

**MSCI 中国 A 股交易型开放式指数  
证券投资基金  
2018 年半年度报告  
2018 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：二〇一八年八月二十五日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 8 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2018 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）.....	10
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.....	48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	50
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.....	50
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.....	50
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	50
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	50
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	50
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	51
7.12 投资组合报告附注.....	51
§8 基金份额持有人信息.....	52
§9 开放式基金份额变动.....	53
§10 重大事件揭示.....	53
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	55
§12 备查文件目录.....	56

## §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	557,503,247 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 股在岸指数。
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	陈四清

### 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（2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	-3,634,817.31
本期利润	-76,795,419.81
加权平均基金份额本期利润	-0.1669
本期加权平均净值利润率	-14.71%
本期基金份额净值增长率	-12.76%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)
期末可供分配利润	13,677,728.80
期末可供分配基金份额利润	0.0245
期末基金资产净值	571,180,975.80
期末基金份额净值	1.0245
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2018年6月30日)
基金份额累计净值增长率	2.45%

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	-7.16%	1.38%	-8.20%	1.42%	1.04%	-0.04%

过去三个月	-9.67%	1.15%	-13.25%	1.16%	3.58%	-0.01%
过去六个月	-12.76%	1.16%	-17.71%	1.18%	4.95%	-0.02%
过去一年	-5.06%	0.95%	-13.61%	0.98%	8.55%	-0.03%
过去三年	-20.51%	1.50%	-35.12%	1.55%	14.61%	-0.05%
自基金合同生效起至今	2.45%	1.59%	-12.48%	1.65%	14.93%	-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 2018 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、首批公募 FOF 基金管理人，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，目前旗下管理华夏上证 50ETF、华夏沪深 300ETF、华夏恒生 ETF、华夏沪港通恒生 ETF、华夏 MSCI 中国 A 股 ETF、华夏中小板 ETF、华夏中证 500ETF、华夏创业板 ETF、华夏战略新兴成指 ETF、华夏消费 ETF、华夏金融 ETF、华夏医药 ETF、华夏快线货币 ETF 和华夏 3-5 年中高级可质押信用债 ETF 等，初步形成了覆盖宽基指数、行业指数、主题指数、大盘蓝筹指数、中小创指数、A 股市场指数、海外市场指数、信用债指数等较为完整的产品线。

上半年，公司及旗下基金荣膺由基金评价机构颁发的多项奖项。在《中国证券报》评奖活动中，公司荣获“中国基金业 20 周年卓越贡献公司”和“被动投资金牛基金公司”两大奖项，旗下华夏回报混合荣获“2017 年度开放式混合型金牛基金”称号，华夏安康债券荣获“2017 年度开放式债券型金牛基金”称号。在《证券时报》评奖活动中，旗下华夏永福混合和华夏回报混合荣获“三年持续回报绝对收益明星基金”称号，华夏安康债券荣获“三年持续回报积极债券型明星基金”称号，华夏消费升级混合荣获“2017 年度平衡混合型明星基金”称号。在《上海证券报》举行的 2018 中国基金业峰会暨第十五届“金基金”颁奖评选中，华夏基金荣获公募基金 20 周年“金基金”TOP 基金公司大奖、华夏沪深 300ETF 获得第十五届“金基金”指数基金奖（一年期）、华夏上证 50ETF 获得第十五届“金基金”指数基金奖（三年期）。在《证券时报》的评奖活动中，华夏永福混合和华夏回报混合荣获“三年持续回报绝对收益明星基金”称号，华夏安康债券荣获“三年持续回报积极债券型明星基金”称号，华夏消费升级混合荣获“2017 年度平衡混合型明星基金”称号。

在客户服务方面，2018 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）华夏基金电子交易平台开展华夏财富宝货币 A、华夏薪金宝货币转换业务优惠活动，为客户提供了更便捷和优惠的基金投资方式；（2）微信服务号上线随存随取业务实时通知功能，方便客户及时了解交易变动的情况；华夏基金网上交易平台上手机号码登录功能，为客户登录网上交易平台提供了更便捷的方式；（3）与中原银行、长城华西银行、西安银行等代销机构合作，拓宽了客户交易的渠道，提高了交易便利性；（4）开展“四大明星基金有奖寻人”、“华夏基金 20 周年司庆感恩二十年”、“华夏基金 20 周年献礼，华夏基金户口本”等活动，为客户提供了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	证券从业	说明
----	----	-----------	------	----

		(助理) 期限		年限	
		任职日期	离任日期		
荣膺	本基金的基金经理、数量投资部高级副总裁	2016-10-20	-	8 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 股在岸指数，MSCI 中国 A 股在岸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，美国经济仍较为强劲，通胀率略有上升，失业率维持低位；欧元区经济延续复苏格局，但走势趋于温和，受贸易保护主义、宽松货币政策退出等影响，半年末市场下调了全年增速预期；日本经济 1 季度意外下挫后，央行继续维持超宽松货币政策不变，但通胀水平依然较低；新兴市场经济体总体经济增长较快，但内部表现继续分化，部分经济体仍面临调整与转型压力。国内方面，供给侧结构性改革深入推进，实现了投资继续保持增长、投资内生性增强、投资结构不断改善的运行态势；消费品市场规模进一步扩大、商品结构持续优化，充分体现了消费对我国经济发展的基础性作用，是拉动我国经济增长的最重要引擎；出口增速总体保持稳定，进口超预期增长，进出口产品结构持续优化；整体而言，中国经济延续了总体平稳、稳中向好的发展态势，转型升级成效明显，新动能加快成长，但贸易摩擦和社融增长减速使得市场对未来经济前景的顾虑提升。

市场方面，受中美贸易战持续发酵、美联储加息节奏加快、地缘政治变局等影响，A 股市场情绪承压，市场成交呈现较为明显的萎缩态势，大盘指数经历了较大幅的回撤。

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。

为促进本基金的市场流动性和平稳运行，经上海证券交易所同意，部分证券公司被确认为本基金的流动性服务商。目前，本基金的流动性服务商包括联讯证券股份有限公司等。

目前该基金已被调入融资融券标的证券名单。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2018 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.0245 元，本报告期份额净值增长率为-12.76%，同期业绩比较基准增长率为-17.71%。本基金本报告期跟踪偏离度为+4.95%，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，贸易战和国际金融环境变化的影响仍不确定，但预计美国经济增长仍较为乐观，美联储仍会加息，缩表进程或将加快；欧洲央行货币政策仍将保持耐心、持续和谨慎，部分欧元区国家经济形势不容乐观，债务危机存在一定风险但目前看还较为可控。国内方面，在经济增速短期下行压力增大的背景下，货币、金融、财税政策有望向结构性宽松转变，制造业将保持温和复苏，同时结构性分化将加大，高端制造业投资或将提速；在扩大内需政策的带动下，下半年或将释放一定内需空间，消费增长逐步得到修复；受外围形势影响，下半年进出口对经济拉动作用继续有限。综合来看，国内经济需求动力有增有减，但总体保持稳定，预计经济增速下半年保持平稳。

市场方面，A 股整体估值水平已接近历史低位，具有较高的安全边际。6 月初，A 股正式纳入 MSCI 新兴市场指数，虽然短期难以成为影响 A 股的主要驱动力，但长远来看，随着纳入比例的提高，A 股市场活力和效率也将随之得到提升。

珍惜基金份额持有人的每一分投资和每一份信任，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，本基金管理人为准确、及时进行基金估值和份额净值计价，制定了基金估值和份额净值计价的业务管理制度，建立了估值委员会，使用可靠的估值业务系统，设有完善的风险监测、控制和报告机制。本基金托管人审阅本基金管理人采用的估值原则及技术，并复核、审查基金资产净值和基金份额申购、赎回价格。会计师事务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技术、假设及输入值的适当性发表专业意见。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

#### 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。

本基金本报告期末未进行利润分配，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：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		-	-
银行存款	6.4.7.1	13,915,529.96	6,925,540.56
结算备付金		3,044,379.04	2,031,778.24
存出保证金		2,366,127.36	1,318,967.63
交易性金融资产	6.4.7.2	553,050,358.35	396,909,626.49
其中：股票投资		553,050,358.35	396,858,226.49
基金投资		-	-
债券投资		-	51,400.00
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	-	700,000.00
应收证券清算款		1,570,767.28	514,526.48
应收利息	6.4.7.5	4,318.57	4,216.72
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		573,951,480.56	408,404,656.12
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2018年6月30日</b>	<b>上年度末 2017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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		1,521,286.64	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		245,706.18	173,405.66
应付托管费		49,141.26	34,681.15
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	56,790.62	25,344.35
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	897,580.06	100,904.10
负债合计		2,770,504.76	334,335.26
<b>所有者权益:</b>		-	-
实收基金	6.4.7.9	557,503,247.00	347,503,247.00
未分配利润	6.4.7.10	13,677,728.80	60,567,073.86
所有者权益合计		571,180,975.80	408,070,320.86
负债和所有者权益总计		573,951,480.56	408,404,656.12

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0245 元，基金份额总额 557,503,247 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：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018年1月1日至 2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017 年6月30日
<b>一、收入</b>		-74,923,521.35	33,479,224.49
1.利息收入		73,683.15	130,566.74
其中：存款利息收入	6.4.7.11	68,649.86	94,572.95
债券利息收入		70.14	84.63
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		4,963.15	35,909.16
其他利息收入		-	-

2.投资收益（损失以“-”填列）		-1,803,132.37	7,230,164.75
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-6,848,846.67	3,632,280.87
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	21,745.24	1,946.07
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	-444,399.03	989,440.00
股利收益	6.4.7.17	5,468,368.09	2,606,497.81
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-73,160,602.50	26,117,773.31
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	-33,469.63	719.69
<b>减：二、费用</b>		1,871,898.46	1,241,297.67
1.管理人报酬		1,290,390.70	840,286.45
2.托管费		258,078.20	168,057.28
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	6.4.7.20	130,979.78	70,277.94
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.税金及附加		856.04	-
7.其他费用	6.4.7.21	191,593.74	162,676.00
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-76,795,419.81	32,237,926.82
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-76,795,419.81	32,237,926.82

## 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：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 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）	347,503,247.00	60,567,073.86	408,070,320.86
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-76,795,419.81	-76,795,419.81
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	210,000,000.00	29,906,074.75	239,906,074.75
其中：1.基金申购款	250,000,000.00	34,180,334.60	284,180,334.60

2.基金赎回款	-40,000,000.00	-4,274,259.85	-44,274,259.85
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）	557,503,247.00	13,677,728.80	571,180,975.80
项目	上年度可比期间 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

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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 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 2018 年 6 月 30 日的财务状况以及 2018 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[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》、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》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

- 1、以发行基金方式募集资金不属于增值税征收范围，不征收增值税。
- 2、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。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。
- 3、基金买卖股票、债券的差价收入免征增值税，暂不征收企业所得税。
- 4、存款利息收入不征收增值税。
- 5、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。
- 6、资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品发生的部分金融商品转让业务，转让2017年12月31日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。
- 7、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。
- 8、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。
- 9、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。
- 10、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。
- 11、本基金分别按实际缴纳的增值税额的5%、3%、2%缴纳城市维护建设税、教育费附加和地



方教育费附加。

#### 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 2018年6月30日
活期存款	13,915,529.96
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计	13,915,529.96

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	602,842,789.83	553,050,358.35	-49,792,431.48
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	602,842,789.83	553,050,358.35	-49,792,431.48

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 2018年6月30日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	14,321,080.00	-	-	-

其中：股指期货	14,321,080.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	14,321,080.00	-	-	-

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
IF1807	沪深 300 股指期货 IF1807 合约	6	6,263,640.00	-334,500.00	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。
IC1807	中证 500 股指期货 IC1807 合约	6	6,225,600.00	-378,040.00	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。
IF1809	沪深 300 股指期货 IF1809 合约	1	1,032,840.00	-86,460.00	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					-799,000.00
股指期货投资本期收益					-444,399.03
股指期货投资本期公允价值变动					-847,520.00

#### 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

无。

##### 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 2018 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	2,748.48
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	1,558.09
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-

应收黄金合约拆借孳息	-
其他	12.00
合计	4,318.57

## 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 2018 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	56,790.62
银行间市场应付交易费用	-
合计	56,790.62

## 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018 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	126,701.47
应退替代款	626,856.65
可退替代款	44,844.80
合计	897,580.06

## 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	347,503,247.00	347,503,247.00
本期申购	250,000,000.00	250,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-40,000,000.00	-40,000,000.00
本期末	557,503,247.00	557,503,247.00

## 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	142,035,359.65	-81,468,285.79	60,567,073.86
本期利润	-3,634,817.31	-73,160,602.50	-76,795,419.81
本期基金份额交易产生的	85,563,623.20	-55,657,548.45	29,906,074.75

变动数			
其中：基金申购款	101,772,173.00	-67,591,838.40	34,180,334.60
基金赎回款	-16,208,549.80	11,934,289.95	-4,274,259.85
本期已分配利润	0.00	-	-
本期末	223,964,165.54	-210,286,436.74	13,677,728.80

## 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	37,225.52
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	31,239.86
其他	184.48
合计	68,649.86

## 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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-6,587,015.33
股票投资收益——赎回差价收入	-261,831.34
股票投资收益——申购差价收入	-
合计	-6,848,846.67

## 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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	75,915,876.12
减：卖出股票成本总额	82,502,891.45
买卖股票差价收入	-6,587,015.33

## 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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	44,274,259.85
减：现金支付赎回款总额	16,412,924.85
减：赎回股票成本总额	28,123,166.34

赎回差价收入	-261,831.34
--------	-------------

## 6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	301,319.75
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	279,500.00
减：应收利息总额	74.51
买卖债券差价收入	21,745.24

## 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 2018年1月1日至2018年6月30日
股指期货投资收益	-444,399.03
合计	-444,399.03

## 6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2018年1月1日至2018年6月30日
股票投资产生的股利收益	5,468,368.09
基金投资产生的股利收益	-
合计	5,468,368.09

## 6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
1.交易性金融资产	-72,313,082.50
——股票投资	-72,313,082.50
——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	-847,520.00
——权证投资	-
——期货投资	-847,520.00
4.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	-73,160,602.50

## 6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	-33,469.63
合计	-33,469.63

## 6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
交易所市场交易费用	130,979.78
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	130,979.78

## 6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
审计费用	29,752.78
信息披露费	39,671.58
银行费用	2,089.23
上市费	29,752.78
指数使用费	90,327.37
合计	191,593.74

## 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

MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金于 2018 年 8 月 11 日公告以通讯方式召开基金份额持有人大会，审议《关于 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金变更标的指数并修订基金合同有关事项的议案》。

## 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 2018年1月1日至2018年6月 30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,290,390.70	840,286.45

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 2018年1月1日至2018年6月 30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30 日
当期发生的基金应支付的托管费	258,078.20	168,057.28

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 2018 年 6 月 30 日		上年度末 2017 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	143,415,281.00	25.72%	102,932,981.00	29.62%

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	
	2018年1月1日至2018年6月30日		2017年1月1日至2017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	13,915,529.96	37,225.52	12,933,107.81	50,848.30

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					
2018 年 1 月 1 日至 2018 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	-	-	-	-	-
上年度可比期间					
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

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

##### 6.4.10.7.1 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 92,468,320.00 元（上年度可比期间：201,477,080.00 元），支付给中信期货的佣金为 2,265.47 元（上年度可比期间：4,936.17 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（2018 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
603693	江苏新能	2018-06-25	2018-07-03	新发流通受限	9.00	9.00	5,384	48,456.00	48,456.00	-
603105	芯能科技	2018-06-29	2018-07-09	新发流通受限	4.83	4.83	3,410	16,470.30	16,470.30	-

## 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
601390	中国中铁	2018-05-07	重大事项	7.47	2018-08-20	7.25	270,300	2,333,842.10	2,019,141.00	-
002252	上海莱士	2018-02-23	重大事项	19.52	-	-	44,031	835,689.18	859,485.12	-
002310	东方园林	2018-05-25	重大事项	15.03	-	-	56,950	863,396.69	855,958.50	-
601727	上海电气	2018-06-06	重大事项	6.34	2018-08-07	5.71	114,100	1,154,977.46	723,394.00	-
600221	海航控股	2018-01-10	重大事项	3.23	2018-07-20	2.91	211,700	715,720.36	683,791.00	-
002602	世纪华通	2018-06-12	重大事项	32.50	-	-	18,100	569,962.09	588,250.00	-
600811	东方集团	2018-05-30	重大事项	4.30	-	-	132,560	677,056.06	570,008.00	-
002739	万达电影	2017-07-04	重大事项	52.04	-	-	10,900	764,008.61	567,236.00	-
000540	中天金	2017-08-21	重大	4.87	-	-	103,425	484,054.41	503,679.75	-

000825	融 太钢不锈	2018-04-16	重大 事项	6.00	-	-	82,900	431,201.99	497,400.00	-
002408	齐翔腾 达	2018-06-19	重大 事项	12.28	-	-	39,200	460,310.75	481,376.00	-
000793	华闻传 媒	2018-02-01	重大 事项	8.40	2018-07-16	7.56	50,191	620,445.87	421,604.40	-
601118	海南橡 胶	2018-05-24	重大 事项	6.62	-	-	62,000	415,191.38	410,440.00	-
600490	鹏欣资 源	2018-04-16	重大 事项	8.67	-	-	46,000	453,290.79	398,820.00	-
600751	海航科 技	2018-01-12	重大 事项	6.49	-	-	57,700	508,632.62	374,473.00	-
002610	爱康科 技	2018-06-05	重大 事项	2.10	-	-	167,900	447,114.72	352,590.00	-
002359	北讯集 团	2018-05-21	重大 事项	19.58	2018-08-21	17.62	17,920	424,514.88	350,873.60	-
000008	神州高 铁	2018-06-06	重大 事项	4.96	2018-08-07	4.46	70,500	528,757.13	349,680.00	-
600745	XD 闻 泰科	2018-04-17	重大 事项	30.48	-	-	11,300	284,543.22	344,424.00	-
600022	山东钢 铁	2018-03-27	重大 事项	2.02	2018-08-16	1.83	168,020	406,435.72	339,400.40	-
000415	渤海金 控	2018-01-17	重大 事项	5.84	2018-07-17	5.26	54,700	444,677.76	319,448.00	-
600175	美都能 源	2018-05-30	重大 事项	4.16	2018-08-17	3.74	75,300	364,065.71	313,248.00	-
600485	信威集 团	2016-12-26	重大 事项	14.59	-	-	21,100	375,349.52	307,849.00	-
002573	清新环 境	2018-06-19	重大 事项	11.55	-	-	26,500	475,270.14	306,075.00	-
002431	棕榈股 份	2018-05-30	重大 事项	6.71	-	-	42,650	398,114.14	286,181.50	-
002665	首航节 能	2018-05-29	重大 事项	5.80	-	-	48,120	362,301.64	279,096.00	-
002051	中工国 际	2018-04-09	重大 事项	15.27	-	-	17,804	346,887.53	271,867.08	-
600122	宏图高 科	2018-06-19	重大 事项	7.40	-	-	36,700	416,301.15	271,580.00	-
002075	沙钢股 份	2016-09-19	重大 事项	16.12	-	-	16,700	206,650.52	269,204.00	-
600158	中体产 业	2018-03-27	重大 事项	11.64	2018-07-16	11.61	22,177	383,383.24	258,140.28	-
000566	海南海	2017-11-22	重大	12.89	2018-07-09	11.60	19,400	224,003.51	250,066.00	-

600687	刚泰控股	2018-06-11	重大事项	9.09	2018-08-20	8.18	25,600	366,784.97	232,704.00	-
000426	兴业矿业	2018-06-19	重大事项	7.21	-	-	32,000	295,806.40	230,720.00	-
002210	飞马国际	2018-03-26	重大事项	12.33	2018-08-13	11.07	18,696	209,603.41	230,521.68	-
002477	雏鹰农牧	2018-06-14	重大事项	3.31	-	-	69,400	297,016.52	229,714.00	-
000939	凯迪生态	2017-11-16	重大事项	4.99	2018-07-02	4.74	45,450	261,699.69	226,795.50	-
002089	新海宜	2018-04-20	重大事项	6.05	2018-07-20	5.45	35,200	260,908.50	212,960.00	-
600848	上海临港	2018-06-15	重大事项	21.67	-	-	9,800	231,915.07	212,366.00	-
000587	金洲慈航	2018-06-15	重大事项	4.96	2018-07-02	4.46	41,600	325,883.33	206,336.00	-
600086	东方金钰	2018-01-19	重大事项	10.04	-	-	19,500	224,845.34	195,780.00	-
600750	江中药业	2018-05-02	重大事项	17.75	2018-08-01	16.12	10,540	217,735.76	187,085.00	-
000666	经纬纺机	2018-03-12	重大事项	18.08	-	-	9,800	206,560.54	177,184.00	-
002445	中南文化	2018-06-13	重大事项	8.44	-	-	20,600	331,213.70	173,864.00	-
600759	洲际油气	2018-03-27	重大事项	3.94	-	-	42,780	334,524.47	168,553.20	-
600226	瀚叶股份	2017-11-28	重大事项	4.56	-	-	36,556	183,916.92	166,695.36	-
002699	美盛文化	2018-02-05	重大事项	18.76	2018-07-02	16.88	7,200	154,368.25	135,072.00	-
600701	*ST 工新	2018-03-14	重大事项	9.22	2018-08-17	8.76	14,600	169,282.51	134,612.00	-
002011	盾安环境	2018-05-02	重大事项	6.40	-	-	20,600	205,938.37	131,840.00	-
002309	中利集团	2018-02-05	重大事项	14.30	2018-07-30	12.78	9,000	161,986.98	128,700.00	-
002239	奥特佳	2018-04-02	重大事项	3.62	-	-	29,540	118,624.51	106,934.80	-
002721	金一文化	2018-05-29	重大事项	8.99	2018-07-09	8.35	3,600	65,414.23	32,364.00	-

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。

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

在日常运作中，本基金的流动性安排能够与基金合同约定的申购赎回安排以及投资者的申购赎回规律相匹配。

在资产端，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，如需对组合进行调

整时，由于指数成份股流动性较好，市场冲击成本较小，基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险较小。基金管理人持续监测本基金持有资产的市场交易量、交易集中度等涉及资产流动性水平的风险指标，并定期开展压力测试，详细评估在不同的压力情景下资产变现情况的变化。

在负债端，基金管理人持续监测本基金投资者历史申赎、投资者类型和结构变化等数据，审慎评估不同市场环境可能带来的投资者潜在赎回需求，当市场环境或投资者结构发生变化时，及时调整组合资产结构，预留充足现金头寸，保持基金资产可变现规模和期限与负债赎回规模和期限的匹配。

如遭遇极端市场情形或投资者非预期巨额赎回情形，基金管理人将采用本基金合同约定的赎回申请处理方式及其他各类流动性风险管理工具，控制极端情况下的潜在流动性风险。

#### 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 2018年6月30日		上年度末 2017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—	553,050,358.35	96.83	396,858,226.49	97.25

股票投资				
交易性金融资产— 贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权 证投资	-	-	-	-
合计	553,050,358.35	96.83	396,858,226.49	97.25

#### 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 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
	+5%	28,916,036.90	19,097,691.02
	-5%	-28,916,036.90	-19,097,691.02

#### 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 2018 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 553,050,358.35 元，第二层次的余额为 0 元，第三层次的余额为 0 元。（截至 2017 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 396,909,626.49 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。

## §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	553,050,358.35	96.36
	其中：股票	553,050,358.35	96.36
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	16,959,909.00	2.95
8	其他各项资产	3,941,213.21	0.69
9	合计	573,951,480.56	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	2,603,304.10	0.46
B	采矿业	17,381,982.53	3.04
C	制造业	262,383,688.27	45.94
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	14,138,428.09	2.48
E	建筑业	17,850,495.05	3.13
F	批发和零售业	17,037,078.09	2.98
G	交通运输、仓储和邮政业	15,378,249.50	2.69
H	住宿和餐饮业	820,168.80	0.14



I	信息传输、软件和信息技术服务业	22,706,181.24	3.98
J	金融业	138,650,238.62	24.27
K	房地产业	29,052,313.71	5.09
L	租赁和商务服务业	7,271,636.49	1.27
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,112,950.87	0.19
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,467,014.00	0.26
R	文化、体育和娱乐业	3,609,941.44	0.63
S	综合	1,586,686.10	0.28
	合计	553,050,356.90	96.83

## 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	432,438	25,332,218.04	4.44
2	600519	贵州茅台	21,975	16,073,833.50	2.81
3	600036	招商银行	566,252	14,971,702.88	2.62
4	000333	美的集团	196,897	10,281,961.34	1.80
5	000651	格力电器	210,164	9,909,232.60	1.73
6	601166	兴业银行	673,916	9,704,390.40	1.70
7	000002	万科A	291,175	7,162,905.00	1.25
8	600887	伊利股份	242,616	6,768,986.40	1.19
9	000858	五粮液	85,229	6,477,404.00	1.13
10	600000	浦发银行	659,148	6,301,454.88	1.10
11	600276	恒瑞医药	82,696	6,265,048.96	1.10
12	600016	民生银行	884,837	6,193,859.00	1.08
13	600030	中信证券	368,280	6,102,399.60	1.07
14	002415	海康威视	161,176	5,984,464.88	1.05
15	601328	交通银行	881,346	5,058,926.04	0.89
16	601668	中国建筑	838,127	4,576,173.42	0.80
17	601398	工商银行	807,200	4,294,304.00	0.75
18	600104	上汽集团	116,562	4,078,504.38	0.71
19	600048	保利地产	325,460	3,970,612.00	0.70
20	000725	京东方A	1,098,350	3,888,159.00	0.68
21	600900	长江电力	219,589	3,544,166.46	0.62
22	601601	中国太保	109,842	3,498,467.70	0.61
23	000001	平安银行	342,688	3,115,033.92	0.55
24	601229	上海银行	194,760	3,069,417.60	0.54
25	601288	农业银行	880,500	3,028,920.00	0.53
26	002304	洋河股份	22,533	2,965,342.80	0.52

27	601169	北京银行	474,745	2,862,712.35	0.50
28	600837	海通证券	282,736	2,677,509.92	0.47
29	600585	海螺水泥	79,915	2,675,554.20	0.47
30	601988	中国银行	736,200	2,657,682.00	0.47
31	600690	青岛海尔	136,868	2,636,077.68	0.46
32	600050	中国联通	528,067	2,598,089.64	0.45
33	600518	康美药业	111,762	2,557,114.56	0.45
34	601888	中国国旅	38,936	2,507,867.76	0.44
35	000538	云南白药	23,377	2,500,403.92	0.44
36	601211	国泰君安	168,700	2,486,638.00	0.44
37	603288	海天味业	33,700	2,481,668.00	0.43
38	600028	中国石化	381,400	2,475,286.00	0.43
39	600009	上海机场	43,249	2,399,454.52	0.42
40	601766	中国中车	303,530	2,337,181.00	0.41
41	601818	光大银行	596,000	2,181,360.00	0.38
42	600019	宝钢股份	277,906	2,164,887.74	0.38
43	002230	科大讯飞	67,256	2,156,899.92	0.38
44	002008	大族激光	39,941	2,124,461.79	0.37
45	600031	三一重工	229,459	2,058,247.23	0.36
46	601939	建设银行	311,147	2,038,012.85	0.36
47	600919	江苏银行	316,900	2,031,329.00	0.36
48	601390	中国中铁	270,300	2,019,141.00	0.35
49	002024	苏宁易购	138,700	1,952,896.00	0.34
50	600703	三安光电	101,300	1,946,986.00	0.34
51	002594	比亚迪	40,508	1,931,421.44	0.34
52	600196	复星医药	45,221	1,871,697.19	0.33
53	601857	中国石油	242,400	1,868,904.00	0.33
54	001979	招商蛇口	98,074	1,868,309.70	0.33
55	601688	华泰证券	121,700	1,821,849.00	0.32
56	601006	大秦铁路	221,503	1,818,539.63	0.32
57	000568	泸州老窖	29,226	1,778,694.36	0.31
58	002475	立讯精密	78,754	1,775,115.16	0.31
59	002027	分众传媒	182,140	1,743,079.80	0.31
60	000338	潍柴动力	195,400	1,709,750.00	0.30
61	601009	南京银行	210,550	1,627,551.50	0.28
62	002236	大华股份	71,950	1,622,472.50	0.28
63	000776	广发证券	117,500	1,559,225.00	0.27
64	601899	紫金矿业	429,200	1,549,412.00	0.27
65	002466	天齐锂业	31,147	1,544,579.73	0.27
66	600660	福耀玻璃	59,700	1,534,887.00	0.27
67	600340	华夏幸福	58,752	1,512,864.00	0.26
68	601012	隆基股份	90,000	1,502,100.00	0.26
69	600741	华域汽车	62,588	1,484,587.36	0.26

70	601186	中国铁建	171,300	1,476,606.00	0.26
71	600867	通化东宝	61,176	1,466,388.72	0.26
72	601933	永辉超市	190,000	1,451,600.00	0.25
73	000661	长春高新	6,360	1,448,172.00	0.25
74	603799	华友钴业	14,800	1,442,556.00	0.25
75	002142	宁波银行	88,090	1,434,986.10	0.25
76	600015	华夏银行	190,948	1,422,562.60	0.25
77	002456	欧菲科技	87,610	1,413,149.30	0.25
78	000963	华东医药	28,941	1,396,403.25	0.24
79	002460	赣锋锂业	35,950	1,386,951.00	0.24
80	600487	亨通光电	61,420	1,354,311.00	0.24
81	601336	新华保险	31,100	1,333,568.00	0.23
82	000423	东阿阿胶	24,534	1,320,174.54	0.23
83	000100	TCL 集团	436,100	1,264,690.00	0.22
84	600352	浙江龙盛	105,000	1,254,750.00	0.22
85	002044	美年健康	54,240	1,225,824.00	0.21
86	000166	申万宏源	279,741	1,222,468.17	0.21
87	600516	方大炭素	48,800	1,189,744.00	0.21
88	002202	金风科技	93,763	1,185,164.32	0.21
89	600436	片仔癀	10,497	1,174,929.21	0.21
90	600999	招商证券	85,190	1,165,399.20	0.20
91	600066	宇通客车	60,419	1,159,440.61	0.20
92	600795	国电电力	439,100	1,150,442.00	0.20
93	601088	中国神华	57,352	1,143,598.88	0.20
94	600570	恒生电子	21,425	1,134,453.75	0.20
95	600111	北方稀土	99,227	1,129,203.26	0.20
96	601901	方正证券	163,500	1,093,815.00	0.19
97	601985	中国核电	193,200	1,091,580.00	0.19
98	000895	双汇发展	40,950	1,081,489.50	0.19
99	601138	工业富联	58,600	1,080,584.00	0.19
100	600406	国电南瑞	68,291	1,078,997.80	0.19
101	000413	东旭光电	176,800	1,071,408.00	0.19
102	600271	航天信息	41,600	1,051,232.00	0.18
103	601155	新城控股	33,700	1,043,689.00	0.18
104	002422	科伦药业	32,144	1,031,822.40	0.18
105	600029	南方航空	122,100	1,031,745.00	0.18
106	601607	上海医药	42,966	1,026,887.40	0.18
107	600089	特变电工	147,710	1,023,630.30	0.18
108	600886	国投电力	134,776	979,821.52	0.17
109	600176	中国巨石	95,618	978,172.14	0.17
110	600535	天士力	37,576	970,212.32	0.17
111	601377	兴业证券	182,900	963,883.00	0.17
112	600085	同仁堂	27,237	960,921.36	0.17

113	600958	东方证券	103,700	946,781.00	0.17
114	601628	中国人寿	41,300	930,076.00	0.16
115	600588	用友网络	37,865	928,071.15	0.16
116	000977	浪潮信息	38,330	914,170.50	0.16
117	600383	金地集团	89,674	913,778.06	0.16
118	600068	葛洲坝	125,676	906,123.96	0.16
119	600100	同方股份	103,048	904,761.44	0.16
120	002241	歌尔股份	88,620	903,037.80	0.16
121	601618	中国中冶	265,942	885,586.86	0.16
122	002572	索菲亚	27,500	884,950.00	0.15
123	600547	山东黄金	36,965	884,202.80	0.15
124	000069	华侨城 A	122,150	883,144.50	0.15
125	600010	包钢股份	565,906	877,154.30	0.15
126	603019	中科曙光	19,100	876,117.00	0.15
127	600522	中天科技	98,938	871,643.78	0.15
128	000768	中航飞机	54,960	859,574.40	0.15
129	002252	上海莱士	44,031	859,485.12	0.15
130	601233	桐昆股份	49,820	857,900.40	0.15
131	002310	东方园林	56,950	855,958.50	0.15
132	600426	华鲁恒升	48,284	849,315.56	0.15
133	601877	正泰电器	37,420	835,214.40	0.15
134	600705	中航资本	178,336	832,829.12	0.15
135	600521	华海药业	30,997	827,309.93	0.14
136	600177	雅戈尔	106,660	821,282.00	0.14
137	000783	长江证券	151,034	820,114.62	0.14
138	601225	陕西煤业	99,300	816,246.00	0.14
139	600809	山西汾酒	12,953	814,614.17	0.14
140	601669	中国电建	151,900	814,184.00	0.14
141	000425	徐工机械	191,300	811,112.00	0.14
142	000830	鲁西化工	47,300	807,884.00	0.14
143	600739	辽宁成大	53,199	807,560.82	0.14
144	600779	水井坊	14,600	806,358.00	0.14
145	600115	东方航空	121,776	806,157.12	0.14
146	002340	格林美	132,608	802,278.40	0.14
147	600332	白云山	20,937	796,652.85	0.14
148	600201	生物股份	46,466	794,103.94	0.14
149	600606	绿地控股	120,800	790,032.00	0.14
150	600637	东方明珠	52,418	789,415.08	0.14
151	000157	中联重科	190,900	784,599.00	0.14
152	000625	长安汽车	87,152	784,368.00	0.14
153	601997	贵阳银行	62,800	776,208.00	0.14
154	002405	四维图新	38,200	773,550.00	0.14
155	002410	广联达	27,859	772,530.07	0.14

156	600256	广汇能源	185,331	758,003.79	0.13
157	002146	荣盛发展	86,342	753,765.66	0.13
158	600893	航发动力	33,472	747,095.04	0.13
159	601788	光大证券	67,900	745,542.00	0.13
160	002007	华兰生物	23,067	741,834.72	0.13
161	603589	口子窖	11,900	731,255.00	0.13
162	600298	安琪酵母	20,400	727,872.00	0.13
163	600804	鹏博士	60,400	724,800.00	0.13
164	600699	均胜电子	28,200	724,458.00	0.13
165	601727	上海电气	114,100	723,394.00	0.13
166	002508	老板电器	23,580	722,019.60	0.13
167	002038	双鹭药业	18,627	707,639.73	0.12
168	002001	新 和 成	37,274	706,715.04	0.12
169	600926	杭州银行	63,700	706,433.00	0.12
170	000998	隆平高科	37,400	705,364.00	0.12
171	002271	东方雨虹	40,911	695,896.11	0.12
172	002050	三花智控	36,866	694,924.10	0.12
173	600109	国金证券	97,600	693,936.00	0.12
174	600816	安信信托	95,062	688,248.88	0.12
175	002179	中航光电	17,618	687,102.00	0.12
176	600584	长电科技	40,528	686,544.32	0.12
177	600221	海航控股	211,700	683,791.00	0.12
178	600482	中国动力	38,800	677,060.00	0.12
179	000623	吉林敖东	37,590	675,868.20	0.12
180	002065	东华软件	77,966	670,507.60	0.12
181	600674	川投能源	76,464	666,766.08	0.12
182	002049	紫光国微	15,106	666,476.72	0.12
183	600872	中炬高新	23,800	666,400.00	0.12
184	600879	航天电子	94,498	664,320.94	0.12
185	603993	洛阳钼业	105,200	661,708.00	0.12
186	002311	海大集团	31,320	660,852.00	0.12
187	000786	北新建材	35,504	657,889.12	0.12
188	600208	新湖中宝	170,800	652,456.00	0.11
189	600362	江西铜业	41,164	652,449.40	0.11
190	002217	合力泰	77,700	641,025.00	0.11
191	002714	牧原股份	14,400	640,224.00	0.11
192	000656	金科股份	132,600	636,480.00	0.11
193	000630	铜陵有色	287,390	635,131.90	0.11
194	000860	顺鑫农业	16,930	634,875.00	0.11
195	600027	华电国际	161,700	633,864.00	0.11
196	601099	太平洋	270,660	633,344.40	0.11
197	600153	建发股份	70,335	632,311.65	0.11
198	600023	浙能电力	135,000	629,100.00	0.11

199	000066	中国长城	87,722	623,703.42	0.11
200	600760	中航沈飞	17,300	623,492.00	0.11
201	600219	南山铝业	229,650	622,351.50	0.11
202	000709	河钢股份	210,923	622,222.85	0.11
203	600497	驰宏锌锗	113,800	620,210.00	0.11
204	600498	烽火通信	24,900	618,765.00	0.11
205	600018	上港集团	103,600	617,456.00	0.11
206	600884	杉杉股份	27,800	614,380.00	0.11
207	601555	东吴证券	89,353	610,280.99	0.11
208	600567	山鹰纸业	158,100	610,266.00	0.11
209	600004	白云机场	46,255	605,477.95	0.11
210	000792	盐湖股份	55,358	598,973.56	0.10
211	000839	中信国安	126,500	598,345.00	0.10
212	002465	海格通信	74,448	597,817.44	0.10
213	600315	上海家化	15,060	596,827.80	0.10
214	002081	金螳螂	59,055	596,455.50	0.10
215	601333	广深铁路	140,300	596,275.00	0.10
216	002673	西部证券	78,232	590,651.60	0.10
217	002602	世纪华通	18,100	588,250.00	0.10
218	000961	中南建设	92,150	581,466.50	0.10
219	000050	深天马 A	40,700	578,754.00	0.10
220	600771	广誉远	10,500	577,080.00	0.10
221	600811	东方集团	132,560	570,008.00	0.10
222	002439	启明星辰	26,800	568,696.00	0.10
223	000513	丽珠集团	12,932	568,361.40	0.10
224	002739	万达电影	10,900	567,236.00	0.10
225	600260	凯乐科技	21,100	566,324.00	0.10
226	600718	东软集团	43,155	563,604.30	0.10
227	600711	盛屯矿业	62,400	563,472.00	0.10
228	002078	太阳纸业	58,000	562,020.00	0.10
229	600118	中国卫星	29,327	560,145.70	0.10
230	601919	中远海控	113,800	559,896.00	0.10
231	000826	启迪桑德	31,970	558,835.60	0.10
232	002736	国信证券	61,003	555,127.30	0.10
233	000581	威孚高科	24,986	552,440.46	0.10
234	600885	宏发股份	18,440	551,724.80	0.10
235	600392	盛和资源	33,500	543,705.00	0.10
236	600170	上海建工	176,829	537,560.16	0.09
237	600138	中青旅	26,938	536,874.34	0.09
238	002176	江特电机	54,700	531,684.00	0.09
239	002797	第一创业	78,300	530,091.00	0.09
240	600600	青岛啤酒	12,086	529,729.38	0.09
241	600258	首旅酒店	19,440	528,184.80	0.09

242	002019	亿帆医药	29,900	527,735.00	0.09
243	601111	中国国航	59,300	527,177.00	0.09
244	000418	小天鹅 A	7,600	527,060.00	0.09
245	600489	中金黄金	77,148	526,149.36	0.09
246	601998	中信银行	84,500	524,745.00	0.09
247	002195	二三四五	121,273	519,048.44	0.09
248	002127	南极电商	54,900	515,511.00	0.09
249	002092	中泰化学	53,294	513,754.16	0.09
250	600642	申能股份	101,770	510,885.40	0.09
251	002085	万丰奥威	54,244	509,893.60	0.09
252	603858	步长制药	11,900	509,201.00	0.09
253	600388	龙净环保	39,750	508,005.00	0.09
254	000596	古井贡酒	5,700	506,046.00	0.09
255	000540	中天金融	103,425	503,679.75	0.09
256	000039	中集集团	37,771	501,598.88	0.09
257	000488	晨鸣纸业	38,606	498,789.52	0.09
258	000825	太钢不锈	82,900	497,400.00	0.09
259	000728	国元证券	66,900	495,060.00	0.09
260	601117	中国化学	73,500	494,655.00	0.09
261	002035	华帝股份	20,200	493,486.00	0.09
262	600839	四川长虹	171,900	491,634.00	0.09
263	600079	人福医药	36,976	488,822.72	0.09
264	000690	宝新能源	70,200	488,592.00	0.09
265	600325	华发股份	63,100	487,763.00	0.09
266	000887	中鼎股份	33,770	486,625.70	0.09
267	002223	鱼跃医疗	24,962	486,509.38	0.09
268	600369	西南证券	126,100	485,485.00	0.08
269	002294	信立泰	13,026	484,176.42	0.08
270	601168	西部矿业	76,869	482,737.32	0.08
271	600566	济川药业	10,000	481,900.00	0.08
272	002408	齐翔腾达	39,200	481,376.00	0.08
273	601699	潞安环能	51,960	481,149.60	0.08
274	600183	生益科技	52,445	480,396.20	0.08
275	002221	东华能源	49,100	479,707.00	0.08
276	002558	巨人网络	20,100	477,978.00	0.08
277	600346	恒力股份	32,600	477,916.00	0.08
278	002013	中航机电	62,690	474,563.30	0.08
279	000997	新大陆	30,120	474,390.00	0.08
280	000060	中金岭南	97,526	473,976.36	0.08
281	600297	广汇汽车	80,830	473,663.80	0.08
282	600998	九州通	27,900	473,184.00	0.08
283	002500	山西证券	70,200	473,148.00	0.08
284	000983	西山煤电	62,575	469,938.25	0.08

285	000040	东旭蓝天	46,400	468,640.00	0.08
286	600038	中直股份	11,700	467,883.00	0.08
287	600438	通威股份	67,400	465,060.00	0.08
288	601800	中国交建	40,800	464,712.00	0.08
289	600011	华能国际	73,000	464,280.00	0.08
290	000876	新希望	73,200	464,088.00	0.08
291	600380	健康元	39,100	463,726.00	0.08
292	600583	海油工程	87,818	461,922.68	0.08
293	600820	隧道股份	78,100	461,571.00	0.08
294	600755	厦门国贸	63,100	459,999.00	0.08
295	002589	瑞康医药	33,680	459,395.20	0.08
296	002183	怡亚通	68,400	454,860.00	0.08
297	600008	首创股份	107,700	454,494.00	0.08
298	002262	恩华药业	22,584	451,905.84	0.08
299	000938	紫光股份	7,200	450,720.00	0.08
300	002640	跨境通	29,900	449,098.00	0.08
301	600525	长园集团	42,480	449,013.60	0.08
302	000960	锡业股份	37,355	448,633.55	0.08
303	002185	华天科技	79,364	447,612.96	0.08
304	601198	东兴证券	34,300	447,272.00	0.08
305	600977	中国电影	27,800	445,912.00	0.08
306	000009	中国宝安	90,743	444,640.70	0.08
307	002493	荣盛石化	42,650	440,148.00	0.08
308	600460	士兰微	35,900	437,980.00	0.08
309	600282	南钢股份	98,500	435,370.00	0.08
310	600060	海信电器	32,500	435,175.00	0.08
311	000627	天茂集团	61,300	430,326.00	0.08
312	600967	内蒙一机	33,600	428,064.00	0.07
313	600572	康恩贝	59,550	426,973.50	0.07
314	603369	今世缘	18,696	426,829.68	0.07
315	600398	海澜之家	33,500	426,790.00	0.07
316	600808	马钢股份	118,565	425,648.35	0.07
317	600549	厦门钨业	27,985	424,812.30	0.07
318	000778	新兴铸管	99,044	423,908.32	0.07
319	600062	华润双鹤	17,260	423,733.00	0.07
320	600702	舍得酒业	11,700	422,253.00	0.07
321	000793	华闻传媒	50,191	421,604.40	0.07
322	000732	泰禾集团	21,600	420,120.00	0.07
323	000671	阳光城	70,365	420,079.05	0.07
324	600252	中恒集团	129,300	418,932.00	0.07
325	000402	金融街	51,900	417,795.00	0.07
326	002032	苏泊尔	8,100	417,150.00	0.07
327	603077	和邦生物	241,080	417,068.40	0.07



328	600688	上海石化	72,800	414,232.00	0.07
329	000750	国海证券	115,100	410,907.00	0.07
330	601118	海南橡胶	62,000	410,440.00	0.07
331	002506	协鑫集成	87,700	410,436.00	0.07
332	000686	东北证券	63,875	409,438.75	0.07
333	600415	小商品城	94,700	408,157.00	0.07
334	601992	金隅集团	124,302	407,710.56	0.07
335	002268	卫士通	18,660	407,347.80	0.07
336	000999	华润三九	14,600	406,318.00	0.07
337	002624	完美世界	13,100	406,231.00	0.07
338	600376	首开股份	57,700	405,631.00	0.07
339	600166	福田汽车	198,700	403,361.00	0.07
340	000807	云铝股份	77,700	402,486.00	0.07
341	600266	北京城建	42,800	402,320.00	0.07
342	002821	凯莱英	4,600	401,258.00	0.07
343	000975	银泰资源	39,440	399,921.60	0.07
344	600490	鹏欣资源	46,000	398,820.00	0.07
345	600895	张江高科	34,600	397,900.00	0.07
346	600409	三友化工	46,200	397,782.00	0.07
347	002074	国轩高科	28,180	396,210.80	0.07
348	000988	华工科技	27,400	395,930.00	0.07
349	600528	中铁工业	38,701	395,524.22	0.07
350	601258	庞大集团	215,500	394,365.00	0.07
351	000717	韶钢松山	60,100	394,256.00	0.07
352	002371	北方华创	7,900	392,393.00	0.07
353	002138	顺络电子	24,400	390,644.00	0.07
354	002601	龙蟠佰利	30,200	390,486.00	0.07
355	000528	柳工	36,400	389,844.00	0.07
356	600143	金发科技	74,200	387,324.00	0.07
357	600056	中国医药	21,200	387,324.00	0.07
358	002353	杰瑞股份	23,800	386,750.00	0.07
359	601018	宁波港	91,613	385,690.73	0.07
360	002273	水晶光电	29,965	385,649.55	0.07
361	002153	石基信息	13,237	383,873.00	0.07
362	600267	海正药业	26,362	383,303.48	0.07
363	002563	森马服饰	26,800	383,240.00	0.07
364	600125	铁龙物流	45,432	380,265.84	0.07
365	600643	爱建集团	40,188	377,767.20	0.07
366	002497	雅化集团	35,800	377,332.00	0.07
367	000729	燕京啤酒	56,006	376,920.38	0.07
368	600499	科达洁能	54,808	375,982.88	0.07
369	600751	海航科技	57,700	374,473.00	0.07
370	000559	万向钱潮	54,696	371,932.80	0.07

371	000878	云南铜业	38,605	368,291.70	0.06
372	600466	蓝光发展	59,260	367,412.00	0.06
373	600418	江淮汽车	56,429	367,352.79	0.06
374	002030	达安基因	23,798	366,965.16	0.06
375	600875	东方电气	49,500	366,795.00	0.06
376	600827	百联股份	35,908	366,261.60	0.06
377	600435	北方导航	44,400	362,304.00	0.06
378	603899	晨光文具	11,400	361,266.00	0.06
379	000598	兴蓉环境	88,900	360,934.00	0.06
380	002407	多氟多	25,700	360,314.00	0.06
381	600909	华安证券	62,900	359,788.00	0.06
382	600511	国药股份	13,328	359,189.60	0.06
383	600094	大名城	62,200	358,272.00	0.06
384	603883	老百姓	4,300	357,588.00	0.06
385	600277	亿利洁能	67,900	355,796.00	0.06
386	000401	冀东水泥	40,100	355,687.00	0.06
387	601238	广汽集团	31,780	354,029.20	0.06
388	002610	爱康科技	167,900	352,590.00	0.06
389	600978	宜华生活	51,600	352,428.00	0.06
390	002359	北讯集团	17,920	350,873.60	0.06
391	000089	深圳机场	45,800	350,370.00	0.06
392	000681	视觉中国	12,200	350,140.00	0.06
393	002600	领益智造	67,400	349,806.00	0.06
394	000008	神州高铁	70,500	349,680.00	0.06
395	600160	巨化股份	47,740	349,456.80	0.06
396	002385	大北农	84,377	348,477.01	0.06
397	000078	海王生物	72,350	348,003.50	0.06
398	002491	通鼎互联	31,300	346,491.00	0.06
399	600737	中粮糖业	45,900	346,086.00	0.06
400	600649	城投控股	56,531	345,969.72	0.06
401	002372	伟星新材	19,470	344,424.30	0.06
402	600745	闻泰科技	11,300	344,424.00	0.06
403	603885	吉祥航空	22,300	343,643.00	0.06
404	002399	海普瑞	15,502	343,214.28	0.06
405	600348	阳泉煤业	47,800	341,770.00	0.06
406	000898	鞍钢股份	61,135	340,521.95	0.06
407	002174	游族网络	17,100	340,290.00	0.06
408	000831	五矿稀土	29,200	339,888.00	0.06
409	600022	山东钢铁	168,020	339,400.40	0.06
410	601098	中南传媒	26,796	338,701.44	0.06
411	600787	中储股份	43,700	338,238.00	0.06
412	600216	浙江医药	26,400	337,128.00	0.06
413	600704	物产中大	64,120	335,347.60	0.06

414	600635	大众公用	90,145	335,339.40	0.06
415	600410	华胜天成	38,260	334,775.00	0.06
416	600161	天坛生物	17,242	333,632.70	0.06
417	002440	闰土股份	28,500	333,165.00	0.06
418	600729	重庆百货	10,100	332,795.00	0.06
419	601872	招商轮船	92,145	332,643.45	0.06
420	600307	酒钢宏兴	155,500	326,550.00	0.06
421	600291	西水股份	24,400	325,984.00	0.06
422	002583	海能达	39,000	325,650.00	0.06
423	600598	北大荒	35,300	323,348.00	0.06
424	601633	长城汽车	32,892	322,999.44	0.06
425	600728	佳都科技	44,220	322,363.80	0.06
426	000970	中科三环	34,400	321,640.00	0.06
427	002244	滨江集团	61,800	321,360.00	0.06
428	002727	一心堂	9,900	321,255.00	0.06
429	002131	利欧股份	152,577	320,411.70	0.06
430	000028	国药一致	6,408	319,759.20	0.06
431	000415	渤海金控	54,700	319,448.00	0.06
432	601021	春秋航空	9,056	317,231.68	0.06
433	600797	浙大网新	31,400	316,826.00	0.06
434	603816	顾家家居	4,300	316,093.00	0.06
435	600175	美都能源	75,300	313,248.00	0.05
436	600240	华业资本	42,391	310,726.03	0.05
437	600339	中油工程	69,200	310,708.00	0.05
438	600485	信威集团	21,100	307,849.00	0.05
439	600667	太极实业	41,800	307,648.00	0.05
440	002281	光迅科技	14,500	307,400.00	0.05
441	002573	清新环境	26,500	306,075.00	0.05
442	002191	劲嘉股份	40,812	304,865.64	0.05
443	002383	合众思壮	18,400	304,520.00	0.05
444	000917	电广传媒	52,770	303,955.20	0.05
445	000738	航发控制	22,800	303,924.00	0.05
446	601801	皖新传媒	39,600	301,356.00	0.05
447	000059	华锦股份	43,700	301,093.00	0.05
448	600881	亚泰集团	80,600	300,638.00	0.05
449	000591	太阳能	82,080	300,412.80	0.05
450	002368	太极股份	10,297	299,333.79	0.05
451	601636	旗滨集团	66,800	297,260.00	0.05
452	002396	星网锐捷	14,500	296,815.00	0.05
453	002151	北斗星通	11,500	295,550.00	0.05
454	600959	江苏有线	57,910	295,341.00	0.05
455	601866	中远海发	118,200	294,318.00	0.05
456	002709	天赐材料	7,600	292,904.00	0.05

457	002603	以岭药业	20,900	292,182.00	0.05
458	600754	锦江股份	7,900	291,984.00	0.05
459	600970	中材国际	43,600	291,248.00	0.05
460	002180	纳思达	10,600	291,076.00	0.05
461	600801	华新水泥	19,300	290,079.00	0.05
462	600320	振华重工	68,765	288,125.35	0.05
463	600859	王府井	13,506	287,272.62	0.05
464	002701	奥瑞金	52,604	287,217.84	0.05
465	600575	皖江物流	77,200	286,412.00	0.05
466	002431	棕榈股份	42,650	286,181.50	0.05
467	600037	歌华有线	27,700	285,864.00	0.05
468	600372	中航电子	21,800	284,708.00	0.05
469	603766	隆鑫通用	52,400	284,532.00	0.05
470	601128	常熟银行	49,700	284,284.00	0.05
471	002152	广电运通	48,300	284,004.00	0.05
472	002028	思源电气	16,900	283,751.00	0.05
473	000848	承德露露	26,789	283,695.51	0.05
474	600500	中化国际	41,400	282,348.00	0.05
475	600803	新奥股份	24,400	281,576.00	0.05
476	600171	上海贝岭	24,300	281,394.00	0.05
477	002745	木林森	15,800	281,082.00	0.05
478	603678	火炬电子	11,250	280,350.00	0.05
479	600503	华丽家族	71,700	280,347.00	0.05
480	002665	首航节能	48,120	279,096.00	0.05
481	000697	炼石有色	19,400	278,584.00	0.05
482	002280	联络互动	48,600	277,992.00	0.05
483	601000	唐山港	117,720	276,642.00	0.05
484	002595	豪迈科技	15,900	276,501.00	0.05
485	601100	恒立液压	13,160	274,780.80	0.05
486	002839	张家港行	44,900	273,441.00	0.05
487	600061	国投资本	29,400	272,832.00	0.05
488	000800	一汽轿车	36,346	271,868.08	0.05
489	002051	中工国际	17,804	271,867.08	0.05
490	600122	宏图高科	36,700	271,580.00	0.05
491	600064	南京高科	36,860	270,552.40	0.05
492	000016	深康佳 A	51,500	270,375.00	0.05
493	002680	长生生物	12,100	269,709.00	0.05
494	002075	沙钢股份	16,700	269,204.00	0.05
495	002517	恺英网络	37,400	268,906.00	0.05
496	600110	诺德股份	51,400	268,822.00	0.05
497	002108	沧州明珠	45,707	268,300.09	0.05
498	000902	新洋丰	29,100	267,720.00	0.05
499	600536	中国软件	12,293	265,897.59	0.05

500	000883	湖北能源	64,600	265,506.00	0.05
501	600562	国睿科技	15,481	265,499.15	0.05
502	600039	四川路桥	80,646	264,518.88	0.05
503	600782	新钢股份	47,400	264,492.00	0.05
504	002444	巨星科技	24,000	264,240.00	0.05
505	600835	上海机电	14,000	264,040.00	0.05
506	000758	中色股份	58,600	263,700.00	0.05
507	600373	中文传媒	20,500	263,425.00	0.05
508	600863	内蒙华电	115,300	261,731.00	0.05
509	601179	中国西电	76,400	261,288.00	0.05
510	002926	华西证券	26,000	261,040.00	0.05
511	600694	大商股份	8,027	260,957.77	0.05
512	600323	瀚蓝环境	17,100	260,262.00	0.05
513	002555	三七互娱	21,300	258,795.00	0.05
514	600158	中体产业	22,177	258,140.28	0.05
515	002128	露天煤业	28,400	257,304.00	0.05
516	002056	横店东磁	36,700	257,267.00	0.05
517	600648	外高桥	13,981	255,572.68	0.04
518	002925	盈趣科技	4,600	254,748.00	0.04
519	600446	金证股份	22,781	250,818.81	0.04
520	601958	金铂股份	39,994	250,762.38	0.04
521	600717	天津港	33,300	250,749.00	0.04
522	000933	神火股份	52,000	250,120.00	0.04
523	000566	海南海药	19,400	250,066.00	0.04
524	600185	格力地产	46,000	249,780.00	0.04
525	000021	深科技	36,600	249,612.00	0.04
526	000012	南玻 A	50,408	249,519.60	0.04
527	000718	苏宁环球	67,770	248,715.90	0.04
528	600230	沧州大化	11,220	248,635.20	0.04
529	601200	上海环境	15,669	248,040.27	0.04
530	002156	通富微电	22,900	248,007.00	0.04
531	002390	信邦制药	33,850	247,782.00	0.04
532	600507	方大特钢	23,100	246,939.00	0.04
533	002672	东江环保	18,800	246,092.00	0.04
534	000989	九芝堂	13,000	245,700.00	0.04
535	002025	航天电器	10,600	244,860.00	0.04
536	600908	无锡银行	41,400	243,846.00	0.04
537	000519	中兵红箭	31,373	243,768.21	0.04
538	002343	慈文传媒	12,980	243,634.60	0.04
539	000027	深圳能源	49,292	243,502.48	0.04
540	600021	上海电力	35,900	241,966.00	0.04
541	000150	宜华健康	8,900	241,190.00	0.04
542	600597	光明乳业	24,360	240,433.20	0.04

543	002690	美亚光电	10,044	239,448.96	0.04
544	002424	贵州百灵	21,036	238,968.96	0.04
545	600269	赣粤高速	58,000	237,220.00	0.04
546	600337	美克家居	40,390	236,685.40	0.04
547	601717	郑煤机	40,700	236,467.00	0.04
548	600120	浙江东方	17,450	236,447.50	0.04
549	002157	正邦科技	58,000	236,060.00	0.04
550	601966	玲珑轮胎	14,900	234,973.00	0.04
551	600823	世茂股份	55,874	233,553.32	0.04
552	600687	刚泰控股	25,600	232,704.00	0.04
553	601588	北辰实业	66,000	232,320.00	0.04
554	002292	奥飞娱乐	26,000	232,180.00	0.04
555	000426	兴业矿业	32,000	230,720.00	0.04
556	002210	飞马国际	18,696	230,521.68	0.04
557	600026	中远海能	54,300	230,232.00	0.04
558	002477	雏鹰农牧	69,400	229,714.00	0.04
559	002249	大洋电机	52,900	227,999.00	0.04
560	601011	宝泰隆	40,000	226,800.00	0.04
561	000939	凯迪生态	45,450	226,795.50	0.04
562	600582	天地科技	61,600	226,072.00	0.04
563	002219	恒康医疗	21,380	225,345.20	0.04
564	002635	安洁科技	13,100	225,320.00	0.04
565	600478	科力远	44,030	224,553.00	0.04
566	002155	湖南黄金	32,829	224,550.36	0.04
567	600280	中央商场	25,700	224,104.00	0.04
568	600545	卓郎智能	28,200	223,908.00	0.04
569	601880	大连港	115,330	223,740.20	0.04
570	002285	世联行	35,560	222,961.20	0.04
571	000537	广宇发展	23,100	222,684.00	0.04
572	002916	深南电路	3,500	222,285.00	0.04
573	002389	南洋科技	16,400	222,056.00	0.04
574	002807	江阴银行	39,500	221,990.00	0.04
575	600777	新潮能源	101,360	221,978.40	0.04
576	000712	锦龙股份	22,210	221,655.80	0.04
577	600017	日照港	68,800	220,848.00	0.04
578	601666	平煤股份	52,700	220,286.00	0.04
579	600259	广晟有色	7,504	219,717.12	0.04
580	002251	步步高	19,300	219,634.00	0.04
581	600416	湘电股份	30,500	219,295.00	0.04
582	600580	卧龙电气	28,769	219,219.78	0.04
583	601718	际华集团	54,500	219,090.00	0.04
584	600098	广州发展	33,881	218,532.45	0.04
585	601222	林洋能源	43,800	218,124.00	0.04

586	002036	联创电子	16,600	217,792.00	0.04
587	600123	兰花科创	31,200	217,464.00	0.04
588	600155	宝硕股份	30,200	217,138.00	0.04
589	600611	大众交通	54,377	216,420.46	0.04
590	000937	冀中能源	52,629	216,305.19	0.04
591	600633	浙数文化	25,800	215,172.00	0.04
592	000400	许继电气	27,492	214,712.52	0.04
593	600057	厦门象屿	42,809	213,616.91	0.04
594	000620	新华联	37,600	213,192.00	0.04
595	002089	新海宜	35,200	212,960.00	0.04
596	002421	达实智能	52,500	212,625.00	0.04
597	600477	杭萧钢构	44,389	212,623.31	0.04
598	600491	龙元建设	30,400	212,496.00	0.04
599	600848	上海临港	9,800	212,366.00	0.04
600	000829	天音控股	28,900	211,837.00	0.04
601	000727	华东科技	112,400	211,312.00	0.04
602	600851	海欣股份	25,700	211,254.00	0.04
603	600770	综艺股份	35,410	208,919.00	0.04
604	000563	陕国投 A	61,308	208,447.20	0.04
605	002670	国盛金控	19,313	208,001.01	0.04
606	601016	节能风电	72,200	207,214.00	0.04
607	600172	黄河旋风	47,620	206,670.80	0.04
608	002237	恒邦股份	22,600	206,338.00	0.04
609	000587	金洲慈航	41,600	206,336.00	0.04
610	002434	万里扬	23,500	206,330.00	0.04
611	601567	三星医疗	28,300	206,024.00	0.04
612	002501	利源精制	33,200	205,840.00	0.04
613	600033	福建高速	68,100	205,662.00	0.04
614	601611	中国核建	26,000	205,400.00	0.04
615	000685	中山公用	25,600	204,032.00	0.04
616	002242	九阳股份	11,400	201,666.00	0.04
617	600612	老凤祥	5,600	201,264.00	0.04
618	002095	生意宝	5,600	200,984.00	0.04
619	600936	广西广电	41,500	197,540.00	0.03
620	000158	常山北明	28,650	196,825.50	0.03
621	601231	环旭电子	21,600	195,912.00	0.03
622	600086	东方金钰	19,500	195,780.00	0.03
623	002429	兆驰股份	78,630	195,002.40	0.03
624	002544	杰赛科技	14,200	194,398.00	0.03
625	002354	天神娱乐	20,960	194,089.60	0.03
626	601311	骆驼股份	16,900	193,843.00	0.03
627	000687	华讯方舟	20,900	192,489.00	0.03
628	000088	盐田港	28,960	190,846.40	0.03

629	002123	梦网集团	21,400	190,246.00	0.03
630	000501	鄂武商 A	15,330	188,405.70	0.03
631	600750	江中药业	10,540	187,085.00	0.03
632	600179	安通控股	18,440	186,797.20	0.03
633	000921	海信科龙	18,000	186,480.00	0.03
634	601375	中原证券	39,900	186,333.00	0.03
635	600622	光大嘉宝	25,706	184,826.14	0.03
636	600072	中船科技	20,100	184,116.00	0.03
637	002707	众信旅游	19,000	182,400.00	0.03
638	002303	美盈森	34,500	182,160.00	0.03
639	600316	洪都航空	19,525	181,973.00	0.03
640	000869	张裕 A	4,545	181,163.70	0.03
641	002509	天广中茂	62,000	180,420.00	0.03
642	000980	众泰汽车	25,300	179,883.00	0.03
643	000676	智度股份	14,400	178,272.00	0.03
644	600986	科达股份	19,000	177,840.00	0.03
645	000090	天健集团	28,648	177,617.60	0.03
646	002375	亚厦股份	33,257	177,592.38	0.03
647	600565	迪马股份	60,100	177,295.00	0.03
648	002489	浙江永强	48,700	177,268.00	0.03
649	000666	经纬纺机	9,800	177,184.00	0.03
650	600874	创业环保	18,900	176,526.00	0.03
651	000935	四川双马	11,400	176,472.00	0.03
652	000541	佛山照明	29,412	176,177.88	0.03
653	002505	大康农业	81,760	174,966.40	0.03
654	000062	深圳华强	8,900	174,440.00	0.03
655	002091	江苏国泰	27,400	173,990.00	0.03
656	002445	中南文化	20,600	173,864.00	0.03
657	601929	吉视传媒	77,200	173,700.00	0.03
658	002093	国脉科技	22,500	173,475.00	0.03
659	600151	航天机电	42,700	173,362.00	0.03
660	000600	建投能源	31,100	173,227.00	0.03
661	600420	现代制药	16,600	172,640.00	0.03
662	600502	安徽水利	42,720	171,734.40	0.03
663	600312	平高电气	30,278	170,767.92	0.03
664	002203	海亮股份	21,000	170,100.00	0.03
665	002643	万润股份	22,600	168,822.00	0.03
666	600759	洲际油气	42,780	168,553.20	0.03
667	600020	中原高速	44,600	168,142.00	0.03
668	601608	中信重工	64,600	167,960.00	0.03
669	600226	瀚叶股份	36,556	166,695.36	0.03
670	600400	红豆股份	44,070	165,262.50	0.03
671	601001	大同煤业	33,200	164,672.00	0.03



672	002503	搜于特	46,600	163,100.00	0.03
673	600006	东风汽车	39,700	162,373.00	0.03
674	600873	梅花生物	38,500	160,930.00	0.03
675	000061	农产品	29,500	159,300.00	0.03
676	603000	人民网	19,172	159,127.60	0.03
677	601163	三角轮胎	11,900	158,984.00	0.03
678	601908	京运通	34,700	158,926.00	0.03
679	002681	奋达科技	18,300	158,478.00	0.03
680	600869	智慧能源	33,100	156,232.00	0.03
681	600058	五矿发展	18,580	154,399.80	0.03
682	601928	凤凰传媒	25,300	153,824.00	0.03
683	600428	中远海特	42,600	151,230.00	0.03
684	002522	浙江众成	22,500	145,575.00	0.03
685	002414	高德红外	10,800	145,152.00	0.03
686	600317	营口港	64,132	144,938.32	0.03
687	000918	嘉凯城	31,300	142,415.00	0.02
688	600550	保变电气	34,200	139,194.00	0.02
689	002482	广田集团	22,800	136,116.00	0.02
690	002302	西部建设	12,600	135,702.00	0.02
691	002699	美盛文化	7,200	135,072.00	0.02
692	600701	*ST 工新	14,600	134,612.00	0.02
693	600604	市北高新	28,000	132,720.00	0.02
694	600338	西藏珠峰	6,400	132,608.00	0.02
695	002011	盾安环境	20,600	131,840.00	0.02
696	603111	康尼机电	19,750	130,547.50	0.02
697	002309	中利集团	9,000	128,700.00	0.02
698	002498	汉缆股份	57,800	127,738.00	0.02
699	600862	中航高科	20,700	127,305.00	0.02
700	300747	锐科激光	1,543	123,995.48	0.02
701	002547	春兴精工	28,100	122,235.00	0.02
702	002542	中化岩土	22,500	120,150.00	0.02
703	002041	登海种业	17,485	119,247.70	0.02
704	002418	康盛股份	25,400	107,188.00	0.02
705	002239	奥特佳	29,540	106,934.80	0.02
706	603650	彤程新材	2,376	50,988.96	0.01
707	603693	江苏新能	5,384	48,456.00	0.01
708	002721	金一文化	3,600	32,364.00	0.01
709	603105	芯能科技	3,410	16,470.30	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	000333	美的集团	6,014,030.25	1.47
2	000651	格力电器	5,073,624.00	1.24
3	000002	万 科 A	5,012,576.62	1.23
4	000858	五 粮 液	3,219,534.77	0.79
5	002415	海康威视	3,153,506.77	0.77
6	000725	京东方 A	2,832,610.00	0.69
7	000001	平安银行	1,944,419.18	0.48
8	601229	上海银行	1,843,319.60	0.45
9	601318	中国平安	1,779,786.59	0.44
10	002460	赣锋锂业	1,539,855.00	0.38
11	002304	洋河股份	1,354,730.00	0.33
12	002594	比亚迪	1,340,753.00	0.33
13	000538	云南白药	1,285,200.00	0.31
14	002230	科大讯飞	1,232,474.08	0.30
15	601012	隆基股份	1,187,848.16	0.29
16	002027	分众传媒	1,185,342.40	0.29
17	600276	恒瑞医药	1,167,503.00	0.29
18	600036	招商银行	1,105,982.00	0.27
19	002475	立讯精密	1,105,863.82	0.27
20	002008	大族激光	1,090,922.00	0.27

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	002450	康得新	2,259,881.34	0.55
2	000002	万 科 A	2,014,381.00	0.49
3	600309	万华化学	1,827,996.14	0.45
4	000063	中兴通讯	1,225,836.08	0.30
5	600276	恒瑞医药	1,056,551.10	0.26
6	000333	美的集团	1,048,301.00	0.26
7	601318	中国平安	1,042,934.00	0.26
8	000651	格力电器	892,762.00	0.22
9	601600	中国铝业	863,802.72	0.21
10	601012	隆基股份	862,451.80	0.21
11	002460	赣锋锂业	849,048.00	0.21
12	000858	五 粮 液	684,509.00	0.17
13	300750	宁德时代	653,170.82	0.16
14	600036	招商银行	626,788.00	0.15
15	600518	康美药业	622,060.00	0.15
16	603259	药明康德	600,980.41	0.15

17	002415	海康威视	568,451.00	0.14
18	601766	中国中车	522,649.00	0.13
19	000661	长春高新	500,343.01	0.12
20	600000	浦发银行	496,969.00	0.12

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	165,707,444.15
卖出股票的收入（成交）总额	75,915,876.12

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
IF1807	沪深 300 股指期货 IF1807 合约	6	6,263,640.00	-334,500.00	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。
IC1807	中证 500 股指期货 IC1807 合约	6	6,225,600.00	-378,040.00	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。
IF1809	沪深 300 股指期货	1	1,032,840.00	-86,460.00	买入股指期货多头合约的目的是进行

	IF1809 合约				更有效地流动性管理。
公允价值变动总额合计					-799,000.00
股指期货投资本期收益					-444,399.03
股指期货投资本期公允价值变动					-847,520.00

#### 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 报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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	2,366,127.36
2	应收证券清算款	1,570,767.28
3	应收股利	-
4	应收利息	4,318.57
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,941,213.21

##### 7.12.4 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。

## 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## 7.12.6 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
9,191	60,657.52	70,041,853.00	12.56%	344,046,113.00	61.71%	143,415,281.00	25.72%

## 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	芜湖歌斐资产管理有限公司—歌斐传承私募基金	11,572,651.00	2.23%
2	厦门市担保有限公司	5,500,000.00	1.06%
3	安英慧	5,038,800.00	0.97%
4	蔡咏仪	4,000,000.00	0.77%
5	陈晓明	3,300,000.00	0.64%
6	田雪芝	3,150,000.00	0.61%
7	宋志强	2,928,300.00	0.56%
8	耿勤新	2,681,800.00	0.52%
9	曹茂秋	2,622,800.00	0.51%
10	联讯证券股份有限公司	2,589,244.00	0.50%
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	143,415,281.00	27.66%

## 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	347,503,247
本报告期基金总申购份额	250,000,000
减：本报告期基金总赎回份额	40,000,000
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	557,503,247

## §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

本基金管理人于 2018 年 4 月 28 日发布公告，杨明辉先生代任华夏基金管理有限公司总经理，汤晓东先生不再担任华夏基金管理有限公司总经理。

本基金管理人于 2018 年 5 月 19 日发布公告，李一梅女士担任华夏基金管理有限公司总经理。

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无受稽查或处罚等情况。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

## 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国泰君安证券	4	187,645,762.52	78.36%	24,641.04	78.36%	-
中国银河证券	5	51,826,719.36	21.64%	6,805.23	21.64%	-

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，本基金还选择了东北证券、东方证券、高华证券、国盛证券、国信证券、海通证券、华泰证券、平安证券、瑞银证券、申万宏源证券、太平洋证券、天风证券、万和证券、西部证券、兴业证券、招商证券、中金公司、中信建投证券、中信证券和中银国际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，国盛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	33,202.20	11.02%	3,500,000.00	100.00%
中国银河证券	268,117.55	88.98%	-	-

## 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杭州分公司营业场所变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2018-01-31
2	华夏基金管理有限公司关于根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》修订旗下开放式基金基金合同的公告	中国证监会指定报刊及网站	2018-03-23
3	华夏基金管理有限公司关于根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》对短期投资行为收取短期赎回费的提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2018-03-23
4	华夏基金管理有限公司公告	中国证监会指定报刊及网站	2018-04-28
5	华夏基金管理有限公司公告	中国证监会指定报刊及网站	2018-05-19
6	华夏基金管理有限公司关于华夏中证 500ETF、华夏 MSCI 中国 A 股 ETF 新增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	2018-06-20

## §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	1	2018-01-01 至 2018-06-30	102,932,981.00	47,882,300.00	7,400,000.00	143,415,281.00	25.72%



ETF 联接							
产品特有风险							
<p>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。</p> <p>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正常运作水平，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。</p>							

## §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  
二〇一八年八月二十五日