

华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金
2017 年半年度报告
2017 年 6 月 30 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：二〇一七年八月二十五日

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。本半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 8 月 23 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 6 月 30 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	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	12
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	12
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	16
7 投资组合报告	33
7.1 期末基金资产组合情况	33
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	33
7.3 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	35
7.3.1 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	35
7.3.2 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	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	49
7.6 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	49
7.7 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	49
7.8 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	50
7.9 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	50
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	50
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	50
7.12 投资组合报告附注	50

8	基金份额持有人信息	51
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	51
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	52
8.3	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	52
9	开放式基金份额变动	52
10	重大事件揭示	52
10.1	基金份额持有人大会决议	52
10.2	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	52
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	53
10.4	基金投资策略的改变	53
10.5	报告期内改聘会计师事务所情况	53
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	53
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	53
10.8	其他重大事件	54
11	影响投资者决策的其他重要信息	57
12	备查文件目录	57
12.1	备查文件目录	57
12.2	存放地点	58
12.3	查阅方式	58

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	3,244,846,615.70 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	$95\% \times \text{MSCI 中国 A 股指数收益率} + 5\% \times \text{金融同业存款利率}$
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
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.huaan.com.cn
基金半年度报告备置地点	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
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 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期（2017年1月1日至2017年6月30日）
本期已实现收益	93,646,199.08
本期利润	261,205,231.35
加权平均基金份额本期利润	0.0738
本期加权平均净值利润率	10.01%
本期基金份额净值增长率	9.44%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)
期末可供分配利润	1,296,401,919.61
期末可供分配基金份额利润	0.3995
期末基金资产净值	2,519,993,233.34
期末基金份额净值	0.777
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017年6月30日)
基金份额累计净值增长率	350.95%

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
过去一个月	6.00%	0.70%	4.78%	0.63%	1.22%	0.07%
过去三个月	4.86%	0.75%	2.05%	0.64%	2.81%	0.11%
过去六个月	9.44%	0.68%	5.33%	0.59%	4.11%	0.09%
过去一年	14.10%	0.75%	8.84%	0.66%	5.26%	0.09%
过去三年	69.43%	1.83%	53.40%	1.69%	16.03%	0.14%
自基金合同生效起至今	350.95%	1.63%	218.27%	1.61%	132.68%	0.02%

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
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
 （2002 年 11 月 8 日至 2017 年 6 月 30 日）



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。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 6 月 30 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 96 只开放式基金，管理资产规模达到 1478.85 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

				<p>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。</p>
--	--	--	--	---

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 公平交易制度的执行情况

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。

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。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司合规监察稽核部会同基金投资、交易部门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，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 0 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 年上半年经济平稳运行，工业增加值增速稳步回升，PPI 同比虽高位有所回落，但 PMI 指数连续处于 51 以上扩张区间。国内“供给侧”改革效果明显，部分中上游行业及行业内龙头公司的盈利改善明显。市场资金面方面，上半年流动性整体中性偏宽松；在 A 股纳入 MSCI 新兴市场指数预期下，北上资金积极关注 A 股优质稀缺标的，为市场带来一定增量资金，一定程度影响到市场风险偏好。从量化因子角度，期间里基本面类因子继续表现强势。本基金配置上偏向基本面较好的价值成长股，行业上对食品饮料、家电、保险有所超配。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2017 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 0.777 元，本报告期份额净值增长率为 9.44%，同期业绩比较基准增长率为 5.33%。截至 2017 年 6 月 30 日，本基金过去 30 个交易日日均跟踪偏离度为 0.2%（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

展望下半年，国内宏观经济仍将“稳中有进”，供给侧改革仍将推进。流动性将保持“松紧适度”，汇率大概率将保持稳定，利率向上压力不大。各行业中有竞争力的企业将继续受益于供给侧改革的红利。我们对市场并不悲观，较强的结构性机会仍将存在，中报及三季报业绩预期较好的行业与个股将受到市场关注，估值与盈利匹配较好的中上游传统行业，以及需求进入爆发前期的新能源汽车产业链将重点值得关注。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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期不进行收益分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对华安 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未进行利润分配。

5.3 托管人对本半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 2017 年半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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 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：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	144,188,104.50	184,716,556.67
结算备付金		8,179,470.87	6,935,145.09
存出保证金		907,073.71	775,495.80
交易性金融资产	6.4.7.2	2,378,160,619.38	3,231,662,799.55
其中：股票投资		2,376,820,173.38	3,229,348,451.31
基金投资		-	-
债券投资		1,340,446.00	2,314,348.24
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	2,795,050.90
应收利息	6.4.7.5	29,045.88	41,754.75
应收股利		-	-
应收申购款		916,057.21	2,707,031.32
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		2,532,380,371.55	3,429,633,834.08
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		5,236,873.65	10,582,822.44
应付管理人报酬		1,998,225.65	2,897,477.43
应付托管费		399,645.13	579,495.48
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	4,061,432.45	4,247,738.64
应交税费		-	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	690,961.33	880,073.38
负债合计		12,387,138.21	19,187,607.37
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.9	988,724,787.41	1,464,601,883.81
未分配利润	6.4.7.10	1,531,268,445.93	1,945,844,342.90
所有者权益合计		2,519,993,233.34	3,410,446,226.71
负债和所有者权益总计		2,532,380,371.55	3,429,633,834.08

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.777 元，基金份额总额 3,244,846,615.70 份。

6.2 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：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
一、收入		289,438,577.57	-370,921,436.68
1.利息收入		595,182.52	591,079.32
其中：存款利息收入	6.4.7.11	589,130.81	588,483.28
债券利息收入		6,051.71	2,596.04
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）		121,284,362.78	-136,612,968.77
其中：股票投资收益	6.4.7.12	102,357,293.56	-153,632,066.25
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	229,853.71	133,931.21
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	18,697,215.51	16,885,166.27
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	167,559,032.27	-234,899,547.23
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-	-
减：二、费用		28,233,346.22	22,445,211.33
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	13,023,109.05	12,549,487.96
2. 托管费	6.4.10.2.2	2,604,621.82	2,509,897.64

3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	12,414,327.36	7,188,065.28
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.19	191,287.99	197,760.45
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		261,205,231.35	-393,366,648.01
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		261,205,231.35	-393,366,648.01

6.3 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：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 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）	1,464,601,883.81	1,945,844,342.90	3,410,446,226.71
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	261,205,231.35	261,205,231.35
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）	-475,877,096.40	-675,781,128.32	-1,151,658,224.72
其中：1.基金申购款	146,235,943.88	210,597,540.86	356,833,484.74
2.基金赎回款	-622,113,040.28	-886,378,669.18	-1,508,491,709.46
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）	988,724,787.41	1,531,268,445.93	2,519,993,233.34
项目	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 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）	-	-393,366,648.01	-393,366,648.01
三、本期基金份额交易产	30,127,139.37	49,462,942.09	79,590,081.46

生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）			
其中：1.基金申购款	336,122,097.53	406,274,615.39	742,396,712.92
2.基金赎回款	-305,994,958.16	-356,811,673.30	-662,806,631.46
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）	1,073,033,563.30	1,323,908,548.97	2,396,942,112.27

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，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

6.4 报表附注

6.4.1 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×95%+金融同业存款利率×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 8 月 23 日批准报出。

6.4.2 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 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(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》和在财务报表附注所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2017 年上半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 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 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。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本会计期间不存在会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本会计期间不存在会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本会计期间不存在差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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补充政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)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。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，股权的股息、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，于 2015 年 9 月 8 日前暂减按 25% 计入应纳税所得额，自 2015 年 9 月 8 日起，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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
活期存款	144,188,104.50

定期存款	-
其他存款	-
合计	144,188,104.50

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	2,266,537,701.39	2,376,820,173.38	110,282,471.99
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	1,304,400.00	36,046.00
	银行间市场	-	-
	合计	1,304,400.00	36,046.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	2,267,842,101.39	2,378,160,619.38	110,318,517.99

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	23,775.97
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	3,312.63

应收债券利息	1,589.90
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	367.38
合计	29,045.88

6.4.7.6 其他资产

无余额。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	4,059,001.26
银行间市场应付交易费用	2,431.19
合计	4,061,432.45

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	500,000.00
应付赎回费	44.34
预提账户维护费	-
预提审计费	52,068.27
预提信息披露费	138,848.72
合计	690,961.33

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	4,806,686,210.22	1,464,601,883.81
本期申购	479,880,705.15	146,235,943.88
本期赎回（以“-”号填列）	-2,041,720,299.67	-622,113,040.28
本期末	3,244,846,615.70	988,724,787.41

注：申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 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	1,776,966,501.57	168,877,841.33	1,945,844,342.90
本期利润	93,646,199.08	167,559,032.27	261,205,231.35
本期基金份额交易产生的变动数	-574,210,781.04	-101,570,347.28	-675,781,128.32
其中：基金申购款	181,477,400.67	29,120,140.19	210,597,540.86
基金赎回款	-755,688,181.71	-130,690,487.47	-886,378,669.18
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,296,401,919.61	234,866,526.32	1,531,268,445.93

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
活期存款利息收入	532,020.61
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	49,843.03
其他	7,267.17
合计	589,130.81

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出股票成交总额	4,485,185,777.86
减：卖出股票成本总额	4,382,828,484.30
买卖股票差价收入	102,357,293.56

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	5,928,476.28
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	5,696,000.00
减：应收利息总额	2,622.57
买卖债券差价收入	229,853.71

6.4.7.14 衍生工具收益

无。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
股票投资产生的股利收益	18,697,215.51
基金投资产生的股利收益	-
合计	18,697,215.51

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
1.交易性金融资产	167,559,032.27
——股票投资	167,811,934.51
——债券投资	-252,902.24
——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	167,559,032.27

6.4.7.17 其他收入

无。

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
交易所市场交易费用	12,414,327.36
银行间市场交易费用	-
合计	12,414,327.36

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
审计费用	52,068.27
信息披露费	138,848.72
银行汇划费用	371.00
合计	191,287.99

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

无。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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(“工商银行”)	基金托管人、基金代销机构

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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

无。

6.4.10.1.4 债券回购交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月 30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	13,023,109.05	12,549,487.96
其中：支付销售机构的客户维护费	504,616.70	480,870.37

注：支付基金管理人华安基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.0% 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 1.0% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月 30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6 月30日
当期发生的基金应支付的托管费	2,604,621.82	2,509,897.64

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 0.2% 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 0.2% / 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.4.2 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。

6.4.10.5 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 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30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	144,188,104.50	532,020.61	127,837,885.16	545,590.31

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。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本报告期不进行利润分配。

6.4.12 期末（2017年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 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

6.4.12.1.1 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
002879	长缆科技	2017-06-05	2017-07-07	网下中签	18.02	18.02	1,313	23,660.26	23,660.26	-
002882	金龙羽	2017-06-15	2017-07-17	网下中签	6.20	6.20	2,966	18,389.20	18,389.20	-
300670	大烨智能	2017-06-26	2017-07-03	网下中签	10.93	10.93	1,259	13,760.87	13,760.87	-
300671	富满电子	2017-06-27	2017-07-05	网下中签	8.11	8.11	942	7,639.62	7,639.62	-
300672	国科微	2017-06-30	2017-07-12	网下中签	8.48	8.48	1,257	10,659.36	10,659.36	-

603305	旭升股份	2017-06-30	2017-07-10	网下中签	11.26	11.26	1,351	15,212.26	15,212.26	-
603331	百达精工	2017-06-27	2017-07-05	网下中签	9.63	9.63	999	9,620.37	9,620.37	-
603617	君禾股份	2017-06-23	2017-07-03	网下中签	8.93	8.93	832	7,429.76	7,429.76	-
603933	睿能科技	2017-06-28	2017-07-06	网下中签	20.20	20.20	857	17,311.40	17,311.40	-

6.4.12.2 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	复牌开盘单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000034	神州数码	2017-03-21	重大资产重组	24.45	2017-07-18	22.01	169,937	3,468,558.61	4,154,959.65	-
000099	中信海直	2017-05-04	重大资产重组	11.26	-	-	14,000	177,733.00	157,640.00	-
000100	TCL集团	2017-04-21	重大事项	3.43	2017-07-26	3.72	175,790	569,658.20	602,959.70	-
000503	海虹控股	2017-05-11	重大资产重组	24.93	-	-	59,090	1,310,955.01	1,473,113.70	-
000656	金科股份	2017-05-05	重大资产重组	6.54	2017-07-05	5.92	135,998	724,295.58	889,426.92	-
000887	中鼎股份	2017-04-27	重大资产重组	22.09	2017-07-14	19.88	631,833	16,281,772.85	13,957,190.97	-
002013	中航机电	2017-05-12	重大事项	10.33	2017-08-02	11.36	634,558	5,984,032.16	6,554,984.14	-
002049	紫光国芯	2017-02-20	重大资产重组	30.82	2017-07-17	27.74	18,727	772,710.39	577,166.14	-
002070	*ST众和	2017-05-02	重大资产重组	10.17	-	-	59,576	890,768.31	605,887.92	-
002129	中环股份	2016-04-25	重大事项	8.27	-	-	43,984	387,674.78	363,747.68	-
002312	*ST三泰	2017-03-31	重大资产重组	6.82	2017-07-24	7.16	137,270	2,570,200.12	936,181.40	-
002505	大康农业	2017-03-13	重大资产重组	3.50	-	-	436,900	1,533,954.00	1,529,150.00	-
600050	中国联通	2017-04-05	重大事项	7.47	2017-08-21	8.22	648,424	3,827,428.54	4,843,727.28	-
600100	同方股份	2017-04-21	重大资产重组	14.12	-	-	21,857	288,314.80	308,620.84	-
60064	爱建集	2017-04	重大资	14.98	2017-0	16.48	302,332	3,062,684.14	4,528,933.36	-

3	团	-17	产重组		8-02					
600655	豫园商城	2016-12-20	重大资产重组	11.32	-	-	553,999	6,902,969.86	6,271,268.68	-
601088	中国神华	2017-06-05	重大事项	22.29	-	-	152,614	2,662,251.84	3,401,766.06	-
601989	中国重工	2017-05-31	重大资产重组	6.21	-	-	61,943	478,599.92	384,666.03	-
603336	宏辉果蔬	2017-06-21	重大事项	28.40	2017-07-05	27.60	1,277	11,888.87	36,266.80	-

注：本基金截至 2017 年 6 月 30 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。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.13 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。

6.4.13.1 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。

6.4.13.2 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。

6.4.13.3 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。

于 2017 年 06 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
2017 年 6 月 30 日					
资产					
银行存款	144,188,104.50	-	-	-	144,188,104.50
结算备付金	8,179,470.87	-	-	-	8,179,470.87
存出保证金	907,073.71	-	-	-	907,073.71
交易性金融资产	1,340,446.00	-	-	2,376,820,173.38	2,378,160,619.38
应收利息	-	-	-	29,045.88	29,045.88

应收申购款	-	-	-	916,057.21	916,057.21
资产总计	154,615,095.08	-	-	2,377,765,276.47	2,532,380,371.55
负债					
应付赎回款	-	-	-	5,236,873.65	5,236,873.65
应付管理人报酬	-	-	-	1,998,225.65	1,998,225.65
应付托管费	-	-	-	399,645.13	399,645.13
应付交易费用	-	-	-	4,061,432.45	4,061,432.45
其他负债	-	-	-	690,961.33	690,961.33
负债总计	-	-	-	12,387,138.21	12,387,138.21
利率敏感度缺口	154,615,095.08	-	-	2,365,378,138.26	2,519,993,233.34
上年度末 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	3,410,446,226.08

					71
--	--	--	--	--	----

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金于 2017 年 6 月 30 日未持有债券资产，且持有的银行存款均为活期存款，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 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。

6.4.13.4.3 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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日		上年度末 2016 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	2,376,820,173.38	94.32	3,229,348,451.31	94.69
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	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	2,376,820,173.38	94.32	3,229,348,451.31	94.69

6.4.13.4.3.2 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: 人民币万元)	
		本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准上升 5%	增加约 14,049	增加约 18,431
	2.业绩比较基准下降 5%	减少约 14,049	减少约 18,431

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 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: (1) 金融商品持有期间(含到期)取得的非保本收益(合同中未明确承诺到期本金可全部收回的投资收益), 不征收增值税; (2) 纳税人购入基金、信托、理财产品等各类资产管理产品持有至到期, 不属于金融商品转让; (3) 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。上述政策自 2016 年 5 月 1 日起执行。

此外, 根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》及 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。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

7 投资组合报告

7.1 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	2,376,820,173.38	93.86
	其中：股票	2,376,820,173.38	93.86
2	固定收益投资	1,340,446.00	0.05
	其中：债券	1,340,446.00	0.05
	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	152,367,575.37	6.02
7	其他各项资产	1,852,176.80	0.07
8	合计	2,532,380,371.55	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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	5,877,068.19	0.23
B	采矿业	122,723,938.93	4.87
C	制造业	1,017,546,481.67	40.38
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,474,195.50	0.65
E	建筑业	54,454,602.47	2.16
F	批发和零售业	51,729,689.68	2.05
G	交通运输、仓储和邮政业	72,228,519.42	2.87
H	住宿和餐饮业	3,494,924.40	0.14
I	信息传输、软件和信息技术服务业	101,553,682.16	4.03
J	金融业	574,862,680.19	22.81
K	房地产业	96,468,060.36	3.83
L	租赁和商务服务业	36,725,997.58	1.46
M	科学研究和技术服务业	85,720.00	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	21,411,717.34	0.85
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	36,800,185.62	1.46
S	综合	3,433,549.28	0.14
	合计	2,215,871,012.79	87.93

7.2.2 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	1,297,495.62	0.05
B	采矿业	75,520.66	0.00
C	制造业	121,155,917.22	4.81
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,752,333.64	0.11
E	建筑业	1,717,686.24	0.07

F	批发和零售业	6,502,042.22	0.26
G	交通运输、仓储和邮政业	498,846.60	0.02
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	13,136,555.42	0.52
J	金融业	187,943.49	0.01
K	房地产业	1,885,273.68	0.07
L	租赁和商务服务业	1,243,723.08	0.05
M	科学研究和技术服务业	5,864,263.12	0.23
N	水利、环境和公共设施管理业	343,160.00	0.01
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	4,288,399.60	0.17
S	综合	-	-
	合计	160,949,160.59	6.39

7.3 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

7.3.1 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	600036	招商银行	3,264,576	78,056,012.16	3.10
2	000651	格力电器	1,869,652	76,973,572.84	3.05
3	000858	五粮液	1,250,966	69,628,767.56	2.76
4	601318	中国平安	1,386,175	68,768,141.75	2.73
5	600516	方大炭素	3,799,977	54,035,672.94	2.14
6	601336	新华保险	910,825	46,816,405.00	1.86
7	601601	中国太保	1,305,329	44,211,493.23	1.75
8	600016	民生银行	4,826,500	39,673,830.00	1.57
9	601699	潞安环能	4,881,451	38,172,946.82	1.51
10	002074	国轩高科	1,162,960	36,691,388.00	1.46
11	600000	浦发银行	2,671,880	33,799,282.00	1.34
12	601328	交通银行	5,192,032	31,982,917.12	1.27
13	600519	贵州茅台	63,743	30,077,134.55	1.19
14	600690	青岛海尔	1,989,662	29,944,413.10	1.19
15	600276	恒瑞医药	578,543	29,268,490.37	1.16

16	600872	中炬高新	1,501,922	27,485,172.60	1.09
17	000970	中科三环	1,769,974	26,160,215.72	1.04
18	601818	光大银行	6,076,322	24,609,104.10	0.98
19	002142	宁波银行	1,259,781	24,313,773.30	0.96
20	601939	建设银行	3,905,211	24,017,047.65	0.95
21	000002	万科 A	938,300	23,429,351.00	0.93
22	002236	大华股份	1,018,601	23,234,288.81	0.92
23	002739	万达电影	443,900	22,625,583.00	0.90
24	002396	星网锐捷	1,148,399	22,221,520.65	0.88
25	002405	四维图新	1,085,976	21,458,885.76	0.85
26	601166	兴业银行	1,244,820	20,987,665.20	0.83
27	600887	伊利股份	881,063	19,022,150.17	0.75
28	000768	中航飞机	940,408	17,341,123.52	0.69
29	000776	广发证券	982,800	16,953,300.00	0.67
30	000937	冀中能源	2,516,434	15,400,576.08	0.61
31	002415	海康威视	455,188	14,702,572.40	0.58
32	001979	招商蛇口	685,276	14,637,495.36	0.58
33	600497	驰宏锌锗	2,233,735	14,630,964.25	0.58
34	600015	华夏银行	1,543,882	14,234,592.04	0.56
35	600383	金地集团	1,239,975	14,222,513.25	0.56
36	000887	中鼎股份	631,833	13,957,190.97	0.55
37	600270	外运发展	682,033	12,910,884.69	0.51
38	002450	康得新	566,051	12,747,468.52	0.51
39	600651	飞乐音响	1,454,438	12,319,089.86	0.49
40	002368	太极股份	432,547	11,977,226.43	0.48
41	002371	北方华创	499,962	11,959,091.04	0.47
42	600837	海通证券	791,084	11,747,597.40	0.47
43	600160	巨化股份	976,360	11,745,610.80	0.47
44	600595	中孚实业	2,384,951	11,495,463.82	0.46
45	002036	联创电子	656,900	10,838,850.00	0.43
46	002183	怡亚通	1,248,983	10,778,723.29	0.43
47	600884	杉杉股份	647,427	10,663,122.69	0.42
48	000069	华侨城 A	1,056,297	10,626,347.82	0.42
49	000983	西山煤电	1,189,828	10,434,791.56	0.41
50	601168	西部矿业	1,354,739	10,417,942.91	0.41
51	600298	安琪酵母	400,000	10,348,000.00	0.41
52	600522	中天科技	855,300	10,306,365.00	0.41
53	600068	葛洲坝	910,444	10,233,390.56	0.41
54	002573	清新环境	543,036	10,219,937.52	0.41
55	002456	欧菲光	562,442	10,219,571.14	0.41
56	002241	歌尔股份	527,754	10,175,097.12	0.40
57	600340	华夏幸福	300,000	10,074,000.00	0.40
58	601688	华泰证券	553,568	9,908,867.20	0.39
59	601288	农业银行	2,800,000	9,856,000.00	0.39

60	002410	广联达	504,119	9,477,437.20	0.38
61	600406	国电南瑞	536,001	9,460,417.65	0.38
62	600999	招商证券	543,281	9,355,298.82	0.37
63	000739	普洛药业	1,249,995	9,174,963.30	0.36
64	601607	上海医药	307,146	8,870,376.48	0.35
65	600143	金发科技	1,468,793	8,856,821.79	0.35
66	600019	宝钢股份	1,253,341	8,409,918.11	0.33
67	601098	中南传媒	446,977	8,331,651.28	0.33
68	002108	沧州明珠	610,000	8,143,500.00	0.32
69	600029	南方航空	900,000	7,830,000.00	0.31
70	601111	中国国航	800,000	7,800,000.00	0.31
71	000895	双汇发展	323,608	7,685,690.00	0.30
72	000625	长安汽车	530,000	7,642,600.00	0.30
73	601600	中国铝业	1,610,738	7,280,535.76	0.29
74	000425	徐工机械	1,940,878	7,278,292.50	0.29
75	601006	大秦铁路	862,131	7,233,279.09	0.29
76	000725	京东方 A	1,738,176	7,230,812.16	0.29
77	600703	三安光电	363,667	7,164,239.90	0.28
78	002146	荣盛发展	706,181	6,970,006.47	0.28
79	600009	上海机场	186,481	6,957,606.11	0.28
80	600201	生物股份	194,133	6,905,310.81	0.27
81	600031	三一重工	843,666	6,859,004.58	0.27
82	002707	众信旅游	520,705	6,836,856.65	0.27
83	000630	铜陵有色	2,402,377	6,822,750.68	0.27
84	002013	中航机电	634,558	6,554,984.14	0.26
85	600816	安信信托	479,211	6,512,477.49	0.26
86	601998	中信银行	1,030,196	6,479,932.84	0.26
87	000501	鄂武商 A	343,846	6,347,397.16	0.25
88	601899	紫金矿业	1,849,893	6,345,132.99	0.25
89	000423	东阿阿胶	88,157	6,337,606.73	0.25
90	600521	华海药业	300,014	6,312,294.56	0.25
91	600655	豫园商城	553,999	6,271,268.68	0.25
92	601390	中国中铁	719,818	6,240,822.06	0.25
93	601668	中国建筑	624,006	6,040,378.08	0.24
94	002400	省广股份	747,426	6,001,830.78	0.24
95	000065	北方国际	251,754	5,986,710.12	0.24
96	002024	苏宁云商	527,046	5,929,267.50	0.24
97	600372	中航电子	340,548	5,915,318.76	0.23
98	600271	航天信息	282,585	5,832,554.40	0.23
99	000977	浪潮信息	334,278	5,789,694.96	0.23
100	600369	西南证券	1,031,429	5,786,316.69	0.23
101	601377	兴业证券	765,852	5,690,280.36	0.23
102	600030	中信证券	329,152	5,602,167.04	0.22
103	600549	厦门钨业	256,691	5,516,289.59	0.22

104	000568	泸州老窖	108,806	5,503,407.48	0.22
105	000728	国元证券	442,755	5,410,466.10	0.21
106	601618	中国中冶	1,066,467	5,342,999.67	0.21
107	601857	中国石油	686,512	5,279,277.28	0.21
108	600376	首开股份	458,837	5,249,095.28	0.21
109	002174	游族网络	164,785	5,233,571.60	0.21
110	002555	三七互娱	200,000	5,114,000.00	0.20
111	601788	光大证券	339,263	5,065,196.59	0.20
112	000807	云铝股份	686,734	4,958,219.48	0.20
113	600415	小商品城	678,375	4,911,435.00	0.19
114	000959	首钢股份	693,083	4,844,650.17	0.19
115	600050	中国联通	648,424	4,843,727.28	0.19
116	600426	华鲁恒升	411,355	4,829,307.70	0.19
117	600125	铁龙物流	536,875	4,810,400.00	0.19
118	002304	洋河股份	54,714	4,749,722.34	0.19
119	600879	航天电子	538,314	4,731,780.06	0.19
120	600153	建发股份	359,188	4,644,300.84	0.18
121	600839	四川长虹	1,280,715	4,636,188.30	0.18
122	600885	宏发股份	115,058	4,589,663.62	0.18
123	600893	航发动力	166,538	4,546,487.40	0.18
124	002195	二三四五	635,630	4,544,754.50	0.18
125	600643	爱建集团	302,332	4,528,933.36	0.18
126	600066	宇通客车	204,128	4,484,692.16	0.18
127	600478	科力远	514,300	4,428,123.00	0.18
128	601898	中煤能源	742,889	4,368,187.32	0.17
129	002223	鱼跃医疗	184,359	4,365,621.12	0.17
130	002230	科大讯飞	107,621	4,294,077.90	0.17
131	000034	神州数码	169,937	4,154,959.65	0.16
132	600021	上海电力	333,671	4,034,082.39	0.16
134	002007	华兰生物	109,109	3,982,478.50	0.16
135	600266	北京城建	269,696	3,921,379.84	0.16
136	600219	南山铝业	1,133,105	3,841,225.95	0.15
137	002517	恺英网络	109,038	3,837,047.22	0.15
138	600094	大名城	500,000	3,835,000.00	0.15
139	600028	中国石化	636,825	3,776,372.25	0.15
140	601555	东吴证券	334,503	3,756,468.69	0.15
141	600004	白云机场	203,058	3,748,450.68	0.15
142	002008	大族激光	107,335	3,718,084.40	0.15
143	000783	长江证券	387,671	3,671,244.37	0.15
144	000027	深圳能源	545,453	3,670,898.69	0.15
145	600489	中金黄金	354,845	3,559,095.35	0.14
146	601669	中国电建	444,213	3,518,166.96	0.14
147	600637	东方明珠	162,061	3,511,861.87	0.14
148	600754	锦江股份	128,964	3,494,924.40	0.14

149	002460	赣锋锂业	75,376	3,486,140.00	0.14
150	600118	中国卫星	123,897	3,449,292.48	0.14
151	601088	中国神华	152,614	3,401,766.06	0.13
152	600729	重庆百货	124,117	3,331,300.28	0.13
153	600428	中远海特	531,375	3,305,152.50	0.13
154	000528	柳工	380,000	3,283,200.00	0.13
155	603288	海天味业	80,000	3,262,400.00	0.13
156	600269	赣粤高速	619,811	3,229,215.31	0.13
157	600170	上海建工	836,256	3,194,497.92	0.13
158	002367	康力电梯	265,652	3,102,815.36	0.12
159	600312	平高电气	223,565	3,071,783.10	0.12
160	600584	长电科技	188,386	3,023,595.30	0.12
161	002594	比亚迪	59,510	2,972,524.50	0.12
162	002050	三花智控	181,633	2,964,250.56	0.12
163	600660	福耀玻璃	112,571	2,931,348.84	0.12
164	601169	北京银行	317,928	2,915,399.76	0.12
165	600138	中青旅	136,443	2,873,489.58	0.11
166	600783	鲁信创投	167,731	2,856,458.93	0.11
167	000089	深圳机场	304,082	2,843,166.70	0.11
168	002092	中泰化学	221,149	2,808,592.30	0.11
169	000999	华润三九	87,272	2,770,886.00	0.11
170	002475	立讯精密	93,656	2,738,501.44	0.11
171	000882	华联股份	758,008	2,736,408.88	0.11
172	600694	大商股份	69,918	2,724,704.46	0.11
173	600196	复星医药	87,373	2,707,689.27	0.11
174	600037	歌华有线	185,456	2,700,239.36	0.11
175	002385	大北农	422,068	2,654,807.72	0.11
176	600039	四川路桥	631,529	2,627,160.64	0.10
177	002065	东华软件	120,031	2,615,475.49	0.10
178	002294	信立泰	73,064	2,605,462.24	0.10
179	002701	奥瑞金	402,374	2,571,169.86	0.10
180	000869	张裕 A	69,037	2,568,176.40	0.10
181	002603	以岭药业	146,531	2,558,431.26	0.10
182	600835	上海机电	120,725	2,552,126.50	0.10
183	000581	威孚高科	98,205	2,543,509.50	0.10
184	600352	浙江龙盛	264,899	2,524,487.47	0.10
185	600499	科达洁能	312,757	2,483,290.58	0.10
186	002219	恒康医疗	205,717	2,476,832.68	0.10
187	601866	中远海发	678,988	2,444,356.80	0.10
188	601766	中国中车	233,320	2,361,198.40	0.09
189	600873	梅花生物	415,924	2,358,289.08	0.09
190	000758	中色股份	335,711	2,353,334.11	0.09
191	601901	方正证券	235,680	2,340,302.40	0.09
192	600685	中船防务	84,752	2,320,509.76	0.09

193	600612	老凤祥	47,226	2,312,657.22	0.09
194	000793	华闻传媒	228,333	2,310,729.96	0.09
195	002202	金风科技	149,205	2,308,201.35	0.09
196	000059	华锦股份	223,451	2,236,744.51	0.09
197	600008	首创股份	333,254	2,192,811.32	0.09
198	002051	中工国际	104,620	2,168,772.60	0.09
199	600808	马钢股份	609,036	2,155,987.44	0.09
200	600183	生益科技	172,319	2,126,416.46	0.08
201	002081	金螳螂	193,268	2,122,082.64	0.08
202	000001	平安银行	225,539	2,117,811.21	0.08
203	000028	国药一致	25,931	2,097,817.90	0.08
204	601179	中国西电	376,447	2,093,045.32	0.08
205	600307	酒钢宏兴	730,382	2,081,588.70	0.08
206	600198	大唐电信	161,912	2,067,616.24	0.08
207	600282	南钢股份	537,707	1,994,892.97	0.08
208	000088	盐田港	188,475	1,980,872.25	0.08
209	600150	中国船舶	85,861	1,963,641.07	0.08
210	002466	天齐锂业	36,039	1,958,719.65	0.08
211	600649	城投控股	185,155	1,945,979.05	0.08
212	000513	丽珠集团	28,073	1,911,771.30	0.08
213	002570	贝因美	139,648	1,899,212.80	0.08
214	000750	国海证券	341,416	1,877,788.00	0.07
215	601801	皖新传媒	133,437	1,844,099.34	0.07
216	600642	申能股份	292,631	1,843,575.30	0.07
217	600587	新华医疗	102,966	1,830,735.48	0.07
218	002601	龙蟠佰利	111,119	1,820,129.22	0.07
219	002244	滨江集团	261,524	1,809,746.08	0.07
220	000400	许继电气	100,748	1,809,434.08	0.07
221	600588	用友网络	104,062	1,781,541.44	0.07
222	600517	置信电气	234,971	1,778,730.47	0.07
223	600557	康缘药业	106,718	1,772,585.98	0.07
224	600216	浙江医药	176,813	1,752,216.83	0.07
225	000338	潍柴动力	132,722	1,751,930.40	0.07
226	600388	龙净环保	112,048	1,740,105.44	0.07
227	002179	中航光电	55,470	1,730,109.30	0.07
228	600177	雅戈尔	169,630	1,716,655.60	0.07
229	002011	盾安环境	145,000	1,645,750.00	0.07
230	601198	东兴证券	94,392	1,627,318.08	0.06
231	600487	亨通光电	57,570	1,614,838.50	0.06
232	600535	天士力	38,552	1,601,450.08	0.06
233	601877	正泰电器	79,399	1,595,125.91	0.06
234	601888	中国国旅	52,538	1,583,495.32	0.06
235	002508	老板电器	36,140	1,571,367.20	0.06
236	600594	益佰制药	102,932	1,570,742.32	0.06

237	600867	通化东宝	86,082	1,570,135.68	0.06
238	000988	华工科技	106,638	1,555,848.42	0.06
239	002310	东方园林	92,845	1,552,368.40	0.06
240	600161	天坛生物	39,697	1,540,640.57	0.06
241	601012	隆基股份	89,892	1,537,153.20	0.06
242	601000	唐山港	294,143	1,535,426.46	0.06
243	002022	科华生物	88,369	1,534,969.53	0.06
244	002505	大康农业	436,900	1,529,150.00	0.06
245	000860	顺鑫农业	74,399	1,488,723.99	0.06
246	000503	海虹控股	59,090	1,473,113.70	0.06
247	000792	盐湖股份	139,632	1,459,154.40	0.06
248	600409	三友化工	142,672	1,436,707.04	0.06
249	600495	晋西车轴	203,127	1,432,045.35	0.06
250	600699	均胜电子	44,500	1,428,005.00	0.06
251	600635	大众公用	260,992	1,422,406.40	0.06
252	600511	国药股份	39,139	1,418,397.36	0.06
253	600418	江淮汽车	132,635	1,399,299.25	0.06
254	002477	雏鹰农牧	310,874	1,377,171.82	0.05
255	002152	广电运通	165,352	1,374,075.12	0.05
256	601928	凤凰传媒	140,129	1,367,659.04	0.05
257	600820	隧道股份	133,921	1,352,602.10	0.05
258	600329	中新药业	73,536	1,331,736.96	0.05
259	000559	万向钱潮	125,326	1,330,962.12	0.05
260	000876	新希望	161,286	1,325,770.92	0.05
261	000592	平潭发展	237,825	1,312,794.00	0.05
262	600718	东软集团	83,881	1,304,349.55	0.05
263	600073	上海梅林	134,850	1,287,817.50	0.05
264	000801	四川九洲	131,827	1,261,584.39	0.05
265	600674	川投能源	127,480	1,251,853.60	0.05
266	002261	拓维信息	104,739	1,226,493.69	0.05
267	000039	中集集团	67,844	1,223,227.32	0.05
268	601929	吉视传媒	352,514	1,219,698.44	0.05
269	600827	百联股份	74,765	1,214,931.25	0.05
270	601800	中国交建	75,915	1,206,289.35	0.05
271	600122	宏图高科	106,900	1,186,590.00	0.05
272	600157	永泰能源	332,092	1,185,568.44	0.05
273	002001	新和成	60,408	1,172,519.28	0.05
274	600026	中远海能	175,638	1,164,479.94	0.05
275	600366	宁波韵升	65,371	1,153,144.44	0.05
276	600115	东方航空	168,761	1,147,574.80	0.05
277	600259	广晟有色	29,076	1,135,127.04	0.05
278	002444	巨星科技	72,834	1,134,753.72	0.05
279	600240	华业资本	125,011	1,132,599.66	0.04
280	600060	海信电器	72,400	1,098,308.00	0.04

281	002390	信邦制药	125,263	1,091,040.73	0.04
282	000547	航天发展	103,950	1,086,277.50	0.04
283	600611	大众交通	194,123	1,071,558.96	0.04
284	002672	东江环保	63,013	1,064,289.57	0.04
285	002479	富春环保	86,717	1,031,932.30	0.04
286	002064	华峰氨纶	213,000	1,026,660.00	0.04
287	601009	南京银行	91,400	1,024,594.00	0.04
288	000917	电广传媒	89,724	1,013,881.20	0.04
289	600058	五矿发展	81,648	1,013,251.68	0.04
290	600062	华润双鹤	36,796	1,009,314.28	0.04
291	002384	东山精密	40,838	1,008,698.60	0.04
292	002344	海宁皮城	120,644	1,003,758.08	0.04
293	600536	中国软件	51,889	994,193.24	0.04
294	002153	石基信息	43,564	990,209.72	0.04
295	600748	上实发展	137,294	988,516.80	0.04
296	000810	创维数字	79,508	964,432.04	0.04
297	600998	九州通	44,364	956,487.84	0.04
298	600688	上海石化	141,979	938,481.19	0.04
299	002312	*ST 三泰	137,270	936,181.40	0.04
300	600525	长园集团	67,780	921,130.20	0.04
301	600787	中储股份	116,441	921,048.31	0.04
302	600048	保利地产	90,493	902,215.21	0.04
303	600309	万华化学	31,288	896,088.32	0.04
304	000656	金科股份	135,998	889,426.92	0.04
305	000786	北新建材	56,138	889,225.92	0.04
306	000418	小天鹅 A	18,834	881,242.86	0.03
307	000961	中南建设	128,989	841,008.28	0.03
308	601186	中国铁建	66,494	799,922.82	0.03
309	600547	山东黄金	27,582	797,947.26	0.03
310	600967	内蒙一机	56,431	769,154.53	0.03
311	000031	中粮地产	101,197	762,013.41	0.03
312	002345	潮宏基	69,400	754,378.00	0.03
313	600399	抚顺特钢	120,063	749,193.12	0.03
314	002041	登海种业	56,054	742,715.50	0.03
315	001696	宗申动力	94,262	713,563.34	0.03
316	601933	永辉超市	99,032	701,146.56	0.03
317	002572	索菲亚	17,000	697,000.00	0.03
318	000800	一汽轿车	67,741	688,925.97	0.03
319	000671	阳光城	117,961	686,533.02	0.03
320	002428	云南锗业	63,540	678,607.20	0.03
321	600804	鹏博士	37,819	671,287.25	0.03
322	600123	兰花科创	85,854	654,207.48	0.03
323	000006	深振业 A	73,049	643,561.69	0.03
324	600410	华胜天成	72,490	642,261.40	0.03

325	600528	中铁工业	43,663	623,944.27	0.02
326	002070	*ST 众和	59,576	605,887.92	0.02
327	000100	TCL 集团	175,790	602,959.70	0.02
328	000587	金洲慈航	39,900	594,510.00	0.02
329	600500	中化国际	61,642	589,297.52	0.02
330	600017	日照港	129,900	584,550.00	0.02
331	002049	紫光国芯	18,727	577,166.14	0.02
332	600111	北方稀土	50,650	573,864.50	0.02
333	600006	东风汽车	96,800	566,280.00	0.02
334	000826	启迪桑德	16,100	565,432.00	0.02
335	600208	新湖中宝	125,444	564,498.00	0.02
336	600978	宜华生活	55,095	553,704.75	0.02
337	600098	广州发展	69,926	553,114.66	0.02
338	600108	亚盛集团	125,017	538,823.27	0.02
339	600736	苏州高新	75,300	532,371.00	0.02
340	002325	洪涛股份	72,837	531,710.10	0.02
341	600826	兰生股份	28,112	508,827.20	0.02
342	600151	航天机电	59,845	492,524.35	0.02
343	600315	上海家化	14,930	484,478.50	0.02
344	600663	陆家嘴	19,948	471,570.72	0.02
345	000839	中信国安	47,104	470,568.96	0.02
346	600958	东方证券	33,726	469,128.66	0.02
347	000157	中联重科	101,274	454,720.26	0.02
348	600325	华发股份	52,740	440,379.00	0.02
349	002073	软控股份	51,708	438,483.84	0.02
350	002029	七匹狼	44,465	425,530.05	0.02
351	002595	豪迈科技	18,700	415,701.00	0.02
352	002364	中恒电气	30,106	412,151.14	0.02
353	601958	金铂股份	55,579	398,501.43	0.02
354	600812	华北制药	64,500	386,355.00	0.02
355	000712	锦龙股份	23,500	384,695.00	0.02
356	601989	中国重工	61,943	384,666.03	0.02
357	600570	恒生电子	8,116	378,854.88	0.02
358	601333	广深铁路	83,318	376,597.36	0.01
359	601118	海南橡胶	66,270	376,413.60	0.01
360	600067	冠城大通	54,700	375,789.00	0.01
361	002129	中环股份	43,984	363,747.68	0.01
362	000009	中国宝安	44,865	362,957.85	0.01
363	600435	北方导航	24,803	354,930.93	0.01
364	600284	浦东建设	32,200	345,184.00	0.01
365	002309	中利集团	26,600	332,766.00	0.01
366	600717	天津港	26,400	329,736.00	0.01
367	600757	长江传媒	42,900	320,463.00	0.01
368	600881	亚泰集团	61,336	311,586.88	0.01

369	600100	同方股份	21,857	308,620.84	0.01
370	000729	燕京啤酒	45,711	307,177.92	0.01
371	600023	浙能电力	54,454	297,318.84	0.01
372	600875	东方电气	30,209	289,402.22	0.01
373	002028	思源电气	17,927	285,756.38	0.01
374	600166	福田汽车	96,356	273,651.04	0.01
375	600580	卧龙电气	40,100	273,482.00	0.01
376	600256	广汇能源	58,864	243,696.96	0.01
377	600252	中恒集团	58,304	235,548.16	0.01
378	601718	际华集团	26,008	228,610.32	0.01
379	002004	华邦健康	29,170	228,401.10	0.01
380	601117	中国化学	32,174	224,896.26	0.01
381	002500	山西证券	23,398	224,152.84	0.01
382	600770	综艺股份	28,551	214,132.50	0.01
383	600320	振华重工	37,601	194,773.18	0.01
384	600064	南京高科	12,300	185,730.00	0.01
385	600348	阳泉煤业	24,853	168,503.34	0.01
386	600316	洪都航空	9,966	160,153.62	0.01
387	000652	泰达股份	28,720	152,216.00	0.01
388	600811	东方集团	22,542	146,973.84	0.01
389	002439	启明星辰	7,404	137,714.40	0.01
390	000600	建投能源	10,600	130,062.00	0.01
391	002375	亚厦股份	14,101	125,639.91	0.00
392	002311	海大集团	6,255	114,278.85	0.00
393	603000	人民网	8,559	112,722.03	0.00
394	600380	健康元	11,957	108,569.56	0.00
395	600597	光明乳业	7,951	101,375.25	0.00
396	600022	山东钢铁	47,704	98,270.24	0.00
397	600645	中源协和	4,000	85,720.00	0.00
398	600109	国金证券	6,982	81,829.04	0.00
399	600823	世茂股份	16,660	81,634.00	0.00
400	000997	新大陆	3,000	68,070.00	0.00
401	600280	中央商场	7,500	59,475.00	0.00
402	600900	长江电力	3,000	46,140.00	0.00
403	600096	云天化	1,217	9,005.80	0.00
404	601988	中国银行	1,311	4,850.70	0.00
405	600221	海航控股	1,293	4,163.46	0.00
-	600089	特变电工	446,504	4,612,386.32	0.18

7.3.2 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	603898	好莱客	607,507	21,232,369.65	0.84
2	600507	方大特钢	1,898,287	16,192,388.11	0.64
3	600782	新钢股份	4,399,939	16,059,777.35	0.64
4	600801	华新水泥	1,300,000	12,389,000.00	0.49
5	300036	超图软件	700,000	11,445,000.00	0.45
6	002196	方正电机	799,970	9,143,657.10	0.36
7	300146	汤臣倍健	586,800	8,062,632.00	0.32
8	600546	山煤国际	1,326,418	6,353,542.22	0.25
9	603018	中设集团	179,940	5,828,256.60	0.23
10	300458	全志科技	165,318	4,354,476.12	0.17
11	300144	宋城演艺	200,000	4,174,000.00	0.17
12	603968	醋化股份	180,323	4,050,054.58	0.16
13	600990	四创电子	60,000	3,719,400.00	0.15
14	300207	欣旺达	267,545	3,154,355.55	0.13
15	002597	金禾实业	131,360	2,871,529.60	0.11
16	002104	恒宝股份	201,224	1,889,493.36	0.07
17	600496	精工钢构	347,600	1,678,908.00	0.07
18	600963	岳阳林纸	205,061	1,544,109.33	0.06
19	300115	长盈精密	48,800	1,423,984.00	0.06
20	002254	泰和新材	103,100	1,371,230.00	0.05
21	600509	天富能源	177,886	1,353,712.46	0.05
22	002321	华英农业	118,169	1,297,495.62	0.05
23	002293	罗莱生活	110,800	1,269,768.00	0.05
24	300383	光环新网	84,758	1,149,318.48	0.05
25	600761	安徽合力	82,200	1,076,820.00	0.04
26	601566	九牧王	64,484	1,039,482.08	0.04
27	600708	光明地产	151,987	1,009,193.68	0.04
28	000536	华映科技	153,857	893,909.17	0.04
29	600236	桂冠电力	154,647	881,487.90	0.03
30	000897	津滨发展	186,400	876,080.00	0.03
31	000919	金陵药业	72,500	784,450.00	0.03
32	002546	新联电子	131,103	780,062.85	0.03
33	000877	天山股份	58,500	741,195.00	0.03
34	002452	长高集团	105,409	724,159.83	0.03
35	600195	中牧股份	34,900	676,711.00	0.03
36	300147	香雪制药	62,600	642,902.00	0.03
38	002181	粤传媒	108,293	585,865.13	0.02
39	002267	陕天然气	58,832	517,133.28	0.02
40	600305	恒顺醋业	45,878	470,708.28	0.02
41	300063	天龙集团	55,297	461,729.95	0.02
42	002063	远光软件	43,894	457,375.48	0.02
43	600844	*ST 丹科	67,481	452,797.51	0.02

44	600720	祁连山	46,000	360,180.00	0.01
45	603222	济民制药	23,803	344,905.47	0.01
46	300070	碧水源	18,400	343,160.00	0.01
47	600377	宁沪高速	34,817	341,206.60	0.01
48	002327	富安娜	34,000	282,540.00	0.01
49	002068	黑猫股份	32,610	274,250.10	0.01
50	601678	滨化股份	36,000	250,200.00	0.01
51	000830	鲁西化工	33,200	229,080.00	0.01
52	600790	轻纺城	28,800	196,128.00	0.01
53	002048	宁波华翔	9,400	196,084.00	0.01
54	601878	浙商证券	11,049	187,943.49	0.01
55	300037	新宙邦	7,598	174,602.04	0.01
56	000099	中信海直	14,000	157,640.00	0.01
57	300618	寒锐钴业	1,600	150,880.00	0.01
58	000417	合肥百货	18,000	148,500.00	0.01
59	603165	荣晟环保	1,574	104,434.90	0.00
60	002852	道道全	1,271	96,596.00	0.00
61	601106	*ST 一重	29,995	90,884.85	0.00
62	600251	冠农股份	11,200	89,264.00	0.00
63	300568	星源材质	1,936	82,183.20	0.00
64	601858	中国科传	6,391	80,015.32	0.00
65	002880	卫光生物	998	75,548.60	0.00
66	603727	博迈科	2,341	75,520.66	0.00
67	603239	浙江仙通	2,772	72,155.16	0.00
68	603186	华正新材	1,681	71,896.37	0.00
69	603208	江山欧派	1,221	65,970.63	0.00
70	300534	陇神戎发	3,486	65,780.82	0.00
71	002832	比音勒芬	1,158	63,771.06	0.00
72	300526	中潜股份	1,968	61,421.28	0.00
73	603966	法兰泰克	2,295	52,739.10	0.00
74	603203	快克股份	1,363	52,461.87	0.00
75	603801	志邦股份	1,406	47,522.80	0.00
76	300596	利安隆	2,170	46,785.20	0.00
77	603043	广州酒家	1,810	45,738.70	0.00
78	300565	科信技术	1,987	44,508.80	0.00
79	300666	江丰电子	2,276	43,448.84	0.00
80	300597	吉大通信	2,447	41,990.52	0.00
81	002835	同为股份	2,252	41,436.80	0.00
82	002826	易明医药	1,888	39,534.72	0.00
83	002825	纳尔股份	1,139	39,352.45	0.00
84	603316	诚邦股份	1,824	38,778.24	0.00
85	603886	元祖股份	1,951	38,278.62	0.00
86	603336	宏辉果蔬	1,277	36,266.80	0.00
87	603859	能科股份	1,121	36,006.52	0.00

88	603380	易德龙	1,298	35,370.50	0.00
89	603559	中通国脉	1,349	35,195.41	0.00
90	300592	华凯创意	1,484	34,384.28	0.00
91	300589	江龙船艇	1,189	29,201.84	0.00
92	603879	永悦科技	1,227	28,343.70	0.00
93	300586	美联新材	1,006	28,117.70	0.00
94	603335	迪生力	2,230	24,864.50	0.00
95	603536	惠发股份	1,008	24,141.60	0.00
96	002879	长缆科技	1,313	23,660.26	0.00
97	600141	兴发集团	1,900	23,503.00	0.00
98	002881	美格智能	989	22,608.54	0.00
99	603679	华体科技	809	21,438.50	0.00
100	603938	三孚股份	1,246	20,932.80	0.00
101	002882	金龙羽	2,966	18,389.20	0.00
102	603933	睿能科技	857	17,311.40	0.00
103	603305	旭升股份	1,351	15,212.26	0.00
104	300669	沪宁股份	841	14,650.22	0.00
105	300670	大烨智能	1,259	13,760.87	0.00
106	603286	日盈电子	890	13,528.00	0.00
107	600596	新安股份	1,300	10,985.00	0.00
108	300672	国科微	1,257	10,659.36	0.00
109	603331	百达精工	999	9,620.37	0.00
110	300671	富满电子	942	7,639.62	0.00
111	603617	君禾股份	832	7,429.76	0.00
112	603298	杭叉集团	3	62.19	0.00
113	600996	贵广网络	3	35.91	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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	601601	中国太保	128,903,044.21	3.78
2	000858	五粮液	80,146,490.20	2.35
3	601668	中国建筑	76,829,536.77	2.25
4	600038	中直股份	75,159,467.81	2.20
5	000651	格力电器	70,329,462.81	2.06
6	601336	新华保险	67,285,273.06	1.97
7	600036	招商银行	64,913,673.75	1.90
8	601939	建设银行	58,216,099.98	1.71
9	300017	网宿科技	56,360,078.78	1.65

10	600801	华新水泥	55,288,834.63	1.62
11	601699	潞安环能	54,132,393.69	1.59
12	600015	华夏银行	49,929,988.15	1.46
13	600068	葛洲坝	49,180,714.48	1.44
14	601288	农业银行	48,879,000.00	1.43
15	000915	山大华特	47,521,412.17	1.39
16	002396	星网锐捷	45,918,948.71	1.35
17	002051	中工国际	45,762,859.89	1.34
18	600872	中炬高新	44,423,987.89	1.30
19	600690	青岛海尔	43,760,244.39	1.28
20	002172	澳洋科技	42,986,633.24	1.26

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。

7.4.2 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	600038	中直股份	120,043,399.69	3.52
2	601601	中国太保	102,847,984.84	3.02
3	601668	中国建筑	95,948,598.75	2.81
4	002008	大族激光	88,798,885.67	2.60
5	000858	五粮液	85,615,374.34	2.51
6	600048	保利地产	76,042,883.73	2.23
7	600015	华夏银行	68,659,326.47	2.01
8	002475	立讯精密	65,922,101.79	1.93
9	002508	老板电器	63,448,661.29	1.86
10	600519	贵州茅台	59,884,349.23	1.76
11	601989	中国重工	58,667,752.58	1.72
12	601318	中国平安	57,691,915.55	1.69
13	600068	葛洲坝	57,080,705.17	1.67
14	601939	建设银行	56,684,897.07	1.66
15	300017	网宿科技	56,143,903.38	1.65
16	600585	海螺水泥	55,519,514.00	1.63
17	600498	烽火通信	51,662,233.58	1.51
18	601169	北京银行	51,561,491.20	1.51
19	000915	山大华特	50,828,410.24	1.49
20	002051	中工国际	50,620,731.17	1.48

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。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	3,362,488,271.86
卖出股票的收入（成交）总额	4,485,185,777.86

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。

7.5 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）	1,340,446.00	0.05
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,340,446.00	0.05

7.6 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	922,684.80	0.04
2	128013	洪涛转债	4,124	417,761.20	0.02

7.7 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。

7.8 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。

7.9 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。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 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。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

无。

7.11.2 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。

7.11.3 本期国债期货投资评价

无。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

7.12.2 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。

7.12.3 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	907,073.71
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	29,045.88

5	应收申购款	916,057.21
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,852,176.80

7.12.4 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	128013	洪涛转债	417,761.20	0.02
2	110031	航信转债	922,684.80	0.04

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况

7.12.5.2 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。

8 基金份额持有人信息

8.1 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
85,222	38,075.22	1,128,956,316.35	34.79%	2,115,890,299.35	65.21%

8.2 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	360,007.76	0.01%

8.3 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

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

注：本公司高级管理人员、基金投资和部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间为 0；

9 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	4,806,686,210.22
本报告期基金总申购份额	479,880,705.15
减：本报告期基金总赎回份额	2,041,720,299.67
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	3,244,846,615.70

10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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：

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、本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动如下：

无。

10.3 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。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内无基金投资策略的改变。

10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘为基金审计的会计师事务所。

10.6 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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	
银河证券	2	3,647,143,544.77	46.50%	3,379,138.95	46.72%	-
广发证券	1	1,484,934,857.13	18.93%	1,353,224.94	18.71%	-
招商证券	1	1,069,057,948.36	13.63%	974,233.79	13.47%	-
中信建投	1	957,196,059.98	12.20%	891,436.48	12.32%	-
申万宏源	1	445,542,168.33	5.68%	414,932.17	5.74%	-
国泰君安	1	133,816,727.72	1.71%	124,623.45	1.72%	-
浙商证券	1	105,086,226.55	1.34%	95,765.27	1.32%	-

注：1、券商专用交易单元选择标准：

基金管理人负责选择证券经营机构，选用其交易单元供本基金证券买卖专用，选择标准为：

- (1) 内部管理规范、严谨；具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- (2) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能够针对本基金业务需要，提供高质量的研究报告和较为全面的服务；
- (3) 具有战略规划和定位，能够积极推动多边业务合作，最大限度地调动整体资源，为基金投资赢取机会；
- (4) 其他有利于基金持有人利益的商业合作考虑。

2、券商专用交易单元选择程序：

- (1) 对交易单元候选券商的综合服务进行评估

由相关部门牵头并组织有关人员依据上述交易单元选择标准和《券商服务评价办法》，对候选交易单元的券商服务质量和综合实力进行评估。

(2) 填写《新增交易单元申请审核表》

牵头部门汇总对各候选交易单元券商的综合评估结果，择优选出拟新增单元，填写《新增交易单元申请审核表》，对拟新增交易单元的必要性和合规性进行阐述。

(3) 候选交易单元名单提交分管领导审批

公司分管领导对相关部门提交的《新增交易单元申请审核表》及其对券商综合评估的结果进行审核，并签署审批意见。

(4) 协议签署及通知托管人

基金管理人与被选择的券商签订《证券交易单元租用协议》，并通知基金托管人。

3、报告期内基金租用券商交易单元的变更情况：

无。

10.7.2 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
银河证券	5,556,824.98	93.73%	-	-	-	-
广发证券	48,086.20	0.81%	-	-	-	-
招商证券	278,124.30	4.69%	-	-	-	-
中信建投	45,440.80	0.77%	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-

10.8 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	关于旗下部分基金增加济安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	2017-01-11

		司网站	
2	关于旗下部分基金增加泰诚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	2017-01-18
3	关于旗下部分基金增加北京肯特瑞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	2017-02-08
4	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	2017-02-13
5	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“武钢股份”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	2017-02-14
6	关于旗下部分基金增加海峡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	2017-02-15
7	关于旗下部分基金增加朝阳永续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	2017-02-22
8	华安基金关于参加平安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	2017-02-22
9	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“王府井”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	2017-02-24
10	关于旗下部分基金增加华阳众惠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	2017-03-02
11	关于旗下部分基金增加华夏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	2017-03-21
12	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	2017-03-28
13	关于华安基金管理有限公司旗下基金参加广发证券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	2017-03-30
14	关于旗下部分基金参加中国工商银行股份有限公司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	2017-03-30
15	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加通华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	2017-04-06
16	华安基金关于参加华宝证券优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时	2017-04-12

		报》、《中国证券报》和公司网站	
17	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	2017-04-22
18	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“山东黄金”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	2017-04-22
19	关于“微钱宝”快速取现服务升级的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-04-25
20	华安基金关于《深圳证券交易所分级基金业务管理指引》实施的风险提示性公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-04-25
21	华安基金关于《深圳证券交易所分级基金业务管理指引》实施的风险提示性公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-04-26
22	华安基金关于《深圳证券交易所分级基金业务管理指引》实施的风险提示性公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-04-27
23	华安基金关于《深圳证券交易所分级基金业务管理指引》实施的风险提示性公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-04-28
24	华安基金关于《深圳证券交易所分级基金业务管理指引》实施的风险提示性公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-04-29
25	华安基金关于《深圳证券交易所分级基金业务管理指引》实施的风险提示性公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-05-03
26	华安基金关于《深圳证券交易所分级基金业务管理指引》实施的风险提示性公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-05-04
27	华安基金关于《深圳证券交易所分级基金业务管理指引》实施的风险提示性公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-05-06
28	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	2017-05-10
29	关于旗下部分基金增加武汉伯嘉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	2017-05-17
30	关于旗下部分基金增加中民财富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	2017-06-07

31	华安基金关于参加上海农商行优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-06-07
32	关于旗下部分基金增加科地瑞富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	2017-06-12
33	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	2017-06-27
34	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	2017-06-30

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。

11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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	20170101-20170630	674,762,483.13	0.00	0.00	674,762,483.13	20.79%
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。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

12 备查文件目录

12.1 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；

12.2 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>。

12.3 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
二〇一七年八月二十五日