

# 华安深证 300 指数证券投资基金 (LOF)

## 2017 年年度报告摘要

2017 年 12 月 31 日

基金管理人：华安基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一八年三月二十七日

## §1 重要提示

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 3 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	华安深证 300 指数 (LOF)
场内简称	华安 S300
基金主代码	160415
交易代码	160415
基金运作方式	上市契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 9 月 2 日
基金管理人	华安基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	562,710,310.90 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2011 年 10 月 18 日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过被动的指数化投资管理, 紧密跟踪标的指数, 追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金为被动式股票指数基金, 采用完全复制标的指数的方法跟踪标的指数, 即按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合, 并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。
业绩比较基准	95%×深证 300 价格指数收益率+5%×商业银行税后活期存款基准利率
风险收益特征	本基金为股票型基金, 属于较高风险、较高预期收益的基金品种, 其风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。

### 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	中国银行股份有限公司
信息披露	姓名	钱鲲	王永民

负责人	联系电话	021-38969999	010-66594896
	电子邮箱	qiankun@huaan.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		4008850099	95566
传真		021-68863414	010-66594942

## 2.4 信息披露方式

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

## §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2017 年	2016 年	2015 年
本期已实现收益	14,376,459.91	-533,420.57	18,885,296.39
本期利润	39,226,290.13	-6,560,827.81	13,332,422.91
加权平均基金份额本期利润	0.1123	-0.2765	0.4498
本期基金份额净值增长率	10.15%	-18.71%	23.84%
3.1.2 期末数据和指标	2017 年末	2016 年末	2015 年末
期末可供分配基金份额利润	0.0462	0.1953	0.4698
期末基金资产净值	588,689,726.49	26,584,237.94	35,393,103.49
期末基金份额净值	1.046	1.195	1.470

注：1、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。

2、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，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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）。

4、合同生效日当年的主要会计数据和财务指标按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.77%	1.00%	1.47%	0.97%	-0.70%	0.03%
过去六个月	4.22%	0.87%	6.46%	0.86%	-2.24%	0.01%
过去一年	10.15%	0.82%	13.14%	0.82%	-2.99%	0.00%
过去三年	10.90%	1.87%	20.64%	1.80%	-9.74%	0.07%
过去五年	52.18%	1.65%	63.21%	1.59%	-11.03%	0.06%
自基金合同生效起至今	31.63%	1.59%	28.97%	1.55%	2.66%	0.04%

#### 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

华安深证 300 指数证券投资基金 (LOF)

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

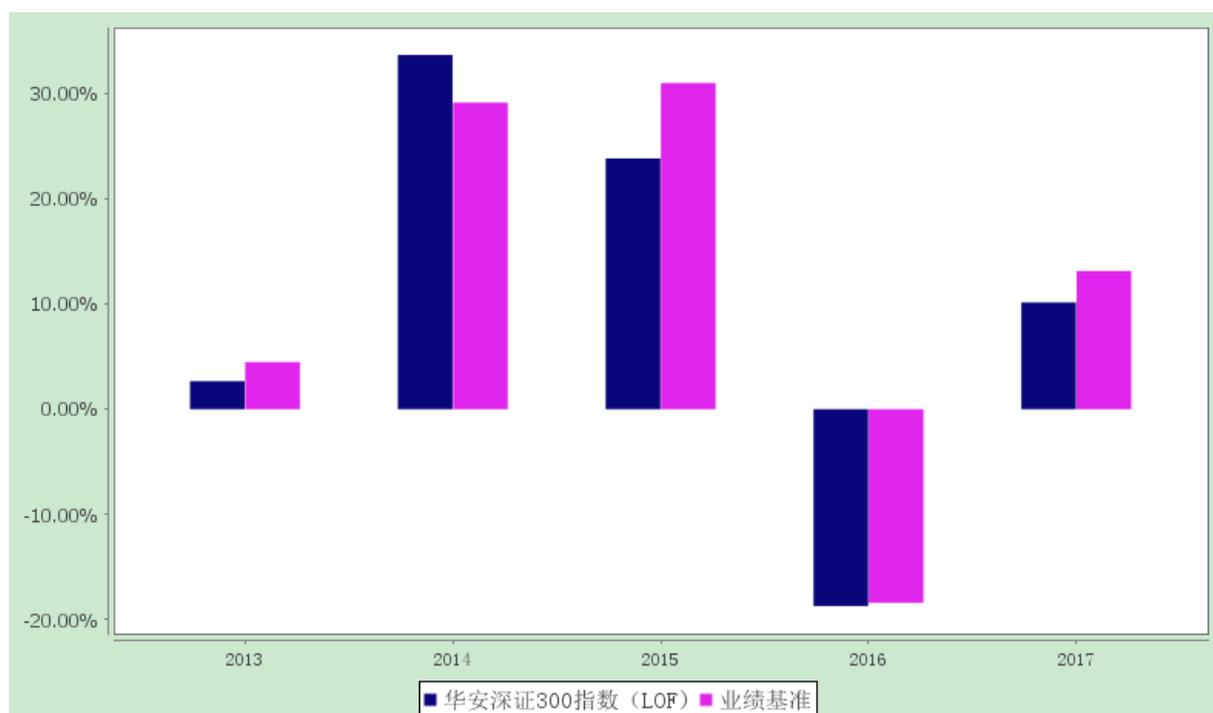
(2011 年 9 月 2 日至 2017 年 12 月 31 日)



#### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华安深证 300 指数证券投资基金 (LOF)

过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金基金合同生效日为 2011 年 9 月 2 日,合同生效日当年的净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2017 年	2.600	985,241,649.45	798,007.25	986,039,656.70	-
合计	2.600	985,241,649.45	798,007.25	986,039,656.70	-

## §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。目前的股东为国泰君安投资管理股份有限公司、上海国际信托有限公司、上海工业投资（集团）有限公司、上海锦江国际投资管理有限公司和国泰君安创新投资有限公司。公司在北京、上海、沈阳、成都、

广州等地设有分公司, 在香港和上海设有子公司—华安 (香港) 资产管理有限公司、华安未来资产管理有限公司。截至 2017 年 12 月 31 日, 公司旗下共管理华安创新混合、华安 MSCI 中国 A、华安现金富利货币、华安稳定收益债券、华安黄金易 ETF、华安沪港深外延增长混合、华安全球美元收益债券等 98 只开放式基金, 管理资产规模达到 1851.32 亿元人民币。

#### 4.1.2 基金经理 (或基金经理小组) 及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 (助理) 期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
许之彦	本基金的基金经理, 指数与量化投资事业总部高级总监	2011-09-02	-	14 年	理学博士, 14 年证券、基金从业经验, 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, 2008 年 4 月至 2012 年 12 月担任华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金的基金经理, 2009 年 9 月起同时担任上证 180 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。2010 年 11 月至 2012 年 12 月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。2011 年 9 月起同时担任本基金的基金经理。2013 年 6 月起担任指数投资部高级总监。2013 年 7 月起同时担任华安易富黄金交易型开放式证券投资基金的基金经理。2013 年 8 月起同时担任华安易富黄金交易型开放式证券投资基金联接基金的基金经理。2014 年 11 月至 2015 年 12 月担任华安中证高分红指数增强型证券投资基金的基金经理。2015 年 6 月起同时担任华安中证全指证券公司指数分级证券投资基金、华安中证银行指数分级证券投资基金的基金经理。2015 年 7 月起担任华安创业板 50 指数分级证券投资基金的基金经

					理。2016 年 6 月起担任华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2017 年 12 月起，同时担任华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金、华安沪深 300 量化增强型指数证券投资基金的基金经理。
孙晨进	本基金的基金经理	2015-03-20	-	7 年	硕士研究生，7 年基金行业从业经验，具有基金从业资格证书。2010 年应届毕业生进入华安基金，先后担任指数投资部数量分析师、投资经理、基金经理助理。2015 年 3 月起担任本基金的基金经理。2015 年 3 月至 2015 年 12 月，同时担任华安中证高分红指数增强型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。2017 年 1 月起，同时担任华安新安平灵活配置混合型证券投资基金、华安新泰利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017 年 12 月起，同时担任华安沪深 300 量化增强型指数证券投资基金的基金经理。

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 1 次,未出现异常交易。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾 2017 年,从宏观经济增长的角度来看,全球主要经济体加速复苏。美国、欧元区、日本等发达经济体均表现强劲。在全球经济复苏明显加快的大背景下,全球贸易也出现了强劲的反弹,这为 2017 年贸易增长拉动中国经济增长提供了支撑,强增长、低利率促使 2017 年全球股市大牛。2017 年 MSCI 全球指数上涨 21%,为 2009 年以来的最佳表现,港股上涨 37%,A 股沪深 300 指数上涨 21%。同时,大宗商品也延续了 2016 年的牛市步伐,标普高盛商品总指数上涨 5.8%,其中工业金属成为最重要的推升力量,此外原油和贵金属上涨也是重要推动力量之一。A 股市场中以有色金属、钢铁、煤炭为代表的周期行业在宏观政策的共同影响下走势强劲。投资管理上,本基金采取紧密跟踪标的指数,进而控制基金的跟踪误差和跟踪偏离度。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2017 年 12 月 31 日,本基金份额净值为 1.046 元,本报告期份额净值增长率为 10.15%,同期业绩比较基准增长率为 13.14%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2018 年宏观经济环境,拉动经济增长的三驾马车大概率仍会与 17 年持平,固定资产投资增速或小幅下降,消费具有较为稳定的基础或与今年基本持平,进出口或略有回落。从宏观政策层面看,去杠杆、去库存、去产能或将取得较大进展,金融杠杆率有望触顶下降,房地产库存逐步下降,钢铁、煤炭产能逐渐出清,产能利用率提升。中央经济工作会议也定调经济稳中求进。因此,我们预计 2018 年 A 股市场将在经济稳中求进的大背景下,实现小幅震荡中上涨,时可能伴随一定的风格切换的可能性。投资热点的主题预计更多的出现在消费升级和产业结构优化等方面。

作为华安深 300LOF 基金的管理人,我们继续坚持积极将基金回报与指数相拟合的原则,降低跟踪偏离和跟踪误差,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

本报告期内实施了 2017 年度第一次分红，分红方案为：2.600 元/10 份，权益登记日及除息日（场外）：2017 年 8 月 28 日；除息日（场内）：2017 年 8 月 29 日；现金红利发放日（场外）：2017 年 8 月 30 日；现金红利发放日（场内）：2017 年 8 月 31 日。

#### 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

本基金报告期内基金持有人数不低于 200 人；基金资产净值有连续超过 20 个工作日低于 5000 万元的情形，但截至 2017 年 12 月 31 日，基金资产净值已经超过 5000 万元。

### §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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对华安深证 300 指数证券投资基金(LOF)（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

## 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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

## 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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## §6 审计报告

本报告期的基金财务会计报告经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计，注册会计师单峰魏佳亮签字出具了普华永道中天审字(2018)第 20790 号标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：华安深证 300 指数证券投资基金 (LOF)

报告截止日：2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：	-	-
银行存款	35,133,761.51	1,768,143.34
结算备付金	454.62	-
存出保证金	361,922.65	1,544.74
交易性金融资产	555,417,347.73	25,170,108.71
其中：股票投资	554,185,947.73	25,166,477.99
基金投资	-	-

债券投资	1,231,400.00	3,630.72
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	7,200.84	359.73
应收股利	-	-
应收申购款	4,184.46	1,628.39
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
<b>资产总计</b>	<b>590,924,871.81</b>	<b>26,941,784.91</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
	<b>2017 年 12 月 31 日</b>	<b>2016 年 12 月 31 日</b>
负 债:	-	-
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	1,355,722.20	51,954.27
应付赎回款	44,379.40	2.49
应付管理人报酬	275,563.69	11,621.05
应付托管费	55,112.72	2,324.22
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	276,200.06	5,644.92
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-

其他负债	228,167.25	286,000.02
<b>负债合计</b>	<b>2,235,145.32</b>	<b>357,546.97</b>
<b>所有者权益：</b>	<b>-</b>	<b>-</b>
实收基金	562,710,310.90	22,240,279.75
未分配利润	25,979,415.59	4,343,958.19
<b>所有者权益合计</b>	<b>588,689,726.49</b>	<b>26,584,237.94</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>	<b>590,924,871.81</b>	<b>26,941,784.91</b>

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.046 元，基金份额总额 562,710,310.90 份。

## 7.2 利润表

会计主体：华安深证 300 指数证券投资基金 (LOF)

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>	<b>44,226,366.82</b>	<b>-5,829,503.42</b>
1.利息收入	1,070,320.87	13,336.37
其中：存款利息收入	1,070,097.17	13,319.37
债券利息收入	223.70	17.00
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）	14,225,740.22	174,610.66
其中：股票投资收益	13,681,570.21	-167,573.60
基金投资收益	-	-
债券投资收益	24,974.55	1,332.01
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-

股利收益	519,195.46	340,852.25
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	24,849,830.22	-6,027,407.24
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	4,080,475.51	9,956.79
<b>减：二、费用</b>	<b>5,000,076.69</b>	<b>731,324.39</b>
1. 管理人报酬	1,915,281.07	144,685.22
2. 托管费	383,056.13	28,937.00
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	2,239,632.74	41,509.68
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	462,106.75	516,192.49
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>39,226,290.13</b>	<b>-6,560,827.81</b>
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>39,226,290.13</b>	<b>-6,560,827.81</b>

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安深证 300 指数证券投资基金 (LOF)

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	22,240,279.75	4,343,958.19	26,584,237.94
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	39,226,290.13	39,226,290.13
三、本期基金份额交易	540,470,031.15	968,448,823.97	1,508,918,855.12

产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	3,775,604,234.40	1,003,462,936.94	4,779,067,171.34
2.基金赎回款	-3,235,134,203.25	-35,014,112.97	-3,270,148,316.22
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)	-	-986,039,656.70	-986,039,656.70
五、期末所有者权益(基金净值)	562,710,310.90	25,979,415.59	588,689,726.49
项目	上年度可比期间		
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	24,080,120.41	11,312,983.08	35,393,103.49
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-6,560,827.81	-6,560,827.81
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)	-1,839,840.66	-408,197.08	-2,248,037.74
其中: 1.基金申购款	6,414,007.89	1,544,828.17	7,958,836.06
2.基金赎回款	-8,253,848.55	-1,953,025.25	-10,206,873.80
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	22,240,279.75	4,343,958.19	26,584,237.94

金净值)			
------	--	--	--

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码 (序号) 从 7.1 至 7.4, 财务报表由下列负责人签署:

基金管理人负责人: 朱学华, 主管会计工作负责人: 赵敏, 会计机构负责人: 陈林

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

华安深证 300 指数证券投资基金(LOF)(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2011]884 号《关于核准华安深证 300 指数证券投资基金(LOF)募集的批复》核准, 由华安基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安深证 300 指数证券投资基金(LOF)基金合同》负责公开募集。本基金为上市契约型开放式, 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 607,830,415.01 元, 业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2011)第 349 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案, 《华安深证 300 指数证券投资基金(LOF)基金合同》于 2011 年 9 月 2 日正式生效, 基金合同生效日的基金份额总额为 608,040,554.70 份基金份额, 其中认购资金利息折合 210,139.69 份基金份额。本基金的基金管理人为华安基金管理有限公司, 基金托管人为中国银行股份有限公司。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上字[2011]310 号文审核同意, 本基金 146,584,084.00 份基金份额于 2011 年 10 月 18 日在深交所挂牌交易。上市的基金份额登记在证券登记结算系统, 可选择按市价流通或按基金份额净值申购或赎回; 未上市的基金份额登记在注册登记系统, 按基金份额净值申购或赎回。通过跨系统转登记可实现基金份额在两个系统之间的转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安深证 300 指数证券投资基金(LOF)基金合同》的有关规定, 本基金的本基金投资范围主要为标的指数深证 300 价格指数成份股及其备选成份股, 少量投资于其他股票(非标的指数成份股及其备选成份股)、新股(首次发行或增发等)、债券、现金等其他金融工具。标的指数成份股及其备选成份股的投资比例不低于基金资产的 90%; 其他股票、新股、债券、现金等其他金融工具的投资比例为基金资产的 5%-10%, 其中现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%, 权证投资占基金资产净值的比例不高于 3%。本基金的业绩比较基准为:  $95\% \times \text{深证 300 价格指数收益率} + 5\% \times \text{商业银行税后活期存款基准利率}$ 。

本财务报表由本基金的基金管理人华安基金管理有限公司于 2018 年 3 月 22 日批准报出。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华安深证 300 指数证券投资基金(LOF)基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2017 年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税

[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

#### 7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
华安基金管理有限公司(“华安基金公司”)	基金管理人、基金销售机构
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	基金托管人、基金代销机构
上海国际信托有限公司	基金管理人的股东
国泰君安创新投资有限公司	基金管理人的股东
上海工业投资(集团)有限公司	基金管理人的股东
上海锦江国际投资管理有限公司	基金管理人的股东
国泰君安投资管理股份有限公司	基金管理人的股东
华安资产管理(香港)有限公司	基金管理人的全资子公司
华安未来资产管理(上海)有限公司	基金管理人的全资子公司

注：1. 下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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

**7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易**

**7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易**

**7.4.8.1.1 股票交易**

无。

**7.4.8.1.2 权证交易**

无。

**7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金**

无。

**7.4.8.2 关联方报酬**

**7.4.8.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12 月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12 月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,915,281.07	144,685.22
其中：支付销售机构的客户维护费	47,249.24	54,162.12

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 0.50% 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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.50\% / \text{当年天数}。$$

**7.4.8.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12 月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12 月31日
当期发生的基金应支付的托管费	383,056.13	28,937.00

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.10% / 当年天数。

**7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

无。

**7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况**

**7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

无。

**7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况**

无。

**7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2017年1月1日至2017年12月31日		2016年1月1日至2016年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	35,133,761.51	876,219.23	1,768,143.34	13,091.20

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

**7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

无。

**7.4.8.7 其他关联交易事项的说明**

无。

**7.4.9 期末（2017 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券**

**7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元

7.4.9.1.1 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类	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

				型						
12802 4	宁行 转债	2017-1 2-05	2018-0 1-12	新债 未上 市	100.00	100.00	5,862. 00	586,20 0.00	586,20 0.00	-
12300 6	东财 转债	2017-1 2-22	2018-0 1-29	新债 未上 市	100.00	100.00	3,282. 00	328,20 0.00	328,20 0.00	-
12300 3	蓝思 转债	2017-1 2-08	2018-0 1-17	新债 未上 市	100.00	100.00	1,195. 00	119,50 0.00	119,50 0.00	-
12300 4	铁汉 转债	2017-1 2-20	2018-0 1-26	新债 未上 市	100.00	100.00	678.00	67,800 .00	67,800 .00	-
12300 5	万信 转债	2017-1 2-21	2018-0 1-30	新债 未上 市	100.00	100.00	652.00	65,200 .00	65,200 .00	-
12802 8	赣锋 转债	2017-1 2-21	2018-0 1-19	新债 未上 市	100.00	100.00	645.00	64,500 .00	64,500 .00	-

注：基金可作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

#### 7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票 代码	股票 名称	停牌 日期	停牌 原因	期末估 值单价	复牌 日期	复牌 开 盘单 价	数量 (单位：股)	期末 成本总额	期末 估值总额	备注
00000 6	深振业 A	2017-09 -11	重大资 产重组	9.85	2018-0 3-08	8.87	154,390.00	1,292,462.32	1,520,741.50	-
00003 1	中粮地 产	2017-07 -24	重大资 产重组	8.00	-	-	6,030.00	39,778.04	48,240.00	-
00015 6	华数传 媒	2017-12 -26	重大资 产重组	11.40	-	-	53,066.00	820,002.04	604,952.40	-
00054 0	中天金 融	2017-08 -21	重大资 产重组	7.35	-	-	28,873.00	218,464.20	212,216.55	-
00054 7	航天发 展	2017-10 -30	重大资 产重组	10.83	-	-	156,100.00	1,843,189.51	1,690,563.00	-
00056	供销大	2017-11	重大资	4.78	-	-	75,200.00	488,196.44	359,456.00	-

4	集	-28	产重组							
000566	海南海药	2017-11-22	重大资产重组	12.89	-	-	109,294.00	1,421,892.63	1,408,799.66	
000592	平潭发展	2017-08-09	重大资产重组	5.75	2018-01-29	5.70	8,348.00	71,555.94	48,001.00	
000693	*ST 华泽	2016-03-01	重大资产重组	12.50	-	-	1,360.00	29,419.08	17,000.00	
000806	银河生物	2017-07-18	重大资产重组	10.76	2018-01-18	10.01	3,400.00	53,099.00	36,584.00	
000930	中粮生化	2017-10-24	重大资产重组	13.34	-	-	125,800.00	1,646,899.23	1,678,172.00	
000979	中弘股份	2017-09-07	重大资产重组	1.94	2018-02-14	1.75	709,314.00	1,390,757.59	1,376,069.16	
002004	华邦健康	2017-12-14	重大资产重组	6.73	2018-03-14	7.30	149,200.00	1,192,518.72	1,004,116.00	
002075	沙钢股份	2016-09-17	重大资产重组	16.12	-	-	4,700.00	70,137.00	75,764.00	
002168	深圳惠程	2017-12-19	重大资产重组	13.76	-	-	4,501.00	60,006.46	61,933.76	
002366	台海核电	2017-12-06	重大资产重组	26.45	-	-	67,800.00	1,802,549.24	1,793,310.00	
002470	金正大	2017-10-25	重大资产重组	9.15	2018-02-09	8.24	207,912.00	1,679,966.50	1,902,394.80	
002739	万达电影	2017-07-04	重大资产重组	52.04	-	-	2,382.00	216,079.95	123,959.28	
300010	立思辰	2017-11-17	重大资产重组	11.17	2018-02-22	10.05	69,300.00	888,142.93	774,081.00	
300090	盛运环保	2017-12-01	重大资产重组	9.24	-	-	112,000.00	1,086,536.80	1,034,880.00	
300104	乐视网	2017-04-17	重大资产重组	3.91	2018-01-24	13.80	12,490.00	334,685.60	48,835.90	
300134	大富科技	2017-12-18	重大资产重组	16.45	2018-03-19	14.81	36,671.00	735,180.47	603,237.95	
300156	神雾环保	2017-07-17	重大资产重组	24.16	2018-01-18	19.57	3,100.00	78,328.00	74,896.00	
300159	新研股份	2017-11-23	重大资产重组	10.40	-	-	116,900.00	1,443,215.22	1,215,760.00	
300292	吴通控股	2017-12-04	重大资产重组	5.67	2018-03-05	5.72	95,900.00	574,811.60	543,753.00	
300383	光环新网	2017-11-07	重大资产重组	12.12	2018-03-19	14.51	131,200.00	1,742,245.80	1,590,144.00	

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

### 7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

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

#### 7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

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

### 7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

#### (1) 公允价值

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次, 由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定:

第一层次: 相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次: 除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次: 相关资产或负债的不可观察输入值。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

###### (i) 各层次金融工具公允价值

于 2017 年 12 月 31 日, 本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 534,338,086.77 元, 属于第二层次的余额为 21,030,425.06 元, 属于第三层次的余额为 48,835.90 元(2016 年 12 月 31 日: 第一层次 23,370,018.70 元, 第二层次 1,800,090.01 元, 无第三层次)。

###### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券, 若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况, 本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次; 并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度, 确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

###### (iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

于本期末, 本基金持有公允价值归属于第三层次的金融工具金额为 48,835.90 元(2016 年 12 月 31 日: 无)。本基金本期净转入第三层次的金额为 125,711.85 元, 计入损益的第三层次金融工具公允价值变动为-76,875.95 元, 涉及乐视网(2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日止期间: 净转入第三层次零元, 计入损益的第三层次金融工具公允价值变动零元)。

上述第三层次资产变动如下:

交易性金融资产

权益工具投资

2017 年 1 月 1 日 -

购买 -

出售 -

转入第三层次 125,711.85

转出第三层次 -

当期利得或损失总额 -76,875.95

计入损益的利得或损失 -76,875.95

2017 年 12 月 31 日 48,835.90

2017 年 12 月 31 日仍持有的资产计入

2017 年度损益的未实现利得或损失的变动

——公允价值变动损益 -156,999.30

使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的相关信息如下:

2017 年 12 月 31 日公允价值	估值技术			不可观察输入值 与公允价值之间的关系
	名称	范围/加权平均值		
交易性金融资产—				
乐视网	48,835.90	可比公司法	市销率 1.90	正相关

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2017 年 12 月 31 日,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2016 年 12 月 31 日:同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债,其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 增值税

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。

根据财政部、国家税务总局于 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

此外，财政部、国家税务总局于 2017 年 12 月 25 日颁布的财税[2017]90 号《关于租入固定资产进行税额抵扣等增值税政策的通知》对资管产品管理人自 2018 年 1 月 1 日起运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务的销售额确定做出规定。

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

(3) 除公允价值和增值税外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	554,185,947.73	93.78
	其中：股票	554,185,947.73	93.78
2	固定收益投资	1,231,400.00	0.21
	其中：债券	1,231,400.00	0.21
	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	35,134,216.13	5.95
7	其他各项资产	373,307.95	0.06
8	合计	590,924,871.81	100.00

## 8.2 报告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	13,835,145.58	2.35
B	采矿业	4,399,489.46	0.75
C	制造业	334,106,049.41	56.75
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,938,958.11	0.67
E	建筑业	10,015,104.43	1.70
F	批发和零售业	9,630,307.30	1.64
G	交通运输、仓储和邮政业	1,801,762.60	0.31
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	47,054,940.80	7.99
J	金融业	41,333,847.55	7.02
K	房地产业	27,563,790.31	4.68
L	租赁和商务服务业	9,608,370.43	1.63
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	8,454,128.14	1.44
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	4,774,285.20	0.81

R	文化、体育和娱乐业	8,146,221.15	1.38
S	综合	1,355,899.74	0.23
	合计	526,018,300.21	89.35

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	-	-
B	采矿业	17,000.00	0.00
C	制造业	19,833,632.52	3.37
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	511,173.00	0.09
E	建筑业	341,968.00	0.06
F	批发和零售业	2,429,302.00	0.41
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	229,712.00	0.04
K	房地产业	1,827,048.00	0.31
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	2,977,812.00	0.51
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	28,167,647.52	4.78

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

#### 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前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	000333	美的集团	440,400	24,411,372.00	4.15
2	000651	格力电器	465,224	20,330,288.80	3.45
3	000858	五粮液	179,274	14,320,407.12	2.43
4	000725	京东方 A	2,455,789	14,219,018.31	2.42
5	002415	海康威视	322,257	12,568,023.00	2.13
6	000002	万科 A	393,472	12,221,240.32	2.08
7	000001	平安银行	817,516	10,872,962.80	1.85
8	300498	温氏股份	365,621	8,738,341.90	1.48
9	000063	中兴通讯	233,751	8,499,186.36	1.44
10	002304	洋河股份	54,400	6,256,000.00	1.06

#### 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前五名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	300142	沃森生物	115,400	2,106,050.00	0.36
2	300274	阳光电源	93,400	1,753,118.00	0.30
3	000830	鲁西化工	104,500	1,663,640.00	0.28
4	300266	兴源环境	57,900	1,563,300.00	0.27
5	002050	三花智控	82,378	1,510,812.52	0.26

### 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	000651	格力电器	38,833,412.49	146.08
2	000333	美的集团	37,879,674.34	142.49
3	000858	五粮液	21,279,463.80	80.05
4	002415	海康威视	21,190,342.64	79.71
5	000725	京东方 A	20,328,687.00	76.47

6	000001	平安银行	20,135,016.21	75.74
7	000002	万 科 A	19,591,265.60	73.70
8	300498	温氏股份	17,877,436.76	67.25
9	002230	科大讯飞	11,864,369.00	44.63
10	000063	中兴通讯	11,726,457.30	44.11
11	000776	广发证券	11,705,918.35	44.03
12	002304	洋河股份	10,622,594.29	39.96
13	300059	东方财富	9,083,374.25	34.17
14	002466	天齐锂业	9,018,081.00	33.92
15	002241	歌尔股份	8,782,119.96	33.04
16	002024	苏宁易购	8,408,301.38	31.63
17	000166	申万宏源	8,253,308.87	31.05
18	000538	云南白药	8,229,435.46	30.96
19	002236	大华股份	8,194,581.28	30.82
20	002456	欧菲科技	8,091,347.88	30.44
21	000568	泸州老窖	7,959,249.54	29.94
22	001979	招商蛇口	7,856,519.05	29.55
23	002142	宁波银行	7,689,648.09	28.93
24	002460	赣锋锂业	7,583,953.00	28.53
25	000783	长江证券	7,384,638.00	27.78
26	002027	分众传媒	7,279,582.00	27.38
27	002594	比亚迪	7,224,384.37	27.18
28	000338	潍柴动力	6,860,044.82	25.80
29	000423	东阿阿胶	6,779,923.76	25.50
30	002008	大族激光	6,763,561.12	25.44
31	000413	东旭光电	6,714,087.00	25.26
32	002475	立讯精密	6,695,917.98	25.19
33	002673	西部证券	6,506,149.07	24.47
34	300136	信维通信	6,477,176.69	24.36
35	300072	三聚环保	6,153,211.00	23.15
36	000100	TCL 集团	6,123,053.00	23.03
37	000625	长安汽车	6,089,959.40	22.91
38	000069	华侨城 A	6,033,537.99	22.70
39	300070	碧水源	5,982,324.67	22.50
40	000839	中信国安	5,854,496.00	22.02
41	300124	汇川技术	5,801,580.73	21.82
42	000728	国元证券	5,716,034.99	21.50
43	002450	康得新	5,665,780.00	21.31
44	300024	机器人	5,576,603.60	20.98
45	002736	国信证券	5,389,547.24	20.27
46	002202	金风科技	5,308,033.92	19.97
47	000768	中航飞机	5,261,741.00	19.79
48	002797	第一创业	4,923,384.40	18.52
49	002310	东方园林	4,886,429.06	18.38

50	300408	三环集团	4,677,922.80	17.60
51	000895	双汇发展	4,617,276.50	17.37
52	000157	中联重科	4,587,040.88	17.25
53	002085	万丰奥威	4,564,163.77	17.17
54	002572	索菲亚	4,475,354.10	16.83
55	000709	河钢股份	4,385,143.00	16.50
56	000963	华东医药	4,381,297.00	16.48
57	002405	四维图新	4,350,428.00	16.36
58	002340	格林美	4,291,291.04	16.14
59	000050	深天马 A	4,241,168.00	15.95
60	300003	乐普医疗	4,239,884.78	15.95
61	000793	华闻传媒	4,217,871.62	15.87
62	000623	吉林敖东	4,206,157.77	15.82
63	000661	长春高新	4,188,546.58	15.76
64	000060	中金岭南	4,167,260.00	15.68
65	002500	山西证券	4,144,350.00	15.59
66	000630	铜陵有色	4,127,028.40	15.52
67	002092	中泰化学	4,119,402.51	15.50
68	300088	长信科技	4,014,441.00	15.10
69	002271	东方雨虹	3,970,783.00	14.94
70	002508	老板电器	3,968,163.30	14.93
71	002044	美年健康	3,957,127.00	14.89
72	002146	荣盛发展	3,891,592.00	14.64
73	000826	启迪桑德	3,803,656.54	14.31
74	002465	海格通信	3,729,095.00	14.03
75	300115	长盈精密	3,723,837.99	14.01
76	002252	上海莱士	3,713,561.00	13.97
77	000998	隆平高科	3,708,114.06	13.95
78	002065	东华软件	3,707,643.42	13.95
79	000750	国海证券	3,693,119.00	13.89
80	300315	掌趣科技	3,625,927.00	13.64
81	300017	网宿科技	3,567,429.09	13.42
82	000425	徐工机械	3,552,982.00	13.36
83	000009	中国宝安	3,497,478.70	13.16
84	002176	江特电机	3,497,373.69	13.16
85	002558	巨人网络	3,489,505.00	13.13
86	000983	西山煤电	3,473,378.00	13.07
87	000066	中国长城	3,402,978.56	12.80
88	000997	新大陆	3,375,168.00	12.70
89	002195	二三四五	3,372,796.00	12.69
90	000686	东北证券	3,323,506.00	12.50
91	000807	云铝股份	3,302,314.00	12.42
92	300296	利亚德	3,280,896.98	12.34
93	000876	新希望	3,268,982.92	12.30

94	000792	盐湖股份	3,264,450.50	12.28
95	300433	蓝思科技	3,233,725.60	12.16
96	000039	中集集团	3,229,905.00	12.15
97	002007	华兰生物	3,212,710.00	12.09
98	002081	金螳螂	3,193,874.50	12.01
99	000778	新兴铸管	3,152,065.00	11.86
100	000559	万向钱潮	3,126,289.11	11.76
101	300027	华谊兄弟	3,114,111.03	11.71
102	000402	金融街	3,094,178.00	11.64
103	002074	国轩高科	3,086,460.00	11.61
104	000970	中科三环	3,077,335.96	11.58
105	000046	泛海控股	3,061,498.46	11.52
106	000488	晨鸣纸业	3,034,218.76	11.41
107	000977	浪潮信息	3,016,957.40	11.35
108	000786	北新建材	3,015,332.00	11.34
109	000581	威孚高科	3,012,079.00	11.33
110	000008	神州高铁	2,969,119.00	11.17
111	000503	海虹控股	2,968,357.00	11.17
112	002366	台海核电	2,873,976.00	10.81
113	000887	中鼎股份	2,840,781.00	10.69
114	002422	科伦药业	2,830,625.16	10.65
115	000690	宝新能源	2,816,638.00	10.60
116	002385	大北农	2,812,735.86	10.58
117	002179	中航光电	2,786,609.54	10.48
118	002280	联络互动	2,768,543.25	10.41
119	300182	捷成股份	2,765,449.00	10.40
120	000656	金科股份	2,719,986.00	10.23
121	002217	合力泰	2,713,423.54	10.21
122	002273	水晶光电	2,702,145.00	10.16
123	002407	多氟多	2,689,336.00	10.12
124	300418	昆仑万维	2,669,684.00	10.04
125	300144	宋城演艺	2,660,624.00	10.01
126	002714	牧原股份	2,647,882.35	9.96
127	002311	海大集团	2,641,796.36	9.94
128	000878	云南铜业	2,635,009.00	9.91
129	000917	电广传媒	2,627,840.08	9.88
130	002573	清新环境	2,620,670.00	9.86
131	002019	亿帆医药	2,593,816.00	9.76
132	000415	渤海金控	2,590,452.50	9.74
133	300383	光环新网	2,566,164.00	9.65
134	002185	华天科技	2,551,484.24	9.60
135	300015	爱尔眼科	2,542,114.25	9.56
136	000825	太钢不锈	2,537,790.00	9.55
137	002223	鱼跃医疗	2,501,156.78	9.41

138	002470	金正大	2,498,037.00	9.40
139	300033	同花顺	2,452,775.00	9.23
140	002583	海能达	2,443,776.00	9.19
141	000930	中粮生化	2,423,399.00	9.12
142	000961	中南建设	2,409,630.35	9.06
143	000547	航天发展	2,404,429.00	9.04
144	000960	锡业股份	2,403,045.90	9.04
145	300166	东方国信	2,383,608.74	8.97
146	002410	广联达	2,375,918.00	8.94
147	300055	万邦达	2,372,668.00	8.93
148	002129	中环股份	2,371,432.00	8.92
149	300159	新研股份	2,367,910.00	8.91
150	000999	华润三九	2,359,543.00	8.88
151	002294	信立泰	2,329,615.00	8.76
152	002108	沧州明珠	2,325,499.00	8.75
153	300168	万达信息	2,312,848.00	8.70
154	002439	启明星辰	2,311,469.00	8.69
155	000400	许继电气	2,303,634.20	8.67
156	002001	新 和 成	2,301,906.00	8.66
157	000566	海南海药	2,294,095.08	8.63
158	002038	双鹭药业	2,290,409.00	8.62
159	300146	汤臣倍健	2,288,581.00	8.61
160	300058	蓝色光标	2,284,988.00	8.60
161	002138	顺络电子	2,280,780.00	8.58
162	000059	华锦股份	2,262,539.77	8.51
163	000598	兴蓉环境	2,246,700.00	8.45
164	000627	天茂集团	2,244,872.43	8.44
165	000988	华工科技	2,213,083.00	8.32
166	002049	紫光国芯	2,201,903.00	8.28
167	300014	亿纬锂能	2,201,069.00	8.28
168	002051	中工国际	2,166,642.00	8.15
169	000883	湖北能源	2,137,746.00	8.04
170	002013	中航机电	2,131,770.50	8.02
171	002004	华邦健康	2,111,098.00	7.94
172	000758	中色股份	2,107,782.09	7.93
173	002408	齐翔腾达	2,104,461.80	7.92
174	300142	沃森生物	2,102,476.00	7.91
175	002030	达安基因	2,096,206.10	7.89
176	002624	完美世界	2,079,683.74	7.82
177	000898	鞍钢股份	2,048,385.00	7.71
178	002601	龙鳞佰利	2,038,607.00	7.67
179	000028	国药一致	2,035,727.00	7.66
180	000697	炼石有色	2,027,448.11	7.63
181	002610	爱康科技	1,998,130.00	7.52

182	000671	阳光城	1,995,611.00	7.51
183	000078	海王生物	1,970,715.30	7.41
184	002665	首航节能	1,930,845.00	7.26
185	000712	锦龙股份	1,926,321.00	7.25
186	000738	航发控制	1,924,249.68	7.24
187	300113	顺网科技	1,916,250.00	7.21
188	002400	省广股份	1,916,047.60	7.21
189	300002	神州泰岳	1,907,658.00	7.18
190	002491	通鼎互联	1,903,090.93	7.16
191	002389	南洋科技	1,892,502.00	7.12
192	002343	慈文传媒	1,890,588.00	7.11
193	002131	利欧股份	1,852,065.00	6.97
194	002152	广电运通	1,851,722.98	6.97
195	000012	南玻 A	1,831,402.05	6.89
196	002444	巨星科技	1,822,792.00	6.86
197	000938	紫光股份	1,807,567.96	6.80
198	000800	一汽轿车	1,805,819.00	6.79
199	300253	卫宁健康	1,798,030.11	6.76
200	000732	泰禾集团	1,796,480.64	6.76
201	002292	奥飞娱乐	1,791,698.92	6.74
202	000729	燕京啤酒	1,791,332.92	6.74
203	000563	陕国投 A	1,782,881.96	6.71
204	300133	华策影视	1,779,361.00	6.69
205	000718	苏宁环球	1,778,540.95	6.69
206	002602	世纪华通	1,768,587.00	6.65
207	300367	东方网力	1,764,949.00	6.64
208	300274	阳光电源	1,763,732.35	6.63
209	000979	中弘股份	1,763,332.00	6.63
210	002431	棕榈股份	1,762,316.24	6.63
211	300244	迪安诊断	1,755,498.00	6.60
212	300197	铁汉生态	1,749,580.00	6.58
213	300251	光线传媒	1,747,712.00	6.57
214	002191	劲嘉股份	1,739,510.55	6.54
215	300090	盛运环保	1,739,429.00	6.54
216	300077	国民技术	1,731,551.80	6.51
217	000006	深振业 A	1,715,289.94	6.45
218	300207	欣旺达	1,702,284.00	6.40
219	000516	国际医学	1,700,989.98	6.40
220	002352	顺丰控股	1,691,261.85	6.36
221	002501	利源精制	1,680,868.17	6.32
222	300068	南都电源	1,667,561.00	6.27
223	002506	协鑫集成	1,661,323.00	6.25
224	002477	雏鹰农牧	1,657,476.82	6.23
225	000830	鲁西化工	1,631,496.01	6.14

226	002155	湖南黄金	1,630,300.48	6.13
227	002493	荣盛石化	1,618,551.98	6.09
228	000937	冀中能源	1,618,144.00	6.09
229	002183	怡亚通	1,615,849.00	6.08
230	000027	深圳能源	1,611,814.00	6.06
231	300266	兴源环境	1,602,847.72	6.03
232	002424	贵州百灵	1,601,724.00	6.03
233	002250	联化科技	1,601,196.00	6.02
234	002353	杰瑞股份	1,583,968.90	5.96
235	300199	翰宇药业	1,583,822.00	5.96
236	002002	鸿达兴业	1,583,341.43	5.96
237	002153	石基信息	1,559,064.00	5.86
238	002468	申通快递	1,537,651.00	5.78
239	000156	华数传媒	1,536,823.00	5.78
240	300026	红日药业	1,514,803.00	5.70
241	002050	三花智控	1,501,250.36	5.65
242	300001	特锐德	1,467,691.00	5.52
243	002276	万马股份	1,464,024.84	5.51
244	000901	航天科技	1,461,430.13	5.50
245	002411	必康股份	1,460,416.00	5.49
246	000685	中山公用	1,457,819.00	5.48
247	300355	蒙草生态	1,451,188.00	5.46
248	002368	太极股份	1,450,523.00	5.46
249	002018	华信国际	1,447,291.00	5.44
250	300496	中科创达	1,400,275.74	5.27
251	002489	浙江永强	1,376,759.24	5.18
252	002716	金贵银业	1,375,699.00	5.17
253	000829	天音控股	1,371,787.62	5.16
254	002709	天赐材料	1,371,246.00	5.16
255	002390	信邦制药	1,369,362.13	5.15
256	000762	西藏矿业	1,368,527.00	5.15
257	002643	万润股份	1,366,485.00	5.14
258	002657	中科金财	1,356,127.00	5.10
259	300020	银江股份	1,339,056.00	5.04
260	002268	卫士通	1,335,543.69	5.02
261	002640	跨境通	1,333,143.00	5.01
262	300073	当升科技	1,328,671.00	5.00
263	002522	浙江众成	1,317,267.38	4.96
264	300122	智飞生物	1,271,807.00	4.78
265	000687	华讯方舟	1,258,035.00	4.73
266	002326	永太科技	1,251,463.00	4.71
267	002426	胜利精密	1,211,542.50	4.56
268	000617	中油资本	1,179,101.00	4.44
269	300273	和佳股份	1,176,020.00	4.42

270	002701	奥瑞金	1,161,201.04	4.37
271	000933	神火股份	1,156,535.00	4.35
272	300010	立思辰	1,149,979.00	4.33
273	002437	誉衡药业	1,142,582.31	4.30
274	002078	太阳纸业	1,127,572.00	4.24
275	000519	中兵红箭	1,117,673.23	4.20
276	002384	东山精密	1,109,176.00	4.17
277	002497	雅化集团	1,105,976.00	4.16
278	002589	瑞康医药	1,091,284.70	4.11
279	000959	首钢股份	1,087,134.00	4.09
280	000717	韶钢松山	1,078,515.00	4.06
281	300450	先导智能	1,078,405.00	4.06
282	002285	世联行	1,077,002.00	4.05
283	002831	裕同科技	1,045,856.38	3.93
284	000062	深圳华强	1,007,487.00	3.79
285	000539	粤电力 A	1,006,360.00	3.79
286	300459	金科文化	991,604.00	3.73
287	002120	韵达股份	976,075.32	3.67
288	300085	银之杰	966,182.00	3.63
289	002010	传化智联	926,110.36	3.48
290	002563	森马服饰	918,819.00	3.46
291	002555	三七互娱	898,417.00	3.38
292	002329	皇氏集团	890,939.00	3.35
293	002642	荣之联	869,650.00	3.27
294	002299	圣农发展	866,214.00	3.26
295	000957	中通客车	865,598.00	3.26
296	002056	横店东磁	839,109.00	3.16
297	300134	大富科技	808,003.00	3.04
298	002631	德尔未来	767,174.00	2.89
299	000036	华联控股	759,603.33	2.86
300	300292	吴通控股	747,821.00	2.81
301	000723	美锦能源	700,382.00	2.63
302	000564	供销大集	692,922.32	2.61
303	000877	天山股份	634,740.00	2.39
304	002635	安洁科技	631,641.00	2.38
305	300474	景嘉微	580,069.00	2.18
306	300222	科大智能	551,474.00	2.07
307	300628	亿联网络	532,117.00	2.00

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	000333	美的集团	22,571,542.52	84.91
2	000651	格力电器	22,257,209.95	83.72
3	000725	京东方 A	13,594,892.19	51.14
4	000858	五 粮 液	13,295,231.52	50.01
5	002415	海康威视	12,479,110.01	46.94
6	000002	万 科 A	12,160,024.50	45.74
7	000001	平安银行	11,786,468.42	44.34
8	300498	温氏股份	10,421,361.16	39.20
9	000063	中兴通讯	7,758,075.10	29.18
10	002230	科大讯飞	6,757,770.00	25.42
11	002304	洋河股份	6,507,764.10	24.48
12	000776	广发证券	6,491,054.71	24.42
13	002466	天齐锂业	5,036,710.44	18.95
14	300059	东方财富	4,929,212.78	18.54
15	002024	苏宁易购	4,792,114.03	18.03
16	000538	云南白药	4,759,945.77	17.91
17	002241	歌尔股份	4,713,480.00	17.73
18	000568	泸州老窖	4,684,816.97	17.62
19	002456	欧菲科技	4,597,627.00	17.29
20	002460	赣锋锂业	4,528,957.72	17.04
21	002236	大华股份	4,501,088.20	16.93
22	002142	宁波银行	4,454,259.11	16.76
23	000166	申万宏源	4,428,083.27	16.66
24	001979	招商蛇口	4,367,818.19	16.43
25	002008	大族激光	4,245,389.88	15.97
26	000338	潍柴动力	4,131,950.20	15.54
27	300136	信维通信	3,941,809.00	14.83
28	000423	东阿阿胶	3,794,068.94	14.27
29	000783	长江证券	3,524,463.49	13.26
30	000100	TCL 集团	3,509,627.00	13.20
31	000839	中信国安	3,497,114.00	13.15
32	002202	金风科技	3,473,970.00	13.07
33	300072	三聚环保	3,467,266.26	13.04
34	300124	汇川技术	3,430,219.04	12.90
35	002475	立讯精密	3,426,620.50	12.89
36	000625	长安汽车	3,395,793.00	12.77
37	002594	比亚迪	3,379,856.96	12.71
38	002673	西部证券	3,313,047.92	12.46
39	000069	华侨城 A	3,226,684.00	12.14

40	300070	碧水源	3,208,074.00	12.07
41	002027	分众传媒	3,151,586.60	11.86
42	300024	机器人	3,014,402.80	11.34
43	000413	东旭光电	2,831,366.02	10.65
44	000768	中航飞机	2,828,216.11	10.64
45	002736	国信证券	2,809,960.00	10.57
46	000728	国元证券	2,807,949.92	10.56
47	000895	双汇发展	2,768,068.66	10.41
48	000661	长春高新	2,667,803.96	10.04
49	300408	三环集团	2,647,277.00	9.96
50	002044	美年健康	2,585,858.00	9.73
51	002405	四维图新	2,513,061.00	9.45
52	000963	华东医药	2,500,756.58	9.41
53	002085	万丰奥威	2,471,023.00	9.30
54	000157	中联重科	2,460,633.00	9.26
55	000793	华闻传媒	2,459,031.00	9.25
56	300003	乐普医疗	2,452,976.74	9.23
57	002310	东方园林	2,445,946.00	9.20
58	002340	格林美	2,439,194.40	9.18
59	002797	第一创业	2,405,661.00	9.05
60	002508	老板电器	2,378,064.90	8.95
61	000050	深天马 A	2,370,664.30	8.92
62	000623	吉林敖东	2,345,036.35	8.82
63	000709	河钢股份	2,300,071.00	8.65
64	000697	炼石有色	2,284,521.18	8.59
65	000630	铜陵有色	2,212,388.00	8.32
66	002572	索菲亚	2,208,423.00	8.31
67	000998	隆平高科	2,182,966.57	8.21
68	000060	中金岭南	2,177,133.68	8.19
69	002271	东方雨虹	2,140,992.02	8.05
70	000826	启迪桑德	2,089,684.25	7.86
71	002500	山西证券	2,085,578.00	7.85
72	300088	长信科技	2,070,533.00	7.79
73	002146	荣盛发展	2,036,343.00	7.66
74	000792	盐湖股份	2,025,230.25	7.62
75	002081	金螳螂	2,003,590.82	7.54
76	000425	徐工机械	2,003,355.00	7.54
77	002092	中泰化学	1,979,380.99	7.45
78	002065	东华软件	1,953,400.00	7.35
79	000750	国海证券	1,948,962.80	7.33
80	002465	海格通信	1,946,990.00	7.32
81	002176	江特电机	1,941,410.00	7.30
82	000983	西山煤电	1,911,200.00	7.19
83	300017	网宿科技	1,893,873.00	7.12

84	000039	中集集团	1,879,979.04	7.07
85	000009	中国宝安	1,873,093.01	7.05
86	300115	长盈精密	1,855,305.00	6.98
87	000008	神州高铁	1,829,192.00	6.88
88	000786	北新建材	1,824,390.82	6.86
89	000066	中国长城	1,807,553.72	6.80
90	000977	浪潮信息	1,797,950.00	6.76
91	002558	巨人网络	1,794,281.29	6.75
92	002007	华兰生物	1,793,086.04	6.74
93	000876	新希望	1,787,895.78	6.73
94	000559	万向钱潮	1,776,021.13	6.68
95	300433	蓝思科技	1,773,749.00	6.67
96	000686	东北证券	1,765,221.00	6.64
97	000997	新大陆	1,750,837.00	6.59
98	002714	牧原股份	1,748,280.00	6.58
99	300315	掌趣科技	1,744,109.00	6.56
100	300027	华谊兄弟	1,733,674.86	6.52
101	000488	晨鸣纸业	1,728,603.00	6.50
102	000046	泛海控股	1,723,928.99	6.48
103	000402	金融街	1,707,108.00	6.42
104	000970	中科三环	1,690,962.00	6.36
105	300296	利亚德	1,664,178.00	6.26
106	002179	中航光电	1,653,355.00	6.22
107	000887	中鼎股份	1,648,131.63	6.20
108	000581	威孚高科	1,639,033.94	6.17
109	000778	新兴铸管	1,613,312.26	6.07
110	300199	翰宇药业	1,612,574.20	6.07
111	002273	水晶光电	1,607,035.47	6.05
112	000516	国际医学	1,606,403.55	6.04
113	002450	康得新	1,595,878.01	6.00
114	000690	宝新能源	1,590,242.00	5.98
115	002195	二三四五	1,581,127.00	5.95
116	002311	海大集团	1,561,346.00	5.87
117	002573	清新环境	1,557,547.00	5.86
118	300015	爱尔眼科	1,556,850.98	5.86
119	002001	新和成	1,556,402.00	5.85
120	002185	华天科技	1,552,774.00	5.84
121	002049	紫光国芯	1,538,669.40	5.79
122	002422	科伦药业	1,523,184.00	5.73
123	002385	大北农	1,521,952.00	5.73
124	002407	多氟多	1,515,994.50	5.70
125	300026	红日药业	1,502,224.25	5.65
126	002294	信立泰	1,499,940.00	5.64
127	002074	国轩高科	1,479,534.30	5.57

128	002250	联化科技	1,463,302.40	5.50
129	002038	双鹭药业	1,448,067.00	5.45
130	300182	捷成股份	1,439,550.52	5.42
131	000656	金科股份	1,434,327.00	5.40
132	002280	联络互动	1,423,309.40	5.35
133	300418	昆仑万维	1,416,800.00	5.33
134	000685	中山公用	1,416,083.12	5.33
135	002410	广联达	1,411,702.00	5.31
136	000878	云南铜业	1,405,563.65	5.29
137	000917	电广传媒	1,404,388.00	5.28
138	002390	信邦制药	1,398,193.71	5.26
139	002019	亿帆医药	1,389,564.29	5.23
140	000807	云铝股份	1,389,060.00	5.23
141	002368	太极股份	1,386,220.57	5.21
142	000825	太钢不锈	1,383,559.00	5.20
143	300144	宋城演艺	1,381,242.00	5.20
144	002217	合力泰	1,372,975.81	5.16
145	000961	中南建设	1,372,525.98	5.16
146	000415	渤海金控	1,371,286.81	5.16
147	002223	鱼跃医疗	1,363,560.00	5.13
148	300055	万邦达	1,356,504.00	5.10
149	002489	浙江永强	1,342,148.72	5.05
150	002439	启明星辰	1,329,996.00	5.00
151	300033	同花顺	1,329,015.90	5.00
152	000960	锡业股份	1,302,450.00	4.90
153	000829	天音控股	1,297,772.94	4.88
154	000671	阳光城	1,292,245.79	4.86
155	000988	华工科技	1,276,113.50	4.80
156	000999	华润三九	1,275,648.00	4.80
157	300058	蓝色光标	1,274,270.72	4.79
158	300166	东方国信	1,271,876.00	4.78
159	000598	兴蓉环境	1,243,128.00	4.68
160	300146	汤臣倍健	1,238,858.76	4.66
161	002138	顺络电子	1,231,771.00	4.63
162	002583	海能达	1,225,014.84	4.61
163	000627	天茂集团	1,220,762.00	4.59
164	002408	齐翔腾达	1,213,420.00	4.56
165	002437	誉衡药业	1,211,107.00	4.56
166	002013	中航机电	1,208,097.00	4.54
167	300168	万达信息	1,206,251.00	4.54
168	000883	湖北能源	1,202,995.22	4.53
169	000400	许继电气	1,184,925.00	4.46
170	002657	中科金财	1,160,921.09	4.37
171	300014	亿纬锂能	1,153,170.00	4.34

172	002030	达安基因	1,144,760.00	4.31
173	002051	中工国际	1,137,652.00	4.28
174	002366	台海核电	1,120,721.00	4.22
175	002326	永太科技	1,119,504.00	4.21
176	000938	紫光股份	1,119,402.96	4.21
177	000059	华锦股份	1,116,862.00	4.20
178	000898	鞍钢股份	1,113,286.90	4.19
179	000078	海王生物	1,094,735.50	4.12
180	002108	沧州明珠	1,079,941.70	4.06
181	300251	光线传媒	1,079,002.00	4.06
182	000758	中色股份	1,069,987.00	4.02
183	000800	一汽轿车	1,066,414.00	4.01
184	300273	和佳股份	1,066,101.88	4.01
185	002610	爱康科技	1,053,612.00	3.96
186	000712	锦龙股份	1,050,174.00	3.95
187	002444	巨星科技	1,041,828.00	3.92
188	000028	国药一致	1,038,275.00	3.91
189	000732	泰禾集团	1,035,876.00	3.90
190	002491	通鼎互联	1,026,690.00	3.86
191	000012	南玻 A	1,019,941.25	3.84
192	002493	荣盛石化	1,012,294.00	3.81
193	002665	首航节能	1,004,906.52	3.78
194	300002	神州泰岳	1,004,817.00	3.78
195	002343	慈文传媒	1,004,812.00	3.78
196	002153	石基信息	1,004,643.00	3.78
197	000729	燕京啤酒	1,002,187.00	3.77
198	002522	浙江众成	1,000,698.00	3.76
199	000738	航发控制	995,399.00	3.74
200	002601	龙蟠佰利	993,432.00	3.74
201	300113	顺网科技	991,069.00	3.73
202	002292	奥飞娱乐	983,959.59	3.70
203	000519	中兵红箭	982,421.00	3.70
204	002389	南洋科技	981,248.00	3.69
205	002268	卫士通	976,599.44	3.67
206	002131	利欧股份	976,148.00	3.67
207	002191	劲嘉股份	972,446.00	3.66
208	002477	雏鹰农牧	971,041.00	3.65
209	300253	卫宁健康	970,476.00	3.65
210	000957	中通客车	967,450.00	3.64
211	002152	广电运通	967,388.00	3.64
212	000539	粤电力 A	949,865.67	3.57
213	002252	上海莱士	947,538.53	3.56
214	002624	完美世界	939,917.57	3.54
215	300383	光环新网	937,529.00	3.53

216	002004	华邦健康	934,142.00	3.51
217	300133	华策影视	930,373.40	3.50
218	300244	迪安诊断	921,282.14	3.47
219	000718	苏宁环球	919,739.00	3.46
220	000566	海南海药	919,078.50	3.46
221	300159	新研股份	914,143.00	3.44
222	300068	南都电源	905,592.00	3.41
223	002563	森马服饰	905,035.16	3.40
224	002501	利源精制	896,222.94	3.37
225	300207	欣旺达	888,343.00	3.34
226	002470	金正大	885,971.00	3.33
227	002400	省广股份	876,101.76	3.30
228	000563	陕国投 A	872,416.70	3.28
229	000930	中粮生化	865,440.00	3.26
230	300077	国民技术	864,000.60	3.25
231	000027	深圳能源	857,118.97	3.22
232	002018	华信国际	848,170.10	3.19
233	000617	中油资本	845,312.40	3.18
234	002431	棕榈股份	840,224.00	3.16
235	002353	杰瑞股份	833,862.00	3.14
236	000762	西藏矿业	832,137.00	3.13
237	000937	冀中能源	829,881.77	3.12
238	002352	顺丰控股	828,823.00	3.12
239	002424	贵州百灵	826,679.50	3.11
240	002506	协鑫集成	824,465.00	3.10
241	300367	东方网力	823,602.00	3.10
242	002002	鸿达兴业	819,397.00	3.08
243	300073	当升科技	793,767.00	2.99
244	002411	必康股份	787,426.23	2.96
245	002468	申通快递	777,617.00	2.93
246	300474	景嘉微	774,742.00	2.91
247	300001	特锐德	768,330.00	2.89
248	300020	银江股份	751,893.00	2.83
249	002329	皇氏集团	749,353.00	2.82
250	002709	天赐材料	745,824.21	2.81
251	300496	中科创达	744,760.00	2.80
252	002716	金贵银业	740,896.00	2.79
253	002155	湖南黄金	735,612.05	2.77
254	000156	华数传媒	720,098.97	2.71
255	002120	韵达股份	700,217.00	2.63
256	002276	万马股份	697,545.00	2.62
257	300090	盛运环保	695,546.00	2.62
258	002602	世纪华通	681,103.00	2.56
259	002643	万润股份	662,722.00	2.49

260	000901	航天科技	660,818.00	2.49
261	000687	华讯方舟	653,723.28	2.46
262	000547	航天发展	646,936.00	2.43
263	002631	德尔未来	646,247.00	2.43
264	000062	深圳华强	538,996.00	2.03
265	002010	传化智联	533,277.00	2.01

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	1,073,647,781.38
卖出股票的收入（成交）总额	583,245,627.58

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）	1,231,400.00	0.21
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,231,400.00	0.21

**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	128024	宁行转债	5,862	586,200.00	0.10
2	123006	东财转债	3,282	328,200.00	0.06
3	123003	蓝思转债	1,195	119,500.00	0.02
4	123004	铁汉转债	678	67,800.00	0.01
5	123005	万信转债	652	65,200.00	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前十名资产支持证券投资明细**

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

**8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细**

本基金本报告期末未持有贵金属。

**8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细**

本基金本报告期末未持有权证投资。

**8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**

**8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末未持有股指期货。

**8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策**

无。

**8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

**8.11.1 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**

本基金本报告期末未持有国债期货。

**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	361,922.65
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	7,200.84
5	应收申购款	4,184.46
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	373,307.95

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 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

金额单位: 人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002470	金正大	1,902,394.80	0.32	重大资产重组
2	002366	台海核电	1,793,310.00	0.30	重大资产重组
3	000547	航天发展	1,690,563.00	0.29	重大资产重组
4	000930	中粮生化	1,678,172.00	0.29	重大资产重组
5	300383	光环新网	1,590,144.00	0.27	重大资产重组
6	000006	深振业A	1,520,741.50	0.26	重大资产重组
7	000566	海南海药	1,408,799.66	0.24	重大资产重组

8	000979	中弘股份	1,376,069.16	0.23	重大资产重组
9	300159	新研股份	1,215,760.00	0.21	重大资产重组
10	300090	盛运环保	1,034,880.00	0.18	重大资产重组

### 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

本基金本报告期末积极投资前五名股票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
1,169	481,360.40	543,832,208.76	96.65%	18,878,102.14	3.35%

### 9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例
1	中国人寿保险股份有限公司	493,771,387.27	87.75%
2	中国人寿保险 (集团) 公司	38,703,791.47	6.88%
3	金鹏期货经纪有限公司	11,357,030.02	2.02%
4	望月英里	1,988,251.57	0.35%
5	林志英	849,790.65	0.15%
6	朱若增	495,387.00	0.09%
7	李少芳	495,207.00	0.09%
8	蒋冰	495,094.50	0.09%
9	卢奕	342,421.46	0.06%
10	袁宁	327,094.50	0.06%

### 9.3 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	1,769.32	0.00%

**9.4 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、基金投资和研究部门负责人持有该只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(2011 年 9 月 2 日)基金份额总额	608,040,554.70
本报告期期初基金份额总额	22,240,279.75
本报告期基金总申购份额	3,775,604,234.40
减：本报告期基金总赎回份额	3,235,134,203.25
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	562,710,310.90

**§11 重大事件揭示**

**11.1 基金份额持有人大会决议**

报告期内无基金份额持有人大会决议。

**11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动**

1、本基金管理人重大人事变动如下：

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

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

2、本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动如下：

2017 年 8 月，陈四清先生担任中国银行股份有限公司董事长、执行董事、董事会战略发展委员会主席及委员等职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内无基金投资策略的改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘为基金审计的会计师事务所。

报告年度支付给聘任会计师事务所的报酬情况：58,000.00 元。

目前的审计机构已提供审计服务的连续年限：自基金合同生效日起至今。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内无管理人、托管人及其高级管理人员受证券监管部门稽查或处罚等情况。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	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	
西南证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	1,574,274,217.41	95.04%	1,434,647.17	95.04%	-
长江证券	1	82,141,570.28	4.96%	74,855.80	4.96%	-

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，最大限度地调动物体资源，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

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
国泰君安	196,618.93	62.42%	-	-	-	-
长江证券	118,351.80	37.58%	-	-	-	-

12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比	期初份	申购份	赎回份	持有份额	份额占比

		例达到或者超过 20%的时间区间	额	额			
机构	1	20171001-201712 31	533, 26 5, 068. 15	0. 00	39, 493, 6 80. 88	493, 771, 387 . 27	87. 75%
产品特有风险							
本基金报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过20%的情形。如该单一投资者大额赎回将可能导致基金份额净值波动风险、基金流动性风险等特定风险。							

## 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

华安基金管理有限公司  
二〇一八年三月二十七日