089,183.20	0.06
268	600240	华业资本	194,500	2,088,930.00	0.06
269	002601	佰利联	164,650	2,084,469.00	0.06
270	000801	四川九洲	195,600	2,079,228.00	0.06
271	600157	永泰能源	517,655	2,075,796.55	0.06
272	000917	电广传媒	139,181	2,002,814.59	0.06
273	600366	宁波韵升	101,234	1,993,297.46	0.06
274	600329	中新药业	114,056	1,989,136.64	0.06
275	600611	大众交通	302,275	1,985,946.75	0.06
276	000860	顺鑫农业	89,118	1,960,596.00	0.06
277	002310	东方园林	137,390	1,944,068.50	0.06
278	002261	拓维信息	162,900	1,941,768.00	0.06
279	600536	中国软件	80,500	1,936,830.00	0.06
280	600058	五矿发展	126,923	1,933,037.29	0.06
281	002390	信邦制药	194,500	1,923,605.00	0.06
282	600259	广晟有色	44,528	1,891,994.72	0.06
283	601012	隆基股份	139,500	1,867,905.00	0.05
284	600115	东方航空	263,108	1,860,173.56	0.05
285	601000	唐山港	458,500	1,838,585.00	0.05

286	002001	新和成	93,800	1,838,480.00	0.05
287	000088	盐田港	257,467	1,835,739.71	0.05
288	000425	徐工机械	538,854	1,821,326.52	0.05
289	600511	国药股份	60,362	1,816,896.20	0.05
290	000338	潍柴动力	181,524	1,807,979.04	0.05
291	002466	天齐锂业	55,680	1,806,816.00	0.05
292	600388	龙净环保	145,652	1,801,715.24	0.05
293	002312	三泰控股	203,250	1,778,437.50	0.05
294	002444	巨星科技	113,200	1,765,920.00	0.05
295	600748	上实发展	214,049	1,753,061.31	0.05
296	600674	川投能源	198,224	1,724,548.80	0.05
297	002672	东江环保	97,400	1,714,240.00	0.05
298	600487	亨通光电	89,100	1,662,606.00	0.05
299	601098	中南传媒	99,112	1,651,205.92	0.05
300	000810	创维数字	117,285	1,650,199.95	0.05
301	002041	登海种业	86,783	1,638,463.04	0.05
302	600008	首创股份	393,754	1,618,328.94	0.05
303	600787	中储股份	172,610	1,565,572.70	0.05
304	600879	航天电子	102,576	1,563,258.24	0.05
305	600026	中远海能	227,991	1,552,618.71	0.05
306	002505	大康农业	436,900	1,546,626.00	0.05
307	000039	中集集团	105,057	1,535,933.34	0.05
308	600060	海信电器	89,600	1,533,952.00	0.04
309	000800	一汽轿车	138,741	1,508,114.67	0.04
310	600699	均胜电子	44,500	1,472,505.00	0.04
311	600998	九州通	68,249	1,415,484.26	0.04
312	000031	中粮地产	157,078	1,401,135.76	0.04
313	600827	百联股份	96,919	1,391,756.84	0.04
314	002011	盾安环境	145,000	1,380,400.00	0.04
315	001696	宗申动力	146,400	1,376,160.00	0.04
316	002153	石基信息	56,361	1,373,517.57	0.04
317	600478	科力远	134,300	1,343,000.00	0.04
318	000937	冀中能源	195,284	1,316,214.16	0.04
319	600122	宏图高科	106,900	1,306,318.00	0.04
320	600525	长园集团	92,280	1,287,306.00	0.04
321	600399	抚顺特钢	186,676	1,282,464.12	0.04
322	002181	粤传媒	160,300	1,263,164.00	0.04
323	600062	华润双鹤	56,777	1,262,152.71	0.04
324	600160	巨化股份	118,180	1,250,344.40	0.04
325	600410	华胜天成	112,700	1,225,049.00	0.04
326	600161	天坛生物	30,536	1,203,118.40	0.04
327	600826	兰生股份	43,500	1,188,420.00	0.03
328	600967	北方创业	87,351	1,185,353.07	0.03
329	601888	中国国旅	27,269	1,183,474.60	0.03

330	002064	华峰氨纶	213,000	1,169,370.00	0.03
331	000572	海马汽车	214,100	1,147,576.00	0.03
332	600108	亚盛集团	194,300	1,111,396.00	0.03
333	000656	金科股份	211,499	1,108,254.76	0.03
334	600362	江西铜业	65,701	1,099,177.73	0.03
335	002428	云南锗业	86,403	1,094,726.01	0.03
336	000006	深振业 A	113,423	1,071,847.35	0.03
337	600123	兰花科创	133,309	1,071,804.36	0.03
338	002364	中恒电气	46,400	965,120.00	0.03
339	600039	四川路桥	199,600	946,104.00	0.03
340	600528	中铁二局	67,419	927,685.44	0.03
341	000671	阳光城	165,860	923,840.20	0.03
342	000786	北新建材	86,824	893,418.96	0.03
343	600823	世茂股份	123,716	868,486.32	0.03
344	002063	远光软件	64,700	850,158.00	0.02
345	002345	潮宏基	69,400	838,352.00	0.02
346	002325	洪涛股份	103,500	829,035.00	0.02
347	600208	东湖高新	195,336	812,597.76	0.02
348	002384	东山精密	40,838	800,833.18	0.02
349	002073	软控股份	67,127	761,891.45	0.02
350	000528	柳工	99,000	723,690.00	0.02
351	000009	中国宝安	69,475	719,761.00	0.02
352	601118	海南橡胶	102,723	714,952.08	0.02
353	002029	七匹狼	68,800	702,448.00	0.02
354	002049	紫光国芯	20,931	689,467.14	0.02
355	600736	苏州高新	75,300	679,959.00	0.02
356	600978	宜华生活	63,592	677,254.80	0.02
357	000839	中信国安	72,780	668,120.40	0.02
358	600006	东风汽车	96,800	665,984.00	0.02
359	600151	航天机电	59,845	656,499.65	0.02
360	600663	陆家嘴	29,359	649,714.67	0.02
361	600005	武钢股份	190,375	649,178.75	0.02
362	600315	上海家化	22,944	622,011.84	0.02
363	600406	国电南瑞	36,075	599,927.25	0.02
364	601958	金铂股份	78,078	597,296.70	0.02
365	000587	金洲慈航	39,900	593,712.00	0.02
366	000712	锦龙股份	23,500	550,840.00	0.02
367	601333	广深铁路	108,109	548,112.63	0.02
368	601117	中国化学	79,639	539,156.03	0.02
369	600690	青岛海尔	53,960	533,124.80	0.02
370	600017	日照港	129,900	526,095.00	0.02
371	600881	亚泰集团	95,498	522,374.06	0.02
372	000729	燕京啤酒	70,744	491,670.80	0.01
373	600570	恒生电子	10,311	486,060.54	0.01

374	600435	北方导航	36,306	473,430.24	0.01
375	600100	同方股份	33,469	463,545.65	0.01
376	600770	综艺股份	43,976	455,151.60	0.01
377	000983	西山煤电	53,510	452,694.60	0.01
378	601168	西部矿业	54,739	428,606.37	0.01
379	600256	广汇能源	91,360	426,651.20	0.01
380	600284	浦东建设	32,200	424,718.00	0.01
381	600252	中恒集团	90,550	414,719.00	0.01
382	600166	福田汽车	134,052	414,220.68	0.01
383	002004	华邦健康	44,970	407,877.90	0.01
384	600812	华北制药	64,500	403,770.00	0.01
385	002595	豪迈科技	18,700	393,635.00	0.01
386	600067	冠城大通	54,700	391,652.00	0.01
387	002309	中利科技	26,600	377,986.00	0.01
388	600325	华发股份	29,300	375,040.00	0.01
389	601718	际华集团	40,147	369,753.87	0.01
390	600580	卧龙电气	40,100	364,910.00	0.01
391	002129	中环股份	43,984	363,747.68	0.01
392	002028	思源电气	27,506	362,529.08	0.01
393	600757	长江传媒	42,900	356,499.00	0.01
394	000418	小天鹅 A	10,600	342,592.00	0.01
395	600875	东方电气	30,209	325,955.11	0.01
396	600320	振华重工	58,012	295,861.20	0.01
397	000620	新华联	33,700	285,776.00	0.01
398	600316	洪都航空	14,291	280,961.06	0.01
399	600717	天津港	26,400	266,112.00	0.01
400	600348	阳泉煤业	37,942	255,349.66	0.01
401	601106	中国一重	46,202	249,952.82	0.01
402	600811	东方集团	34,743	248,412.45	0.01
403	000652	泰达股份	44,373	244,938.96	0.01
404	002375	亚厦股份	20,500	216,890.00	0.01
405	603000	人民网	12,263	216,564.58	0.01
406	002739	万达院线	3,900	210,873.00	0.01
407	600549	厦门钨业	9,478	208,705.56	0.01
408	600064	南京高科	12,300	206,025.00	0.01
409	600380	健康元	17,262	171,411.66	0.01
410	000725	京东方 A	58,866	168,356.76	0.00
411	600597	光明乳业	11,251	146,938.06	0.00
412	600022	山东钢铁	47,369	118,422.50	0.00
413	600109	国金证券	8,775	114,338.25	0.00
414	600645	中源协和	4,000	107,200.00	0.00
415	600280	中央商场	7,500	64,575.00	0.00
416	000997	新大陆	3,000	58,290.00	0.00
417	600651	飞乐音响	1,300	13,689.00	0.00

418	002517	恺英网络	160	5,369.60	0.00
419	600221	海南航空	1,393	4,541.18	0.00

8.3.2 期末积极投资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	603968	醋化股份	859,900	20,861,174.00	0.61
2	300458	全志科技	210,500	19,246,015.00	0.56
3	002452	长高集团	1,874,100	17,616,540.00	0.52
4	600195	中牧股份	784,842	16,677,892.50	0.49
5	600133	东湖高新	1,197,623	9,844,461.06	0.29
6	300150	世纪瑞尔	899,956	8,972,561.32	0.26
7	002140	东华科技	642,600	8,687,952.00	0.25
8	600963	岳阳林纸	1,000,000	8,170,000.00	0.24
9	600596	新安股份	709,933	7,269,713.92	0.21
10	600476	湘邮科技	230,000	7,263,400.00	0.21
11	300449	汉邦高科	146,000	7,072,240.00	0.21
12	300398	飞凯材料	120,000	6,988,800.00	0.20
13	603898	好莱客	200,000	6,474,000.00	0.19
14	300078	思创医惠	247,600	6,415,316.00	0.19
15	000422	湖北宣化	800,000	6,360,000.00	0.19
16	600546	山煤国际	1,326,418	5,398,521.26	0.16
17	002205	国统股份	128,000	3,901,440.00	0.11
18	600268	国电南自	430,700	3,884,914.00	0.11
19	000070	特发信息	141,200	3,570,948.00	0.10
20	300015	爱尔眼科	118,207	3,534,389.30	0.10
21	600303	曙光股份	389,600	3,514,192.00	0.10
22	300462	华铭智能	101,160	3,495,078.00	0.10
23	600815	厦工股份	500,000	3,220,000.00	0.09
24	300017	网宿科技	60,000	3,216,600.00	0.09
25	002597	金禾实业	204,300	3,193,209.00	0.09
26	002087	新野纺织	429,490	3,006,430.00	0.09
27	601208	东材科技	336,300	2,586,147.00	0.08
28	000536	华映科技	149,147	2,277,474.69	0.07
29	002216	三全食品	160,361	1,956,404.20	0.06
30	002321	华英农业	174,645	1,870,447.95	0.05
31	600509	天富能源	241,900	1,806,993.00	0.05
32	601566	九牧王	100,000	1,769,000.00	0.05
33	002546	新联电子	179,180	1,625,162.60	0.05
34	600708	光明地产	181,783	1,623,322.19	0.05
35	600425	青松建化	338,900	1,575,885.00	0.05
36	002293	罗莱生活	110,800	1,490,260.00	0.04

37	600496	精工钢构	347,600	1,487,728.00	0.04
38	600236	桂冠电力	240,636	1,467,879.60	0.04
39	300383	光环新网	52,400	1,307,904.00	0.04
40	002254	泰和新材	103,100	1,274,316.00	0.04
41	300115	长盈精密	48,800	1,271,728.00	0.04
42	300144	宋城演艺	57,229	1,198,375.26	0.04
43	300070	碧水源	68,400	1,198,368.00	0.04
44	600761	安徽合力	82,200	1,045,584.00	0.03
45	300063	天龙集团	34,200	996,246.00	0.03
46	000919	金陵药业	72,500	980,925.00	0.03
47	600305	恒顺醋业	71,233	832,001.44	0.02
48	600844	丹化科技	104,800	821,632.00	0.02
49	300147	香雪制药	62,600	807,540.00	0.02
50	000897	津滨发展	186,400	797,792.00	0.02
51	603222	济民制药	36,632	682,087.84	0.02
52	002267	陕天然气	58,832	564,198.88	0.02
53	600377	宁沪高速	53,800	459,990.00	0.01
54	000877	天山股份	58,500	412,425.00	0.01
55	600720	祁连山	46,000	375,820.00	0.01
56	002068	黑猫股份	42,101	352,806.38	0.01
57	002327	富安娜	34,000	299,200.00	0.01
58	601678	滨化股份	36,000	262,440.00	0.01
59	600996	贵广网络	12,500	234,875.00	0.01
60	002048	宁波华翔	9,400	208,116.00	0.01
61	600790	轻纺城	28,800	207,360.00	0.01
62	000830	鲁西化工	33,200	185,588.00	0.01
63	000099	中信海直	14,000	163,940.00	0.00
64	000417	合肥百货	18,000	155,340.00	0.00
65	603727	博迈科	2,832	134,604.96	0.00
66	603823	百合花	3,762	123,167.88	0.00
67	300568	星源材质	1,310	107,262.80	0.00
68	601375	中原证券	26,695	106,780.00	0.00
69	300526	中潜股份	984	105,317.52	0.00
70	300565	科信技术	2,382	94,517.76	0.00
71	000600	建投能源	10,600	94,128.00	0.00
72	600251	冠农股份	11,200	90,832.00	0.00
73	603298	杭叉集团	3,641	88,403.48	0.00
74	603228	景旺电子	3,491	80,851.56	0.00
75	002832	比音勒芬	1,158	70,290.60	0.00
76	603577	汇金通	2,460	69,642.60	0.00
77	603336	宏辉果蔬	1,471	69,239.97	0.00
78	603218	日月股份	1,652	68,805.80	0.00
79	603877	太平鸟	3,180	67,734.00	0.00
80	603203	快克股份	1,048	65,929.68	0.00

81	300583	赛托生物	1,582	63,738.78	0.00
82	300534	陇神戎发	996	63,544.80	0.00
83	603859	能科股份	1,121	59,895.03	0.00
84	002826	易明医药	2,181	57,316.68	0.00
85	603416	信捷电气	1,076	53,886.08	0.00
86	002825	纳尔股份	1,139	53,521.61	0.00
87	603559	中通国脉	899	48,447.11	0.00
88	002833	弘亚数控	2,743	48,331.66	0.00
89	603058	永吉股份	3,869	42,675.07	0.00
90	603886	元祖股份	2,242	39,683.40	0.00
91	603689	皖天然气	4,818	37,917.66	0.00
92	300582	英飞特	1,359	35,157.33	0.00
93	603239	浙江仙通	924	29,059.80	0.00
94	600141	兴发集团	1,900	28,899.00	0.00
95	002835	同为股份	1,126	24,220.26	0.00
96	603035	常熟汽饰	2,316	24,179.04	0.00
97	603266	天龙股份	1,562	22,852.06	0.00
98	300587	天铁股份	1,438	20,290.18	0.00
99	603929	亚翔集成	2,193	15,592.23	0.00
100	002840	华统股份	1,814	11,881.70	0.00
101	002838	道恩股份	682	10,420.96	0.00
102	603186	华正新材	1,874	10,063.38	0.00
103	603032	德新交运	1,628	9,458.68	0.00
104	300586	美联新材	1,006	9,355.80	0.00
105	300591	万里马	2,397	7,358.79	0.00
106	300588	熙菱信息	1,380	6,817.20	0.00

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	000858	五 粮 液	171,363,381.91	6.24
2	601088	中国神华	81,991,247.79	2.98
3	000709	河钢股份	78,940,825.92	2.87
4	600015	华夏银行	78,596,017.78	2.86
5	600519	贵州茅台	74,641,660.43	2.72
6	000333	美的集团	71,954,297.50	2.62
7	002051	中工国际	68,710,642.83	2.50
8	002475	立讯精密	66,896,995.41	2.44

9	601668	中国建筑	63,374,262.57	2.31
10	600028	中国石化	62,994,406.77	2.29
11	000937	冀中能源	62,610,659.07	2.28
12	600409	三友化工	61,748,283.84	2.25
13	002070	众和股份	61,439,766.73	2.24
14	600525	长园集团	60,823,822.13	2.21
15	601009	南京银行	60,094,701.08	2.19
16	601818	光大银行	59,962,006.84	2.18
17	000049	德赛电池	59,052,543.46	2.15
18	000750	国海证券	58,151,945.24	2.12
19	601318	中国平安	57,547,617.13	2.09
20	600305	恒顺醋业	56,883,828.47	2.07
21	600038	中直股份	56,398,014.79	2.05
22	000630	铜陵有色	55,675,475.51	2.03
23	600782	新钢股份	55,448,159.00	2.02
24	601233	桐昆股份	55,400,015.52	2.02
25	002179	中航光电	55,383,790.28	2.02

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	000858	五粮液	149,604,215.90	5.45
2	601009	南京银行	93,394,559.32	3.40
3	600525	长园集团	90,563,717.16	3.30
4	601088	中国神华	79,887,554.80	2.91
5	000937	冀中能源	72,166,645.05	2.63
6	000709	河钢股份	70,399,505.08	2.56
7	002070	众和股份	67,816,038.77	2.47
8	600019	宝钢股份	66,927,808.19	2.44
9	002051	中工国际	64,472,536.66	2.35
10	600703	三安光电	63,161,403.61	2.30
11	600782	新钢股份	61,919,664.39	2.25
12	600030	中信证券	60,925,198.60	2.22
13	000049	德赛电池	60,246,608.00	2.19
14	601336	新华保险	58,586,247.89	2.13
15	600015	华夏银行	58,267,511.25	2.12
16	601668	中国建筑	58,073,796.34	2.11
17	600305	恒顺醋业	55,965,594.90	2.04

18	601233	桐昆股份	53,640,950.90	1.95
19	601169	北京银行	53,273,945.88	1.94
20	600409	三友化工	53,194,795.92	1.94

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	6,888,943,806.19
卖出股票的收入（成交）总额	5,914,686,605.71

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）	2,314,348.24	0.07
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,314,348.24	0.07

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	110031	航信转债	8,920	968,533.60	0.03
2	128013	洪涛转债	4,860	548,499.60	0.02
3	110035	白云转债	3,950	492,012.00	0.01
4	128009	歌尔转债	2,524	305,303.04	0.01

8.7 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。

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	775,495.80
2	应收证券清算款	2,795,050.90
3	应收股利	-
4	应收利息	41,754.75
5	应收申购款	2,707,031.32
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,319,332.77

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产 净值比例(%)
1	128009	歌尔转债	305,303.04	0.01
2	110035	白云转债	492,012.00	0.01
3	110031	航信转债	968,533.60	0.03

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前五名积极投资中不存在流通受限情况。

§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
83,937	57,265.40	2,541,163,915.25	52.87%	2,265,522,294.97	47.13%

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	715,000.58	0.01%

注：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(2002年11月8日)基金份额总额	1,762,466,123.89
本报告期期初基金份额总额	3,423,231,890.05
本报告期基金总申购份额	3,395,963,283.02
减：本报告期基金总赎回份额	2,012,508,962.85
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	4,806,686,210.22

§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

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

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 100,000.00 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	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
广发证券	1	580,621,188.20	4.54%	529,119.99	4.48%	-
银河证券	2	5,769,426,717.28	45.09%	5,326,479.36	45.13%	-
国泰君安	1	2,012,634,745.73	15.73%	1,874,360.42	15.88%	-
招商证券	1	1,649,174,934.24	12.89%	1,502,896.04	12.73%	-
申万宏源	1	1,073,167,915.19	8.39%	999,438.75	8.47%	-
浙商证券	1	1,074,595,492.15	8.40%	979,280.45	8.30%	-
中信建投	1	634,552,963.28	4.96%	590,958.37	5.01%	-

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副总经理审批

公司分管副总经理对相关部门提交的《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：

无。

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
广发证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	562,579.13	83.66%	-	-	-	-
国泰君安	64,030.00	9.52%	-	-	-	-
招商证券	11,342.35	1.69%	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
浙商证券	34,537.19	5.14%	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-

11.8 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	华安基金关于 2016 年 1 月 4 日指数熔断期间调整旗下基金相关业务办理时间的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-01-04
2	华安基金管理有限公司关于旗下场内基金在指数熔断期间暂停申购赎回业务的提示性公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-01-06
3	华安基金关于 2016 年 1 月 7 日指数熔断期间调整旗下基金相关业务办理时间的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-01-07
4	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“众信旅游”等股票估值调整的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-01-08
5	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“万科 A”股票估值调整的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-01-09
6	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“新希望”等股票估值调整的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-01-12
7	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加金牛网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	2016-01-14
8	华安基金管理有限公司关于参加渤海银行费率优惠的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-01-19
9	华安基金管理有限公司关于华安 MSCI 中国 A 股指数增强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	2016-01-19
10	华安基金管理有限公司关于参加京东淘宝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	2016-01-19
11	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加泰信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	2016-01-25
12	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“互动娱乐”股票估值调整的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-01-26
13	华安基金管理有限公司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	2016-02-03
14	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“众和股份”股票估值调整的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-02-16
15	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“卓翼科技”、“浦发银行”股票估值调整的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-02-19
16	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海凯石财富基金销售有限公司为销售机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-02-23
17	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中正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	2016-02-25

18	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“康得新”、“江西铜业”股票估值调整的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-02-25
19	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加苏州银行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	2016-03-23
20	华安基金管理有限公司关于参加深圳新兰德费率优惠的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-03-24
21	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“长安汽车”股票估值调整的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-03-25
22	华安基金管理有限公司关于电子直销平台延长“微钱宝”账户交易费率优惠时间的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-03-28
23	华安基金管理有限公司关于华安旗下基金参加工商银行申购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	2016-03-30
24	关于旗下部分基金参加东亚银行（中国）有限公司定期定额申购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	2016-03-30
25	华安基金管理有限公司关于以自有资金购买基金所涉风险资产的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-03-30
26	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“四维图新”、“国瓷材料”股票估值调整的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-04-05
27	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“科大讯飞”股票估值调整的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-04-09
28	华安基金管理有限公司关于参加好买基金网费率优惠的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-04-11
29	华安基金管理有限公司关于基金电子交易平台暂停部分基金赎回转申购业务的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-04-12
30	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加钱景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	2016-04-19
31	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加格上理财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	2016-04-26
32	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“南山铝业”股票估值调整的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-04-27
33	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中经北证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	2016-04-29
34	华安基金管理有限公司关于华安基金公司淘宝店关闭申购服务的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-05-05
35	华安基金管理有限公司关于基金电子交易平台支付宝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	2016-05-05

36	华安基金管理有限公司关于参加金牛网费率优惠的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-05-06
37	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加金观诚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	2016-05-10
38	华安基金管理有限公司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	2016-05-10
39	关于华安旗下部分基金参加民生银行申购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	2016-05-14
40	华安基金管理有限公司关于参加中正费率优惠的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-05-18
41	关于华安基金管理有限公司旗下基金参加泉州银行优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-05-25
42	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加东莞农商行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	2016-06-02
43	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加晟视天下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	2016-06-03
44	华安基金管理有限公司关于电子直销平台延长“微钱宝”账户交易费率优惠活动时间公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-06-08
45	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加奕丰金融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	2016-06-14
46	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“广电运通”股票估值调整的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-06-16
47	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加广源达信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	2016-06-21
48	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“格力电器”股票估值调整的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-06-22
49	关于华安基金管理有限公司旗下基金参加交通银行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	2016-06-23
50	华安基金管理有限公司关于旗下基金参加东亚中国费率优惠的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-06-27
51	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中信期货为销售机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-06-28
52	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加京东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	2016-06-28
53	华安基金关于旗下部分基金增加金斧子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	2016-07-05
54	关于旗下部分基金增加凯恩斯为销售机构	《上海证券报》、《证券时报》、	2016-07-12

	并参加费率优惠活动的公告	《中国证券报》和公司网站	
55	华安基金管理有限公司关于旗下基金参加和讯费率优惠的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-07-15
56	关于旗下部分基金增加常熟农商行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	2016-07-20
57	华安基金新增蛋卷基金代销并参加费率优惠的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-07-22
58	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“宜通世纪”、“长海股份”股票估值调整的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-07-30
59	华安基金关于旗下部分基金增加大智慧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	2016-08-06
60	关于华安基金管理有限公司旗下基金参加中信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	2016-08-09
61	关于旗下部分基金增加创金启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	2016-08-13
62	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	2016-08-15
63	关于华安基金管理有限公司旗下基金参加联泰优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-08-19
64	关于旗下部分基金增加昆山农商行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	2016-09-06
65	关于旗下部分基金增加新浪仓石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	2016-09-12
66	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“全志科技”股票估值调整的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-09-19
67	关于华安基金管理有限公司旗下基金参加交通银行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	2016-09-20
68	关于旗下部分基金增加嘉兴银行为销售机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-09-21
69	关于旗下部分基金增加宁波银行为销售机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-09-21
70	关于电子直销平台延长“微钱宝”账户交易费率优惠时间的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-09-23
71	关于旗下部分基金增加苏宁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	2016-09-29
72	关于旗下部分基金增加万得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	2016-10-11
73	华安基金管理有限公司关于旗下基金参加钱景财富费率优惠的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-10-13
74	关于旗下部分基金增加国美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	2016-10-18
75	关于旗下部分基金增加途牛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	2016-10-27

76	关于旗下部分基金增加和耕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	2016-11-01
77	关于旗下部分基金增加云湾投资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	2016-11-10
78	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	2016-11-10
79	华安基金管理有限公司关于统一客户服务热线号的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-11-16
80	关于旗下部分基金增加乾道金融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	2016-11-16
81	关于电子直销平台延长“微钱宝”账户交易费率优惠时间的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-11-29
82	关于华安基金管理有限公司旗下基金参加交通银行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	2016-11-29
83	华安基金管理有限公司关于旗下基金参加凯石费率优惠的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-11-30
84	关于旗下部分基金增加懒猫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	2016-11-30
85	关于旗下部分基金增加华鑫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》和公司网站	2016-12-06
86	关于旗下部分基金增加汇付金融为销售机构并参加费率优惠的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-12-13
87	关于旗下部分基金增加东海期货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	2016-12-20
88	关于华安基金管理有限公司旗下基金参加交通银行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	2016-12-22
89	关于旗下部分基金增加挖财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	2016-12-23
90	关于华安基金管理有限公司旗下基金参加中国农业银行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	2016-12-28
91	关于旗下部分基金开通并参加中国工商银行股份有限公司基金定期定额投资优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-12-28
92	华安基金管理有限公司关于旗下基金参加苏州银行费率优惠的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-12-28
93	关于旗下部分基金参加邮储银行申购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	2016-12-28
94	华安基金管理有限公司关于参加东莞银行费率优惠的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-12-30
95	华安基金管理有限公司关于参加烟台银行费率优惠的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2016-12-30

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。

§12 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、《华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金基金合同》
- 2、《华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金招募说明书》及其更新
- 3、《华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金托管协议》
- 4、中国证监会批准基金设立的文件；
- 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；

13.2 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>。

13.3 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
二〇一七年三月二十八日