

**MSCI 中国 A 股交易型开放式指数
证券投资基金
2017 年半年度报告**

2017 年 6 月 30 日

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一七年八月二十六日

§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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告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.....	1
§2 基金简介.....	3
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	4
3.1 主要会计数据和财务指标.....	4
3.2 基金净值表现.....	4
§4 管理人报告.....	5
§5 托管人报告.....	9
§6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	9
6.1 资产负债表.....	10
6.2 利润表.....	11
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	12
6.4 报表附注.....	13
§7 投资组合报告.....	31
7.1 期末基金资产组合情况.....	31
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	31
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.....	32
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	53
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	54
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.....	54
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.....	54
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.....	54
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.....	54
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	54
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	55
7.12 投资组合报告附注.....	55
§8 基金份额持有人信息.....	56
§9 开放式基金份额变动.....	57
§10 重大事件揭示.....	57
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	59
§12 备查文件目录.....	60

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	华夏 MSCI 中国 A 股 ETF
场内简称	MSCIA 股
基金主代码	512990
交易代码	512990
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2015 年 2 月 12 日
基金管理人	华夏基金管理有限公司
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	377,503,247 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2015 年 3 月 25 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化，以期获得与标的指数收益相似的回报。
投资策略	本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为 MSCI 中国 A 股指数。
风险收益特征	本基金属于股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，在股票基金中属于较高风险、较高收益的产品。

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		华夏基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李彬	王永民
	联系电话	400-818-6666	010-66594896
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-818-6666	95566
传真		010-63136700	010-66594942
注册地址		北京市顺义区天竺空港工业区 A 区	北京市西城区复兴门内大街1号
办公地址		北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层	北京市西城区复兴门内大街1号
邮政编码		100033	100818
法定代表人		杨明辉	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《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.ChinaAMC.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号
注册登记机构	华夏基金管理有限公司	北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 8 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	6,120,153.51
本期利润	32,237,926.82
加权平均基金份额本期利润	0.0974
本期加权平均净值利润率	9.50%
本期基金份额净值增长率	9.33%
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	29,854,306.09
期末可供分配基金份额利润	0.0791
期末基金资产净值	407,357,553.09
期末基金份额净值	1.0791
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	7.91%

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，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期末可供分配利润为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。

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	5.87%	0.61%	5.29%	0.64%	0.58%	-0.03%

过去三个月	3.92%	0.66%	2.40%	0.67%	1.52%	-0.01%
过去六个月	9.33%	0.61%	5.85%	0.61%	3.48%	0.00%
过去一年	17.13%	0.69%	9.54%	0.70%	7.59%	-0.01%
自基金合同生效起至今	7.91%	1.80%	1.31%	1.86%	6.60%	-0.06%

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

MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金

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

(2015 年 2 月 12 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

华夏基金管理有限公司成立于 1998 年 4 月 9 日，是经中国证监会批准成立的首批全国性基金管理公司之一。公司总部设在北京，在北京、上海、深圳、成都、南京、杭州、广州和青岛设有分公司，在香港、深圳、上海设有子公司。公司是首批全国社保基金管理人、首批企业年金基金管理人、境内首批 QDII 基金管理人、境内首只 ETF 基金管理人、境内首只沪港通 ETF 基金管理人、首批内地与香港基金互认基金管理人、首批基本养老保险基金投资管理人资格、首家加入联合国责任投资原则组织的公募基金公司，以及特定客户资产管理人、保险资金投资管理人，香港子公司是首批

RQFII 基金管理人。华夏基金是业务领域最广泛的基金管理公司之一。

华夏基金是境内 ETF 基金资产管理规模最大的基金管理公司之一，在 ETF 基金管理方面积累了丰富的经验，目前旗下管理华夏沪深 300ETF、华夏 MSCI 中国 A 股 ETF、华夏中证 500ETF、华夏上证 50ETF、华夏中小板 ETF、华夏消费 ETF、华夏金融 ETF、华夏医药 ETF、华夏恒生 ETF、华夏沪港通恒生 ETF 和华夏快线 ETF，初步形成了覆盖宽基指数、大盘蓝筹指数、中小盘指数、行业指数、海外市场指数等的产品线。今年 6 月，A 股成功纳入 MSCI 新兴市场指数，作为境内率先推出的跟踪 MSCI 中国 A 股指数的 ETF 基金，华夏 MSCI 中国 A 股 ETF 受到市场广泛关注。

在《中国证券报》主办的第十四届中国基金业金牛奖的评选中，华夏基金获得“2016 年度被动投资金牛基金公司”奖。

在客户服务方面，2017 年上半年，华夏基金继续以客户需求为导向，努力提高客户使用的便利性和服务体验：（1）下调旗下开放式基金在直销机构及华夏财富的申购、赎回等业务最低数量限制，更好地满足客户理财需求；（2）新增开通华夏财富宝货币、华夏薪金宝货币网上交易快速赎回业务，并且将单日单账户快速赎回份额上调至 50 万份，更好地满足了投资者的流动性需求；（3）网上交易上线中信银行和广发银行快捷支付业务，并与花旗银行、青岛农商银行、国美基金等代销机构合作，拓宽客户交易渠道，提高客户交易便利性；（4）开展“华夏基金 19 周年司庆”、“4 月万物生长，定投让理财生花”、“知识就是红包”等多项客户活动，为客户提供多样化的投资者教育和关怀服务。

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		
张弘弢	本基金的基金经理、董事总经理	2015-02-12	-	17 年	硕士。2000 年 4 月加入华夏基金管理有限公司，曾任研究发展部总经理、数量投资部副总经理，上证能源交易型开放式指数发起式证券投资基金基金经理（2013 年 3 月 28 日至 2016 年 3 月 28 日期间）等。
荣膺	本基金的基金经理、数量投资部高级副总裁	2016-10-20	-	7 年	北京大学光华管理学院会计学硕士。2010 年 7 月加入华夏基金管理有限公司，曾任研究发展部高级产品经理，数量投资部研究员、投资经理、基金经理助理等。

注：①上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

②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

报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司开展投资、研究活动防控内幕交易指导意见》、基金合同和其他有关法律法规，本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

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

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《华夏基金管理有限公司公平交易制度》的规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，未出现涉及本基金的交易所公开竞价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 5% 的情况。

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

本基金跟踪的标的指数为 MSCI 中国 A 股指数，MSCI 中国 A 股指数是国际指数公司 MSCI 为中国 A 股市场创建的独立国家指数，旨在为当前投资 A 股市场的广大投资者提供一个股票表现基准，该指数力图反映国内 A 股投资者的投资过程和制约因素，同时也可成为国际投资者了解和参与中国 A 股市场的一个工具。该指数自 2005 年 5 月起正式发布，以 A 股沪深两市大中盘股票为成份股样本，以其经调整的自由流通市值为权数计算得到。本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好地跟踪标的指数，实现基金投资目标。

上半年，国际方面，美国经济持续复苏，美联储加息 50bp；欧洲经济继续改善，但政治不确定性仍是重大风险隐患。国内方面，经济企稳态势延续，出口形势转暖，消费保持平稳，在供给侧改革、基建与房地产投资拉动等因素影响下，工业品价格脱离底部低位，企业利润增长加快，但 CPI 仍总体可控。报告期内，外汇市场较为稳定，货币政策保持中性，但监管部门重点防范潜在风险，房地产领域维持高压、金融领域严格推进“去杠杆”，市场资金利率中枢有一定的抬升。

市场方面，一季度在国内外基本面企稳确认、工业品价格持续上涨、企业盈利恢复、居民消费升级等因素带动下，市场走出了一波震荡上涨行情。二季度期初，工业品价格环比回落、金融领域

加强监管等因素对风险偏好形成一定压制，市场有所调整，但在雄安新区、监管节奏调整、A 股纳入 MSCI 等因素影响下，市场走出了一波以蓝筹龙头股板块为代表的震荡上涨行情。

基金投资运作方面，报告期内，本基金在做好跟踪标的指数的基础上，认真应对投资者日常申购、赎回及成份股调整等工作。

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 1.0791 元，本报告期份额净值增长率为 9.33%，同期业绩比较基准增长率为 5.85%。本基金本报告期跟踪偏离度为+3.48%，与业绩比较基准产生偏离的主要原因为成份股分红、日常运作费用、指数结构调整、申购赎回等产生的差异。

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，国际方面，在经济保持平稳增长的前提下，美国预期还会有一次加息，利率抬升一定程度后美联储或将启动缩表程序；英国脱欧对欧洲的负面影响继续消散，短期政治风险继续减弱，在依旧宽松的货币政策下预计欧洲经济走势仍持续缓慢回暖。国内方面，在供给侧结构性改革深入实施、创新驱动发展战略加快推进的背景下，我国实体经济运行当中的积极变化还会继续增加，稳中向好的发展态势将进一步巩固；货币政策仍然会维持上半年的中性偏紧的态势，在长期性的金融严监管之下，股市的推动因素基本面重于资金面，但整体宏观环境仍然利好股市，在基本面继续向好的情况下，MSCI 中国 A 股指数有望有较好的投资机会。

本基金将会根据基金合同要求，在紧密跟踪标的指数的基础上，做好相关投资工作。

珍惜基金份额持有人的每一份投资和每一份信任，本基金将继续奉行华夏基金管理有限公司“为信任奉献回报”的经营理念，规范运作，审慎投资，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求长期、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

根据中国证监会相关规定及基金合同约定，本基金管理人应严格按照新准则、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。会计师事务所所在估值调整导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上时对所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。其中，本基金管理人为了确保估值工作的合规开展，建立了负责估值工作决策和执行的专门机构，组成人员包括主管基金运营的公司领导或其授权人、督察长、投资风控工作负责人、证券研究工作负责人、合规负责人及基金会计工作负责人等，以上人员具有丰富的风控、证券研究、合规、会计方面的专业经验。同时，根据基金管理公司制定的相关制度，估值工作决策机构的成员中不包括基金经理。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金基金合同规定，本基金的收益分配原则为：每份基金份额享有同等分配权。基金收益评价日核定的基金累计报酬率超过同期标的指数累计报酬率达到 1% 以上时，可进行收益分配。基金收益分配采用现金方式。在符合基金收益分配条件的情况下，本基金收益每年最多分配 4 次，每次基金收益分配数额的确定原则为使收益分配后基金累计报酬率尽可能贴近标的指数同期累计报酬率。若基金合同生效不满 3 个月则可不进行收益分配。法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

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

报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金（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遵规守信、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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金

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	12,933,107.81	12,854,628.00
结算备付金		8,528,092.48	2,888,999.49
存出保证金		4,776,187.27	4,914,047.05
交易性金融资产	6.4.7.2	377,320,129.39	302,125,249.67
其中：股票投资		377,320,129.39	302,125,249.67
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	9,500,000.00	5,700,000.00
应收证券清算款		280,836.17	1,016,202.32
应收利息	6.4.7.5	10,477.39	12,647.16
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		413,348,830.51	329,511,773.69
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		4,957,183.29	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		150,941.34	143,016.49
应付托管费		30,188.30	28,603.30
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	23,321.62	15,700.11
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	829,642.87	133,923.29
负债合计		5,991,277.42	321,243.19
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.9	377,503,247.00	333,515,418.00
未分配利润	6.4.7.10	29,854,306.09	-4,324,887.50
所有者权益合计		407,357,553.09	329,190,530.50
负债和所有者权益总计		413,348,830.51	329,511,773.69

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0791 元，基金份额总额 377,503,247 份。

6.2 利润表

会计主体：MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金

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		33,479,224.49	-84,745,684.24
1.利息收入		130,566.74	130,360.76
其中：存款利息收入	6.4.7.11	94,572.95	129,686.92
债券利息收入		84.63	180.03
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		35,909.16	493.81
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		7,230,164.75	-38,923,425.45
其中：股票投资收益	6.4.7.12	3,632,280.87	-35,532,847.89
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	1,946.07	34,755.15
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	989,440.00	-6,132,540.00
股利收益	6.4.7.17	2,606,497.81	2,707,207.29
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	26,117,773.31	-45,911,017.02
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	719.69	-41,602.53
减：二、费用		1,241,297.67	1,475,724.02
1.管理人报酬		840,286.45	959,242.42
2.托管费		168,057.28	191,848.46
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	6.4.7.20	70,277.94	123,994.07
5.利息支出		-	-

其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.其他费用	6.4.7.21	162,676.00	200,639.07
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		32,237,926.82	-86,221,408.26
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		32,237,926.82	-86,221,408.26

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金

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）	333,515,418.00	-4,324,887.50	329,190,530.50
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	32,237,926.82	32,237,926.82
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）	43,987,829.00	1,941,266.77	45,929,095.77
其中：1.基金申购款	73,987,829.00	3,087,486.43	77,075,315.43
2.基金赎回款	-30,000,000.00	-1,146,219.66	-31,146,219.66
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）	377,503,247.00	29,854,306.09	407,357,553.09
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）	488,515,418.00	43,855,075.60	532,370,493.60
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-86,221,408.26	-86,221,408.26
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）	-90,000,000.00	10,993,384.44	-79,006,615.56
其中：1.基金申购款	75,000,000.00	-6,687,807.27	68,312,192.73
2.基金赎回款	-165,000,000.00	17,681,191.71	-147,318,808.29

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）	398,515,418.00	-31,372,948.22	367,142,469.78

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：杨明辉，主管会计工作负责人：汪贵华，会计机构负责人：汪贵华

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）已获中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2014]870 号《关于准予 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金注册的批复》，由华夏基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金基金合同》及其他有关法律法规负责公开募集。本基金为交易型开放式，存续期限为不定期。本基金自 2015 年 1 月 19 日至 2015 年 2 月 6 日期间共募集 4,136,470,618.00 元（不含认购资金利息），业经德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）德师报（验）字（15）第 0145 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2015 年 2 月 12 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 4,136,570,680 份基金份额，其中认购资金利息折合 100,062 份基金份额。本基金的基金管理人为华夏基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股、替代性股票。为更好地实现投资目标，基金还可投资于非成份股、债券（含中小企业私募债券）、股指期货、权证、货币市场工具、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

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 日及其后颁布和修订的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会发布的《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>》和中国证监会、

中国基金业协会允许的如财务报表附注 6.4.4 所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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 1 月 1 日至 6 月 30 日期间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

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

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

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

根据财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]103 号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、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、以发行基金方式募集资金不属于营业税或增值税征收范围，不征收营业税或增值税。
- 2、基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税或增值税，暂不征收企业所得税。
- 3、存款利息收入不征收增值税。
- 4、国债、地方政府债利息收入，金融同业往来利息收入免征增值税。
- 5、对基金取得的债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。
- 6、对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利收入时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。基金从上市公司分配取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，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，

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。

7、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。

8、基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

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	12,933,107.81
定期存款	-
其他存款	-
合计	12,933,107.81

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	385,597,384.59	377,320,129.39	-8,277,255.20
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	385,597,384.59	377,320,129.39	-8,277,255.20

注：股票投资的估值增值和股票投资的公允价值均包含可退替代款的估值增值。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-

权益衍生工具	23,704,420.00	-	-	-
其中：股指期货	23,704,420.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	23,704,420.00	-	-	-

注：期货投资采用当日无负债结算制度，相关价值已包含在结算备付金中，具体投资情况详见下表（买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示）：

代码	名称	持仓量	合约市值	公允价值变动	风险说明
IF1707	沪深 300 股指期货 IF1707 合约	15.00	16,413,300.00	591,600.00	买入股指期货多头合约的目的是进行更有效地流动性管理。
IC1707	中证 500 股指期货 IC1707 合约	4.00	4,882,400.00	125,080.00	买入股指期货多头合约的目的是进行更有效地流动性管理。
IC1709	中证 500 股指期货 IC1709 合约	2.00	2,408,720.00	28,600.00	买入股指期货多头合约的目的是进行更有效地流动性管理。
公允价值变动总额合计					745,280.00
股指期货投资本期收益					989,440.00
股指期货投资本期公允价值变动					865,260.00

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

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
银行间同业市场买入返售金融资产	-	-
交易所市场买入返售金融资产	9,500,000.00	-
合计	9,500,000.00	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

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	2,797.81
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	4,485.44
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	3,178.24
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	15.90
合计	10,477.39

6.4.7.6 其他资产

无。

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	23,321.62
银行间市场应付交易费用	-
合计	23,321.62

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	-
应付赎回费	-
预提费用	99,177.14
指数使用费	58,820.07
应退替代款	579,294.86
可退替代款	92,350.80
合计	829,642.87

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	333,515,418.00	333,515,418.00
本期申购	73,987,829.00	73,987,829.00
本期赎回（以“-”号填列）	-30,000,000.00	-30,000,000.00

本期末	377,503,247.00	377,503,247.00
-----	----------------	----------------

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	126,357,800.59	-130,682,688.09	-4,324,887.50
本期利润	6,120,153.51	26,117,773.31	32,237,926.82
本期基金份额交易产生的变动数	17,676,414.75	-15,735,147.98	1,941,266.77
其中：基金申购款	29,287,737.61	-26,200,251.18	3,087,486.43
基金赎回款	-11,611,322.86	10,465,103.20	-1,146,219.66
本期已分配利润	-	-	-
本期末	150,154,368.85	-120,300,062.76	29,854,306.09

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	50,848.30
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	43,609.23
其他	115.42
合计	94,572.95

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	4,887,531.83
股票投资收益——赎回差价收入	-1,255,250.96
股票投资收益——申购差价收入	-
合计	3,632,280.87

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出股票成交总额	40,130,415.83
减：卖出股票成本总额	35,242,884.00
买卖股票差价收入	4,887,531.83

6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
赎回基金份额对价总额	31,146,219.66
减：现金支付赎回款总额	11,918,049.66
减：赎回股票成本总额	20,483,420.96
赎回差价收入	-1,255,250.96

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	275,030.70
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	273,000.00
减：应收利息总额	84.63
买卖债券差价收入	1,946.07

6.4.7.14 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.15 贵金属投资收益

6.4.7.15.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.15.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.15.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.15.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.16 衍生工具收益

6.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
股指期货投资收益	989,440.00
合计	989,440.00

6.4.7.17 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	2,606,497.81
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,606,497.81

6.4.7.18 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	25,252,513.31
——股票投资	25,252,513.31
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	865,260.00
——权证投资	-
——期货投资	865,260.00
4.其他	-
合计	26,117,773.31

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
基金赎回费收入	-
申购费	19,990.00
替代损益	-19,270.31
合计	719.69

6.4.7.20 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	70,277.94
银行间市场交易费用	-
合计	70,277.94

6.4.7.21 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	29,752.78
信息披露费	39,671.58
银行费用	3,216.00
上市费	29,752.78
指数使用费	60,282.86
合计	162,676.00

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

截至资产负债表日，本基金无或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无资产负债表日后事项。

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

本基金本报告期不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。

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
华夏基金管理有限公司	基金管理人
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人
中信证券股份有限公司	基金管理人的股东
中信期货有限公司（“中信期货”）	基金管理人股东控股的公司
MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金联接基金	该基金是本基金的联接基金

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	840,286.45	959,242.42

注：①支付基金管理人的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 0.5% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

②基金管理人报酬计算公式为：日基金管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.5% / 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	168,057.28	191,848.46

注：①支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值 0.1% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

②基金托管费计算公式为：日基金托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.1% / 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2017 年 6 月 30 日		上年度末 2016 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
华夏 MSCI 中国 A 股 ETF 联接	99,323,083.00	26.31%	93,172,883.00	27.94%

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的相关费用符合基金招募说明书、交易所、登记结算机构的有关规定。

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		上年度可比期间	
	2017年1月1日至2017年6月30日		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
中国银行活期存款	12,933,107.81	50,848.30	18,854,441.50	70,014.56

注：本基金的活期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。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
中信证券股份有限公司	113011	光大转债	老股东优先配售	2,650	265,000.00
上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
中信证券股份有限公司	110032	三一转债	老股东优先配售	680	68,000.00
中信证券股份有限公司	600489	中金黄金	老股东配售	8,382	52,136.04

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期通过中信期货买卖股指期货成交额为 201,477,080.00 元（上年度可比期间：356,145,420.00 元），支付给中信期货的佣金为 4,936.17 元（上年度可比期间：15,916.01 元）。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配事项。

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	新发流通受限	18.02	18.02	1,313	23,660.26	23,660.26	-
002882	金龙羽	2017-06-15	2017-07-17	新发流通受限	6.20	6.20	2,966	18,389.20	18,389.20	-
603933	睿能科技	2017-06-28	2017-07-06	新发流通受限	20.20	20.20	857	17,311.40	17,311.40	-
603305	旭升股份	2017-06-30	2017-07-10	新发流通受限	11.26	11.26	1,351	15,212.26	15,212.26	-
300670	大烨智能	2017-06-26	2017-07-03	新发流通受限	10.93	10.93	1,259	13,760.87	13,760.87	-
300672	国科微	2017-06-30	2017-07-12	新发流通受限	8.48	8.48	1,257	10,659.36	10,659.36	-
603331	百达精工	2017-06-27	2017-07-05	新发流通受限	9.63	9.63	999	9,620.37	9,620.37	-
300671	富满电子	2017-06-27	2017-07-05	新发流通受限	8.11	8.11	942	7,639.62	7,639.62	-
603617	君禾股份	2017-06-23	2017-07-03	新发流通受限	8.93	8.93	832	7,429.76	7,429.76	-

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
601989	中国重工	2017-05-31	重大事项	6.21	-	-	245,765	2,432,221.87	1,526,200.65	-
600050	中国联通	2017-04-05	重大事项	7.47	2017-08-21	8.22	197,467	1,107,787.22	1,475,078.49	-
600795	国电电力	2017-06-05	重大事项	3.60	-	-	261,700	988,575.03	942,120.00	-
601088	中国神华	2017-06-05	重大事项	22.29	-	-	39,252	720,407.29	874,927.08	-
600100	同方股份	2017-04-21	重大事项	14.12	-	-	47,448	723,948.80	669,965.76	-
000100	TCL集团	2017-04-21	重大事项	3.43	2017-07-26	3.72	193,800	891,240.06	664,734.00	-
000656	金科股份	2017-05-05	重大事项	6.54	2017-07-05	5.92	83,700	538,417.99	547,398.00	-
002252	上海莱士	2017-04-21	重大事项	20.24	-	-	24,631	433,942.68	498,531.44	-
601727	上海电气	2017-06-22	重大事项	7.57	2017-07-03	7.54	62,800	979,985.42	475,396.00	-
600643	爱建集团	2017-04-17	重大事项	14.98	2017-08-02	16.48	28,263	344,959.87	423,379.74	-
000503	海虹控股	2017-05-11	重大事项	24.93	-	-	16,962	638,358.05	422,862.66	-
601919	中远海控	2017-05-17	重大事项	5.35	2017-07-26	5.89	68,800	439,894.96	368,080.00	-
600959	江苏有线	2017-06-19	重大事项	10.57	-	-	34,510	399,639.26	364,770.70	-
002129	中环股份	2016-04-25	重大事项	8.27	-	-	41,300	459,854.62	341,551.00	-
000887	中鼎股份	2017-04-27	重大事项	22.09	2017-07-14	19.88	15,370	326,692.17	339,523.30	-
600666	奥瑞德	2017-04-27	重大事项	17.40	-	-	17,760	366,877.89	309,024.00	-
600485	信威集团	2016-12-26	重大事项	14.59	-	-	21,100	375,349.52	307,849.00	-
600673	东阳光科	2016-11-15	重大事项	7.29	-	-	41,080	310,424.64	299,473.20	-
002426	胜利精密	2017-01-16	重大事项	7.68	-	-	38,600	356,537.69	296,448.00	-
002509	天广中茂	2017-06-12	重大事项	9.20	-	-	31,600	238,838.67	290,720.00	-
002075	沙钢	2016-09-19	重大事	16.12	-	-	16,700	206,650.52	269,204.00	-

601872	招商 轮船	2017-05-02	重大事 项	5.16	-	-	49,645	294,624.17	256,168.20	-
600655	豫园 商城	2016-12-20	重大事 项	11.32	-	-	22,100	295,831.11	250,172.00	-
600172	黄河 旋风	2017-06-30	重大事 项	8.23	2017-07-14	8.00	28,420	302,427.70	233,896.60	-
002127	南极 电商	2017-06-29	重大事 项	12.08	2017-07-06	12.61	18,700	222,978.87	225,896.00	-
002049	紫光 国芯	2017-02-20	重大事 项	30.82	2017-07-17	27.74	7,306	302,163.85	225,170.92	-
002013	中航 机电	2017-05-12	重大事 项	10.33	2017-08-02	11.36	20,527	264,216.31	212,043.91	-
600490	鹏欣 资源	2017-02-21	重大事 项	7.91	-	-	26,800	288,267.94	211,988.00	-
600654	*ST 中 安	2017-06-07	重大事 项	13.48	-	-	15,700	402,227.36	211,636.00	-
601717	郑煤 机	2017-04-24	重大事 项	7.79	-	-	23,500	183,487.79	183,065.00	-
600634	富控 互动	2017-04-19	重大事 项	18.03	2017-07-17	17.21	10,100	200,719.21	182,103.00	-
600277	亿利 洁能	2017-03-06	重大事 项	7.83	-	-	22,900	203,778.54	179,307.00	-
600146	商赢 环球	2017-01-05	重大事 项	35.73	-	-	5,000	169,171.42	178,650.00	-
600255	鑫科 材料	2017-06-26	重大事 项	4.04	-	-	43,800	223,865.04	176,952.00	-
600568	中珠 医疗	2017-04-25	重大事 项	19.16	2017-07-27	6.15	9,000	157,922.15	172,440.00	-
002312	*ST 三 泰	2017-03-31	重大事 项	6.82	2017-07-24	7.16	25,025	368,455.19	170,670.50	-
601608	中信 重工	2017-04-19	重大事 项	5.54	2017-07-26	5.26	30,500	208,634.22	168,970.00	-
002399	海普 瑞	2017-04-28	重大事 项	20.23	-	-	8,302	179,496.45	167,949.46	-
002642	荣之 联	2017-04-10	重大事 项	25.06	2017-07-07	22.54	6,500	241,365.61	162,890.00	-
002025	航天 电器	2016-09-12	重大事 项	24.95	2017-07-04	22.46	6,500	168,019.47	162,175.00	-
002358	森源 电气	2017-05-12	重大事 项	17.02	2017-07-12	16.68	9,500	214,546.59	161,690.00	-
000061	农产 品	2017-06-28	重大事 项	9.06	-	-	17,400	240,153.33	157,644.00	-
002547	春兴	2017-02-20	重大事 项	10.89	2017-08-18	9.80	14,000	150,791.09	152,460.00	-

	精工		项							
600577	精达股份	2017-06-26	重大事项	4.80	2017-07-10	4.50	31,100	186,557.66	149,280.00	-
000034	神州数码	2017-03-21	重大事项	24.45	2017-07-18	22.01	6,000	122,703.50	146,700.00	-
002122	天马股份	2017-04-24	重大事项	10.30	2017-07-24	11.15	14,200	169,460.75	146,260.00	-
002622	融钰集团	2017-04-20	重大事项	12.30	-	-	11,800	138,099.66	145,140.00	-
000935	四川双马	2017-01-17	重大事项	23.06	-	-	6,100	187,115.53	140,666.00	-
600057	象屿股份	2017-06-27	重大事项	10.17	2017-07-04	10.17	13,800	152,322.27	140,346.00	-
600289	亿阳信通	2017-05-10	重大事项	10.94	2017-08-18	12.03	12,600	198,980.79	137,844.00	-
002505	大康农业	2017-03-13	重大事项	3.50	-	-	38,660	157,313.66	135,310.00	-
002128	露天煤业	2017-03-17	重大事项	8.70	2017-08-14	9.57	15,400	137,023.39	133,980.00	-
600701	工大高新	2017-06-12	重大事项	11.14	-	-	11,600	146,023.00	129,224.00	-
002610	爱康科技	2017-05-12	重大事项	2.44	2017-08-02	2.44	52,300	184,760.88	127,612.00	-
002418	康盛股份	2017-03-20	重大事项	9.31	2017-07-10	9.30	13,600	147,384.24	126,616.00	-
002070	*ST 众和	2017-05-02	重大事项	10.17	-	-	12,300	346,138.34	125,091.00	-
600653	申华控股	2017-05-08	重大事项	3.26	-	-	37,900	191,865.55	123,554.00	-
000662	天夏智慧	2017-06-05	重大事项	16.00	-	-	7,100	140,515.63	113,600.00	-
002681	奋达科技	2017-06-22	重大事项	12.59	2017-07-03	12.70	8,800	162,443.69	110,792.00	-
601001	大同煤业	2017-06-22	重大事项	5.25	2017-07-21	5.78	20,100	143,150.80	105,525.00	-
002256	兆新股份	2017-06-05	重大事项	4.39	-	-	21,200	141,021.89	93,068.00	-
000838	财信发展	2017-05-02	重大事项	6.59	-	-	9,600	142,285.11	63,264.00	-
002638	勤上股份	2017-04-26	重大事项	8.14	-	-	1,200	11,964.00	9,768.00	-

注：上述股票的复牌日期及复牌开盘单价更新截至本财务报表批准日。

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

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金一贯的风险管理政策是使基金投资风险可测、可控、可承担。本基金管理人建立了由风险管理委员会、督察长、法律部、合规部、稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的多层次风险管理架构体系。风险管理团队在识别、衡量投资风险后，通过正式报告的方式，将分析结果及时传达给基金经理、投资总监、投资决策委员会和风险管理委员会，协助制定风险控制决策，实现风险管理目标。

本基金管理人主要通过定性分析和定量分析的方法，估测各种金融工具风险可能产生的损失。本基金管理人从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重性；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的金融工具特征，通过特定的风险量化指标、模型和日常的量化报告，参考压力测试结果，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时对各种风险进行监督、检查和评估，并制定相应决策，将风险控制在预期可承受的范围之内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指由于基金所投资债券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息，债券发行人信用评级降低导致债券价格下降，或基金在交易过程中发生交收违约，而造成基金资产损失的可能性。

本基金管理人通过信用分析团队建立了内部评级体系和交易对手库，对发行人及债券投资进行内部评级，对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能出现的信用风险。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是在市场或持有资产流动性不足的情况下，基金管理人可能无法迅速、低成本地调整基金投资组合，从而对基金收益造成不利影响。

本基金所投资的证券在证券交易所或银行间市场交易，除在“6.4.12 期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制的情况外，其余均能及时变现。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指由于市场变化或波动所引起的资产损失的可能性，本基金管理人通过监测组合敏感性指标来衡量市场风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率变动引起组合中资产特别是债券投资的市场价格变动，从而影响基金投资收益的风险。

本基金为指数型基金，采用完全复制策略。本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。因此，利率风险不是本基金的主要风险。

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险为除市场利率和外汇汇率以外的市场因素发生变动时产生的价格波动风险。本基金的其他价格风险主要为市场价格变化或波动所引起的股票资产损失的可能性。

本基金为指数型基金，采用完全复制策略。本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。本基金管理人通常用敏感性指标来衡量市场价格风险。

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	377,320,129.39	92.63	302,125,249.67	91.78
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
合计	377,320,129.39	92.63	302,125,249.67	91.78

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1、估测组合市场价格风险的数据为 MSCI 中国 A 股指数变动时，各类持仓资产相应的理论变动值对基金资产净值的影响金额。		
	2、假定 MSCI 中国 A 股指数变化 5%，其他市场变量均不发生变化。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2017年6月30日	上年度末 2016年12月31日
	+5%	20,190,677.12	16,008,535.50
	-5%	-20,190,677.12	-16,008,535.50

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

根据企业会计准则的相关规定，以公允价值计量的金融工具，其公允价值的计量可分为三个层

次：

第一层次：对存在活跃市场报价的金融工具，可以相同资产/负债在活跃市场上的报价确定公允价值。

第二层次：对估值日活跃市场无报价的金融工具，可以类似资产/负债在活跃市场上的报价为依据做必要调整确定公允价值；对估值日不存在活跃市场的金融工具，可以相同或类似资产/负债在非活跃市场上的报价为依据做必要调整确定公允价值。

第三层次：对无法获得相同或类似资产可比市场交易价格的金融工具，可以其他反映市场参与者对资产/负债定价时所使用的参数为依据确定公允价值。

6.4.14.2 各层次金融工具公允价值

截至 2017 年 6 月 30 日止，本基金持有的以公允价值计量的金融工具第一层次的余额为 377,320,228.39 元，第二层次的余额为 0 元，第三层次的余额为 0 元。（截至 2016 年 12 月 31 日止，本基金持有的以公允价值计量的金融工具第一层次的余额为 302,125,249.67 元，第二层次的余额为 0 元，第三层次的余额为 0 元。）

6.4.14.3 公允价值所属层次间的重大变动

对于持有的非公开发行股票，本基金于限售期内将相关股票公允价值所属层次列入第二层次，于限售期满并恢复市价估值之日起从第二层次转入第一层次。

6.4.14.4 第三层次公允价值本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量的金融工具第三层次公允价值本期未发生变动。

6.4.14.5 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	377,320,129.39	91.28
	其中：股票	377,320,129.39	91.28
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	9,500,000.00	2.30
	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	21,461,200.29	5.19
7	其他各项资产	5,067,500.83	1.23
8	合计	413,348,830.51	100.00

注：股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	2,249,328.25	0.55
B	采矿业	10,894,637.32	2.67
C	制造业	172,586,212.17	42.37
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,225,761.02	3.00
E	建筑业	14,372,530.17	3.53
F	批发和零售业	12,523,482.51	3.07
G	交通运输、仓储和邮政业	11,178,806.90	2.74
H	住宿和餐饮业	135,500.00	0.03
I	信息传输、软件和信息技术服务业	16,937,254.52	4.16
J	金融业	89,433,439.49	21.95
K	房地产业	22,024,898.85	5.41
L	租赁和商务服务业	3,738,917.15	0.92

M	科学研究和技术服务业	188,605.43	0.05
N	水利、环境和公共设施管理业	2,055,043.01	0.50
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	826,005.00	0.20
R	文化、体育和娱乐业	4,008,287.53	0.98
S	综合	1,941,519.07	0.48
	合计	377,320,228.39	92.63

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	601318	中国平安	263,238	13,059,237.18	3.21
2	600036	招商银行	344,552	8,238,238.32	2.02
3	601166	兴业银行	410,316	6,917,927.76	1.70
4	600519	贵州茅台	13,375	6,310,993.75	1.55
5	600000	浦发银行	426,848	5,399,627.20	1.33
6	000651	格力电器	127,964	5,268,277.88	1.29
7	000002	万 科 A	206,775	5,163,171.75	1.27
8	000333	美的集团	107,297	4,618,062.88	1.13
9	600016	民生银行	538,737	4,428,418.14	1.09
10	600030	中信证券	220,280	3,749,165.60	0.92
11	601668	中国建筑	364,405	3,527,440.40	0.87
12	601328	交通银行	536,446	3,304,507.36	0.81
13	600887	伊利股份	147,816	3,191,347.44	0.78
14	000858	五 粮 液	51,829	2,884,802.14	0.71
15	002415	海康威视	84,176	2,718,884.80	0.67
16	601398	工商银行	491,400	2,579,850.00	0.63
17	000725	京东方 A	618,850	2,574,416.00	0.63
18	600837	海通证券	172,036	2,554,734.60	0.63
19	601169	北京银行	277,171	2,541,658.07	0.62
20	601601	中国太保	66,742	2,260,551.54	0.55
21	601766	中国中车	221,630	2,242,895.60	0.55
22	600104	上汽集团	70,962	2,203,370.10	0.54
23	601211	国泰君安	104,300	2,139,193.00	0.53
24	600900	长江电力	133,689	2,056,136.82	0.50
25	000001	平安银行	208,588	1,958,641.32	0.48
26	600276	恒瑞医药	38,397	1,942,504.23	0.48
27	601288	农业银行	536,100	1,887,072.00	0.46
28	600518	康美药业	82,762	1,799,245.88	0.44
29	600048	保利地产	180,060	1,795,198.20	0.44
30	601988	中国银行	438,100	1,620,970.00	0.40

31	002450	康得新	69,698	1,569,598.96	0.39
32	601989	中国重工	245,765	1,526,200.65	0.37
33	601688	华泰证券	82,800	1,482,120.00	0.36
34	600050	中国联通	197,467	1,475,078.49	0.36
35	601390	中国中铁	169,900	1,473,033.00	0.36
36	601818	光大银行	362,700	1,468,935.00	0.36
37	600028	中国石化	232,300	1,377,539.00	0.34
38	000063	中兴通讯	56,839	1,349,357.86	0.33
39	601006	大秦铁路	158,103	1,326,484.17	0.33
40	001979	招商蛇口	59,874	1,278,908.64	0.31
41	601186	中国铁建	104,900	1,261,947.00	0.31
42	600690	青岛海尔	83,468	1,256,193.40	0.31
43	601939	建设银行	203,947	1,254,274.05	0.31
44	000776	广发证券	71,900	1,240,275.00	0.30
45	002304	洋河股份	13,733	1,192,161.73	0.29
46	000538	云南白药	12,677	1,189,736.45	0.29
47	601009	南京银行	101,150	1,133,891.50	0.28
48	600019	宝钢股份	168,006	1,127,320.26	0.28
49	002230	科大讯飞	27,969	1,115,963.10	0.27
50	002024	苏宁云商	99,000	1,113,750.00	0.27
51	600585	海螺水泥	48,615	1,105,018.95	0.27
52	600703	三安光电	55,800	1,099,260.00	0.27
53	600015	华夏银行	116,948	1,078,260.56	0.26
54	600309	万华化学	37,247	1,066,754.08	0.26
55	000166	申万宏源	182,841	1,023,909.60	0.25
56	000423	东阿阿胶	13,934	1,001,715.26	0.25
57	002466	天齐锂业	18,280	993,518.00	0.24
58	601901	方正证券	100,000	993,000.00	0.24
59	600009	上海机场	26,449	986,812.19	0.24
60	002241	歌尔股份	51,020	983,665.60	0.24
61	002456	欧菲光	53,510	972,276.70	0.24
62	600660	福耀玻璃	36,500	950,460.00	0.23
63	600031	三一重工	116,159	944,372.67	0.23
64	600795	国电电力	261,700	942,120.00	0.23
65	600089	特变电工	91,010	940,133.30	0.23
66	601985	中国核电	118,100	922,361.00	0.23
67	002236	大华股份	39,750	906,697.50	0.22
68	601377	兴业证券	122,000	906,460.00	0.22
69	601899	紫金矿业	262,700	901,061.00	0.22
70	600999	招商证券	51,990	895,267.80	0.22
71	601088	中国神华	39,252	874,927.08	0.21
72	600068	葛洲坝	76,976	865,210.24	0.21
73	000568	泸州老窖	16,926	856,117.08	0.21

74	600196	复星医药	27,521	852,875.79	0.21
75	603288	海天味业	20,800	848,224.00	0.21
76	601933	永辉超市	116,400	824,112.00	0.20
77	002594	比亚迪	16,408	819,579.60	0.20
78	600741	华域汽车	33,588	814,173.12	0.20
79	600886	国投电力	102,876	812,720.40	0.20
80	601336	新华保险	15,800	812,120.00	0.20
81	600066	宇通客车	36,919	811,110.43	0.20
82	002142	宁波银行	41,492	800,795.60	0.20
83	002008	大族激光	22,641	784,284.24	0.19
84	600637	东方明珠	36,118	782,677.06	0.19
85	000839	中信国安	77,400	773,226.00	0.19
86	600958	东方证券	55,200	767,832.00	0.19
87	000625	长安汽车	53,152	766,451.84	0.19
88	601607	上海医药	26,366	761,450.08	0.19
89	600010	包钢股份	346,306	758,410.14	0.19
90	002475	立讯精密	25,905	757,462.20	0.19
91	601857	中国石油	98,400	756,696.00	0.19
92	000069	华侨城 A	74,950	753,997.00	0.19
93	601600	中国铝业	166,686	753,420.72	0.18
94	600340	华夏幸福	22,352	750,580.16	0.18
95	600487	亨通光电	26,700	748,935.00	0.18
96	600029	南方航空	85,300	742,110.00	0.18
97	601669	中国电建	92,900	735,768.00	0.18
98	000338	潍柴动力	55,200	728,640.00	0.18
99	000413	东旭光电	64,100	719,202.00	0.18
100	600406	国电南瑞	40,691	718,196.15	0.18
101	000783	长江证券	75,734	717,200.98	0.18
102	601788	光大证券	47,600	710,668.00	0.17
103	600109	国金证券	59,600	698,512.00	0.17
104	600705	中航资本	122,636	692,893.40	0.17
105	002673	西部证券	48,232	685,859.04	0.17
106	601628	中国人寿	25,400	685,292.00	0.17
107	002202	金风科技	44,087	682,025.89	0.17
108	601618	中国中冶	135,742	680,067.42	0.17
109	600535	天士力	16,283	676,395.82	0.17
110	600100	同方股份	47,448	669,965.76	0.16
111	601099	太平洋	165,860	666,757.20	0.16
112	000100	TCL 集团	193,800	664,734.00	0.16
113	600816	安信信托	48,502	659,142.18	0.16
114	002460	赣锋锂业	13,900	642,875.00	0.16
115	002572	索菲亚	15,500	635,500.00	0.16
116	600383	金地集团	54,974	630,551.78	0.15

117	600739	辽宁成大	34,861	628,543.83	0.15
118	600111	北方稀土	55,227	625,721.91	0.15
119	002508	老板电器	14,380	625,242.40	0.15
120	601888	中国国旅	20,736	624,983.04	0.15
121	000768	中航飞机	33,760	622,534.40	0.15
122	600570	恒生电子	13,225	617,343.00	0.15
123	600522	中天科技	51,138	616,212.90	0.15
124	601555	东吴证券	54,753	614,876.19	0.15
125	600153	建发股份	47,435	613,334.55	0.15
126	600352	浙江龙盛	64,200	611,826.00	0.15
127	600804	鹏博士	34,400	610,600.00	0.15
128	000623	吉林敖东	26,590	608,645.10	0.15
129	000895	双汇发展	24,950	592,562.50	0.15
130	000963	华东医药	11,894	591,131.80	0.15
131	600085	同仁堂	16,537	578,133.52	0.14
132	601012	隆基股份	33,700	576,270.00	0.14
133	600547	山东黄金	19,765	571,801.45	0.14
134	600867	通化东宝	31,280	570,547.20	0.14
135	600893	航发动力	20,772	567,075.60	0.14
136	600221	海航控股	174,900	563,178.00	0.14
137	002739	万达电影	10,900	555,573.00	0.14
138	600177	雅戈尔	54,460	551,135.20	0.14
139	000656	金科股份	83,700	547,398.00	0.13
140	002310	东方园林	32,650	545,908.00	0.13
141	600176	中国巨石	49,232	540,567.36	0.13
142	600820	隧道股份	52,600	531,260.00	0.13
143	000402	金融街	45,300	530,916.00	0.13
144	600219	南山铝业	156,250	529,687.50	0.13
145	600208	新湖中宝	117,400	528,300.00	0.13
146	600489	中金黄金	52,548	527,056.44	0.13
147	600674	川投能源	53,664	526,980.48	0.13
148	000661	长春高新	4,060	524,186.60	0.13
149	600271	航天信息	25,300	522,192.00	0.13
150	002085	万丰奥威	26,844	522,115.80	0.13
151	002065	东华软件	23,733	517,142.07	0.13
152	002007	华兰生物	14,167	517,095.50	0.13
153	000157	中联重科	114,500	514,105.00	0.13
154	600115	东方航空	74,376	505,756.80	0.12
155	600079	人福医药	25,776	505,725.12	0.12
156	600118	中国卫星	18,127	504,655.68	0.12
157	002271	东方雨虹	13,548	502,630.80	0.12
158	600201	生物股份	14,102	501,608.14	0.12
159	000630	铜陵有色	175,990	499,811.60	0.12

160	002252	上海莱士	24,631	498,531.44	0.12
161	000793	华闻传媒	49,091	496,800.92	0.12
162	000540	中天金融	71,350	495,882.50	0.12
163	002340	格林美	81,908	495,543.40	0.12
164	002736	国信证券	37,303	494,264.75	0.12
165	002465	海格通信	45,848	492,407.52	0.12
166	603799	华友钴业	8,100	492,318.00	0.12
167	600018	上港集团	77,500	491,350.00	0.12
168	600027	华电国际	99,900	482,517.00	0.12
169	600369	西南证券	85,700	480,777.00	0.12
170	600415	小商品城	66,400	480,736.00	0.12
171	601727	上海电气	62,800	475,396.00	0.12
172	000709	河钢股份	112,623	471,890.37	0.12
173	601229	上海银行	18,400	469,936.00	0.12
174	000998	隆平高科	21,200	466,824.00	0.11
175	000066	中国长城	51,722	466,015.22	0.11
176	000826	启迪桑德	13,050	458,316.00	0.11
177	000060	中金岭南	40,384	452,300.80	0.11
178	600023	浙能电力	82,700	451,542.00	0.11
179	601018	宁波港	79,913	451,508.45	0.11
180	000009	中国宝安	55,543	449,342.87	0.11
181	600110	诺德股份	31,600	445,244.00	0.11
182	601155	新城控股	23,900	443,106.00	0.11
183	600879	航天电子	49,998	439,482.42	0.11
184	002044	美年健康	25,800	438,600.00	0.11
185	601238	广汽集团	16,800	437,808.00	0.11
186	000728	国元证券	35,800	437,476.00	0.11
187	600315	上海家化	13,460	436,777.00	0.11
188	600682	南京新百	11,800	435,420.00	0.11
189	600332	白云山	14,937	433,770.48	0.11
190	600008	首创股份	65,900	433,622.00	0.11
191	600362	江西铜业	25,364	427,637.04	0.10
192	000997	新大陆	18,820	427,025.80	0.10
193	002405	四维图新	21,600	426,816.00	0.10
194	600643	爱建集团	28,263	423,379.74	0.10
195	000750	国海证券	76,900	422,950.00	0.10
196	000503	海虹控股	16,962	422,862.66	0.10
197	600266	北京城建	28,800	418,752.00	0.10
198	000039	中集集团	23,171	417,773.13	0.10
199	600718	东软集团	26,555	412,930.25	0.10
200	600516	方大炭素	29,000	412,380.00	0.10
201	000778	新兴铸管	61,244	410,334.80	0.10
202	601992	金隅股份	63,402	410,210.94	0.10

203	600297	广汇汽车	54,430	409,857.90	0.10
204	600157	永泰能源	113,580	405,480.60	0.10
205	600584	长电科技	25,128	403,304.40	0.10
206	000559	万向钱潮	37,796	401,393.52	0.10
207	000050	深天马 A	19,400	399,058.00	0.10
208	000581	威孚高科	15,386	398,497.40	0.10
209	000425	徐工机械	106,200	398,250.00	0.10
210	603993	洛阳钼业	78,700	398,222.00	0.10
211	002081	金螳螂	36,155	396,981.90	0.10
212	601800	中国交建	24,900	395,661.00	0.10
213	600642	申能股份	62,770	395,451.00	0.10
214	600895	张江高科	23,400	394,992.00	0.10
215	600170	上海建工	102,929	393,188.78	0.10
216	000786	北新建材	24,804	392,895.36	0.10
217	002146	荣盛发展	39,742	392,253.54	0.10
218	000686	东北证券	38,975	391,698.75	0.10
219	600436	片仔癀	6,397	390,472.88	0.10
220	601333	广深铁路	85,800	387,816.00	0.10
221	600839	四川长虹	106,200	384,444.00	0.09
222	600388	龙净环保	24,750	384,367.50	0.09
223	601111	中国国航	39,300	383,175.00	0.09
224	002074	国轩高科	12,100	381,755.00	0.09
225	600150	中国船舶	16,646	380,694.02	0.09
226	600426	华鲁恒升	32,384	380,188.16	0.09
227	000415	渤海金控	56,400	379,572.00	0.09
228	002092	中泰化学	29,594	375,843.80	0.09
229	601258	庞大集团	133,100	372,680.00	0.09
230	002500	山西证券	38,800	371,704.00	0.09
231	000876	新希望	45,000	369,900.00	0.09
232	601919	中远海控	68,800	368,080.00	0.09
233	000917	电广传媒	32,470	366,911.00	0.09
234	601168	西部矿业	47,569	365,805.61	0.09
235	600978	宜华生活	36,300	364,815.00	0.09
236	600959	江苏有线	34,510	364,770.70	0.09
237	600649	城投控股	34,631	363,971.81	0.09
238	600498	烽火通信	14,300	362,505.00	0.09
239	601198	东兴证券	21,000	362,040.00	0.09
240	600256	广汇能源	87,178	360,916.92	0.09
241	002050	三花智控	22,066	360,117.12	0.09
242	600872	中炬高新	19,600	358,680.00	0.09
243	600525	长园集团	26,380	358,504.20	0.09
244	002183	怡亚通	41,500	358,145.00	0.09
245	600827	百联股份	21,908	356,005.00	0.09

246	000792	盐湖股份	33,958	354,861.10	0.09
247	600663	陆家嘴	14,840	350,817.60	0.09
248	600061	国投安信	22,400	348,320.00	0.09
249	600138	中青旅	16,538	348,290.28	0.09
250	600166	福田汽车	122,600	348,184.00	0.09
251	002311	海大集团	19,020	347,495.40	0.09
252	600497	驰宏锌锗	53,000	347,150.00	0.09
253	600588	用友网络	20,119	344,437.28	0.08
254	002129	中环股份	41,300	341,551.00	0.08
255	002179	中航光电	10,918	340,532.42	0.08
256	002038	双鹭药业	11,677	340,384.55	0.08
257	600056	中国医药	13,100	339,945.00	0.08
258	002294	信立泰	9,526	339,697.16	0.08
259	000887	中鼎股份	15,370	339,523.30	0.08
260	002407	多氟多	15,400	338,646.00	0.08
261	000983	西山煤电	38,475	337,425.75	0.08
262	600482	中国动力	13,300	336,357.00	0.08
263	600583	海油工程	53,818	335,824.32	0.08
264	600521	华海药业	15,881	334,136.24	0.08
265	600074	保千里	26,000	333,060.00	0.08
266	000028	国药一致	4,108	332,337.20	0.08
267	002185	华天科技	45,864	332,055.36	0.08
268	600011	华能国际	45,000	330,300.00	0.08
269	600291	西水股份	15,000	330,000.00	0.08
270	600038	中直股份	7,200	329,544.00	0.08
271	002422	科伦药业	19,944	329,474.88	0.08
272	600919	江苏银行	35,100	326,079.00	0.08
273	002384	东山精密	13,200	326,040.00	0.08
274	002555	三七互娱	12,700	324,739.00	0.08
275	600699	均胜电子	10,100	324,109.00	0.08
276	600252	中恒集团	79,800	322,392.00	0.08
277	600528	中铁工业	22,501	321,539.29	0.08
278	002195	二三四五	44,810	320,391.50	0.08
279	601998	中信银行	50,700	318,903.00	0.08
280	600977	中国电影	16,900	316,368.00	0.08
281	002004	华邦健康	40,367	316,073.61	0.08
282	600161	天坛生物	8,140	315,913.40	0.08
283	000977	浪潮信息	18,200	315,224.00	0.08
284	600751	天海投资	55,300	314,657.00	0.08
285	600376	首开股份	27,500	314,600.00	0.08
286	000878	云南铜业	23,805	313,987.95	0.08
287	601117	中国化学	44,900	313,851.00	0.08
288	601216	君正集团	64,094	313,419.66	0.08

289	000970	中科三环	21,200	313,336.00	0.08
290	002385	大北农	49,777	313,097.33	0.08
291	000008	神州高铁	42,700	310,856.00	0.08
292	600158	中体产业	18,177	310,826.70	0.08
293	000598	兴蓉环境	55,000	309,100.00	0.08
294	600666	奥瑞德	17,760	309,024.00	0.08
295	600485	信威集团	21,100	307,849.00	0.08
296	600037	歌华有线	21,100	307,216.00	0.08
297	000488	晨鸣纸业	23,806	307,097.40	0.08
298	600614	鹏起科技	27,800	305,800.00	0.08
299	601098	中南传媒	16,396	305,621.44	0.08
300	002573	清新环境	16,200	304,884.00	0.07
301	600755	厦门国贸	33,300	303,696.00	0.07
302	000400	许继电气	16,892	303,380.32	0.07
303	600635	大众公用	55,645	303,265.25	0.07
304	600060	海信电器	19,900	301,883.00	0.07
305	002583	海能达	18,700	300,883.00	0.07
306	600673	东阳光科	41,080	299,473.20	0.07
307	600298	安琪酵母	11,500	297,505.00	0.07
308	002426	胜利精密	38,600	296,448.00	0.07
309	600325	华发股份	35,500	296,425.00	0.07
310	600373	中文传媒	12,600	296,226.00	0.07
311	600875	东方电气	30,800	295,064.00	0.07
312	600688	上海石化	44,600	294,806.00	0.07
313	600435	北方导航	20,600	294,786.00	0.07
314	002273	水晶光电	14,250	293,977.50	0.07
315	000938	紫光股份	4,800	293,376.00	0.07
316	002601	龙蟠佰利	17,900	293,202.00	0.07
317	002223	鱼跃医疗	12,362	292,732.16	0.07
318	002280	联络互动	26,800	291,584.00	0.07
319	002030	达安基因	13,371	291,354.09	0.07
320	601718	际华集团	33,100	290,949.00	0.07
321	002509	天广中茂	31,600	290,720.00	0.07
322	002108	沧州明珠	21,690	289,561.50	0.07
323	600503	华丽家族	41,800	288,838.00	0.07
324	002410	广联达	15,359	288,749.20	0.07
325	600606	绿地控股	36,900	288,558.00	0.07
326	600409	三友化工	28,500	286,995.00	0.07
327	000671	阳光城	49,165	286,140.30	0.07
328	002470	金正大	38,000	286,140.00	0.07
329	600704	物产中大	39,120	285,184.80	0.07
330	002217	合力泰	28,800	284,544.00	0.07
331	002051	中工国际	13,704	284,083.92	0.07

332	600868	梅雁吉祥	58,200	284,016.00	0.07
333	603589	口子窖	7,300	283,167.00	0.07
334	600549	厦门钨业	13,173	283,087.77	0.07
335	000999	华润三九	8,900	282,575.00	0.07
336	600967	内蒙一机	20,700	282,141.00	0.07
337	600884	杉杉股份	17,100	281,637.00	0.07
338	002366	台海核电	6,000	281,460.00	0.07
339	002131	利欧股份	85,550	281,459.50	0.07
340	002439	启明星辰	15,100	280,860.00	0.07
341	002019	亿帆医药	16,800	280,224.00	0.07
342	002138	顺络电子	15,000	278,700.00	0.07
343	000046	泛海控股	31,750	277,177.50	0.07
344	000960	锡业股份	20,355	277,031.55	0.07
345	600418	江淮汽车	26,229	276,715.95	0.07
346	600809	山西汾酒	7,953	275,889.57	0.07
347	600022	山东钢铁	133,920	275,875.20	0.07
348	600143	金发科技	45,700	275,571.00	0.07
349	600567	山鹰纸业	76,800	274,944.00	0.07
350	600021	上海电力	22,700	274,443.00	0.07
351	002219	恒康医疗	22,780	274,271.20	0.07
352	600998	九州通	12,700	273,812.00	0.07
353	601997	贵阳银行	17,300	273,513.00	0.07
354	600307	酒钢宏兴	95,900	273,315.00	0.07
355	600122	宏图高科	24,600	273,060.00	0.07
356	002408	齐翔腾达	24,600	272,568.00	0.07
357	000738	航发控制	13,900	272,023.00	0.07
358	000566	海南海药	20,500	271,830.00	0.07
359	002359	齐星铁塔	6,900	270,825.00	0.07
360	600633	浙数文化	14,000	270,480.00	0.07
361	002491	通鼎互联	20,100	270,144.00	0.07
362	002075	沙钢股份	16,700	269,204.00	0.07
363	000078	海王生物	44,550	268,636.50	0.07
364	601633	长城汽车	20,192	268,351.68	0.07
365	000825	太钢不锈	61,200	266,220.00	0.07
366	002411	必康股份	9,200	266,064.00	0.07
367	600909	华安证券	26,300	265,367.00	0.07
368	000979	中弘股份	101,250	265,275.00	0.07
369	600737	中粮糖业	28,100	265,264.00	0.07
370	000089	深圳机场	28,300	264,605.00	0.06
371	601179	中国西电	47,300	262,988.00	0.06
372	600600	青岛啤酒	7,486	262,758.60	0.06
373	000627	天茂集团	32,500	262,600.00	0.06
374	601877	正泰电器	13,020	261,571.80	0.06

375	600777	新潮能源	68,460	261,517.20	0.06
376	000988	华工科技	17,900	261,161.00	0.06
377	600004	白云机场	14,100	260,286.00	0.06
378	601866	中远海发	72,200	259,920.00	0.06
379	002001	新 和 成	13,373	259,569.93	0.06
380	600312	平高电气	18,878	259,383.72	0.06
381	600808	马钢股份	73,265	259,358.10	0.06
382	600885	宏发股份	6,500	259,285.00	0.06
383	002400	省广股份	32,175	258,365.25	0.06
384	000820	神雾节能	6,800	258,264.00	0.06
385	600811	东方集团	39,600	258,192.00	0.06
386	000930	中粮生化	23,900	257,642.00	0.06
387	600594	益佰制药	16,874	257,497.24	0.06
388	600499	科达洁能	32,408	257,319.52	0.06
389	600717	天津港	20,600	257,294.00	0.06
390	002078	太阳纸业	35,000	257,250.00	0.06
391	002603	以岭药业	14,700	256,662.00	0.06
392	601872	招商轮船	49,645	256,168.20	0.06
393	601200	上海环境	9,569	255,396.61	0.06
394	601000	唐山港	48,900	255,258.00	0.06
395	600511	国药股份	7,028	254,694.72	0.06
396	601801	皖新传媒	18,400	254,288.00	0.06
397	000758	中色股份	36,200	253,762.00	0.06
398	601588	北辰实业	40,900	253,580.00	0.06
399	000806	银河生物	18,700	252,450.00	0.06
400	000401	冀东水泥	16,400	252,396.00	0.06
401	000513	丽珠集团	3,706	252,378.60	0.06
402	601699	潞安环能	32,260	252,273.20	0.06
403	600125	铁龙物流	28,032	251,166.72	0.06
404	600655	豫园商城	22,100	250,172.00	0.06
405	002635	安洁科技	6,900	249,918.00	0.06
406	002174	游族网络	7,800	247,728.00	0.06
407	000697	炼石有色	12,100	247,687.00	0.06
408	603019	中科曙光	8,800	247,632.00	0.06
409	600446	金证股份	13,981	245,785.98	0.06
410	600477	杭萧钢构	16,100	245,686.00	0.06
411	002191	劲嘉股份	26,212	245,344.32	0.06
412	000059	华锦股份	24,500	245,245.00	0.06
413	600797	浙大网新	19,700	244,083.00	0.06
414	002424	贵州百灵	12,936	243,972.96	0.06
415	600711	盛屯矿业	36,700	243,688.00	0.06
416	601375	中原证券	24,200	243,452.00	0.06
417	600881	亚泰集团	47,900	243,332.00	0.06

418	002221	东华能源	22,300	243,293.00	0.06
419	600500	中化国际	25,400	242,824.00	0.06
420	600598	北大荒	21,800	242,198.00	0.06
421	600062	华润双鹤	8,800	241,384.00	0.06
422	000816	智慧农业	32,400	241,056.00	0.06
423	600572	康恩贝	34,650	239,778.00	0.06
424	600478	科力远	27,730	238,755.30	0.06
425	000006	深振业 A	26,974	237,640.94	0.06
426	600240	华业资本	26,191	237,290.46	0.06
427	002714	牧原股份	8,700	236,814.00	0.06
428	002176	江特电机	27,100	236,312.00	0.06
429	002640	跨境通	11,100	235,875.00	0.06
430	000516	国际医学	42,300	235,611.00	0.06
431	600856	中天能源	20,900	235,334.00	0.06
432	002292	奥飞娱乐	13,900	234,910.00	0.06
433	600970	中材国际	27,000	234,630.00	0.06
434	600160	巨化股份	19,500	234,585.00	0.06
435	603766	隆鑫通用	32,200	234,416.00	0.06
436	600172	黄河旋风	28,420	233,896.60	0.06
437	002477	雏鹰农牧	52,700	233,461.00	0.06
438	002501	利源精制	20,500	233,085.00	0.06
439	002431	棕榈股份	21,150	233,073.00	0.06
440	600372	中航电子	13,400	232,758.00	0.06
441	002353	杰瑞股份	14,700	232,554.00	0.06
442	000729	燕京啤酒	34,606	232,552.32	0.06
443	600694	大商股份	5,927	230,975.19	0.06
444	600874	创业环保	11,800	230,926.00	0.06
445	002701	奥瑞金	36,104	230,704.56	0.06
446	002444	巨星科技	14,800	230,584.00	0.06
447	000807	云铝股份	31,800	229,596.00	0.06
448	000031	中粮地产	30,489	229,582.17	0.06
449	000547	航天发展	21,900	228,855.00	0.06
450	002602	世纪华通	6,300	228,438.00	0.06
451	000800	一汽轿车	22,446	228,275.82	0.06
452	600550	保变电气	21,200	228,112.00	0.06
453	600282	南钢股份	60,900	225,939.00	0.06
454	002127	南极电商	18,700	225,896.00	0.06
455	600601	方正科技	60,700	225,804.00	0.06
456	000959	首钢股份	32,300	225,777.00	0.06
457	600715	文投控股	10,000	225,600.00	0.06
458	600565	迪马股份	40,900	225,359.00	0.06
459	002049	紫光国芯	7,306	225,170.92	0.06
460	000418	小天鹅 A	4,800	224,592.00	0.06

461	600393	粤泰股份	31,000	224,440.00	0.06
462	000712	锦龙股份	13,710	224,432.70	0.06
463	002028	思源电气	14,000	223,160.00	0.05
464	600026	中远海能	33,600	222,768.00	0.05
465	000829	天音控股	20,600	222,480.00	0.05
466	600380	健康元	24,500	222,460.00	0.05
467	002522	浙江众成	13,600	222,360.00	0.05
468	600120	浙江东方	8,200	220,416.00	0.05
469	600392	盛和资源	16,700	220,273.00	0.05
470	600622	嘉宝集团	13,520	220,105.60	0.05
471	600320	振华重工	42,465	219,968.70	0.05
472	600771	广誉远	5,500	219,725.00	0.05
473	002343	慈文传媒	5,800	219,588.00	0.05
474	600151	航天机电	26,500	218,095.00	0.05
475	002250	联化科技	15,238	217,903.40	0.05
476	600200	江苏吴中	16,500	217,800.00	0.05
477	002152	广电运通	26,100	216,891.00	0.05
478	000158	常山股份	13,700	216,460.00	0.05
479	600183	生益科技	17,500	215,950.00	0.05
480	002595	豪迈科技	9,700	215,631.00	0.05
481	600863	内蒙华电	71,500	215,215.00	0.05
482	600064	南京高科	14,200	214,420.00	0.05
483	600210	紫江企业	34,900	214,286.00	0.05
484	002589	瑞康医药	13,880	213,752.00	0.05
485	000592	平潭发展	38,700	213,624.00	0.05
486	000898	鞍钢股份	37,735	213,580.10	0.05
487	000939	凯迪生态	41,850	213,435.00	0.05
488	002013	中航机电	20,527	212,043.91	0.05
489	600490	鹏欣资源	26,800	211,988.00	0.05
490	600787	中储股份	26,800	211,988.00	0.05
491	600654	*ST 中安	15,700	211,636.00	0.05
492	002262	恩华药业	13,984	211,577.92	0.05
493	600039	四川路桥	50,846	211,519.36	0.05
494	601880	大连港	71,430	211,432.80	0.05
495	601231	环旭电子	13,400	210,514.00	0.05
496	600759	洲际油气	34,580	209,554.80	0.05
497	002032	苏泊尔	5,100	209,355.00	0.05
498	600410	华胜天成	23,560	208,741.60	0.05
499	601991	大唐发电	46,100	208,372.00	0.05
500	000860	顺鑫农业	10,330	206,703.30	0.05
501	000012	南玻 A	22,100	206,193.00	0.05
502	002266	浙富控股	42,180	205,838.40	0.05
503	600198	大唐电信	16,103	205,635.31	0.05

504	002022	科华生物	11,838	205,626.06	0.05
505	002643	万润股份	13,900	205,164.00	0.05
506	600687	刚泰控股	15,900	204,792.00	0.05
507	002389	南洋科技	9,700	204,282.00	0.05
508	002390	信邦制药	23,450	204,249.50	0.05
509	600067	冠城大通	29,700	204,039.00	0.05
510	600664	哈药股份	35,109	203,983.29	0.05
511	000027	深圳能源	30,292	203,865.16	0.05
512	600685	中船防务	7,432	203,488.16	0.05
513	601118	海南橡胶	35,800	203,344.00	0.05
514	000563	陕国投 A	39,308	203,222.36	0.05
515	002002	鸿达兴业	25,771	201,786.93	0.05
516	002261	拓维信息	17,200	201,412.00	0.05
517	000600	建投能源	16,400	201,228.00	0.05
518	002299	圣农发展	13,500	200,745.00	0.05
519	002462	嘉事堂	5,100	200,379.00	0.05
520	000666	经纬纺机	8,800	200,112.00	0.05
521	000937	冀中能源	32,629	199,689.48	0.05
522	600348	阳泉煤业	29,400	199,332.00	0.05
523	000883	湖北能源	39,700	199,294.00	0.05
524	002434	万里扬	12,500	199,000.00	0.05
525	600086	东方金钰	18,400	198,904.00	0.05
526	600416	湘电股份	14,500	198,650.00	0.05
527	601898	中煤能源	33,700	198,156.00	0.05
528	000690	宝新能源	33,100	197,938.00	0.05
529	002672	东江环保	11,700	197,613.00	0.05
530	002517	恺英网络	5,600	197,064.00	0.05
531	600316	洪都航空	12,225	196,455.75	0.05
532	002268	卫士通	11,660	196,121.20	0.05
533	000727	华东科技	69,300	196,119.00	0.05
534	002665	首航节能	27,220	195,984.00	0.05
535	000587	金洲慈航	13,100	195,190.00	0.05
536	002155	湖南黄金	20,329	194,548.53	0.05
537	600566	济川药业	5,100	193,953.00	0.05
538	000687	华讯方舟	12,800	193,792.00	0.05
539	002368	太极股份	6,997	193,746.93	0.05
540	000732	泰禾集团	11,600	193,488.00	0.05
541	000021	深科技	22,500	193,050.00	0.05
542	000921	海信科龙	11,200	192,752.00	0.05
543	600108	亚盛集团	44,700	192,657.00	0.05
544	600597	光明乳业	15,060	192,015.00	0.05
545	000766	通化金马	12,000	191,760.00	0.05
546	002018	华信国际	27,980	191,663.00	0.05

547	600728	佳都科技	24,720	191,332.80	0.05
548	601928	凤凰传媒	19,600	191,296.00	0.05
549	002281	光迅科技	8,600	191,092.00	0.05
550	002249	大洋电机	29,000	190,820.00	0.05
551	600017	日照港	42,400	190,800.00	0.05
552	002489	浙江永强	29,900	190,762.00	0.05
553	601611	中国核建	15,900	190,323.00	0.05
554	600557	康缘药业	11,436	189,951.96	0.05
555	000519	中兵红箭	15,073	189,919.80	0.05
556	000718	苏宁环球	32,370	189,688.20	0.05
557	600343	航天动力	10,929	189,508.86	0.05
558	600267	海正药业	16,162	188,772.16	0.05
559	600645	中源协和	8,801	188,605.43	0.05
560	600094	大名城	24,500	187,915.00	0.05
561	603077	和邦生物	36,900	187,821.00	0.05
562	000901	航天科技	6,900	187,404.00	0.05
563	600226	瀚叶股份	21,200	187,196.00	0.05
564	002308	威创股份	14,300	186,615.00	0.05
565	600269	赣粤高速	35,800	186,518.00	0.05
566	002354	天神娱乐	8,660	186,190.00	0.05
567	600611	大众交通	33,677	185,897.04	0.05
568	600491	龙元建设	17,300	185,629.00	0.05
569	000088	盐田港	17,660	185,606.60	0.05
570	002373	千方科技	13,600	185,504.00	0.05
571	600495	晋西车轴	26,060	183,723.00	0.05
572	000961	中南建设	28,150	183,538.00	0.05
573	600366	宁波韵升	10,400	183,456.00	0.05
574	002375	亚厦股份	20,557	183,162.87	0.04
575	601717	郑煤机	23,500	183,065.00	0.04
576	002153	石基信息	8,037	182,681.01	0.04
577	600169	太原重工	47,261	182,427.46	0.04
578	002421	达实智能	29,800	182,376.00	0.04
579	600634	富控互动	10,100	182,103.00	0.04
580	000667	美好置业	55,000	182,050.00	0.04
581	600835	上海机电	8,600	181,804.00	0.04
582	002440	闰土股份	11,900	181,594.00	0.04
583	600765	中航重机	13,161	181,358.58	0.04
584	600562	国睿科技	6,585	181,350.90	0.04
585	600270	外运发展	9,566	181,084.38	0.04
586	601636	旗滨集团	40,100	180,851.00	0.04
587	002023	海特高新	17,600	180,752.00	0.04
588	600667	太极实业	25,900	180,523.00	0.04
589	600652	游久游戏	16,500	180,180.00	0.04

590	002544	杰赛科技	7,900	180,120.00	0.04
591	600277	亿利洁能	22,900	179,307.00	0.04
592	000528	柳 工	20,700	178,848.00	0.04
593	600146	商赢环球	5,000	178,650.00	0.04
594	000703	恒逸石化	12,500	178,000.00	0.04
595	000543	皖能电力	30,400	177,232.00	0.04
596	600750	江中药业	5,100	177,225.00	0.04
597	601958	金钼股份	24,694	177,055.98	0.04
598	600255	鑫科材料	43,800	176,952.00	0.04
599	600391	航发科技	6,600	176,682.00	0.04
600	600575	皖江物流	42,000	176,400.00	0.04
601	002285	世联行	21,960	176,119.20	0.04
602	002276	万马股份	17,400	175,566.00	0.04
603	002302	西部建设	7,900	175,143.00	0.04
604	002326	永太科技	12,600	174,636.00	0.04
605	600582	天地科技	38,000	174,420.00	0.04
606	000777	中核科技	8,700	173,652.00	0.04
607	600069	银鸽投资	19,000	173,470.00	0.04
608	002117	东港股份	6,700	173,396.00	0.04
609	000596	古井贡酒	3,400	173,230.00	0.04
610	000685	中山公用	15,800	173,010.00	0.04
611	002055	得润电子	7,600	172,748.00	0.04
612	600568	中珠医疗	9,000	172,440.00	0.04
613	000501	鄂武商 A	9,330	172,231.80	0.04
614	002372	伟星新材	9,200	171,856.00	0.04
615	002570	贝因美	12,600	171,360.00	0.04
616	002437	誉衡药业	23,500	171,080.00	0.04
617	601666	平煤股份	32,400	170,748.00	0.04
618	002312	*ST 三泰	25,025	170,670.50	0.04
619	002089	新 海 宜	25,100	169,927.00	0.04
620	002056	横店东磁	22,600	169,500.00	0.04
621	600729	重庆百货	6,300	169,092.00	0.04
622	601608	中信重工	30,500	168,970.00	0.04
623	002709	天赐材料	4,100	168,797.00	0.04
624	600076	康欣新材	18,800	168,636.00	0.04
625	000751	锌业股份	34,300	168,413.00	0.04
626	600072	中船科技	10,000	168,200.00	0.04
627	600259	广晟有色	4,304	168,028.16	0.04
628	000975	银泰资源	13,300	167,979.00	0.04
629	002399	海普瑞	8,302	167,949.46	0.04
630	600823	世茂股份	34,274	167,942.60	0.04
631	600273	嘉化能源	17,900	167,902.00	0.04
632	000016	深康佳 A	34,300	167,727.00	0.04

633	002047	宝鹰股份	19,400	167,616.00	0.04
634	603188	亚邦股份	9,600	167,424.00	0.04
635	600466	蓝光发展	19,400	167,422.00	0.04
636	002503	搜于特	23,800	167,314.00	0.04
637	000615	京汉股份	12,100	167,101.00	0.04
638	002542	中化岩土	13,800	166,842.00	0.04
639	601021	春秋航空	4,956	166,670.28	0.04
640	600175	美都能源	38,300	166,605.00	0.04
641	000882	华联股份	46,000	166,060.00	0.04
642	600098	广州发展	20,881	165,168.71	0.04
643	000875	吉电股份	32,700	165,135.00	0.04
644	600807	天业股份	17,500	165,025.00	0.04
645	000620	新华联	23,200	164,952.00	0.04
646	000591	太阳能	32,080	164,891.20	0.04
647	002445	中南文化	12,800	164,480.00	0.04
648	600422	昆药集团	14,500	164,430.00	0.04
649	601929	吉视传媒	47,500	164,350.00	0.04
650	600770	综艺股份	21,910	164,325.00	0.04
651	601890	亚星锚链	18,900	164,241.00	0.04
652	002244	滨江集团	23,700	164,004.00	0.04
653	601966	玲珑轮胎	7,300	163,739.00	0.04
654	000848	承德露露	16,389	163,562.22	0.04
655	600073	上海梅林	17,100	163,305.00	0.04
656	600428	中远海特	26,200	162,964.00	0.04
657	002642	荣之联	6,500	162,890.00	0.04
658	600745	中茵股份	8,700	162,777.00	0.04
659	000090	天健集团	14,640	162,504.00	0.04
660	002025	航天电器	6,500	162,175.00	0.04
661	601011	宝泰隆	25,200	162,036.00	0.04
662	000902	新洋丰	18,000	162,000.00	0.04
663	002358	森源电气	9,500	161,690.00	0.04
664	600986	科达股份	11,900	161,364.00	0.04
665	002325	洪涛股份	22,080	161,184.00	0.04
666	600399	抚顺特钢	25,750	160,680.00	0.04
667	601163	三角轮胎	6,100	160,430.00	0.04
668	600033	福建高速	42,100	160,401.00	0.04
669	002036	联创电子	9,700	160,050.00	0.04
670	002011	盾安环境	14,100	160,035.00	0.04
671	002512	达华智能	9,900	159,885.00	0.04
672	001696	宗申动力	21,100	159,727.00	0.04
673	000650	仁和药业	26,700	159,666.00	0.04
674	600216	浙江医药	16,100	159,551.00	0.04
675	002130	沃尔核材	24,800	159,464.00	0.04

676	601233	桐昆股份	11,500	159,390.00	0.04
677	600648	外高桥	8,581	158,920.12	0.04
678	002396	星网锐捷	8,200	158,670.00	0.04
679	600284	浦东建设	14,800	158,656.00	0.04
680	603000	人民网	11,972	157,671.24	0.04
681	000061	农产品	17,400	157,644.00	0.04
682	603678	火炬电子	5,650	157,239.50	0.04
683	002151	北斗星通	5,600	156,520.00	0.04
684	603588	高能环境	10,000	156,000.00	0.04
685	000652	泰达股份	29,335	155,475.50	0.04
686	600330	天通股份	17,700	155,406.00	0.04
687	600155	宝硕股份	10,500	155,190.00	0.04
688	601777	力帆股份	19,300	155,172.00	0.04
689	000426	兴业矿业	17,100	154,242.00	0.04
690	601689	拓普集团	4,600	154,054.00	0.04
691	002657	中科金财	5,300	153,647.00	0.04
692	002707	众信旅游	11,700	153,621.00	0.04
693	000601	韶能股份	21,500	153,295.00	0.04
694	002210	飞马国际	8,880	152,469.60	0.04
695	002547	春兴精工	14,000	152,460.00	0.04
696	000881	中广核技	8,000	152,400.00	0.04
697	002180	纳思达	6,300	152,208.00	0.04
698	002156	通富微电	14,900	151,682.00	0.04
699	000958	东方能源	18,700	151,096.00	0.04
700	600323	瀚蓝环境	10,400	150,904.00	0.04
701	002413	雷科防务	13,460	150,752.00	0.04
702	601311	骆驼股份	10,600	150,096.00	0.04
703	600185	格力地产	22,100	150,059.00	0.04
704	000541	佛山照明	16,420	149,586.20	0.04
705	002429	兆驰股份	48,630	149,294.10	0.04
706	000801	四川九洲	15,600	149,292.00	0.04
707	600577	精达股份	31,100	149,280.00	0.04
708	000062	深圳华强	5,600	148,568.00	0.04
709	002073	软控股份	17,487	148,289.76	0.04
710	002064	华峰氨纶	30,700	147,974.00	0.04
711	000733	振华科技	9,300	147,870.00	0.04
712	600123	兰花科创	19,300	147,066.00	0.04
713	002237	恒邦股份	14,000	146,860.00	0.04
714	000034	神州数码	6,000	146,700.00	0.04
715	600171	上海贝岭	14,400	146,448.00	0.04
716	002479	富春环保	12,300	146,370.00	0.04
717	002122	天马股份	14,200	146,260.00	0.04
718	600261	阳光照明	22,200	145,854.00	0.04

719	000918	嘉凯城	19,400	145,694.00	0.04
720	000928	中钢国际	15,400	145,684.00	0.04
721	600536	中国软件	7,593	145,481.88	0.04
722	002581	未名医药	7,100	145,195.00	0.04
723	002622	融钰集团	11,800	145,140.00	0.04
724	002190	成飞集成	5,400	144,720.00	0.04
725	000726	鲁泰 A	12,200	144,692.00	0.04
726	600006	东风汽车	24,700	144,495.00	0.04
727	002005	德豪润达	30,237	144,230.49	0.04
728	600206	有研新材	16,600	144,088.00	0.04
729	600587	新华医疗	8,093	143,893.54	0.04
730	600662	强生控股	17,917	143,873.51	0.04
731	600058	五矿发展	11,580	143,707.80	0.04
732	600053	九鼎投资	4,100	143,336.00	0.04
733	600651	飞乐音响	16,900	143,143.00	0.04
734	600736	苏州高新	20,200	142,814.00	0.04
735	002663	普邦股份	26,296	142,787.28	0.04
736	600517	置信电气	18,800	142,316.00	0.03
737	600458	时代新材	12,413	142,128.85	0.03
738	600851	海欣股份	15,800	141,884.00	0.03
739	603444	吉比特	500	141,665.00	0.03
740	002563	森马服饰	16,700	141,616.00	0.03
741	600329	中新药业	7,812	141,475.32	0.03
742	002506	协鑫集成	30,800	141,372.00	0.03
743	600639	浦东金桥	7,800	141,336.00	0.03
744	601016	节能风电	38,400	141,312.00	0.03
745	601222	林洋能源	19,000	141,170.00	0.03
746	000935	四川双马	6,100	140,666.00	0.03
747	600057	象屿股份	13,800	140,346.00	0.03
748	002428	云南锗业	13,100	139,908.00	0.03
749	600855	航天长峰	6,600	139,788.00	0.03
750	603111	康尼机电	11,450	139,690.00	0.03
751	002242	九阳股份	7,100	139,657.00	0.03
752	600020	中原高速	27,600	139,104.00	0.03
753	600763	通策医疗	5,500	137,995.00	0.03
754	600289	亿阳信通	12,600	137,844.00	0.03
755	600773	西藏城投	12,400	137,268.00	0.03
756	600612	老凤祥	2,800	137,116.00	0.03
757	000969	安泰科技	15,700	137,061.00	0.03
758	600331	宏达股份	25,100	137,046.00	0.03
759	000040	东旭蓝天	10,400	136,760.00	0.03
760	600317	营口港	39,832	136,623.76	0.03
761	000558	莱茵体育	17,900	136,040.00	0.03

762	600812	华北制药	22,700	135,973.00	0.03
763	000150	宜华健康	5,600	135,912.00	0.03
764	002329	皇氏集团	14,100	135,501.00	0.03
765	600754	锦江股份	5,000	135,500.00	0.03
766	002505	大康农业	38,660	135,310.00	0.03
767	600873	梅花生物	23,800	134,946.00	0.03
768	002636	金安国纪	7,800	134,706.00	0.03
769	002680	长生生物	8,800	134,552.00	0.03
770	600783	鲁信创投	7,900	134,537.00	0.03
771	603888	新华网	4,150	134,418.50	0.03
772	600859	王府井	8,306	134,141.90	0.03
773	002128	露天煤业	15,400	133,980.00	0.03
774	600400	红豆股份	19,450	133,816.00	0.03
775	000065	北方国际	5,600	133,168.00	0.03
776	600438	通威股份	23,700	132,246.00	0.03
777	002283	天润曲轴	20,600	131,840.00	0.03
778	002433	太安堂	14,200	131,350.00	0.03
779	002099	海翔药业	19,700	131,202.00	0.03
780	600880	博瑞传播	19,889	129,875.17	0.03
781	002498	汉缆股份	35,400	129,564.00	0.03
782	000572	海马汽车	25,000	129,250.00	0.03
783	600701	工大高新	11,600	129,224.00	0.03
784	002482	广田集团	14,300	128,557.00	0.03
785	000982	*ST 中绒	25,900	128,464.00	0.03
786	002550	千红制药	21,600	128,304.00	0.03
787	002345	潮宏基	11,800	128,266.00	0.03
788	000156	华数传媒	8,600	128,226.00	0.03
789	600337	美克家居	22,690	128,198.50	0.03
790	002161	远望谷	15,800	127,980.00	0.03
791	600595	中孚实业	26,500	127,730.00	0.03
792	000739	普洛药业	17,400	127,716.00	0.03
793	002610	爱康科技	52,300	127,612.00	0.03
794	002481	双塔食品	19,100	127,397.00	0.03
795	002303	美盈森	16,500	127,380.00	0.03
796	000989	九芝堂	6,700	127,032.00	0.03
797	002418	康盛股份	13,600	126,616.00	0.03
798	600292	远达环保	11,730	126,449.40	0.03
799	002318	久立特材	15,450	126,381.00	0.03
800	002203	海亮股份	15,500	126,170.00	0.03
801	002367	康力电梯	10,800	126,144.00	0.03
802	600280	中央商场	15,800	125,294.00	0.03
803	002070	*ST 众和	12,300	125,091.00	0.03
804	600862	中航高科	12,900	125,001.00	0.03

805	002041	登海种业	9,385	124,351.25	0.03
806	600653	申华控股	37,900	123,554.00	0.03
807	002284	亚太股份	11,100	123,210.00	0.03
808	600894	广日股份	10,400	123,136.00	0.03
809	002029	七匹狼	12,812	122,610.84	0.03
810	000555	神州信息	7,300	121,910.00	0.03
811	600748	上实发展	16,850	121,320.00	0.03
812	600580	卧龙电气	17,669	120,502.58	0.03
813	002371	北方华创	5,000	119,600.00	0.03
814	601010	文峰股份	28,300	119,143.00	0.03
815	002215	诺普信	14,000	118,440.00	0.03
816	600481	双良节能	22,300	118,413.00	0.03
817	600433	冠豪高新	21,416	118,216.32	0.03
818	002721	金一文化	7,900	117,947.00	0.03
819	002123	梦网荣信	10,400	115,544.00	0.03
820	002658	雪迪龙	6,500	115,375.00	0.03
821	002269	美邦服饰	30,900	115,257.00	0.03
822	002095	生意宝	3,300	114,048.00	0.03
823	002251	步步高	9,200	113,988.00	0.03
824	600869	智慧能源	16,900	113,737.00	0.03
825	000662	天夏智慧	7,100	113,600.00	0.03
826	000802	北京文化	7,800	113,568.00	0.03
827	000767	漳泽电力	33,100	113,533.00	0.03
828	600896	览海投资	13,400	113,498.00	0.03
829	000861	海印股份	30,900	113,403.00	0.03
830	002157	正邦科技	24,700	112,385.00	0.03
831	600395	盘江股份	15,200	111,416.00	0.03
832	600757	长江传媒	14,900	111,303.00	0.03
833	002681	奋达科技	8,800	110,792.00	0.03
834	000676	智度股份	7,400	110,778.00	0.03
835	600686	金龙汽车	8,300	110,390.00	0.03
836	002309	中利集团	8,800	110,088.00	0.03
837	601127	小康股份	5,500	109,725.00	0.03
838	600300	维维股份	20,500	109,470.00	0.03
839	600180	瑞茂通	7,733	108,571.32	0.03
840	600103	青山纸业	27,200	108,256.00	0.03
841	002298	中电鑫龙	9,900	107,613.00	0.03
842	600826	兰生股份	5,900	106,790.00	0.03
843	002488	金固股份	9,200	106,444.00	0.03
844	002414	高德红外	5,800	106,140.00	0.03
845	601001	大同煤业	20,100	105,525.00	0.03
846	002364	中恒电气	7,700	105,413.00	0.03
847	600096	云天化	14,200	105,080.00	0.03

848	002416	爱施德	9,700	104,663.00	0.03
849	002239	奥特佳	24,140	104,526.20	0.03
850	000626	远大控股	5,600	104,160.00	0.03
851	002631	德尔未来	7,000	103,110.00	0.03
852	600139	西部资源	12,300	102,213.00	0.03
853	600825	新华传媒	14,400	102,096.00	0.03
854	000681	视觉中国	6,500	101,790.00	0.02
855	002690	美亚光电	5,244	100,579.92	0.02
856	601369	陕鼓动力	15,068	99,750.16	0.02
857	002344	海宁皮城	11,884	98,874.88	0.02
858	600650	锦江投资	5,500	98,670.00	0.02
859	000869	张裕 A	2,645	98,394.00	0.02
860	600640	号百控股	5,799	98,003.10	0.02
861	002588	史丹利	12,600	96,894.00	0.02
862	002699	美盛文化	7,000	96,600.00	0.02
863	000815	美利云	7,400	96,348.00	0.02
864	000810	创维数字	7,900	95,827.00	0.02
865	002093	国脉科技	10,700	94,160.00	0.02
866	600775	南京熊猫	9,200	94,024.00	0.02
867	600726	华电能源	20,900	93,632.00	0.02
868	002256	兆新股份	21,200	93,068.00	0.02
869	000607	华媒控股	12,300	92,988.00	0.02
870	600676	交运股份	12,400	92,380.00	0.02
871	002527	新时达	8,500	90,355.00	0.02
872	601908	京运通	18,200	87,360.00	0.02
873	002653	海思科	6,624	86,178.24	0.02
874	002698	博实股份	7,300	85,921.00	0.02
875	000550	江铃汽车	4,125	85,387.50	0.02
876	002519	银河电子	10,370	81,611.90	0.02
877	000838	财信发展	9,600	63,264.00	0.02
878	603801	志邦股份	1,406	47,522.80	0.01
879	603043	广州酒家	1,810	45,738.70	0.01
880	300666	江丰电子	2,276	43,448.84	0.01
881	603326	我乐家居	1,452	40,612.44	0.01
882	603335	迪生力	2,230	24,864.50	0.01
883	002879	长缆科技	1,313	23,660.26	0.01
884	002881	美格智能	989	22,608.54	0.01
885	603679	华体科技	809	21,438.50	0.01
886	603938	三孚股份	1,246	20,932.80	0.01
887	002882	金龙羽	2,966	18,389.20	0.00
888	603933	睿能科技	857	17,311.40	0.00
889	603305	旭升股份	1,351	15,212.26	0.00
890	300669	沪宁股份	841	14,650.22	0.00

891	300670	大烨智能	1,259	13,760.87	0.00
892	300672	国科微	1,257	10,659.36	0.00
893	002638	勤上股份	1,200	9,768.00	0.00
894	603331	百达精工	999	9,620.37	0.00
895	300671	富满电子	942	7,639.62	0.00
896	603617	君禾股份	832	7,429.76	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	601166	兴业银行	1,605,984.00	0.49
2	000333	美的集团	1,388,762.00	0.42
3	601318	中国平安	1,247,749.10	0.38
4	000651	格力电器	999,814.00	0.30
5	000002	万科 A	990,190.40	0.30
6	600036	招商银行	826,255.00	0.25
7	000858	五粮液	751,983.00	0.23
8	603288	海天味业	740,183.75	0.22
9	600016	民生银行	706,672.00	0.21
10	601328	交通银行	680,466.00	0.21
11	600519	贵州茅台	677,881.00	0.21
12	600000	浦发银行	634,117.00	0.19
13	000725	京东方 A	555,446.00	0.17
14	002415	海康威视	501,897.00	0.15
15	000066	中国长城	487,951.03	0.15
16	600019	宝钢股份	481,219.28	0.15
17	600030	中信证券	453,152.00	0.14
18	000001	平安银行	421,160.00	0.13
19	601668	中国建筑	420,050.00	0.13
20	002304	洋河股份	418,382.26	0.13

注：“买入金额”按买入成交金额（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	600016	民生银行	1,367,635.00	0.42
2	000651	格力电器	1,292,706.94	0.39
3	601288	农业银行	592,301.00	0.18
4	000066	中国长城	427,524.00	0.13

5	000002	万 科 A	410,234.61	0.12
6	000748	长城信息	363,792.72	0.11
7	600005	武钢股份	353,815.28	0.11
8	600015	华夏银行	331,892.00	0.10
9	000333	美的集团	294,852.97	0.09
10	600996	贵广网络	258,250.00	0.08
11	603986	兆易创新	248,655.00	0.08
12	000538	云南白药	236,242.00	0.07
13	601818	光大银行	230,725.00	0.07
14	600276	恒瑞医药	229,064.00	0.07
15	601200	上海环境	222,962.00	0.07
16	601375	中原证券	215,678.35	0.07
17	601169	北京银行	213,481.00	0.06
18	300616	尚品宅配	205,264.20	0.06
19	000725	京东方 A	195,284.00	0.06
20	601228	广州港	194,370.00	0.06

注：“卖出金额”按卖出成交金额（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	83,108,743.37
卖出股票的收入（成交）总额	40,130,415.83

注：“买入股票成本”、“卖出股票收入”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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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。

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

代码	名称	持仓量	合约市值	公允价值变动	风险说明
IF1707	沪深 300 股指期货 IF1707 合约	15	16,413,300.00	591,600.00	买入股指期货多头合约的目的是进行更有效地流动性管理。
IC1707	中证 500 股指期货 IC1707 合约	4	4,882,400.00	125,080.00	买入股指期货多头合约的目的是进行更有效地流动性管理。
IC1709	中证 500 股指期货 IC1709 合约	2	2,408,720.00	28,600.00	买入股指期货多头合约的目的是进行更有效地流动性管理。
公允价值变动总额合计					745,280.00
股指期货投资本期收益					989,440.00
股指期货投资本期公允价值变动					865,260.00

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金为指数型基金，主要投资标的为指数成份股和备选成份股。基金留存的现金头寸根据基金合同规定，投资于基础资产与标的指数相关性较高的股指期货组合，旨在配合基金日常投资管理需要，更有效地进行流动性管理，以更好地跟踪标的指数，实现投资目标。

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

本基金本报告期末无国债期货投资。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货投资。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 2017 年 5 月 24 日中信证券收到了中国证券监督管理委员会下发的《行政处罚事先告知书》。

本基金为指数型基金，采取完全复制策略，中信证券系标的指数成份股，该股票的投资决策程序符合相关法律法规的要求。

7.12.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

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	4,776,187.27
2	应收证券清算款	280,836.17

3	应收股利	-
4	应收利息	10,477.39
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,067,500.83

7.12.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§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		华夏 MSCI 中国 A 股 ETF 联接	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
4,488	84,113.91	92,806,937.00	24.58%	185,373,227.00	49.11%	99,323,083.00	26.31%

8.2 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	中邮创业基金—华夏银行—华夏银行股份有限公司	30,412,312.00	8.98%
2	厦门市担保有限公司	5,500,000.00	1.62%
3	安英慧	5,038,800.00	1.49%
4	张凯风	3,618,600.00	1.07%
5	蒋化民	3,500,000.00	1.03%
6	田雪芝	3,153,600.00	0.93%
7	曹茂秋	2,622,800.00	0.77%
8	深圳博普科技有限公司	2,410,000.00	0.71%
9	易方达资产管理(香港)有限公司—客户资金(交易所)	2,315,200.00	0.68%

10	金怡	2,156,500.00	0.64%
11	中国银行股份有限公司—MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金联接基金	99,323,083.00	29.34%

8.3 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	-	-

8.4 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

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015年2月12日）基金份额总额	4,136,570,680
本报告期期初基金份额总额	333,515,418
本报告期基金总申购份额	73,987,829
减：本报告期基金总赎回份额	30,000,000
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	377,503,247

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

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

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金所聘用的会计师事务所未发生改变。

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

本基金管理人、基金托管人涉及托管业务的部门及其高级管理人员在本报告期内未受到任何处分。

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	
国泰君安证券	4	79,710,437.22	67.70%	10,467.40	67.71%	-
中国银河证券	5	38,027,784.47	32.30%	4,992.03	32.29%	-

注：①为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即：

i 经营行为规范，在近一年内无重大违规行为。

ii 公司财务状况良好。

iii 有良好的内控制度，在业内有良好的声誉。

iv 有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告。

v 建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯和服务。

②券商专用交易单元选择程序：

i 对交易单元候选券商的研究服务进行评估

本基金管理人组织相关人员依据交易单元选择标准对交易单元候选券商的服务质量和研究实力进行评估，确定选用交易单元的券商。

ii 协议签署及通知托管人

本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

③除本表列示外，本基金还选择了东方证券、高华证券、国信证券、海通证券、华泰证券、瑞银证券、申万宏源证券、太平洋证券、天风证券、西部证券、兴业证券、招商证券、中金公司、中信建投证券、中信证券、中银国际证券、万和证券的交易单元作为本基金交易单元，本报告期无股

票交易及应付佣金。

④在上述租用的券商交易单元中，太平洋证券、天风证券和万和证券的交易单元为本基金本期新增的交易单元。本期没有剔除的券商交易单元。

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	
	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
国泰君安证券	275,030.70	100.00%	90,000,000.00	100.00%
中国银河证券	-	-	-	-

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	华夏基金管理有限公司关于旗下基金认购关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2017-03-20
2	华夏基金管理有限公司关于新增华夏快线交易型货币市场基金、MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金申购赎回代办证券公司的公告	中国证监会指定报刊及网站	2017-06-02
3	华夏基金管理有限公司关于青岛分公司营业场所变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2017-06-03

§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
华夏 MSCI 中国 A 股 ETF 联接	1	2017-01-01 至 2017-06-30	93,172,883.00	13,983,800.00	7,833,600.00	99,323,083.00	26.31%
产品特有风险							

本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额20%的情形，在市场流动性不足的情况下，如遇投资者巨额赎回或集中赎回，基金管理人可能无法以合理的价格及时变现基金资产，有可能对基金净值产生一定的影响，甚至可能引发基金的流动性风险。在特定情况下，若持有基金份额占比较高的投资者大量赎回本基金，可能导致在其赎回后本基金资产规模持续低于5000万元，面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

12.1.1 中国证监会准予基金注册的文件；

12.1.2 《MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；

12.1.3 《MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；

12.1.4 法律意见书；

12.1.5 基金管理人业务资格批件、营业执照；

12.1.6 基金托管人业务资格批件、营业执照。

12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

12.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的住所免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

华夏基金管理有限公司

二〇一七年八月二十六日