

# 平安大华行业先锋混合型证券投资基金 2017 年年度报告 摘要

2017 年 12 月 31 日

基金管理人：平安大华基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2018 年 3 月 29 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 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

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。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	平安大华行业先锋混合
场内简称	-
基金主代码	700001
前端交易代码	-
后端交易代码	-
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 9 月 20 日
基金管理人	平安大华基金管理有限公司
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	241, 233, 514. 27 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	-
上市日期	-

### 2.2 基金产品说明

投资目标	深入研究中国宏观经济、证券市场发展过程中的结构性和趋势性规律，把握不同行业在此变化趋势中可行的投资机会，以超越业绩比较基准表现为首要投资目标，并以追求基金资产的长期稳健回报为最终投资目标。
投资策略	本基金通过深入研究中国宏观经济、证券市场发展过程中的结构性和趋势性规律，全面准确地判断大类资产风险程度和收益前景，把握不同行业在此变化趋势中可行的投资机会。同时，重点围绕有效结合宏观研究、行业研究、量化研究和个股研究成果，转化为基金资产中长期的资本增值成果，并采用有效的风险控制措施增加投资组合收益的确定性。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率 × 85% + 中证全债指数收益率 × 15%
风险收益特征	本基金为混合型基金，预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于证券投资基金中的中高风险和中高预期收益产品。

## 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		平安大华基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈特正	王永民
	联系电话	0755-22626828	010-66594896
	电子邮箱	fundservice@pingan.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-800-4800	95566
传真		0755-23997878	010-66594942

## 2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.fund.pingan.com">http://www.fund.pingan.com</a>
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人住所

## § 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	6,042,847.74	-126,503,097.78	256,066,180.96
本期利润	8,340,874.85	-179,286,907.85	281,685,588.66
加权平均基金份额本期利润	0.0311	-0.5729	0.6926
本期基金份额净值增长率	3.00%	-33.86%	39.51%
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	0.1694	0.1349	0.7159
期末基金资产净值	282,107,282.08	332,507,999.84	533,584,697.98
期末基金份额净值	1.169	1.135	1.716

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. 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，而非当期发生数）；

3. 上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。

## 3.2 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

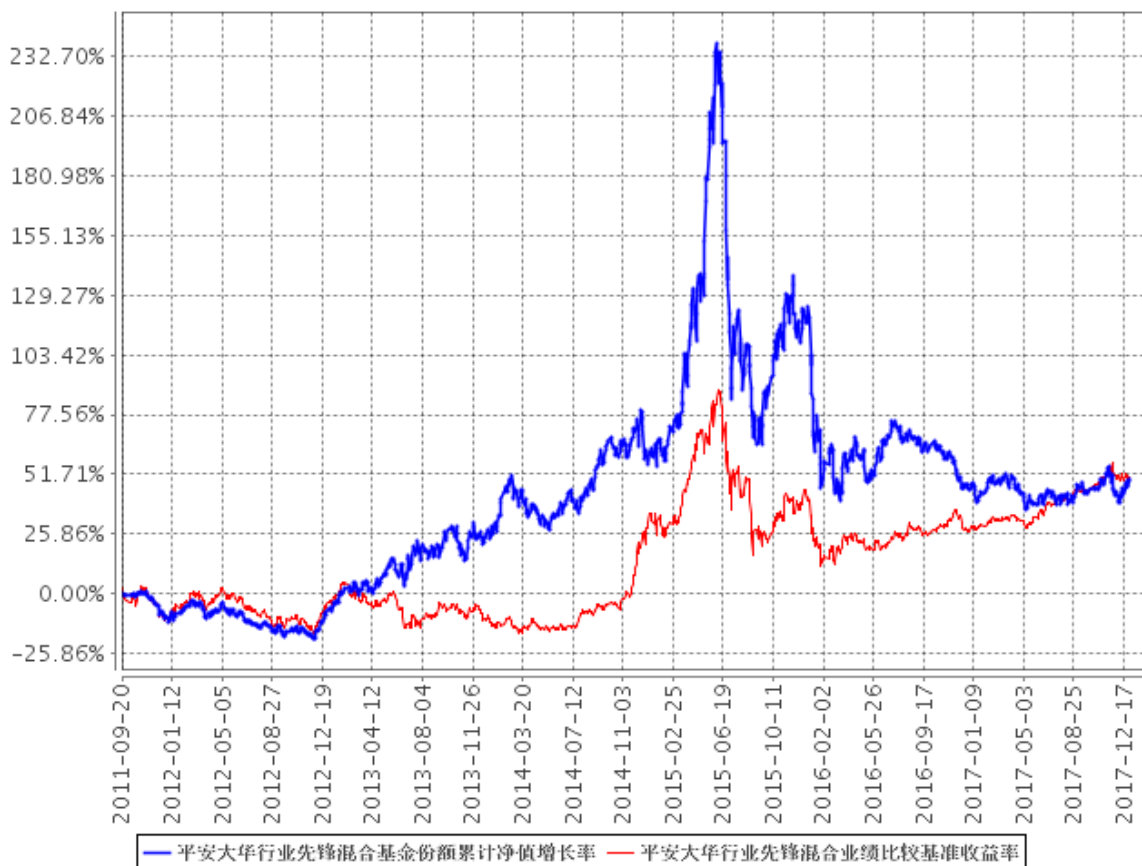
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	3.27%	1.13%	4.21%	0.68%	-0.94%	0.45%
过去六个月	3.63%	1.03%	8.40%	0.59%	-4.77%	0.44%
过去一年	3.00%	0.96%	18.24%	0.54%	-15.24%	0.42%
过去三年	-4.96%	2.06%	15.08%	1.43%	-20.04%	0.63%
过去五年	60.23%	1.84%	56.19%	1.31%	4.04%	0.53%
自基金合同生效起至今	49.66%	1.69%	50.87%	1.28%	-1.21%	0.41%

注：1、业绩比较基准：沪深 300 指数收益率×85% + 中证全债指数收益率×15%。沪深 300 指数的成分股样本选自沪、深两个证券市场，覆盖了沪深市场 60%左右的市值，是中国 A 股市场中代表性强、流动性高、可投资性大的股票组合，能够反映 A 股市场总体发展趋势。中证全债指数从沪深交易所和银行间市场挑选国债、金融债及企业债组成样本券，最大限度地涵盖了我国固定收益市场可供投资的产品，已成为广受投资者认可的投资中国固定收益市场的基准指标。本基金为混合型基金，通常状况下基金在运作过程中股票资产将在 80%-90%范围内调整，中长期可能的股票仓位平均在 85%左右。权益类资产和固定收益类资产对应的业绩比较基准的权重分别是 85%和 15%。因此，该基准是衡量本基金投资业绩的理想基准。

2、本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

### 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

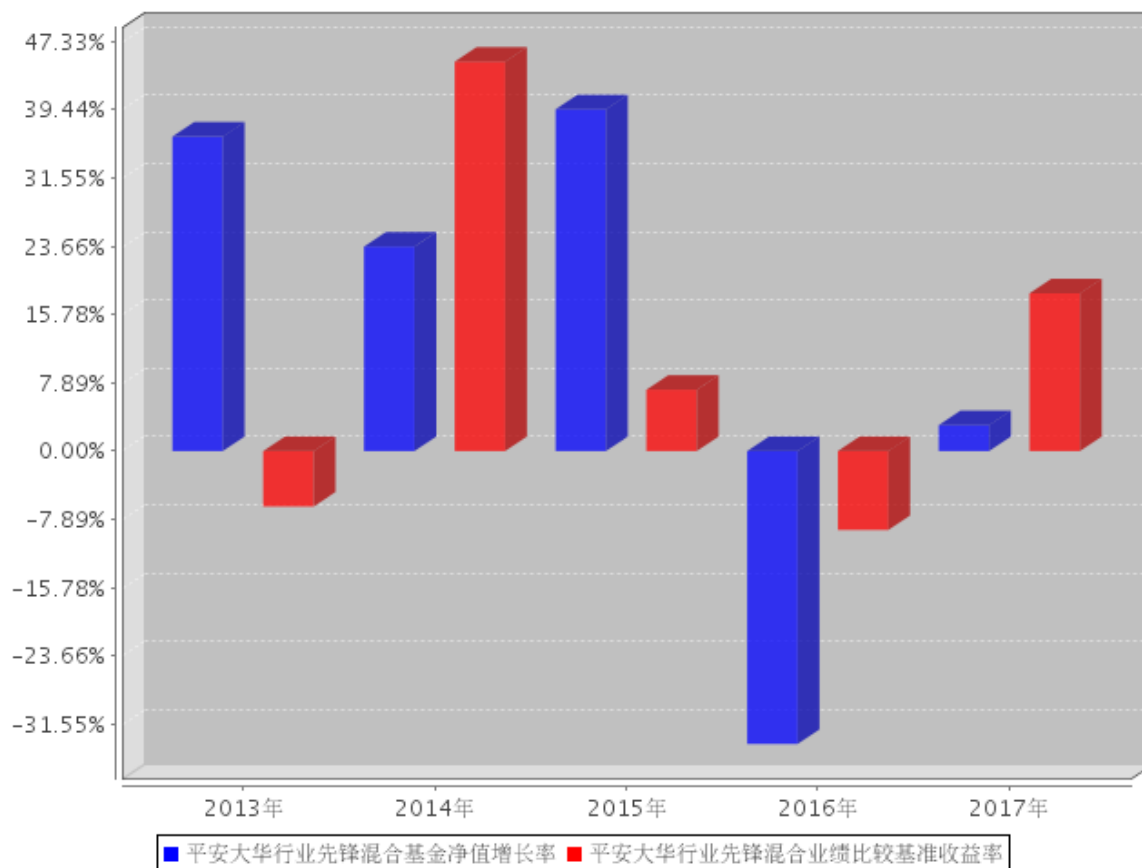
### 平安大华行业先锋混合基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



- 1、本基金基金合同于 2011 年 9 月 20 日正式生效，截至报告期末已满六年；
- 2、按照本基金的基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定，截至报告期末本基金已完成建仓，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

### 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

平安大华行业先锋混合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对比图



- 1、本基金基金合同于 2011 年 9 月 20 日正式生效，截至报告期末已满六年；
- 2、2011 年是合同生效当年，按实际续存期计算，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

无。

## § 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

平安大华基金管理有限公司（以下简称“平安基金”）经中国证监会证监许可【2010】1917 号文批准设立。平安基金总部位于深圳，注册资本金为 3 亿元人民币，是目前中国内地基金业注册资本金最高的基金公司之一。目前公司股东为平安信托有限责任公司，持有股权 60.7%；新加坡大华资产管理有限公司，持有股权 25%；三亚盈湾旅业有限公司，持有股权 14.3%。

平安基金秉承“规范、诚信、专业、创新”企业管理理念，致力于通过持续稳定的投资业绩，不断丰富客户服务手段及服务内容，为投资人提供多样化的基金产品和高品质的理财服务，从而实现“以专业承载信赖”的品牌承诺，成为深得投资人信赖的基金管理公司。截至 2017 年 12 月 31 日，平安基金共管理 46 只公募基金，资产管理总规模 1795 亿元。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

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		
傅浩	平安大华行业先锋混合证券投资基金的基金经理	2016 年 8 月 16 日	-	9	傅浩先生，中山大学金融学硕士，9 年证券从业经验，曾任国都证券有限责任公司行业研究员、广发证券资产管理（广东）有限公司投资经理，2016 年 5 月加入平安大华基金管理公司，任投资研究部投资经理，现任平安大华行业先锋混合型证券投资基金、平安大华智能生活灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决定确认的解聘日期；对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确认的聘任日期和解聘日期。

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遵规守信情况的说明

本报告期内，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》、《证券投资基金销售管理办法》和《证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、《平安大华行业先锋混合型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。



## 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

本报告期内，根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，本基金管理人严格遵守《平安大华基金管理有限责任公司公平交易管理制度》、《平安大华基金管理有限责任公司异常交易监控及报告制度》，严格执行法律法规及制度要求，从以下五个方面对交易行为进行严格控制：一是搭建平等的投资信息平台，合理设置各类资产管理业务之间以及各类资产管理业务内部的组织结构，在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时，确保其在获得投资信息、投资建议和实施投资决策等方面享有公平的机会。二是制定公平交易规则，建立科学的投资决策体系，加强交易执行环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。三是加强对投资交易行为的监察稽核力度，建立有效的异常交易行为日常监控和分析评估制度，通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。四是明确报告制度和路线，根据法规及公司内部要求，分别于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的投资业绩进行分析、评估，形成分析报告，由投资组合经理、督察长、总经理签署后，妥善保存备查，如果发现涉嫌违背公平交易原则的行为，及时向公司管理层汇报并采取相关控制和改进措施。五是建立投资组合投资信息的管理及保密制度，不同投资组合经理之间的持仓和交易等重大非公开投资信息相互隔离。

### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

本基金管理人按日内、3日内、5日内三个不同的时间窗口，对本基金管理人管理的全部投资组合在本报告期连续四个季度期间内的交易情况进行了同向交易价差分析，各投资组合交易过程中不存在显著的交易价差，不存在不公平交易的情况。

### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2017 年中国经济运行呈现稳健态势，国内货币环境在金融去杠杆背景下继续保持中性。在

供给侧改革、补库存等共同推动下，需求增长有所恢复，商品价格反弹，上游行业盈利预期明显改善，低估值蓝筹白马和周期股表现较为优异。

2017 年本基金的投资策略为：重点关注具备估值优势与业绩成长性的公司，在注重业绩稳健性与低估值品种的配置价值的同时，对于成长性较好估值回落至合理区间的成长股及基本面改善的周期股也采取了择机介入的投资策略，并根据宏观、行业及个股基本面变化，动态调整投资组合。持续买入基本面不错、业绩可持续、估值相对合理的公司，以及部分优质的成长板块龙头及基本面有望持续改善带来价值回归的低估值龙头蓝筹，如医药、家电、周期等行业，同时在市场波动过程中积极调整股票持仓结构。

#### 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 1.169 元，份额累计净值为 1.449 元。报告期内，本基金份额净值增长率为 3.00%，同期业绩基准增长率为 18.24%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认为在 2017 年基础上，2018 年中国经济将继续在保持平稳增速、改革稳步推进、金融环境稳健的大环境下运行。中国经济的内生动能将进一步释放，国际需求将逐步改善。虽然面临去年基数提升的压力，但综合判断未来宏观经济将继续表现良好。因此，我们认为 2018 年市场将继续呈现结构性行情，龙头公司盈利将继续改善、市场份额进一步提升。估值合理的标的，股价仍有望维持稳步上行趋势。而新兴行业中竞争力强、股票估值合理的公司，也将逐步具备投资价值。本基金将继续坚持价值加真成长的投资方向，寻找优质标的进行投资。

### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人坚持一切从规范运作、防范风险、保护基金份额持有人利益出发，严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，在进一步梳理完善内部控制制度和业务流程的同时，确保各项法规和管理制度的落实。公司法律合规监察部按照规定的权限和程序，通过合规评审、合规检视等各项合规管理措施以及实时监控、定期检查、专项检查等方法，对基金的投资运作、基金销售、基金运营、客户服务和信息披露等进行了重点监控与稽核，发现问题及时提出改进建议，并督促相关部门进行整改，同时定期向董事会和公司管理层出具监察稽核报告。公司重视对员工的合规培训，开展了多次培训活动，加强对员工行为的管理，增强员工合规意识。公司还通过网站、邮件等多种形式进行了投资者教育工作。报告期内，本基金管理人管理的基金运作合法合规，基金合同得到严格履行，有效保障了基金份额持有人利益。本基金管理人

将继续以风险控制为核心，提高监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金安全、合规运作。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人严格按照企业会计准则、《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的资产按照公允价值进行估值。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工作组，由投研部、运营部及法律合规监察部相关人员组成。估值工作组负责公司基金估值政策、程序及方法的制定和修订，负责定期审议公司估值政策、程序及方法的科学合理性，保证基金估值的公平、合理。估值工作组的相关人员均具有一定年限的专业从业经验，具有良好的专业能力，并能在相关工作中保持独立性。

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，由中央国债登记结算有限责任公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

报告期内本基金未进行利润分配，符合基金合同的约定。

#### 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内未出现连续 20 个工作日基金份额持有人数量不满 200 人、基金资产净值低于 5000 万的情形。

### § 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”）在对平安大华行业先锋混合型证券投资基金（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

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2018)第 22925 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	平安大华行业先锋混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了平安大华行业先锋混合基金 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。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了

	<p>我们在这些准则下的责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于平安大华行业先锋混合基金，并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	-
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>平安大华行业先锋混合基金的基金管理人平安大华基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估平安大华行业先锋混合基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算平安大华行业先锋混合基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督平安大华行业先锋混合基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的</p>

	<p>风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对平安大华行业先锋混合基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而未来的事项或情况可能导致平安大华行业先锋混合基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露)，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	曹翠丽   边晓红
会计师事务所的地址	上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼
审计报告日期	2018 年 3 月 27 日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：平安大华行业先锋混合型证券投资基金

报告截止日：2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末	上年度末
----	-----	-----	------

		2017 年 12 月 31 日	2016 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款		42,990,905.56	63,667,328.12
结算备付金		2,865,066.32	7,689,165.58
存出保证金		237,547.66	349,882.09
交易性金融资产		246,834,389.83	254,004,613.94
其中：股票投资		246,834,389.83	254,004,613.94
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		3,862,998.25	12,840,990.26
应收利息		7,155.32	11,280.19
应收股利		-	-
应收申购款		73,493.32	200,718.33
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		296,871,556.26	338,763,978.51
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2017 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2016 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债：</b>			
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		11,231,192.55	1,065,495.98
应付赎回款		419,065.26	123,303.26
应付管理人报酬		349,455.27	431,331.33
应付托管费		58,242.57	71,888.55
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		1,280,353.57	3,217,876.45
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		1,425,964.96	1,346,083.10
负债合计		14,764,274.18	6,255,978.67
<b>所有者权益：</b>			
实收基金		241,233,514.27	292,993,192.19
未分配利润		40,873,767.81	39,514,807.65
所有者权益合计		282,107,282.08	332,507,999.84

负债和所有者权益总计		296,871,556.26	338,763,978.51
------------	--	----------------	----------------

注：（1）报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.169 元，基金份额总额 241,233,514.27 份。

## 7.2 利润表

会计主体：平安大华行业先锋混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	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
<b>一、收入</b>		30,050,388.57	-159,567,350.92
1. 利息收入		409,588.53	510,821.28
其中：存款利息收入		359,073.46	487,212.05
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		50,515.07	23,609.23
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		27,320,932.24	-107,360,710.77
其中：股票投资收益		23,226,552.20	-108,921,951.79
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		4,094,380.04	1,561,241.02
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		2,298,027.11	-52,783,810.07
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）		21,840.69	66,348.64
<b>减：二、费用</b>		21,709,513.72	19,719,556.93
1. 管理人报酬	7.4.8.2.1	4,558,697.06	5,916,286.35
2. 托管费	7.4.8.2.2	759,782.86	986,047.70
3. 销售服务费	7.4.8.2.3	-	-
4. 交易费用		15,989,835.36	12,382,011.56
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用		401,198.44	435,211.32



三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		8,340,874.85	-179,286,907.85
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		8,340,874.85	-179,286,907.85

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：平安大华行业先锋混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	292,993,192.19	39,514,807.65	332,507,999.84
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	8,340,874.85	8,340,874.85
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）	-51,759,677.92	-6,981,914.69	-58,741,592.61
其中：1. 基金申购款	18,111,448.49	2,366,992.22	20,478,440.71
2. 基金赎回款	-69,871,126.41	-9,348,906.91	-79,220,033.32
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）	241,233,514.27	40,873,767.81	282,107,282.08
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）	310,965,843.57	222,618,854.41	533,584,697.98
二、本期经营活动产生的	-	-179,286,907.85	-179,286,907.85

基金净值变动数（本期净利润）			
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-17,972,651.38	-3,817,138.91	-21,789,790.29
其中：1. 基金申购款	63,115,263.94	16,947,776.18	80,063,040.12
2. 基金赎回款	-81,087,915.32	-20,764,915.09	-101,852,830.41
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）	292,993,192.19	39,514,807.65	332,507,999.84

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

_____ 罗春风	_____ 林婉文	_____ 胡明
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

平安大华行业先锋混合型证券投资基金(原名为平安大华行业先锋股票型证券投资基金,以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2011]1111号《关于核准平安大华行业先锋股票型证券投资基金募集的批复》的核准,由平安大华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《平安大华行业先锋股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币3,197,219,239.94元,经安永华明会计师事务所验证并出具安永华明(2011)验字第60937497\_H01号验资报告。经向中国证监会备案,《平安大华行业先锋股票型证券投资基金基金合同》于2011年9月20日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为3,198,155,247.37份基金份额,其中认购资金利息折合936,007.43份基金份额。本基金的基金管理人为平安大华基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司(以下简称“中国银行”)。

根据2014年中国证监会令第104号《公开募集证券投资基金运作管理办法》,平安大华行业先锋股票型证券投资基金于2015年8月5日公告后更名为平安大华行业先锋混合型证券投资

基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安大华行业先锋混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、中期票据、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。本基金投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例范围为 60%-95%，除股票外的其他资产占基金资产的比例范围为 5%-40%，其中权证投资比例不高于基金资产净值的 3%，在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金以及到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×85% + 中证全债指数收益率×15%。

#### 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》、《平安大华行业先锋股票型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

#### 7.4.4 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.4.1 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。

##### 7.4.4.2 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。

##### 7.4.4.3 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。

### 7.4.5 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。

### 7.4.6 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
平安大华基金管理有限公司(“平安大华”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国银行	基金托管人、基金销售机构
平安信托有限责任公司	基金管理人的股东
大华资产管理有限公司	基金管理人的股东
三亚盈湾旅业有限公司	基金管理人的股东
深圳平安大华汇通财富管理有限公司	基金管理人的子公司
平安证券股份有限公司(“平安证券”)	基金管理人的股东的子公司、基金销售机构
中国平安保险(集团)股份有限公司	基金管理人的最终控股母公司

上海陆金所基金销售有限公司	基金管理人最终控股母公司的联营公司、基金销售机构
平安银行股份有限公司	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 7.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 7.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 7.4.7.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年12月31日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例
平安证券	733,051,252.46	6.48%	767,175,235.38	9.00%

#### 7.4.7.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

#### 7.4.7.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

#### 7.4.7.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 7.4.7.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
平安证券	682,691.05	7.34%	22,250.27	1.74%
关联方名称	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例 (%)
平安证券	714,471.23	9.76%	118,189.80	3.67%

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记

结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。权证交易不计佣金。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

#### 7.4.7.2 关联方报酬

##### 7.4.7.2.1 基金管理费

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
当期发生的基金应支付的管理费	4,558,697.06	5,916,286.35
其中：支付销售机构的客户维护费	1,190,315.93	1,523,219.19

注：支付基金管理人平安大华的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50% 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：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.50% / 当年天数。

##### 7.4.7.2.2 基金托管费

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
当期发生的基金应支付的托管费	759,782.86	986,047.70

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 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

##### 7.4.7.2.3 销售服务费

本基金本报告期内及上年度可比期间均无销售服务费。

#### 7.4.7.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未发生与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 7.4.7.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.7.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未运用固有资金投资本基金。

#### 7.4.7.4.2 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

除基金管理人之外的其他关联方于本期末及上年度末均未持有本基金份额。

#### 7.4.7.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年12月31日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	42,990,905.56	273,294.61	63,667,328.12	420,332.85

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。

#### 7.4.7.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期及上年度可比期间均无参与关联方承销证券的情况。

#### 7.4.7.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间均无须作说明的其他关联交易事项。

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

##### 7.4.8.1 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

7.4.10.1.1 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
300664	鹏鹞环保	2017年12月28日	2018年1月5日	新股未上市	8.88	8.88	3,640	32,323.20	32,323.20	-
603161	科华控股	2017年12月28日	2018年1月5日	新股未上市	16.75	16.75	1,239	20,753.25	20,753.25	-
002923	润都股份	2017年12月28日	2018年1月5日	新股未上市	17.01	17.01	954	16,227.54	16,227.54	-
603080	新疆火炬	2017年12月25日	2018年1月3日	新股未上市	13.60	13.60	1,187	16,143.20	16,143.20	-

##### 7.4.8.2 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（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
601600	中国铝业	2017年9月12日	重大事项	6.67	2018年2月26日	7.28	1,568,500	11,882,607.30	10,461,895.00	-
300383	光环新网	2017年11月7日	重大事项	13.19	2018年3月19日	14.51	597,900	9,013,742.39	7,886,301.00	-
000540	中天金融	2017年8月21日	重大事项	7.35	-	-	8,300	65,699.00	61,005.00	-
300730	科创信息	2017年12月25日	重大事项	41.55	2018年1月2日	45.71	821	6,863.56	34,112.55	-
002919	名臣健康	2017年12月28日	重大事项	35.26	2018年1月2日	38.79	821	10,311.76	28,948.46	-

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。

### 7.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 7.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

### 7.4.9 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 228,276,680.63 元，属于第二层次的余额为 18,557,709.20 元，无属于第三层次的余额(2016 年 12 月 31 日：第一层次 253,573,619.10 元，第二层次 430,994.84 元，无属于第三层次的余额)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

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

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 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截至 2017 年 12 月 31 日止的财务状况和经营成果无影响。

(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	246,834,389.83	83.15
	其中：股票	246,834,389.83	83.15
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	45,855,971.88	15.45
8	其他各项资产	4,181,194.55	1.41
9	合计	296,871,556.26	100.00

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	8,575,305.20	3.04
B	采矿业	14,089,203.40	4.99
C	制造业	146,604,517.02	51.97

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,143.20	0.01
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	26,265,842.50	9.31
G	交通运输、仓储和邮政业	13,148,630.76	4.66
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	14,687,669.55	5.21
J	金融业	-	-
K	房地产业	61,005.00	0.02
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	11,379,139.20	4.03
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	12,006,934.00	4.26
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	246,834,389.83	87.50

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末无港股通投资股票。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600362	江西铜业	705,999	14,239,999.83	5.05
2	600388	龙净环保	812,610	14,058,153.00	4.98
3	600031	三一重工	1,453,000	13,178,710.00	4.67
4	601231	环旭电子	786,500	12,403,105.00	4.40
5	300347	泰格医药	341,300	12,006,934.00	4.26
6	000933	神火股份	1,141,500	11,586,225.00	4.11

7	002573	清新环境	499,200	11,346,816.00	4.02
8	600566	济川药业	286,440	10,927,686.00	3.87
9	601600	中国铝业	1,568,500	10,461,895.00	3.71
10	600859	王府井	512,243	10,449,757.20	3.70

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于管理人网站的年度报告正文。

## 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	600068	葛洲坝	78,739,632.51	23.68
2	603993	洛阳钼业	70,596,016.27	21.23
3	601668	中国建筑	67,814,243.14	20.39
4	601336	新华保险	67,459,384.66	20.29
5	601111	中国国航	65,196,931.92	19.61
6	600104	上汽集团	60,342,512.41	18.15
7	600153	建发股份	58,587,376.23	17.62
8	600019	宝钢股份	57,916,880.22	17.42
9	000651	格力电器	57,804,352.58	17.38
10	600029	南方航空	57,591,600.91	17.32
11	000333	美的集团	55,923,571.42	16.82
12	002456	欧菲科技	55,028,820.46	16.55
13	002573	清新环境	54,629,774.81	16.43
14	600585	海螺水泥	53,189,410.04	16.00
15	600690	青岛海尔	53,123,750.78	15.98
16	000049	德赛电池	52,696,723.39	15.85
17	600887	伊利股份	50,636,377.44	15.23
18	000858	五粮液	50,339,675.66	15.14
19	600884	杉杉股份	46,627,702.47	14.02
20	002475	立讯精密	46,129,317.41	13.87
21	000725	京东方A	44,784,240.00	13.47
22	601117	中国化学	44,633,275.93	13.42
23	000983	西山煤电	44,189,524.90	13.29

24	601800	中国交建	43,085,400.41	12.96
25	002241	歌尔股份	42,985,864.61	12.93
26	000709	河钢股份	42,941,735.72	12.91
27	600362	江西铜业	42,498,522.49	12.78
28	600036	招商银行	41,964,667.29	12.62
29	002271	东方雨虹	41,812,491.36	12.57
30	300136	信维通信	40,700,096.62	12.24
31	600276	恒瑞医药	39,146,893.00	11.77
32	000059	华锦股份	38,487,648.19	11.57
33	002616	长青集团	38,028,728.77	11.44
34	600507	方大特钢	37,912,304.14	11.40
35	000065	北方国际	37,888,363.53	11.39
36	600388	龙净环保	36,876,340.36	11.09
37	600547	山东黄金	36,458,655.19	10.96
38	000018	神州长城	36,361,161.47	10.94
39	002092	中泰化学	35,840,235.13	10.78
40	601186	中国铁建	35,678,192.08	10.73
41	001979	招商蛇口	34,059,459.22	10.24
42	600015	华夏银行	33,714,975.80	10.14
43	000998	隆平高科	31,913,734.48	9.60
44	601231	环旭电子	30,712,584.34	9.24
45	601600	中国铝业	30,378,715.00	9.14
46	002024	苏宁易购	29,720,477.00	8.94
47	600660	福耀玻璃	29,202,672.67	8.78
48	601699	潞安环能	28,034,983.70	8.43
49	002202	金风科技	28,021,652.63	8.43
50	000895	双汇发展	27,961,005.84	8.41
51	600240	华业资本	27,828,192.86	8.37
52	601225	陕西煤业	27,567,123.68	8.29
53	600703	三安光电	27,314,681.14	8.21
54	000069	华侨城A	27,301,526.28	8.21
55	000921	海信科龙	27,281,689.29	8.20
56	601398	工商银行	26,929,763.00	8.10
57	002108	沧州明珠	26,595,155.98	8.00
58	300450	先导智能	26,583,123.70	7.99
59	002236	大华股份	26,455,866.33	7.96

60	601939	建设银行	26,065,554.00	7.84
61	300323	华灿光电	25,362,761.73	7.63
62	000980	众泰汽车	25,329,474.09	7.62
63	601933	永辉超市	25,144,630.71	7.56
64	000090	天健集团	25,087,459.41	7.54
65	000910	大亚圣象	24,746,581.66	7.44
66	600859	王府井	24,557,093.27	7.39
67	600963	岳阳林纸	24,499,179.52	7.37
68	300237	美晨生态	24,286,410.27	7.30
69	000418	小天鹅A	24,283,996.58	7.30
70	002294	信立泰	24,130,415.60	7.26
71	603288	海天味业	23,730,334.25	7.14
72	601233	桐昆股份	23,697,817.28	7.13
73	000789	万年青	23,539,518.68	7.08
74	000002	万科A	23,268,311.09	7.00
75	002273	水晶光电	22,973,872.29	6.91
76	000050	深天马A	22,966,501.21	6.91
77	600352	浙江龙盛	22,703,272.10	6.83
78	601689	拓普集团	22,499,322.75	6.77
79	601155	新城控股	22,313,847.27	6.71
80	600348	阳泉煤业	22,121,109.00	6.65
81	600297	广汇汽车	21,750,143.10	6.54
82	600567	山鹰纸业	21,651,219.00	6.51
83	601222	林洋能源	21,415,425.10	6.44
84	002511	中顺洁柔	21,296,610.18	6.40
85	600745	闻泰科技	21,257,769.89	6.39
86	601601	中国太保	21,254,378.91	6.39
87	000959	首钢股份	21,013,587.30	6.32
88	600521	华海药业	20,521,886.89	6.17
89	600886	国投电力	20,518,073.70	6.17
90	600060	海信电器	20,489,548.32	6.16
91	002497	雅化集团	20,415,941.18	6.14
92	601006	大秦铁路	19,434,669.00	5.84
93	601009	南京银行	19,317,063.00	5.81
94	300124	汇川技术	19,209,781.90	5.78
95	000039	中集集团	18,824,474.18	5.66

96	603757	大元泵业	18,724,614.18	5.63
97	002353	杰瑞股份	18,441,023.46	5.55
98	601288	农业银行	18,371,267.00	5.53
99	601989	中国重工	17,869,247.60	5.37
100	002611	东方精工	17,857,278.70	5.37
101	000063	中兴通讯	17,828,168.77	5.36
102	600487	亨通光电	17,775,710.89	5.35
103	002831	裕同科技	17,647,564.62	5.31
104	600048	保利地产	17,621,198.60	5.30
105	600038	中直股份	17,573,154.22	5.29
106	600231	凌钢股份	17,542,643.98	5.28
107	603626	科森科技	17,436,855.36	5.24
108	600566	济川药业	17,318,598.00	5.21
109	300137	先河环保	17,255,269.00	5.19
110	300347	泰格医药	17,189,845.84	5.17
111	000568	泸州老窖	16,558,319.00	4.98
112	600166	福田汽车	16,557,473.00	4.98
113	000899	赣能股份	16,507,987.55	4.96
114	002303	美盈森	16,502,596.71	4.96
115	601611	中国核建	16,480,672.00	4.96
116	600569	安阳钢铁	16,383,913.00	4.93
117	600522	中天科技	16,236,501.93	4.88
118	002372	伟星新材	15,684,354.73	4.72
119	600518	康美药业	15,454,344.26	4.65
120	600581	八一钢铁	15,431,784.06	4.64
121	600340	华夏幸福	15,341,869.74	4.61
122	600741	华域汽车	15,325,958.40	4.61
123	601628	中国人寿	15,282,873.43	4.60
124	300034	钢研高纳	15,208,323.72	4.57
125	300385	雪浪环境	15,123,391.88	4.55
126	600848	上海临港	15,069,312.95	4.53
127	002027	分众传媒	15,041,439.20	4.52
128	002221	东华能源	15,025,085.00	4.52
129	600425	*ST 青松	14,924,152.00	4.49
130	002466	天齐锂业	14,908,880.36	4.48
131	002074	国轩高科	14,876,379.54	4.47

132	600966	博汇纸业	14,859,155.36	4.47
133	300003	乐普医疗	14,834,909.31	4.46
134	603708	家家悦	14,583,691.20	4.39
135	002228	合兴包装	14,555,225.54	4.38
136	603612	索通发展	14,494,304.00	4.36
137	601168	西部矿业	14,450,497.15	4.35
138	000423	东阿阿胶	14,396,926.00	4.33
139	000425	徐工机械	14,112,773.43	4.24
140	601899	紫金矿业	13,944,290.00	4.19
141	603898	好莱客	13,922,433.45	4.19
142	002035	华帝股份	13,839,677.92	4.16
143	600409	三友化工	13,715,885.97	4.12
144	600326	西藏天路	13,656,628.00	4.11
145	000151	中成股份	13,363,516.37	4.02
146	300410	正业科技	13,238,723.26	3.98
147	600867	通化东宝	13,161,768.00	3.96
148	002128	露天煤业	13,160,284.12	3.96
149	601818	光大银行	13,121,557.00	3.95
150	000513	丽珠集团	13,020,003.20	3.92
151	603186	华正新材	13,013,568.43	3.91
152	600285	羚锐制药	12,770,696.45	3.84
153	002045	国光电器	12,627,042.22	3.80
154	600031	三一重工	12,589,621.00	3.79
155	601166	兴业银行	12,572,581.00	3.78
156	600983	惠而浦	12,371,408.17	3.72
157	002508	老板电器	12,360,628.64	3.72
158	000581	威孚高科	12,270,398.86	3.69
159	002043	兔宝宝	12,247,190.02	3.68
160	002677	浙江美大	11,979,107.40	3.60
161	000975	银泰资源	11,854,455.00	3.57
162	000968	蓝焰控股	11,841,408.75	3.56
163	600449	宁夏建材	11,833,395.58	3.56
164	600291	西水股份	11,833,064.00	3.56
165	000786	北新建材	11,813,988.40	3.55
166	600801	华新水泥	11,811,664.96	3.55
167	600258	首旅酒店	11,735,277.20	3.53



168	600282	南钢股份	11,716,735.00	3.52
169	002291	星期六	11,704,964.00	3.52
170	601666	平煤股份	11,685,887.70	3.51
171	300424	航新科技	11,576,009.10	3.48
172	601000	唐山港	11,450,890.00	3.44
173	002304	洋河股份	11,426,728.00	3.44
174	600110	诺德股份	11,284,833.30	3.39
175	600519	贵州茅台	11,196,381.32	3.37
176	000823	超声电子	11,104,741.98	3.34
177	002465	海格通信	11,026,401.91	3.32
178	300258	精锻科技	10,857,591.23	3.27
179	002635	安洁科技	10,659,874.20	3.21
180	600987	航民股份	10,626,675.16	3.20
181	601766	中国中车	10,446,856.36	3.14
182	601211	国泰君安	10,416,787.90	3.13
183	002233	塔牌集团	10,392,397.00	3.13
184	000860	顺鑫农业	10,387,088.20	3.12
185	002061	浙江交科	10,345,531.00	3.11
186	600096	云天化	10,305,863.42	3.10
187	600307	酒钢宏兴	10,156,604.20	3.05
188	000703	恒逸石化	10,134,570.44	3.05
189	000800	一汽轿车	10,091,168.56	3.03
190	002215	诺普信	10,081,257.51	3.03
191	300152	科融环境	10,069,626.65	3.03
192	000008	神州高铁	10,054,776.00	3.02
193	000666	经纬纺机	10,046,362.07	3.02
194	300183	东软载波	10,045,658.33	3.02
195	600183	生益科技	10,036,522.30	3.02
196	000563	陕国投A	9,982,011.00	3.00
197	300093	金刚玻璃	9,950,752.00	2.99
198	002080	中材科技	9,895,555.97	2.98
199	000933	神火股份	9,778,990.00	2.94
200	002185	华天科技	9,769,823.00	2.94
201	603040	新坐标	9,720,807.00	2.92
202	600885	宏发股份	9,693,058.39	2.92
203	601888	中国国旅	9,661,289.00	2.91

204	600452	涪陵电力	9,613,561.50	2.89
205	600754	锦江股份	9,590,362.00	2.88
206	002068	黑猫股份	9,494,798.00	2.86
207	600266	北京城建	9,265,988.00	2.79
208	002311	海大集团	9,239,697.96	2.78
209	600486	扬农化工	9,156,287.20	2.75
210	600651	飞乐音响	9,060,463.84	2.72
211	300433	蓝思科技	9,033,234.94	2.72
212	002032	苏泊尔	9,014,737.18	2.71
213	300383	光环新网	9,013,742.39	2.71
214	002705	新宝股份	8,976,753.00	2.70
215	600089	特变电工	8,976,073.67	2.70
216	601998	中信银行	8,925,542.99	2.68
217	601328	交通银行	8,895,456.00	2.68
218	600549	厦门钨业	8,891,084.88	2.67
219	601377	兴业证券	8,814,702.00	2.65
220	300070	碧水源	8,698,882.00	2.62
221	002020	京新药业	8,248,522.00	2.48
222	002262	恩华药业	8,229,873.87	2.48
223	300188	美亚柏科	8,193,079.00	2.46
224	600977	中国电影	8,134,894.00	2.45
225	000822	山东海化	8,097,717.00	2.44
226	600720	祁连山	8,093,872.85	2.43
227	002365	永安药业	8,064,442.00	2.43
228	002419	天虹股份	7,892,545.00	2.37
229	600584	长电科技	7,857,820.40	2.36
230	000898	鞍钢股份	7,797,514.00	2.35
231	002714	牧原股份	7,507,057.00	2.26
232	600050	中国联通	7,463,567.00	2.24
233	600309	万华化学	7,227,721.60	2.17
234	002078	太阳纸业	7,224,252.00	2.17
235	002460	赣锋锂业	7,199,324.33	2.17
236	600702	沱牌舍得	7,171,199.00	2.16
237	600406	国电南瑞	7,062,208.00	2.12
238	600256	广汇能源	6,945,487.00	2.09
239	600782	新钢股份	6,873,667.00	2.07

240	000630	铜陵有色	6,855,328.00	2.06
241	600280	中央商场	6,776,274.00	2.04
242	002773	康弘药业	6,747,801.00	2.03
243	002622	融钰集团	6,728,696.82	2.02
244	600006	东风汽车	6,704,393.00	2.02
245	300106	西部牧业	6,703,736.95	2.02
246	600237	铜峰电子	6,700,623.00	2.02
247	600809	山西汾酒	6,697,586.00	2.01
248	300001	特锐德	6,684,772.95	2.01
249	300153	科泰电源	6,674,472.76	2.01
250	000852	石化机械	6,669,842.00	2.01

注：“买入金额”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	600068	葛洲坝	85,174,028.28	25.62
2	603993	洛阳钼业	72,190,340.20	21.71
3	601336	新华保险	66,688,753.66	20.06
4	601668	中国建筑	65,769,171.25	19.78
5	600104	上汽集团	62,435,544.93	18.78
6	601111	中国国航	60,710,766.30	18.26
7	000651	格力电器	60,185,409.66	18.10
8	000049	德赛电池	60,099,374.22	18.07
9	002456	欧菲科技	58,105,760.41	17.47
10	000018	神州长城	57,581,943.70	17.32
11	600153	建发股份	56,740,839.68	17.06
12	600019	宝钢股份	56,723,948.57	17.06
13	000333	美的集团	55,008,912.21	16.54
14	002475	立讯精密	54,879,395.29	16.50
15	000725	京东方 A	54,018,698.52	16.25
16	600585	海螺水泥	53,520,699.15	16.10
17	601800	中国交建	52,847,277.81	15.89
18	600690	青岛海尔	52,371,918.61	15.75
19	600029	南方航空	51,722,599.02	15.56
20	600887	伊利股份	50,715,709.10	15.25

21	000858	五 粮 液	50,373,757.14	15.15
22	600884	杉杉股份	49,502,115.40	14.89
23	000065	北方国际	49,352,244.10	14.84
24	601117	中国化学	44,754,011.27	13.46
25	002241	歌尔股份	44,716,138.53	13.45
26	000983	西山煤电	44,554,868.94	13.40
27	002271	东方雨虹	43,056,545.61	12.95
28	002573	清新环境	42,666,619.10	12.83
29	600036	招商银行	42,634,295.70	12.82
30	000059	华锦股份	42,485,234.15	12.78
31	300136	信维通信	41,994,932.72	12.63
32	000709	河钢股份	41,926,240.06	12.61
33	002616	长青集团	40,329,577.02	12.13
34	600276	恒瑞医药	39,515,875.39	11.88
35	600507	方大特钢	37,566,290.48	11.30
36	600547	山东黄金	36,303,162.20	10.92
37	601233	桐昆股份	36,018,048.56	10.83
38	601186	中国铁建	35,466,684.92	10.67
39	001979	招商蛇口	34,584,218.40	10.40
40	002092	中泰化学	34,169,191.82	10.28
41	600015	华夏银行	33,981,349.71	10.22
42	600362	江西铜业	29,817,352.44	8.97
43	600660	福耀玻璃	29,761,722.65	8.95
44	600703	三安光电	29,502,198.43	8.87
45	601699	潞安环能	28,331,615.50	8.52
46	601933	永辉超市	27,408,424.81	8.24
47	601225	陕西煤业	27,309,611.03	8.21
48	601398	工商银行	27,247,973.94	8.19
49	002108	沧州明珠	27,230,987.64	8.19
50	600240	华业资本	27,197,995.13	8.18
51	300450	先导智能	27,161,122.28	8.17
52	002202	金风科技	27,018,596.70	8.13
53	002236	大华股份	26,753,277.14	8.05
54	000895	双汇发展	26,703,973.64	8.03
55	000069	华侨城 A	26,477,515.84	7.96
56	000910	大亚圣象	26,350,986.50	7.92
57	601939	建设银行	26,094,773.00	7.85
58	000090	天健集团	25,281,800.16	7.60

59	000921	海信科龙	25,087,286.40	7.54
60	600963	岳阳林纸	25,038,124.47	7.53
61	000418	小天鹅A	24,671,500.68	7.42
62	300323	华灿光电	24,278,793.87	7.30
63	300237	美晨生态	24,273,065.35	7.30
64	002294	信立泰	24,224,730.52	7.29
65	000789	万年青	24,078,578.78	7.24
66	601989	中国重工	23,977,734.12	7.21
67	603288	海天味业	23,825,414.96	7.17
68	601155	新城控股	23,583,412.21	7.09
69	000980	众泰汽车	23,582,025.90	7.09
70	000002	万科A	23,239,484.20	6.99
71	000050	深天马A	23,179,278.91	6.97
72	600352	浙江龙盛	22,846,851.44	6.87
73	000998	隆平高科	22,835,519.15	6.87
74	600388	龙净环保	22,559,264.16	6.78
75	000423	东阿阿胶	22,356,329.90	6.72
76	002497	雅化集团	22,297,598.65	6.71
77	601689	拓普集团	22,113,650.56	6.65
78	601601	中国太保	22,096,503.54	6.65
79	600348	阳泉煤业	21,975,731.00	6.61
80	000959	首钢股份	21,272,928.01	6.40
81	600886	国投电力	20,711,057.14	6.23
82	600521	华海药业	20,488,661.08	6.16
83	601222	林洋能源	20,445,135.49	6.15
84	002024	苏宁易购	20,325,611.00	6.11
85	600567	山鹰纸业	20,214,458.30	6.08
86	601009	南京银行	19,911,762.00	5.99
87	002511	中顺洁柔	19,747,048.00	5.94
88	601231	环旭电子	19,715,518.61	5.93
89	601600	中国铝业	19,589,703.00	5.89
90	600231	凌钢股份	19,408,596.00	5.84
91	601006	大秦铁路	19,297,127.00	5.80
92	300410	正业科技	19,229,858.69	5.78
93	603757	大元泵业	19,110,260.28	5.75
94	600110	诺德股份	19,050,329.59	5.73
95	300124	汇川技术	19,023,177.58	5.72
96	601288	农业银行	18,829,196.00	5.66

97	603626	科森科技	18,558,183.62	5.58
98	600581	八一钢铁	18,426,280.10	5.54
99	002353	杰瑞股份	18,268,630.19	5.49
100	600487	亨通光电	18,194,532.58	5.47
101	002611	东方精工	18,144,334.49	5.46
102	600569	安阳钢铁	18,095,514.23	5.44
103	600166	福田汽车	18,087,898.00	5.44
104	000063	中兴通讯	17,849,689.55	5.37
105	300137	先河环保	17,664,264.00	5.31
106	002831	裕同科技	17,521,679.78	5.27
107	600038	中直股份	17,458,010.54	5.25
108	002291	星期六	17,372,839.79	5.22
109	600048	保利地产	17,229,854.00	5.18
110	000568	泸州老窖	17,027,780.00	5.12
111	000899	赣能股份	16,692,012.51	5.02
112	300003	乐普医疗	16,665,558.76	5.01
113	601611	中国核建	16,655,940.03	5.01
114	600518	康美药业	16,597,882.86	4.99
115	000703	恒逸石化	16,479,198.86	4.96
116	600966	博汇纸业	16,207,460.47	4.87
117	600741	华域汽车	16,061,030.16	4.83
118	600522	中天科技	16,052,516.08	4.83
119	300034	钢研高纳	15,949,823.57	4.80
120	603612	索通发展	15,744,873.38	4.74
121	000538	云南白药	15,466,457.18	4.65
122	600745	闻泰科技	15,356,177.74	4.62
123	002273	水晶光电	15,311,561.48	4.60
124	601628	中国人寿	15,304,488.05	4.60
125	600565	迪马股份	15,275,508.60	4.59
126	603708	家家悦	15,196,592.06	4.57
127	002466	天齐锂业	15,196,038.75	4.57
128	600848	上海临港	15,179,287.00	4.57
129	002303	美盈森	15,128,879.58	4.55
130	600340	华夏幸福	15,127,680.00	4.55
131	000425	徐工机械	15,030,412.00	4.52
132	002221	东华能源	14,854,063.00	4.47
133	600859	王府井	14,805,041.49	4.45
134	002027	分众传媒	14,732,911.96	4.43

135	002372	伟星新材	14,549,470.17	4.38
136	600409	三友化工	14,508,128.78	4.36
137	002074	国轩高科	14,396,002.92	4.33
138	601899	紫金矿业	14,064,477.00	4.23
139	600425	*ST 青松	13,865,130.00	4.17
140	601818	光大银行	13,674,960.00	4.11
141	300385	雪浪环境	13,564,478.34	4.08
142	600297	广汇汽车	13,296,347.24	4.00
143	002045	国光电器	13,129,387.75	3.95
144	002035	华帝股份	13,119,324.42	3.95
145	600326	西藏天路	13,116,438.23	3.94
146	600867	通化东宝	13,053,404.31	3.93
147	600787	中储股份	12,956,354.62	3.90
148	603898	好莱客	12,836,502.43	3.86
149	002228	合兴包装	12,766,800.64	3.84
150	002128	露天煤业	12,710,939.28	3.82
151	603186	华正新材	12,706,450.89	3.82
152	600285	羚锐制药	12,674,772.87	3.81
153	002043	兔宝宝	12,627,882.82	3.80
154	600060	海信电器	12,459,538.75	3.75
155	002019	亿帆医药	12,400,373.43	3.73
156	600983	惠而浦	12,397,450.14	3.73
157	601166	兴业银行	12,391,442.78	3.73
158	600987	航民股份	12,310,721.60	3.70
159	000151	中成股份	12,245,640.68	3.68
160	300424	航新科技	12,226,674.40	3.68
161	000581	威孚高科	12,110,203.59	3.64
162	002677	浙江美大	12,076,131.74	3.63
163	002508	老板电器	12,067,848.83	3.63
164	600449	宁夏建材	11,878,566.63	3.57
165	000786	北新建材	11,836,163.23	3.56
166	600801	华新水泥	11,804,560.90	3.55
167	600519	贵州茅台	11,754,942.68	3.54
168	002304	洋河股份	11,653,848.70	3.50
169	600291	西水股份	11,542,632.00	3.47
170	600096	云天化	11,538,816.00	3.47
171	000975	银泰资源	11,533,564.96	3.47
172	600282	南钢股份	11,439,369.20	3.44

173	601000	唐山港	11,379,911.00	3.42
174	600258	首旅酒店	11,363,981.15	3.42
175	000968	蓝焰控股	11,361,041.57	3.42
176	002311	海大集团	11,153,755.31	3.35
177	000666	经纬纺机	11,032,545.38	3.32
178	000039	中集集团	11,023,004.00	3.32
179	601666	平煤股份	11,007,681.00	3.31
180	000823	超声电子	10,835,156.88	3.26
181	002384	东山精密	10,781,138.00	3.24
182	002635	安洁科技	10,762,522.14	3.24
183	002061	浙江交科	10,372,429.50	3.12
184	002233	塔牌集团	10,369,448.00	3.12
185	601211	国泰君安	10,301,278.00	3.10
186	601766	中国中车	10,283,234.16	3.09
187	300152	科融环境	10,236,255.21	3.08
188	000860	顺鑫农业	10,048,994.57	3.02
189	300093	金刚玻璃	9,963,906.05	3.00
190	002080	中材科技	9,936,225.24	2.99
191	000008	神州高铁	9,917,767.86	2.98
192	002215	诺普信	9,915,963.63	2.98
193	000563	陕国投A	9,911,492.00	2.98
194	002185	华天科技	9,865,977.57	2.97
195	300258	精锻科技	9,791,161.34	2.94
196	600486	扬农化工	9,782,389.20	2.94
197	000800	一汽轿车	9,760,341.94	2.94
198	600720	祁连山	9,723,897.45	2.92
199	600183	生益科技	9,688,880.58	2.91
200	300332	天壕环境	9,543,944.38	2.87
201	600885	宏发股份	9,532,425.21	2.87
202	600452	涪陵电力	9,492,125.65	2.85
203	300183	东软载波	9,490,205.61	2.85
204	300433	蓝思科技	9,472,419.16	2.85
205	601888	中国国旅	9,437,171.87	2.84
206	002068	黑猫股份	9,367,427.00	2.82
207	600309	万华化学	9,191,566.00	2.76
208	600307	酒钢宏兴	9,152,173.54	2.75
209	002032	苏泊尔	9,135,933.80	2.75
210	601377	兴业证券	9,083,377.00	2.73



211	601998	中信银行	9,065,537.00	2.73
212	600584	长电科技	8,938,378.70	2.69
213	600141	兴发集团	8,878,003.78	2.67
214	600651	飞乐音响	8,838,929.40	2.66
215	603040	新坐标	8,797,347.00	2.65
216	002705	新宝股份	8,713,256.09	2.62
217	600754	锦江股份	8,695,202.63	2.62
218	600549	厦门钨业	8,658,418.42	2.60
219	300070	碧水源	8,627,894.00	2.59
220	601328	交通银行	8,586,632.00	2.58
221	600089	特变电工	8,475,107.00	2.55
222	600266	北京城建	8,457,471.28	2.54
223	002365	永安药业	8,214,374.00	2.47
224	002262	恩华药业	8,119,885.75	2.44
225	300188	美亚柏科	7,993,483.00	2.40
226	000822	山东海化	7,861,890.00	2.36
227	000898	鞍钢股份	7,807,448.99	2.35
228	600977	中国电影	7,772,982.30	2.34
229	002020	京新药业	7,568,182.00	2.28
230	002714	牧原股份	7,526,489.00	2.26
231	600702	沱牌舍得	7,327,121.00	2.20
232	000100	TCL 集团	7,305,648.00	2.20
233	002078	太阳纸业	7,115,731.20	2.14
234	002460	赣锋锂业	7,048,447.00	2.12
235	600150	中国船舶	7,036,610.00	2.12
236	300476	胜宏科技	6,940,475.00	2.09
237	300153	科泰电源	6,874,482.52	2.07
238	600782	新钢股份	6,872,258.00	2.07
239	300001	特锐德	6,868,882.39	2.07
240	002773	康弘药业	6,855,646.00	2.06
241	002419	天虹股份	6,789,324.57	2.04
242	000630	铜陵有色	6,758,273.00	2.03
243	000852	石化机械	6,721,128.07	2.02
244	000597	东北制药	6,718,232.82	2.02
245	600809	山西汾酒	6,701,751.00	2.02
246	600006	东风汽车	6,701,577.00	2.02

注：“卖出金额”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

买入股票成本（成交）总额	5,646,995,702.91
卖出股票收入（成交）总额	5,679,690,506.33

注：“买入股票成本”或“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。

## 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本报告期末本基金未持有债券投资。

## 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券投资。

## 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末无贵金属投资。

## 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 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

本报告期末本基金未持有股指期货。

### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末无股指期货投资。

## 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

本基金本报告期末无国债期货投资。

### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货投资。

### 8.11.3 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。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1

2017 年 5 月 15 日，河南神火煤电股份有限公司（以下简称“公司”）下属薛湖煤矿 2306 风巷掘进工作面发生一起煤与瓦斯突出事故（详见公司于 2017 年 5 月 17 日披露的《河南神火煤电股份有限公司关于下属薛湖煤矿发生安全事故的公告》（公告编号：2017-036））。公司收到河南煤矿安全监察局出具的《关于河南神火集团有限公司薛湖煤矿“5.15”较大煤与瓦斯突出事故调查处理的意见》（豫煤安监调查【2017】137 号）及事故调查组出具的《河南神火集团有限公司薛湖煤矿“5.15”较大煤与瓦斯突出事故调查报告》后，将事故调查情况及对公司处理结果进行了公告（详见公司于 2017 年 8 月 30 日披露的《河南神火煤电股份有限公司关于下属薛湖煤矿安全事故调查处理结果及复产的公告》（公告编号：2017-050））。

且上述公告披露，公司已于 2017 年 8 月 27 日收到永城市人民政府《关于薛湖煤矿复工复产请示的批复》（永政文【2017】96 号），经永城市安监局对薛湖煤矿复工复产进行初验并通过验收，永城市人民政府同意薛湖煤矿复工复产。薛湖煤矿已于 2017 年 8 月 28 日复工复产。

本基金管理人对该公司进行了深入的了解和分析，认为该事项处理结果对公司的盈利情况暂不会造成重大不利影响。我们对该证券的投资严格执行内部投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

报告期内，本基金投资的前十名证券的其余九名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

### 8.12.2

本基金投资前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定的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	237,547.66
2	应收证券清算款	3,862,998.25
3	应收股利	-
4	应收利息	7,155.32
5	应收申购款	73,493.32
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,181,194.55

**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**

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	601600	中国铝业	10,461,895.00	3.71	重大事项

**8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分**

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

**§ 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
11,184	21,569.52	7,701,655.85	3.19%	233,531,858.42	96.81%

## 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	245,155.47	0.1016%

## 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2011年9月20日）基金份额总额	3,198,155,247.37
本报告期期初基金份额总额	292,993,192.19
本报告期基金总申购份额	18,111,448.49
减：本报告期基金总赎回份额	69,871,126.41
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	241,233,514.27

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本基金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、经平安大华基金管理有限公司第二届董事会第三十八次会议审议通过，由付强先生任职公司副总经理，任职日期为2017年1月20日。

2、经平安大华基金管理有限公司第四次职工代表大会审议通过，由李峥女士接替毛晴峰先生为第三届监事会职工监事，任职日期为 2017 年 2 月 17 日。

3、经平安大华基金管理有限公司 2017 年第三次股东会议审议通过，由李兆良先生、李娟娟女士、刘雪生先生、潘汉腾先生接替曹勇先生、刘茂山先生、郑学定先生、黄士林先生任职公司第三届董事会董事，任职日期为 2017 年 6 月 1 日。

4、经平安大华基金管理有限公司 2017 年第三次股东会议审议通过，由巢傲文先生接替张云平为第三届监事会监事，任职日期为 2017 年 6 月 1 日。

5、经平安大华基金管理有限公司第三届董事会第二次会议通过，同意选举罗春风先生为第三届董事会董事长；同意聘任肖宇鹏先生为总经理；同意聘任付强先生、林婉文女士、汪涛先生为副总经理；同意聘任陈特正先生为督察长兼董事会秘书，任职日期为 2017 年 7 月 13 日。

6、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。上述人事变动已按照相关规定备案、公告。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本基金本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内基金未更换会计师事务所，普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）已为本基金提供审计服务 4 年。报告期内应支付给该事务所的报酬为 60,000.00 元。

### 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，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

本报告期内，本基金管理人及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
兴业证券	2	1,049,350,975.96	9.27%	754,289.83	8.11%	-
银河证券	2	934,375,219.63	8.25%	870,182.35	9.35%	-
广发证券	1	871,160,380.68	7.70%	811,313.44	8.72%	-
民生证券	2	750,946,949.64	6.63%	549,166.83	5.90%	-
平安证券	2	733,051,252.46	6.48%	682,691.05	7.34%	-
国金证券	1	638,035,133.43	5.64%	594,198.15	6.39%	-
招商证券	2	544,321,051.86	4.81%	506,926.58	5.45%	-
华泰证券	1	531,552,103.45	4.70%	378,093.49	4.06%	-
中信证券	2	511,727,076.35	4.52%	476,572.69	5.12%	-
东方证券	2	508,559,492.75	4.49%	371,910.88	4.00%	-
国信证券	2	482,803,782.81	4.27%	353,074.39	3.79%	-
西南证券	1	423,660,326.37	3.74%	301,350.21	3.24%	-
长江证券	1	387,012,792.42	3.42%	360,425.60	3.87%	-
中银国际	1	341,534,326.97	3.02%	242,930.86	2.61%	-
中金公司	2	332,924,150.02	2.94%	310,052.21	3.33%	-
国泰君安	2	330,099,353.91	2.92%	234,798.62	2.52%	新增
中信建投	1	317,524,639.98	2.81%	232,205.84	2.50%	-
安信证券	2	280,379,662.78	2.48%	205,041.12	2.20%	-
方正证券	2	262,135,598.03	2.32%	244,127.05	2.62%	-
中泰证券	1	261,552,974.04	2.31%	186,042.84	2.00%	-
申万证券	2	238,047,154.34	2.10%	221,692.33	2.38%	-
西藏东方财富	2	187,210,780.24	1.65%	133,161.03	1.43%	新增
华信证券	2	175,374,150.27	1.55%	124,744.12	1.34%	新增
浙商证券	2	85,475,359.08	0.76%	60,797.94	0.65%	新增
长城证券	2	77,325,525.80	0.68%	55,001.78	0.59%	-
南京证券	1	63,512,232.55	0.56%	45,176.14	0.49%	新增
中投证券	1	-	-	-	-	-
中航证券	1	-	-	-	-	-

湘财证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	2	-	-	-	-	-

1、基金交易单元的选择标准如下：

- (1) 研究实力
- (2) 业务服务水平
- (3) 综合类研究服务对投资业绩贡献度
- (4) 专题类服务

2、本基金管理人负责根据上述选择标准，考察后与确定选用交易单元的券商签订交易单元租用协议。

### 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		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券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
兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	36,000,000.00	100.00%	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-



申万证券	-	-	-	-	-	-
西藏东方财富	-	-	-	-	-	-
华信证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-

平安大华基金管理有限公司  
2018 年 3 月 29 日