

华安深证 300 指数证券投资基金（LOF）

2017 年年度报告

2017 年 12 月 31 日

基金管理人：华安基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一八年三月二十七日

§1 重要提示及目录

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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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

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

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

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
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	15
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	16
§6 审计报告	16
6.1 审计意见	16
6.2 形成审计意见的基础	16
6.3 管理层对财务报表的责任	16
6.4 注册会计师的责任	17
§7 年度财务报表	18
7.1 资产负债表	18
7.2 利润表	19
7.3 所有者权益 (基金净值) 变动表	21
7.4 报表附注	22
§8 投资组合报告	49
8.1 期末基金资产组合情况	49
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	49
8.3 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	51
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	58
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	72

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	73
8.7 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	73
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	73
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	73
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	73
8.12 投资组合报告附注	74
§9 基金份额持有人信息	75
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	75
9.2 期末上市基金前十名持有人	75
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	75
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	76
§10 开放式基金份额变动	76
§11 重大事件揭示	76
11.1 基金份额持有人大会决议	76
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	76
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	77
11.4 基金投资策略的改变	77
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	77
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	77
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	77
11.8 其他重大事件	79
12 影响投资者决策的其他重要信息	82
§13 备查文件目录	82
13.1 备查文件目录	82
13.2 存放地点	82
13.3 查阅方式	83

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

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

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	华安基金管理有限公司	中国银行股份有限公司

信息披露 负责人	姓名	钱鲲	王永民
	联系电话	021-38969999	010-66594896
	电子邮箱	qiankun@huaan.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		4008850099	95566
传真		021-68863414	010-66594942
注册地址		中国 (上海) 自由贸易试验区 世纪大道8号国金中心二期31 —32层	北京西城区复兴门内大街1号
办公地址		中国 (上海) 自由贸易试验区 世纪大道8号国金中心二期31 —32层	北京西城区复兴门内大街1号
邮政编码		200120	100818
法定代表人		朱学华	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	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.huaan.com.cn
基金年度报告备置地点	上海市世纪大道 8 号上海国金中心二期 31、32 层

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2017 年	2016 年	2015 年
本期已实现收益	14,376,459.91	-533,420.57	18,885,296.39
本期利润	39,226,290.13	-6,560,827.81	13,332,422.91
加权平均基金份额本期利润	0.1123	-0.2765	0.4498
本期加权平均净值利润率	10.22%	-22.68%	31.10%
本期基金份额净值增长率	10.15%	-18.71%	23.84%
3.1.2 期末数据和指标	2017 年末	2016 年末	2015 年末
期末可供分配利润	25,979,415.59	4,343,958.19	11,312,983.08
期末可供分配基金份额利润	0.0462	0.1953	0.4698
期末基金资产净值	588,689,726.49	26,584,237.94	35,393,103.49
期末基金份额净值	1.046	1.195	1.470
3.1.3 累计期末指标	2017 年末	2016 年末	2015 年末
基金份额累计净值增长率	31.63%	19.50%	47.00%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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

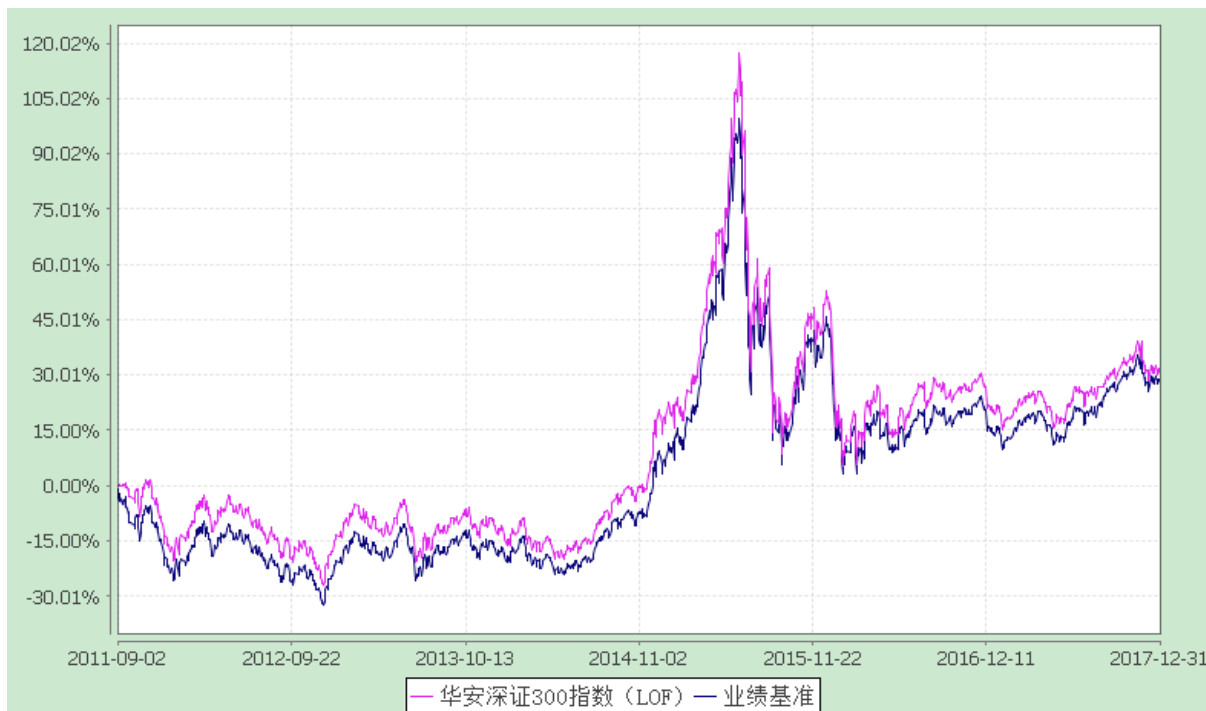
效起至今						
------	--	--	--	--	--	--

3.2.2 自基金合同生效以来 基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华安深证 300 指数证券投资基金 (LOF)

自基金合同生效以来份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

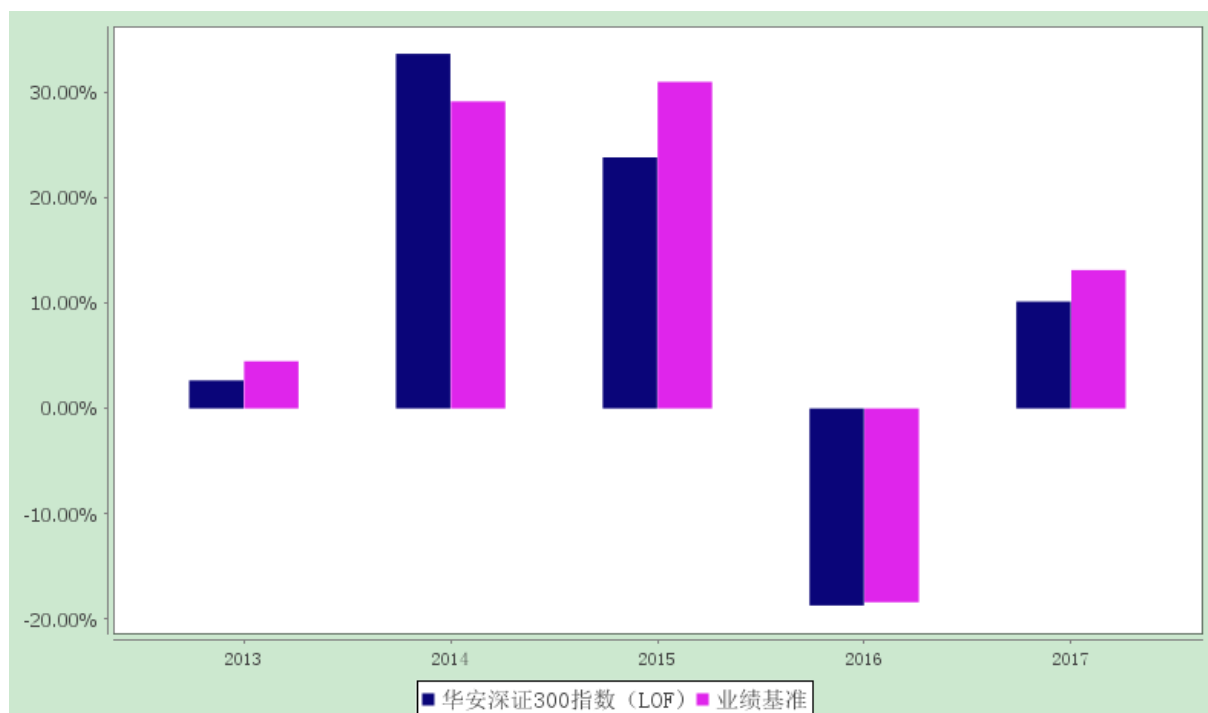
(2011 年 9 月 2 日至 2017 年 12 月 31 日)



3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华安深证 300 指数证券投资基金 (LOF)

过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



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

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

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

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

华安基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1998]20 号文批准于 1998 年 6 月设立，是国内首批基金管理公司之一，注册资本 1.5 亿元人民币，公司总部设在上海陆家嘴金融贸易区。目前的股东为国泰君安投资管理股份有限公司、上海国际信托有限公司、上海工业投资（集团）有限公司、上海锦江国际投资管理有限公司和国泰君安创新投资有限公司。公司在北京、上海、沈阳、成都、广州等地设有分公司，在香港和上海设有子公司—华安（香港）资产管理有限公司、华安未来资产管理有限公司。截至 2017 年 12 月 31 日，公司旗下共管理华安创新混合、华安 MSCI 中国 A、华安

现金富利货币、华安稳定收益债券、华安黄金易 ETF、华安沪港深外延增长混合、华安全球美元收益债券等 98 只开放式基金，管理资产规模达到 1851.32 亿元人民币。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
许之彦	本基金的基金经理，指数与量化投资事业总部高级总监	2011-09-02	-	14 年	理学博士，14 年证券、基金从业经验，CQF(国际数量金融工程师)。曾在广发证券和中山大学经济管理学院博士后流动站从事金融工程工作，2005 年加入华安基金管理有限公司，曾任研究发展部数量策略分析师，2008 年 4 月至 2012 年 12 月担任华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金的基金经理，2009 年 9 月起同时担任上证 180 交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理。2010 年 11 月至 2012 年 12 月担任上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理。2011 年 9 月起同时担任本基金的基金经理。2013 年 6 月起担任指数投资部高级总监。2013 年 7 月起同时担任华安易富黄金交易型开放式证券投资基金的基金经理。2013 年 8 月起同时担任华安易富黄金交易型开放式证券投资基金联接基金的基金经理。2014 年 11 月至 2015 年 12 月担任华安中证高分红指数增强型证券投资基金的基金经理。2015 年 6 月起同时担任华安中证全指证券公司指数分级证券投资基金、华安中证银行指数分级证券投资基金的基金经理。2015 年 7 月起担任华安创业板 50 指数分级证券投资基金的基金经理。2016 年 6 月起担任华安创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2017 年 12 月起，

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

注: 此处的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日, 即以公告日为准。证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内, 本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、招募说明书等有关基金法律文件的规定, 本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产, 在控制风险的前提下, 为基金份额持有人谋求最大利益, 不存在违法违规或未履行基金合同承诺的情形。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》, 公司制定了《华安基金管理有限公司公平交易管理制度》, 将封闭式基金、开放式基金、特定客户资产管理组合及其他投资组合资产在研究分析、投资决策、交易执行等方面全部纳入公平交易管理中。控制措施包括: 在研究环节, 研究员在为公司管理的各类投资组合提供研究信息、投资建议过程中, 使用晨会发言、邮件发送、登录在研究报告管理系统中等方式来确保各类投资组合经理可以公平享有信息获取机会。在投资环节, 公司各投资组合经理根据投资组合的风格和投资策略, 制定并严格执行交易决策规则, 以

保证各投资组合交易决策的客观性和独立性。同时严格执行投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体授权机制，投资组合经理在授权范围内自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易环节，公司实行强制公平交易机制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。(1) 交易所二级市场业务，遵循价格优先、时间优先、比例分配、综合平衡的控制原则，实现同一时间下达指令的投资组合在交易时机上的公平性。(2) 交易所一级市场业务，投资组合经理按意愿独立进行业务申报，集中交易部以投资组合名义对外进行申报。若该业务以公司名义进行申报与中签，则按实际中签情况以价格优先、比例分配原则进行分配。若中签量过小无法合理进行比例分配，且以公司名义获得，则投资部门在合规监察员监督参与下，进行公平协商分配。(3) 银行间市场业务遵循指令时间优先原则，先到先询价的控制原则。通过内部共同的 iwind 群，发布询价需求和结果，做到信息公开。若是多个投资组合进行一级市场投标，则各投资组合经理须以各投资组合名义向集中交易部下达投资意向，交易员以此进行投标，以确保中签结果与投资组合投标意向一一对应。若中签量过小无法合理进行比例分配，且以公司名义获得，则投资部门在风险管理部投资监督参与下，进行公平协商分配。交易监控、分析与评估环节，公司风险管理部对公司旗下的各投资组合投资境内证券市场上市交易的投资品种、进行场外的非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购、不同投资组合同日和临近交易日的反向交易以及可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控，根据市场公认的第三方信息（如：中债登的债券估值），定期对各投资组合与交易对手之间议价交易的交易价格公允性进行审查，对不同投资组合临近交易日的同向交易的交易时机和交易价差进行分析。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

本基金管理人通过统计检验的方法对管理的不同投资组合，在不同时间窗下（日内、3日内、5日内）的本年度同向交易价差进行了专项分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司合规监察稽核部会同基金投资、交易部门讨论制定了公募基金、专户针对股票、债券、回购等投资品种在交易所及银行间的同日反向交易控制规则，并在投资系统中进行了设置，实现了完全的系统控制。同时加强了对基金、专户间的同日反向交易的监控与隔日反向交易的检查；风险管理部开发了同向交易分析系统，对相关同向交易指标进行持续监控，并定期对组合间的同向交易行为进行了重点分析。

本报告期内，因组合流动性管理或投资策略调整需要，除指数基金以外的所有投资组合参与的

交易所公开竞价交易中, 同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的次数为 1 次, 未出现异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

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

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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

作为华安深 300LOF 基金的管理人, 我们继续坚持积极将基金回报与指数相拟合的原则, 降低跟踪偏离和跟踪误差, 勤勉尽责, 为投资者获得长期稳定的回报。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内, 公司合规监察稽核部从维护基金份额持有人利益、保障基金的合规运作出发, 重点在法律事务、合规管理、内部稽核、信息披露、反洗钱、员工行为规范等方面开展工作, 深化员

工的合规意识，推动公司的合规文化和内部风险控制机制的完善与优化。

监察稽核工作重点集中于以下几个方面：

(1) 继续深化“主动合规”的管理理念，强化全体员工的合规意识和风险控制意识，通过定期组织员工进行职业道德规范、反洗钱、防范利益冲突、客户信息保密、销售适用性等方面的合规培训和内部审计，推动公司建立良好的内控环境和合规文化。

(2) 强化内控建设，持续进行投资管理人员合规培训，坚守“三条底线”；

(3) 做好在新基金产品开发、新投资品种、及其他创新业务中法律、合规及风险控制方面的支持，坚持定期对投资、研究、交易、核算、销售等相关业务活动的日常合规性检查。

(4) 推动落实公司投资、运营业务操作流程标准化，细化各相关部门在各业务环节的操作流程及工作职责，降低操作风险发生的概率。

(5) 按照法规的要求，做好旗下各只基金的信息披露工作，做到信息披露的真实、完整、准确、及时。

(6) 有计划地对公司投资研究、基金销售、后台运营等相关业务部门进行了多次全面或专项稽核，强化对公司制度执行和风控措施的落实。

本基金管理人承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范和控制各种风险，保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本基金管理人设有估值委员会，负责在证券发行机构发生了严重影响证券价格的重大事件时，评估重大事件对投资品种价值的影响程度、评估对基金估值的影响程度、确定采用的估值方法、确

定该证券的公允价值；同时将采用的估值方法以及采用该方法对相关证券的估值与基金的托管银行进行沟通。估值委员会成员由投资总监、研究总监、固定收益部总监、指数投资部总监、基金运营部总经理、风险管理部总监等人员组成，具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备行业研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.9 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

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

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

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

5.3 托管人对本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

普华永道中天审字(2018)第 20790 号

华安深证 300 指数证券投资基金(LOF) 全体基金份额持有人：

6.1 审计意见

(一) 我们审计的内容

我们审计了华安深证 300 指数证券投资基金(LOF)(以下简称“华安深证 300 指数基金”)的财务报表，包括 2017 年 12 月 31 日的资产负债表，2017 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

(二) 我们的意见

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，公允反映了华安深证 300 指数基金 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。

6.2 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。

按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于华安深证 300 指数基金，并履行了职业道德方面的其他责任。

6.3 管理层对财务报表的责任

华安深证 300 指数基金的基金管理人华安基金管理有限公司(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。

在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估华安深证 300 指数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华安深证 300 指数基金、终止运营或别无其他现实的选择。

基金管理人治理层负责监督华安深证 300 指数基金的财务报告过程。

6.4 注册会计师的责任

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。

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:

(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风险。

(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。

(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。

(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, 就可能导致对华安安信消费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华安安信消费混合基金不能持续经营。

(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。

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。

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)

中国注册会计师

单峰 魏佳亮

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：华安深证 300 指数证券投资基金 (LOF)

报告截止日：2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	7.4.7.1	35,133,761.51	1,768,143.34
结算备付金		454.62	-
存出保证金		361,922.65	1,544.74
交易性金融资产	7.4.7.2	555,417,347.73	25,170,108.71
其中：股票投资		554,185,947.73	25,166,477.99
基金投资		-	-
债券投资		1,231,400.00	3,630.72
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	7,200.84	359.73
应收股利		-	-
应收申购款		4,184.46	1,628.39
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		590,924,871.81	26,941,784.91

负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
负债：		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		1,355,722.20	51,954.27
应付赎回款		44,379.40	2.49
应付管理人报酬		275,563.69	11,621.05
应付托管费		55,112.72	2,324.22
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	276,200.06	5,644.92
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	228,167.25	286,000.02
负债合计		2,235,145.32	357,546.97
所有者权益：		-	-
实收基金	7.4.7.9	562,710,310.90	22,240,279.75
未分配利润	7.4.7.10	25,979,415.59	4,343,958.19
所有者权益合计		588,689,726.49	26,584,237.94
负债和所有者权益总计		590,924,871.81	26,941,784.91

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

7.2 利润表

会计主体：华安深证 300 指数证券投资基金 (LOF)

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	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
一、收入		44,226,366.82	-5,829,503.42
1.利息收入		1,070,320.87	13,336.37
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,070,097.17	13,319.37
债券利息收入		223.70	17.00
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		14,225,740.22	174,610.66
其中：股票投资收益	7.4.7.12	13,681,570.21	-167,573.60
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	24,974.55	1,332.01
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	519,195.46	340,852.25
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	24,849,830.22	-6,027,407.24
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	4,080,475.51	9,956.79
减：二、费用		5,000,076.69	731,324.39
1. 管理人报酬		1,915,281.07	144,685.22
2. 托管费		383,056.13	28,937.00
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	2,239,632.74	41,509.68
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-

6. 其他费用	7.4.7.20	462,106.75	516,192.49
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		39,226,290.13	-6,560,827.81
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		39,226,290.13	-6,560,827.81

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安深证 300 指数证券投资基金 (LOF)

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	22,240,279.75	4,343,958.19	26,584,237.94
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	39,226,290.13	39,226,290.13
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	540,470,031.15	968,448,823.97	1,508,918,855.12
其中：1.基金申购款	3,775,604,234.40	1,003,462,936.94	4,779,067,171.34
2.基金赎回款	-3,235,134,203.25	-35,014,112.97	-3,270,148,316.22
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-986,039,656.70	-986,039,656.70
五、期末所有者权益（基金净值）	562,710,310.90	25,979,415.59	588,689,726.49

项目	上年度可比期间		
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	24,080,120.41	11,312,983.08	35,393,103.49
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	-6,560,827.81	-6,560,827.81
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)	-1,839,840.66	-408,197.08	-2,248,037.74
其中：1.基金申购款	6,414,007.89	1,544,828.17	7,958,836.06
2.基金赎回款	-8,253,848.55	-1,953,025.25	-10,206,873.80
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动 (净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益 (基金净值)	22,240,279.75	4,343,958.19	26,584,237.94

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码 (序号) 从 7.1 至 7.4, 财务报表由下列负责人签署:

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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

华安深证 300 指数证券投资基金(LOF)(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2011]884 号《关于核准华安深证 300 指数证券投资基金(LOF)募集的批复》核准, 由华安基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安深证 300 指数证

券投资基金(LOF)基金合同》负责公开募集。本基金为上市契约型开放式, 存续期限不定, 首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 607,830,415.01 元, 业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2011)第 349 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案, 《华安深证 300 指数证券投资基金(LOF)基金合同》于 2011 年 9 月 2 日正式生效, 基金合同生效日的基金份额总额为 608,040,554.70 份基金份额, 其中认购资金利息折合 210,139.69 份基金份额。本基金的基金管理人为华安基金管理有限公司, 基金托管人为中国银行股份有限公司。

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

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

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

7.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2017 年度财务报表符合企业会计准则的要求, 真实、完整地反映了本基金 2017 年 12 月

31 日的财务状况以及 2017 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，其中场外基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按红利发放日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资，场内基金份额持有人只能选择现金分红。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。具体收益分配政策请参见本基金合同的相关章节。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[201708]1338号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》和中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中央国债登记结算有限责任公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

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

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
活期存款	35,133,761.51	1,768,143.34

定期存款	-	-
其他存款	-	-
合计	35,133,761.51	1,768,143.34

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2017 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		530,648,946.84	554,185,947.73	23,537,000.89
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	1,231,400.00	1,231,400.00	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	1,231,400.00	1,231,400.00	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		531,880,346.84	555,417,347.73	23,537,000.89
项目		上年度末 2016 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		26,479,738.04	25,166,477.99	-1,313,260.05
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	3,200.00	3,630.72	430.72
	银行间市场	-	-	-
	合计	3,200.00	3,630.72	430.72
资产支持证券		-	-	-

基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	26,482,938.04	25,170,108.71	-1,312,829.33

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

7.4.7.4 买入返售金融资产

无余额。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	6,914.96	351.50
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	0.04	-
应收债券利息	121.98	7.26
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	0.96	0.27
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	162.90	0.70
合计	7,200.84	359.73

7.4.7.6 其他资产

无余额。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末

	2017 年 12 月 31 日	2016 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	276,200.06	5,644.92
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	276,200.06	5,644.92

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2017 年 12 月 31 日	2016 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	167.25	0.02
预提账户维护费	-	-
预提费用	178,000.00	236,000.00
应付指数使用费	50,000.00	50,000.00
合计	228,167.25	286,000.02

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	22,240,279.75	22,240,279.75
本期申购	3,775,604,234.40	3,775,604,234.40
本期赎回 (以“-”号填列)	-3,235,134,203.25	-3,235,134,203.25
本期末	562,710,310.90	562,710,310.90

注：(1) 申购含红利再投资份额。

(2) 截至 2017 年 12 月 31 日止，本基金于深交所上市的基金份额为 1,426,012.00 份(2016 年 12 月 31 日：1,339,947.00 份)，托管在场外未上市交易的基金份额为 561,284,298.90 份(2016 年 12 月 31 日：20,900,332.75 份)。上市的基金份额登记在证券登记结算系统，可选择按市价流通或按基金份额净值申购或赎回；未上市的基金份额登记在注册登记系统，按基金份额净值申购或赎回。通过跨系统转登记可实现基金份额在两个系统之间的转换。

7.4.7.10 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	12,604,169.69	-8,260,211.50	4,343,958.19
本期利润	14,376,459.91	24,849,830.22	39,226,290.13
本期基金份额交易产生的变动数	1,139,570,905.46	-171,122,081.49	968,448,823.97
其中：基金申购款	2,118,132,041.82	-1,114,669,104.88	1,003,462,936.94
基金赎回款	-978,561,136.36	943,547,023.39	-35,014,112.97
本期已分配利润	-986,039,656.70	-	-986,039,656.70
本期末	180,511,878.36	-154,532,462.77	25,979,415.59

7.4.7.11 存款利息收入

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
活期存款利息收入	876,219.23	13,091.20
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	14,457.29	172.59
其他	179,420.65	55.58
合计	1,070,097.17	13,319.37

7.4.7.12 股票投资收益

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
卖出股票成交总额	583,245,627.58	14,541,903.27
减：卖出股票成本总额	569,564,057.37	14,709,476.87
买卖股票差价收入	13,681,570.21	-167,573.60

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12 月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12 月31日
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	24,974.55	1,332.01
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	24,974.55	1,332.01

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月 31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月 31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	314,970.73	11,443.30
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	289,900.00	10,100.00
减：应收利息总额	96.18	11.29
买卖债券差价收入	24,974.55	1,332.01

7.4.7.14 贵金属投资收益

7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

无。

7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

7.4.7.15 衍生工具收益

无。

7.4.7.16 股利收益

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
股票投资产生的股利收益	519,195.46	340,852.25
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	519,195.46	340,852.25

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年12月31日	2016年1月1日至2016年12月31日
1.交易性金融资产	24,849,830.22	-6,027,407.24
——股票投资	24,850,260.94	-6,027,837.96
——债券投资	-430.72	430.72
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3.其他	-	-
合计	24,849,830.22	-6,027,407.24

7.4.7.18 其他收入

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
基金赎回费收入	4,080,475.51	9,956.79
其他收入_其他	-	-
合计	4,080,475.51	9,956.79

注：本基金的场内赎回费率为赎回金额的 0.5%，场外赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

7.4.7.19 交易费用

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
交易所市场交易费用	2,239,632.74	41,509.68
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	2,239,632.74	41,509.68

7.4.7.20 其他费用

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
审计费用	58,000.00	56,000.00
信息披露费	120,000.00	180,000.00
银行汇划费用	6,106.75	2,192.49
上市年费	60,000.00	60,000.00
帐户维护费	18,000.00	18,000.00
指数使用费	200,000.00	200,000.00
合计	462,106.75	516,192.49

注：根据《华安深证 300 指数证券投资基金(LOF)基金合同》及《深证 300 指数使用许可协议书》，本基金的指数许可使用费从基金财产中列支，收取标准为每年本基金的资产净值的 0.02%，收取下限为每季 5 万元，逐日累计，每季支付一次。基金合同生效之日所在季度的指数使用费，按实际计提金额收取，不设下限。计算方法如下：

$$\text{日指数许可使用费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.02\% / \text{当年天数}。$$

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

7.4.9 关联方关系

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

注：1. 下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易**7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易****7.4.10.1.1 股票交易**

无。

7.4.10.1.2 权证交易

无。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

无。

7.4.10.2 关联方报酬**7.4.10.2.1 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	1,915,281.07	144,685.22
其中：支付销售机构的客户维护费	47,249.24	54,162.12

注：支付基金管理人华安基金公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

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

7.4.10.2.2 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	383,056.13	28,937.00

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

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.10\% / \text{当年天数}。$$

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

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

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

7.4.10.7.1 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每 10 份 基金份额 分红数	现金形式 发放总额	再投资形 式发放总 额	利润分配合 计	备注
		场 内	场 外					
1	2017-08-28	2017- 08-29	2017- 08-28	2.600	985,241,649. 45	798,007.25	986,039,656. 70	-
合计				2.600	985,241,649. 45	798,007.25	986,039,656. 70	-

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

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 受限证券类别：债券										
证券 代码	证券 名称	成功 认购日	可流 通日	流通 受 限类	认购 价格	期末估 值单价	数量(单 位：股)	期末 成本 总额	期末 估值 总额	备注

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

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

7.4.12.2 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
00000 6	深振业 A	2017-09 -11	重大资 产重组	9.85	2018-0 3-08	8.87	154,390.00	1,292,462.32	1,520,741.50	-
00003 1	中粮地 产	2017-07 -24	重大资 产重组	8.00	-	-	6,030.00	39,778.04	48,240.00	-
00015 6	华数传 媒	2017-12 -26	重大资 产重组	11.40	-	-	53,066.00	820,002.04	604,952.40	-
00054 0	中天金 融	2017-08 -21	重大资 产重组	7.35	-	-	28,873.00	218,464.20	212,216.55	-
00054 7	航天发 展	2017-10 -30	重大资 产重组	10.83	-	-	156,100.00	1,843,189.51	1,690,563.00	-
00056	供销大	2017-11	重大资	4.78	-	-	75,200.00	488,196.44	359,456.00	-

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

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

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

7.4.13 金融工具风险及管理

本基金是指数型基金, 采用完全复制策略, 跟踪深证 300 指数, 属于较高风险、较高预期收益的基金品种, 其风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。本基金投资的金融工具主要为股票投资。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合, 并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但因特殊情况(例如因受相关法规限制而无法买入标的指数成份股等情况)导致无法获得或无法获得足够数量的股票时, 基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合, 追求尽可能贴近目标指数的表现。

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设, 建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部和风险管理部等相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险管理委员会, 负责制定风险管理的宏观政策, 审议通过风险控制的总体措施等; 在管理层层面设立风险控制委员会, 讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施; 在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险管理部负责, 协调并与各部门合作完成运作风险管理和投资风险、绩效评估等。监察稽核部和风险管理部对公司执行总裁负责, 并由督察长分管。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发, 判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。从定量分析的角度出发, 根据本基金的投资目标, 结合基金资产所运用金融工具, 通过特定的风险量化指标、模型, 形成常规的量化报告, 确定风险损失的限度和相应置信程度, 及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估, 并通过相应决策, 将风险控制在可承受的范围内。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

于 2017 年 12 月 31 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.21%（2016 年 12 月 31 日：0.01%）。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金所持部分证券在证券交易所上市, 其余亦可在银行间同业市场交易, 部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。此外, 本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求, 其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算, 确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时, 本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度; 按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理, 以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外, 本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度: 根据质押品的资质确定质押率水平; 持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额; 并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时, 可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施, 本基金在本报告期内流动性情况良好。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险, 包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险, 其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控, 并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息, 因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、存出保证金和债券投资等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	35,133,761.51	-	-	-	35,133,761.51
结算备付金	454.62	-	-	-	454.62
存出保证金	361,922.65	-	-	-	361,922.65
交易性金融资产	-	-	1,231,400.00	554,185,947.73	555,417,347.73
应收利息	-	-	-	7,200.84	7,200.84
应收申购款	-	-	-	4,184.46	4,184.46
资产总计	35,496,138.78	-	1,231,400.00	554,197,333.03	590,924,871.81
负债					
应付赎回款	-	-	-	44,379.40	44,379.40
应付管理人报酬	-	-	-	275,563.69	275,563.69
应付托管费	-	-	-	55,112.72	55,112.72
应付交易费用	-	-	-	276,200.06	276,200.06
应付证券清算款	-	-	-	1,355,722.20	1,355,722.20
其他负债	-	-	-	228,167.25	228,167.25
负债总计	-	-	-	2,235,145.32	2,235,145.32
利率敏感度缺口	35,496,138.78	-	1,231,400.00	551,962,187.71	588,689,726.49
上年度末 2016 年 12 月 31 日					
资产					
银行存款	1,768,143.34	-	-	-	1,768,143.34
存出保证金	1,544.74	-	-	-	1,544.74
交易性金融资产	-	-	3,630.72	25,166,477.99	25,170,108.71
应收利息	-	-	-	359.73	359.73
应收申购款	-	-	-	1,628.39	1,628.39

资产总计	1,769,688.08	-	3,630.72	25,168,466.11	26,941,784.91
负债					
应付赎回款	-	-	-	2.49	2.49
应付管理人报酬	-	-	-	11,621.05	11,621.05
应付托管费	-	-	-	2,324.22	2,324.22
应付交易费用	-	-	-	5,644.92	5,644.92
应付证券清算款	-	-	-	51,954.27	51,954.27
其他负债	-	-	-	286,000.02	286,000.02
负债总计	-	-	-	357,546.97	357,546.97
利率敏感度缺口	1,769,688.08	-	3,630.72	24,810,919.14	26,584,237.94

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金 2017 年 12 月 31 日持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.21% (2016 年 12 月 31 日：0.00%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响 (2016 年 12 月 31 日：同)。

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用完全复制标的指数的方法跟踪标的指数，即按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。深证 300 指数成份股和备选成份股股票投资比例不低于基金资产的 90%，其他股票、新股、债券及及其它金融工具投资比例为基金资产的 5%-10%。

此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR (Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日		上年度末 2016 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	554,185,947.73	94.14	25,166,477.99	94.67
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
合计	554,185,947.73	94.14	25,166,477.99	94.67

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额 (单位：人民币元)	
		本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	增加约 29,110,000.00	增加约 1,420,000.00
	业绩比较基准下降 5%	减少约 29,110,000.00	减少约 1,420,000.00

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

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

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

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

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

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

上述第三层次资产变动如下：

交易性金融资产

权益工具投资

2017 年 1 月 1 日 -

购买 -

出售 -

转入第三层次 125,711.85

转出第三层次 -

当期利得或损失总额 -76,875.95

计入损益的利得或损失 -76,875.95

2017 年 12 月 31 日 48,835.90

2017 年 12 月 31 日仍持有的资产计入

2017 年度损益的未实现利得或损失的变动

——公允价值变动损益 -156,999.30

使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的相关信息如下:

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

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

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

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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

(2) 增值税

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

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

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

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

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

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位: 人民币元

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

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 指数投资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位: 人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	13,835,145.58	2.35
B	采矿业	4,399,489.46	0.75
C	制造业	334,106,049.41	56.75

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,938,958.11	0.67
E	建筑业	10,015,104.43	1.70
F	批发和零售业	9,630,307.30	1.64
G	交通运输、仓储和邮政业	1,801,762.60	0.31
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	47,054,940.80	7.99
J	金融业	41,333,847.55	7.02
K	房地产业	27,563,790.31	4.68
L	租赁和商务服务业	9,608,370.43	1.63
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	8,454,128.14	1.44
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	4,774,285.20	0.81
R	文化、体育和娱乐业	8,146,221.15	1.38
S	综合	1,355,899.74	0.23
	合计	526,018,300.21	89.35

8.2.2 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	17,000.00	0.00
C	制造业	19,833,632.52	3.37
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	511,173.00	0.09
E	建筑业	341,968.00	0.06
F	批发和零售业	2,429,302.00	0.41

G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	229,712.00	0.04
K	房地产业	1,827,048.00	0.31
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	2,977,812.00	0.51
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	28,167,647.52	4.78

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

8.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	000333	美的集团	440,400	24,411,372.00	4.15
2	000651	格力电器	465,224	20,330,288.80	3.45
3	000858	五粮液	179,274	14,320,407.12	2.43
4	000725	京东方 A	2,455,789	14,219,018.31	2.42
5	002415	海康威视	322,257	12,568,023.00	2.13
6	000002	万科 A	393,472	12,221,240.32	2.08
7	000001	平安银行	817,516	10,872,962.80	1.85
8	300498	温氏股份	365,621	8,738,341.90	1.48
9	000063	中兴通讯	233,751	8,499,186.36	1.44
10	002304	洋河股份	54,400	6,256,000.00	1.06
11	002027	分众传媒	430,120	6,056,089.60	1.03
12	002230	科大讯飞	99,294	5,872,247.16	1.00
13	002594	比亚迪	81,992	5,333,579.60	0.91
14	000776	广发证券	294,118	4,905,888.24	0.83

15	002450	康得新	218,505	4,850,811.00	0.82
16	000568	泸州老窖	70,492	4,652,472.00	0.79
17	000538	云南白药	43,700	4,448,223.00	0.76
18	002008	大族激光	85,897	4,243,311.80	0.72
19	002024	苏宁云商	335,997	4,129,403.13	0.70
20	002475	立讯精密	175,332	4,109,782.08	0.70
21	002456	欧菲科技	193,195	3,977,885.05	0.68
22	002202	金风科技	208,849	3,936,803.65	0.67
23	300136	信维通信	77,400	3,924,180.00	0.67
24	002142	宁波银行	219,264	3,905,091.84	0.66
25	000338	潍柴动力	464,844	3,876,798.96	0.66
26	002466	天齐锂业	72,124	3,837,718.04	0.65
27	300059	东方财富	288,511	3,736,217.45	0.63
28	001979	招商蛇口	190,564	3,727,431.84	0.63
29	002236	大华股份	160,348	3,702,435.32	0.63
30	000413	东旭光电	391,692	3,674,070.96	0.62
31	002460	赣锋锂业	49,248	3,533,544.00	0.60
32	000166	申万宏源	645,100	3,464,187.00	0.59
33	002241	歌尔股份	191,474	3,322,073.90	0.56
34	000100	TCL 集团	849,928	3,314,719.20	0.56
35	000783	长江证券	404,754	3,185,413.98	0.54
36	300072	三聚环保	89,291	3,136,792.83	0.53
37	000503	海虹控股	71,833	3,100,312.28	0.53
38	000423	东阿阿胶	50,600	3,049,662.00	0.52
39	300124	汇川技术	102,316	2,969,210.32	0.50
40	002310	东方园林	138,249	2,788,482.33	0.47
41	000069	华侨城 A	322,885	2,741,293.65	0.47
42	002252	上海莱士	135,789	2,695,411.65	0.46
43	000625	长安汽车	208,337	2,625,046.20	0.45
44	000661	长春高新	14,200	2,598,600.00	0.44
45	300070	碧水源	148,977	2,587,730.49	0.44
46	000839	中信国安	262,555	2,517,902.45	0.43
47	000895	双汇发展	94,913	2,515,194.50	0.43
48	002044	美年健康	109,200	2,388,204.00	0.41
49	000963	华东医药	43,658	2,352,293.04	0.40
50	002673	西部证券	186,877	2,302,324.64	0.39
51	300024	机器人	120,456	2,266,981.92	0.39
52	002508	老板电器	46,870	2,254,447.00	0.38
53	002405	四维图新	83,824	2,212,115.36	0.38
54	002422	科伦药业	88,070	2,192,943.00	0.37
55	000768	中航飞机	128,800	2,175,432.00	0.37
56	000728	国元证券	197,500	2,172,500.00	0.37
57	002572	索菲亚	58,393	2,148,862.40	0.37
58	300003	乐普医疗	88,873	2,147,171.68	0.36

59	300408	三环集团	105,600	2,128,896.00	0.36
60	002085	万丰奥威	117,099	2,096,072.10	0.36
61	002271	东方雨虹	51,900	2,073,924.00	0.35
62	002081	金螳螂	135,255	2,072,106.60	0.35
63	000157	中联重科	457,868	2,046,669.96	0.35
64	002797	第一创业	206,200	2,020,760.00	0.34
65	002340	格林美	280,013	2,013,293.47	0.34
66	002129	中环股份	175,137	2,012,324.13	0.34
67	000425	徐工机械	431,202	1,996,465.26	0.34
68	000998	隆平高科	75,701	1,947,029.72	0.33
69	002736	国信证券	177,217	1,922,804.45	0.33
70	000623	吉林敖东	85,200	1,917,000.00	0.33
71	002470	金正大	207,912	1,902,394.80	0.32
72	000786	北新建材	84,374	1,898,415.00	0.32
73	002001	新 和 成	49,448	1,881,990.88	0.32
74	002092	中泰化学	140,631	1,871,798.61	0.32
75	000792	盐湖股份	134,366	1,869,031.06	0.32
76	000039	中集集团	80,702	1,844,040.70	0.31
77	002049	紫光国芯	38,036	1,825,347.64	0.31
78	000630	铜陵有色	621,080	1,813,553.60	0.31
79	002366	台海核电	67,800	1,793,310.00	0.30
80	300296	利亚德	91,100	1,775,539.00	0.30
81	002714	牧原股份	33,400	1,765,524.00	0.30
82	000050	深天马 A	88,734	1,748,947.14	0.30
83	000060	中金岭南	155,212	1,733,718.04	0.29
84	000793	华闻传媒	169,159	1,693,281.59	0.29
85	000547	航天发展	156,100	1,690,563.00	0.29
86	000826	启迪桑德	51,051	1,685,704.02	0.29
87	000709	河钢股份	432,186	1,685,525.40	0.29
88	000930	中粮生化	125,800	1,678,172.00	0.29
89	000807	云铝股份	162,700	1,664,421.00	0.28
90	002146	荣盛发展	174,461	1,662,613.33	0.28
91	300015	爱尔眼科	53,252	1,640,161.60	0.28
92	300017	网宿科技	153,448	1,632,686.72	0.28
93	000977	浪潮信息	81,020	1,610,677.60	0.27
94	002294	信立泰	35,585	1,608,086.15	0.27
95	002583	海能达	86,400	1,599,264.00	0.27
96	300383	光环新网	131,200	1,590,144.00	0.27
97	000983	西山煤电	154,492	1,566,548.88	0.27
98	002311	海大集团	66,433	1,554,532.20	0.26
99	002179	中航光电	39,264	1,546,216.32	0.26
100	300088	长信科技	195,764	1,532,832.12	0.26
101	000876	新 希 望	204,344	1,522,362.80	0.26
102	000006	深振业 A	154,390	1,520,741.50	0.26

103	002074	国轩高科	67,710	1,507,224.60	0.26
104	002465	海格通信	155,338	1,489,691.42	0.25
105	002500	山西证券	159,804	1,473,392.88	0.25
106	000488	晨鸣纸业	87,500	1,458,625.00	0.25
107	002007	华兰生物	53,560	1,439,692.80	0.24
108	002573	清新环境	63,326	1,439,399.98	0.24
109	002065	东华软件	174,896	1,434,147.20	0.24
110	300433	蓝思科技	47,780	1,426,233.00	0.24
111	002185	华天科技	165,798	1,412,598.96	0.24
112	000566	海南海药	109,294	1,408,799.66	0.24
113	300027	华谊兄弟	159,377	1,391,361.21	0.24
114	002176	江特电机	122,500	1,386,700.00	0.24
115	000008	神州高铁	158,000	1,382,500.00	0.23
116	002558	巨人网络	37,420	1,377,056.00	0.23
117	000979	中弘股份	709,314	1,376,069.16	0.23
118	000690	宝新能源	170,698	1,365,584.00	0.23
119	002019	亿帆医药	61,134	1,360,231.50	0.23
120	000066	中国长城	186,492	1,359,526.68	0.23
121	300055	万邦达	64,500	1,356,435.00	0.23
122	000009	中国宝安	187,538	1,355,899.74	0.23
123	002217	合力泰	135,000	1,350,000.00	0.23
124	000402	金融街	121,264	1,347,243.04	0.23
125	300315	掌趣科技	241,092	1,340,471.52	0.23
126	000559	万向钱潮	131,789	1,337,658.35	0.23
127	000581	威孚高科	55,614	1,334,736.00	0.23
128	000750	国海证券	272,276	1,334,152.40	0.23
129	002385	大北农	218,110	1,321,746.60	0.22
130	000656	金科股份	265,067	1,312,081.65	0.22
131	300144	宋城演艺	69,958	1,305,416.28	0.22
132	002038	双鹭药业	41,203	1,276,056.91	0.22
133	000887	中鼎股份	69,801	1,268,284.17	0.22
134	000686	东北证券	144,452	1,266,844.04	0.22
135	000970	中科三环	87,982	1,265,181.16	0.21
136	000671	阳光城	160,450	1,262,741.50	0.21
137	002410	广联达	63,902	1,252,479.20	0.21
138	002439	启明星辰	53,400	1,246,890.00	0.21
139	002195	二三四五	212,670	1,241,992.80	0.21
140	002273	水晶光电	51,768	1,221,207.12	0.21
141	300159	新研股份	116,900	1,215,760.00	0.21
142	000997	新大陆	66,755	1,196,917.15	0.20
143	000046	泛海控股	158,875	1,185,207.50	0.20
144	000878	云南铜业	82,781	1,174,662.39	0.20
145	002624	完美世界	34,700	1,161,062.00	0.20
146	000961	中南建设	181,064	1,160,620.24	0.20

147	002223	鱼跃医疗	58,522	1,147,031.20	0.19
148	002407	多氟多	55,000	1,123,100.00	0.19
149	300146	汤臣倍健	74,638	1,121,062.76	0.19
150	000778	新兴铸管	213,962	1,116,881.64	0.19
151	300182	捷成股份	128,999	1,110,681.39	0.19
152	000825	太钢不锈	223,512	1,108,619.52	0.19
153	002493	荣盛石化	77,000	1,104,950.00	0.19
154	002426	胜利精密	189,300	1,103,619.00	0.19
155	300115	长盈精密	54,718	1,098,190.26	0.19
156	000988	华工科技	64,817	1,074,665.86	0.18
157	000938	紫光股份	14,531	1,046,667.93	0.18
158	000732	泰禾集团	52,130	1,043,642.60	0.18
159	002602	世纪华通	30,700	1,043,186.00	0.18
160	300197	铁汉生态	85,800	1,042,470.00	0.18
161	000999	华润三九	38,291	1,041,515.20	0.18
162	002280	联络互动	135,950	1,041,377.00	0.18
163	300090	盛运环保	112,000	1,034,880.00	0.18
164	000917	电广传媒	113,931	1,032,214.86	0.18
165	000960	锡业股份	78,063	1,030,431.60	0.18
166	002183	怡亚通	145,084	1,022,842.20	0.17
167	000598	兴蓉环境	185,967	1,009,800.81	0.17
168	000415	渤海金控	174,500	1,005,120.00	0.17
169	002408	齐翔腾达	79,257	1,004,978.76	0.17
170	002004	华邦健康	149,200	1,004,116.00	0.17
171	300014	亿纬锂能	50,794	996,070.34	0.17
172	300418	昆仑万维	48,400	995,588.00	0.17
173	300166	东方国信	78,460	984,673.00	0.17
174	300168	万达信息	72,143	972,487.64	0.17
175	300251	光线传媒	92,878	970,575.10	0.16
176	300033	同花顺	19,200	959,616.00	0.16
177	002013	中航机电	86,318	931,371.22	0.16
178	002030	达安基因	50,083	930,542.14	0.16
179	000078	海王生物	151,133	891,684.70	0.15
180	002268	卫士通	38,653	889,792.06	0.15
181	000059	华锦股份	93,200	888,196.00	0.15
182	002138	顺络电子	53,468	886,499.44	0.15
183	002352	顺丰控股	17,600	886,336.00	0.15
184	000800	一汽轿车	82,200	884,472.00	0.15
185	002051	中工国际	47,982	884,308.26	0.15
186	000627	天茂集团	110,300	882,400.00	0.15
187	002610	爱康科技	369,000	874,530.00	0.15
188	000898	鞍钢股份	137,630	873,950.50	0.15
189	000883	湖北能源	187,710	869,097.30	0.15
190	002343	慈文传媒	24,300	865,323.00	0.15

191	002491	通鼎互联	68,552	863,755.20	0.15
192	002153	石基信息	32,303	861,197.98	0.15
193	002108	沧州明珠	75,410	856,657.60	0.15
194	000012	南玻 A	100,026	845,219.70	0.14
195	002601	龙蟠佰利	52,700	844,254.00	0.14
196	000400	许继电气	63,620	839,147.80	0.14
197	000729	燕京啤酒	123,456	832,093.44	0.14
198	000712	锦龙股份	48,086	816,500.28	0.14
199	000758	中色股份	125,202	805,048.86	0.14
200	002191	劲嘉股份	86,973	804,500.25	0.14
201	002506	协鑫集成	188,300	804,041.00	0.14
202	000028	国药一致	13,196	795,059.00	0.14
203	002152	广电运通	106,725	794,034.00	0.13
204	002292	奥飞娱乐	55,466	792,609.14	0.13
205	002701	奥瑞金	126,747	792,168.75	0.13
206	002400	省广股份	148,323	790,561.59	0.13
207	002389	南洋科技	37,400	790,262.00	0.13
208	002131	利欧股份	301,747	784,542.20	0.13
209	002424	贵州百灵	50,715	781,011.00	0.13
210	300010	立思辰	69,300	774,081.00	0.13
211	300113	顺网科技	41,900	766,351.00	0.13
212	300367	东方网力	50,800	766,064.00	0.13
213	002444	巨星科技	55,300	764,799.00	0.13
214	002155	湖南黄金	77,800	754,660.00	0.13
215	002665	首航节能	113,110	753,312.60	0.13
216	002709	天赐材料	16,300	749,637.00	0.13
217	002501	利源精制	72,100	747,677.00	0.13
218	300244	迪安诊断	31,580	745,919.60	0.13
219	300133	华策影视	68,546	743,038.64	0.13
220	300253	卫宁健康	109,486	734,651.06	0.12
221	300058	蓝色光标	132,927	733,757.04	0.12
222	300002	神州泰岳	119,891	733,732.92	0.12
223	002831	裕同科技	12,900	720,852.00	0.12
224	002431	棕榈股份	84,605	710,682.00	0.12
225	002477	雏鹰农牧	159,704	709,085.76	0.12
226	300068	南都电源	44,000	707,520.00	0.12
227	000738	航发控制	46,248	707,131.92	0.12
228	002555	三七互娱	34,100	700,414.00	0.12
229	000027	深圳能源	114,600	694,476.00	0.12
230	002018	华信国际	96,100	679,427.00	0.12
231	300496	中科创达	20,800	672,256.00	0.11
232	002002	鸿达兴业	96,920	662,932.80	0.11
233	300073	当升科技	25,200	662,508.00	0.11
234	000901	航天科技	28,199	658,728.64	0.11

235	300207	欣旺达	66,800	651,968.00	0.11
236	002468	申通快递	26,100	644,409.00	0.11
237	000718	苏宁环球	148,804	644,321.32	0.11
238	002353	杰瑞股份	48,679	638,668.48	0.11
239	000762	西藏矿业	40,600	637,420.00	0.11
240	000937	冀中能源	109,246	635,811.72	0.11
241	002299	圣农发展	43,553	627,163.20	0.11
242	000563	陕国投 A	146,500	622,625.00	0.11
243	002716	金贵银业	32,700	617,049.00	0.10
244	002411	必康股份	23,000	613,410.00	0.10
245	300459	金科文化	54,400	605,472.00	0.10
246	000156	华数传媒	53,066	604,952.40	0.10
247	300134	大富科技	36,671	603,237.95	0.10
248	300077	国民技术	58,189	581,890.00	0.10
249	300020	银江股份	49,400	577,980.00	0.10
250	300001	特锐德	41,700	570,873.00	0.10
251	002643	万润股份	51,850	554,276.50	0.09
252	300292	吴通控股	95,900	543,753.00	0.09
253	300431	暴风集团	24,840	541,512.00	0.09
254	002642	荣之联	39,650	519,811.50	0.09
255	002399	海普瑞	33,977	519,168.56	0.09
256	002276	万马股份	59,000	508,580.00	0.09
257	002010	传化智联	29,400	475,692.00	0.08
258	000687	华讯方舟	44,900	471,899.00	0.08
259	300291	华录百纳	39,499	448,313.65	0.08
260	300085	银之杰	32,390	440,504.00	0.07
261	000959	首钢股份	73,500	439,530.00	0.07
262	000062	深圳华强	18,007	422,984.43	0.07
263	000564	供销大集	75,200	359,456.00	0.06
264	002120	韵达股份	5,920	271,017.60	0.05
265	000540	中天金融	28,873	212,216.55	0.04
266	000617	中油资本	12,400	186,000.00	0.03
267	002739	万达电影	2,382	123,959.28	0.02
268	002075	沙钢股份	4,700	75,764.00	0.01
269	300156	神雾环保	3,100	74,896.00	0.01
270	002168	深圳惠程	4,501	61,933.76	0.01
271	300104	乐视网	12,490	48,835.90	0.01
272	000031	中粮地产	6,030	48,240.00	0.01
273	000592	平潭发展	8,348	48,001.00	0.01
274	000806	银河生物	3,400	36,584.00	0.01

8.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	300142	沃森生物	115,400	2,106,050.00	0.36
2	300274	阳光电源	93,400	1,753,118.00	0.30
3	000830	鲁西化工	104,500	1,663,640.00	0.28
4	300266	兴源环境	57,900	1,563,300.00	0.27
5	002050	三花智控	82,378	1,510,812.52	0.26
6	300355	蒙草生态	112,800	1,414,512.00	0.24
7	002640	跨境通	69,300	1,326,402.00	0.23
8	300122	智飞生物	45,600	1,279,992.00	0.22
9	002078	太阳纸业	125,000	1,160,000.00	0.20
10	002384	东山精密	40,100	1,141,246.00	0.19
11	000933	神火股份	112,000	1,136,800.00	0.19
12	002589	瑞康医药	82,000	1,102,900.00	0.19
13	002497	雅化集团	81,900	1,091,727.00	0.19
14	000717	韶钢松山	122,300	1,083,578.00	0.18
15	002285	世联行	96,000	1,070,400.00	0.18
16	300450	先导智能	18,200	1,036,854.00	0.18
17	002056	横店东磁	77,900	833,530.00	0.14
18	000036	华联控股	83,700	756,648.00	0.13
19	000723	美锦能源	101,200	697,268.00	0.12
20	002635	安洁科技	24,500	639,205.00	0.11
21	000877	天山股份	60,700	631,280.00	0.11
22	300222	科大智能	28,000	552,440.00	0.09
23	300628	亿联网络	4,000	533,200.00	0.09
24	000600	建投能源	66,300	511,173.00	0.09
25	002302	西部建设	29,000	508,080.00	0.09
26	000158	常山北明	59,800	474,812.00	0.08
27	002542	中化岩土	46,400	341,968.00	0.06
28	002839	张家港行	19,600	229,712.00	0.04
29	000693	*ST 华泽	1,360	17,000.00	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2% 或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000651	格力电器	38,833,412.49	146.08
2	000333	美的集团	37,879,674.34	142.49

3	000858	五 粮 液	21,279,463.80	80.05
4	002415	海康威视	21,190,342.64	79.71
5	000725	京东方 A	20,328,687.00	76.47
6	000001	平安银行	20,135,016.21	75.74
7	000002	万 科 A	19,591,265.60	73.70
8	300498	温氏股份	17,877,436.76	67.25
9	002230	科大讯飞	11,864,369.00	44.63
10	000063	中兴通讯	11,726,457.30	44.11
11	000776	广发证券	11,705,918.35	44.03
12	002304	洋河股份	10,622,594.29	39.96
13	300059	东方财富	9,083,374.25	34.17
14	002466	天齐锂业	9,018,081.00	33.92
15	002241	歌尔股份	8,782,119.96	33.04
16	002024	苏宁易购	8,408,301.38	31.63
17	000166	申万宏源	8,253,308.87	31.05
18	000538	云南白药	8,229,435.46	30.96
19	002236	大华股份	8,194,581.28	30.82
20	002456	欧菲科技	8,091,347.88	30.44
21	000568	泸州老窖	7,959,249.54	29.94
22	001979	招商蛇口	7,856,519.05	29.55
23	002142	宁波银行	7,689,648.09	28.93
24	002460	赣锋锂业	7,583,953.00	28.53
25	000783	长江证券	7,384,638.00	27.78
26	002027	分众传媒	7,279,582.00	27.38
27	002594	比亚迪	7,224,384.37	27.18
28	000338	潍柴动力	6,860,044.82	25.80
29	000423	东阿阿胶	6,779,923.76	25.50
30	002008	大族激光	6,763,561.12	25.44
31	000413	东旭光电	6,714,087.00	25.26
32	002475	立讯精密	6,695,917.98	25.19
33	002673	西部证券	6,506,149.07	24.47
34	300136	信维通信	6,477,176.69	24.36
35	300072	三聚环保	6,153,211.00	23.15
36	000100	TCL 集团	6,123,053.00	23.03
37	000625	长安汽车	6,089,959.40	22.91
38	000069	华侨城 A	6,033,537.99	22.70
39	300070	碧水源	5,982,324.67	22.50
40	000839	中信国安	5,854,496.00	22.02
41	300124	汇川技术	5,801,580.73	21.82
42	000728	国元证券	5,716,034.99	21.50
43	002450	康得新	5,665,780.00	21.31
44	300024	机器人	5,576,603.60	20.98
45	002736	国信证券	5,389,547.24	20.27
46	002202	金风科技	5,308,033.92	19.97

47	000768	中航飞机	5,261,741.00	19.79
48	002797	第一创业	4,923,384.40	18.52
49	002310	东方园林	4,886,429.06	18.38
50	300408	三环集团	4,677,922.80	17.60
51	000895	双汇发展	4,617,276.50	17.37
52	000157	中联重科	4,587,040.88	17.25
53	002085	万丰奥威	4,564,163.77	17.17
54	002572	索菲亚	4,475,354.10	16.83
55	000709	河钢股份	4,385,143.00	16.50
56	000963	华东医药	4,381,297.00	16.48
57	002405	四维图新	4,350,428.00	16.36
58	002340	格林美	4,291,291.04	16.14
59	000050	深天马 A	4,241,168.00	15.95
60	300003	乐普医疗	4,239,884.78	15.95
61	000793	华闻传媒	4,217,871.62	15.87
62	000623	吉林敖东	4,206,157.77	15.82
63	000661	长春高新	4,188,546.58	15.76
64	000060	中金岭南	4,167,260.00	15.68
65	002500	山西证券	4,144,350.00	15.59
66	000630	铜陵有色	4,127,028.40	15.52
67	002092	中泰化学	4,119,402.51	15.50
68	300088	长信科技	4,014,441.00	15.10
69	002271	东方雨虹	3,970,783.00	14.94
70	002508	老板电器	3,968,163.30	14.93
71	002044	美年健康	3,957,127.00	14.89
72	002146	荣盛发展	3,891,592.00	14.64
73	000826	启迪桑德	3,803,656.54	14.31
74	002465	海格通信	3,729,095.00	14.03
75	300115	长盈精密	3,723,837.99	14.01
76	002252	上海莱士	3,713,561.00	13.97
77	000998	隆平高科	3,708,114.06	13.95
78	002065	东华软件	3,707,643.42	13.95
79	000750	国海证券	3,693,119.00	13.89
80	300315	掌趣科技	3,625,927.00	13.64
81	300017	网宿科技	3,567,429.09	13.42
82	000425	徐工机械	3,552,982.00	13.36
83	000009	中国宝安	3,497,478.70	13.16
84	002176	江特电机	3,497,373.69	13.16
85	002558	巨人网络	3,489,505.00	13.13
86	000983	西山煤电	3,473,378.00	13.07
87	000066	中国长城	3,402,978.56	12.80
88	000997	新大陆	3,375,168.00	12.70
89	002195	二三四五	3,372,796.00	12.69
90	000686	东北证券	3,323,506.00	12.50

91	000807	云铝股份	3,302,314.00	12.42
92	300296	利亚德	3,280,896.98	12.34
93	000876	新希望	3,268,982.92	12.30
94	000792	盐湖股份	3,264,450.50	12.28
95	300433	蓝思科技	3,233,725.60	12.16
96	000039	中集集团	3,229,905.00	12.15
97	002007	华兰生物	3,212,710.00	12.09
98	002081	金螳螂	3,193,874.50	12.01
99	000778	新兴铸管	3,152,065.00	11.86
100	000559	万向钱潮	3,126,289.11	11.76
101	300027	华谊兄弟	3,114,111.03	11.71
102	000402	金融街	3,094,178.00	11.64
103	002074	国轩高科	3,086,460.00	11.61
104	000970	中科三环	3,077,335.96	11.58
105	000046	泛海控股	3,061,498.46	11.52
106	000488	晨鸣纸业	3,034,218.76	11.41
107	000977	浪潮信息	3,016,957.40	11.35
108	000786	北新建材	3,015,332.00	11.34
109	000581	威孚高科	3,012,079.00	11.33
110	000008	神州高铁	2,969,119.00	11.17
111	000503	海虹控股	2,968,357.00	11.17
112	002366	台海核电	2,873,976.00	10.81
113	000887	中鼎股份	2,840,781.00	10.69
114	002422	科伦药业	2,830,625.16	10.65
115	000690	宝新能源	2,816,638.00	10.60
116	002385	大北农	2,812,735.86	10.58
117	002179	中航光电	2,786,609.54	10.48
118	002280	联络互动	2,768,543.25	10.41
119	300182	捷成股份	2,765,449.00	10.40
120	000656	金科股份	2,719,986.00	10.23
121	002217	合力泰	2,713,423.54	10.21
122	002273	水晶光电	2,702,145.00	10.16
123	002407	多氟多	2,689,336.00	10.12
124	300418	昆仑万维	2,669,684.00	10.04
125	300144	宋城演艺	2,660,624.00	10.01
126	002714	牧原股份	2,647,882.35	9.96
127	002311	海大集团	2,641,796.36	9.94
128	000878	云南铜业	2,635,009.00	9.91
129	000917	电广传媒	2,627,840.08	9.88
130	002573	清新环境	2,620,670.00	9.86
131	002019	亿帆医药	2,593,816.00	9.76
132	000415	渤海金控	2,590,452.50	9.74
133	300383	光环新网	2,566,164.00	9.65
134	002185	华天科技	2,551,484.24	9.60

135	300015	爱尔眼科	2,542,114.25	9.56
136	000825	太钢不锈	2,537,790.00	9.55
137	002223	鱼跃医疗	2,501,156.78	9.41
138	002470	金正大	2,498,037.00	9.40
139	300033	同花顺	2,452,775.00	9.23
140	002583	海能达	2,443,776.00	9.19
141	000930	中粮生化	2,423,399.00	9.12
142	000961	中南建设	2,409,630.35	9.06
143	000547	航天发展	2,404,429.00	9.04
144	000960	锡业股份	2,403,045.90	9.04
145	300166	东方国信	2,383,608.74	8.97
146	002410	广联达	2,375,918.00	8.94
147	300055	万邦达	2,372,668.00	8.93
148	002129	中环股份	2,371,432.00	8.92
149	300159	新研股份	2,367,910.00	8.91
150	000999	华润三九	2,359,543.00	8.88
151	002294	信立泰	2,329,615.00	8.76
152	002108	沧州明珠	2,325,499.00	8.75
153	300168	万达信息	2,312,848.00	8.70
154	002439	启明星辰	2,311,469.00	8.69
155	000400	许继电气	2,303,634.20	8.67
156	002001	新 和 成	2,301,906.00	8.66
157	000566	海南海药	2,294,095.08	8.63
158	002038	双鹭药业	2,290,409.00	8.62
159	300146	汤臣倍健	2,288,581.00	8.61
160	300058	蓝色光标	2,284,988.00	8.60
161	002138	顺络电子	2,280,780.00	8.58
162	000059	华锦股份	2,262,539.77	8.51
163	000598	兴蓉环境	2,246,700.00	8.45
164	000627	天茂集团	2,244,872.43	8.44
165	000988	华工科技	2,213,083.00	8.32
166	002049	紫光国芯	2,201,903.00	8.28
167	300014	亿纬锂能	2,201,069.00	8.28
168	002051	中工国际	2,166,642.00	8.15
169	000883	湖北能源	2,137,746.00	8.04
170	002013	中航机电	2,131,770.50	8.02
171	002004	华邦健康	2,111,098.00	7.94
172	000758	中色股份	2,107,782.09	7.93
173	002408	齐翔腾达	2,104,461.80	7.92
174	300142	沃森生物	2,102,476.00	7.91
175	002030	达安基因	2,096,206.10	7.89
176	002624	完美世界	2,079,683.74	7.82
177	000898	鞍钢股份	2,048,385.00	7.71
178	002601	龙蟠佰利	2,038,607.00	7.67

179	000028	国药一致	2,035,727.00	7.66
180	000697	炼石有色	2,027,448.11	7.63
181	002610	爱康科技	1,998,130.00	7.52
182	000671	阳光城	1,995,611.00	7.51
183	000078	海王生物	1,970,715.30	7.41
184	002665	首航节能	1,930,845.00	7.26
185	000712	锦龙股份	1,926,321.00	7.25
186	000738	航发控制	1,924,249.68	7.24
187	300113	顺网科技	1,916,250.00	7.21
188	002400	省广股份	1,916,047.60	7.21
189	300002	神州泰岳	1,907,658.00	7.18
190	002491	通鼎互联	1,903,090.93	7.16
191	002389	南洋科技	1,892,502.00	7.12
192	002343	慈文传媒	1,890,588.00	7.11
193	002131	利欧股份	1,852,065.00	6.97
194	002152	广电运通	1,851,722.98	6.97
195	000012	南玻 A	1,831,402.05	6.89
196	002444	巨星科技	1,822,792.00	6.86
197	000938	紫光股份	1,807,567.96	6.80
198	000800	一汽轿车	1,805,819.00	6.79
199	300253	卫宁健康	1,798,030.11	6.76
200	000732	泰禾集团	1,796,480.64	6.76
201	002292	奥飞娱乐	1,791,698.92	6.74
202	000729	燕京啤酒	1,791,332.92	6.74
203	000563	陕国投 A	1,782,881.96	6.71
204	300133	华策影视	1,779,361.00	6.69
205	000718	苏宁环球	1,778,540.95	6.69
206	002602	世纪华通	1,768,587.00	6.65
207	300367	东方网力	1,764,949.00	6.64
208	300274	阳光电源	1,763,732.35	6.63
209	000979	中弘股份	1,763,332.00	6.63
210	002431	棕榈股份	1,762,316.24	6.63
211	300244	迪安诊断	1,755,498.00	6.60
212	300197	铁汉生态	1,749,580.00	6.58
213	300251	光线传媒	1,747,712.00	6.57
214	002191	劲嘉股份	1,739,510.55	6.54
215	300090	盛运环保	1,739,429.00	6.54
216	300077	国民技术	1,731,551.80	6.51
217	000006	深振业 A	1,715,289.94	6.45
218	300207	欣旺达	1,702,284.00	6.40
219	000516	国际医学	1,700,989.98	6.40
220	002352	顺丰控股	1,691,261.85	6.36
221	002501	利源精制	1,680,868.17	6.32
222	300068	南都电源	1,667,561.00	6.27

223	002506	协鑫集成	1,661,323.00	6.25
224	002477	雏鹰农牧	1,657,476.82	6.23
225	000830	鲁西化工	1,631,496.01	6.14
226	002155	湖南黄金	1,630,300.48	6.13
227	002493	荣盛石化	1,618,551.98	6.09
228	000937	冀中能源	1,618,144.00	6.09
229	002183	怡亚通	1,615,849.00	6.08
230	000027	深圳能源	1,611,814.00	6.06
231	300266	兴源环境	1,602,847.72	6.03
232	002424	贵州百灵	1,601,724.00	6.03
233	002250	联化科技	1,601,196.00	6.02
234	002353	杰瑞股份	1,583,968.90	5.96
235	300199	翰宇药业	1,583,822.00	5.96
236	002002	鸿达兴业	1,583,341.43	5.96
237	002153	石基信息	1,559,064.00	5.86
238	002468	申通快递	1,537,651.00	5.78
239	000156	华数传媒	1,536,823.00	5.78
240	300026	红日药业	1,514,803.00	5.70
241	002050	三花智控	1,501,250.36	5.65
242	300001	特锐德	1,467,691.00	5.52
243	002276	万马股份	1,464,024.84	5.51
244	000901	航天科技	1,461,430.13	5.50
245	002411	必康股份	1,460,416.00	5.49
246	000685	中山公用	1,457,819.00	5.48
247	300355	蒙草生态	1,451,188.00	5.46
248	002368	太极股份	1,450,523.00	5.46
249	002018	华信国际	1,447,291.00	5.44
250	300496	中科创达	1,400,275.74	5.27
251	002489	浙江永强	1,376,759.24	5.18
252	002716	金贵银业	1,375,699.00	5.17
253	000829	天音控股	1,371,787.62	5.16
254	002709	天赐材料	1,371,246.00	5.16
255	002390	信邦制药	1,369,362.13	5.15
256	000762	西藏矿业	1,368,527.00	5.15
257	002643	万润股份	1,366,485.00	5.14
258	002657	中科金财	1,356,127.00	5.10
259	300020	银江股份	1,339,056.00	5.04
260	002268	卫士通	1,335,543.69	5.02
261	002640	跨境通	1,333,143.00	5.01
262	300073	当升科技	1,328,671.00	5.00
263	002522	浙江众成	1,317,267.38	4.96
264	300122	智飞生物	1,271,807.00	4.78
265	000687	华讯方舟	1,258,035.00	4.73
266	002326	永太科技	1,251,463.00	4.71

267	002426	胜利精密	1,211,542.50	4.56
268	000617	中油资本	1,179,101.00	4.44
269	300273	和佳股份	1,176,020.00	4.42
270	002701	奥瑞金	1,161,201.04	4.37
271	000933	神火股份	1,156,535.00	4.35
272	300010	立思辰	1,149,979.00	4.33
273	002437	誉衡药业	1,142,582.31	4.30
274	002078	太阳纸业	1,127,572.00	4.24
275	000519	中兵红箭	1,117,673.23	4.20
276	002384	东山精密	1,109,176.00	4.17
277	002497	雅化集团	1,105,976.00	4.16
278	002589	瑞康医药	1,091,284.70	4.11
279	000959	首钢股份	1,087,134.00	4.09
280	000717	韶钢松山	1,078,515.00	4.06
281	300450	先导智能	1,078,405.00	4.06
282	002285	世联行	1,077,002.00	4.05
283	002831	裕同科技	1,045,856.38	3.93
284	000062	深圳华强	1,007,487.00	3.79
285	000539	粤电力 A	1,006,360.00	3.79
286	300459	金科文化	991,604.00	3.73
287	002120	韵达股份	976,075.32	3.67
288	300085	银之杰	966,182.00	3.63
289	002010	传化智联	926,110.36	3.48
290	002563	森马服饰	918,819.00	3.46
291	002555	三七互娱	898,417.00	3.38
292	002329	皇氏集团	890,939.00	3.35
293	002642	荣之联	869,650.00	3.27
294	002299	圣农发展	866,214.00	3.26
295	000957	中通客车	865,598.00	3.26
296	002056	横店东磁	839,109.00	3.16
297	300134	大富科技	808,003.00	3.04
298	002631	德尔未来	767,174.00	2.89
299	000036	华联控股	759,603.33	2.86
300	300292	吴通控股	747,821.00	2.81
301	000723	美锦能源	700,382.00	2.63
302	000564	供销大集	692,922.32	2.61
303	000877	天山股份	634,740.00	2.39
304	002635	安洁科技	631,641.00	2.38
305	300474	景嘉微	580,069.00	2.18
306	300222	科大智能	551,474.00	2.07
307	300628	亿联网络	532,117.00	2.00

注：本项“买入金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2% 或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000333	美的集团	22,571,542.52	84.91
2	000651	格力电器	22,257,209.95	83.72
3	000725	京东方 A	13,594,892.19	51.14
4	000858	五 粮 液	13,295,231.52	50.01
5	002415	海康威视	12,479,110.01	46.94
6	000002	万 科 A	12,160,024.50	45.74
7	000001	平安银行	11,786,468.42	44.34
8	300498	温氏股份	10,421,361.16	39.20
9	000063	中兴通讯	7,758,075.10	29.18
10	002230	科大讯飞	6,757,770.00	25.42
11	002304	洋河股份	6,507,764.10	24.48
12	000776	广发证券	6,491,054.71	24.42
13	002466	天齐锂业	5,036,710.44	18.95
14	300059	东方财富	4,929,212.78	18.54
15	002024	苏宁易购	4,792,114.03	18.03
16	000538	云南白药	4,759,945.77	17.91
17	002241	歌尔股份	4,713,480.00	17.73
18	000568	泸州老窖	4,684,816.97	17.62
19	002456	欧菲科技	4,597,627.00	17.29
20	002460	赣锋锂业	4,528,957.72	17.04
21	002236	大华股份	4,501,088.20	16.93
22	002142	宁波银行	4,454,259.11	16.76
23	000166	申万宏源	4,428,083.27	16.66
24	001979	招商蛇口	4,367,818.19	16.43
25	002008	大族激光	4,245,389.88	15.97
26	000338	潍柴动力	4,131,950.20	15.54
27	300136	信维通信	3,941,809.00	14.83
28	000423	东阿阿胶	3,794,068.94	14.27
29	000783	长江证券	3,524,463.49	13.26
30	000100	TCL 集团	3,509,627.00	13.20
31	000839	中信国安	3,497,114.00	13.15
32	002202	金风科技	3,473,970.00	13.07
33	300072	三聚环保	3,467,266.26	13.04
34	300124	汇川技术	3,430,219.04	12.90
35	002475	立讯精密	3,426,620.50	12.89
36	000625	长安汽车	3,395,793.00	12.77

37	002594	比亚迪	3,379,856.96	12.71
38	002673	西部证券	3,313,047.92	12.46
39	000069	华侨城 A	3,226,684.00	12.14
40	300070	碧水源	3,208,074.00	12.07
41	002027	分众传媒	3,151,586.60	11.86
42	300024	机器人	3,014,402.80	11.34
43	000413	东旭光电	2,831,366.02	10.65
44	000768	中航飞机	2,828,216.11	10.64
45	002736	国信证券	2,809,960.00	10.57
46	000728	国元证券	2,807,949.92	10.56
47	000895	双汇发展	2,768,068.66	10.41
48	000661	长春高新	2,667,803.96	10.04
49	300408	三环集团	2,647,277.00	9.96
50	002044	美年健康	2,585,858.00	9.73
51	002405	四维图新	2,513,061.00	9.45
52	000963	华东医药	2,500,756.58	9.41
53	002085	万丰奥威	2,471,023.00	9.30
54	000157	中联重科	2,460,633.00	9.26
55	000793	华闻传媒	2,459,031.00	9.25
56	300003	乐普医疗	2,452,976.74	9.23
57	002310	东方园林	2,445,946.00	9.20
58	002340	格林美	2,439,194.40	9.18
59	002797	第一创业	2,405,661.00	9.05
60	002508	老板电器	2,378,064.90	8.95
61	000050	深天马 A	2,370,664.30	8.92
62	000623	吉林敖东	2,345,036.35	8.82
63	000709	河钢股份	2,300,071.00	8.65
64	000697	炼石有色	2,284,521.18	8.59
65	000630	铜陵有色	2,212,388.00	8.32
66	002572	索菲亚	2,208,423.00	8.31
67	000998	隆平高科	2,182,966.57	8.21
68	000060	中金岭南	2,177,133.68	8.19
69	002271	东方雨虹	2,140,992.02	8.05
70	000826	启迪桑德	2,089,684.25	7.86
71	002500	山西证券	2,085,578.00	7.85
72	300088	长信科技	2,070,533.00	7.79
73	002146	荣盛发展	2,036,343.00	7.66
74	000792	盐湖股份	2,025,230.25	7.62
75	002081	金螳螂	2,003,590.82	7.54
76	000425	徐工机械	2,003,355.00	7.54
77	002092	中泰化学	1,979,380.99	7.45
78	002065	东华软件	1,953,400.00	7.35
79	000750	国海证券	1,948,962.80	7.33
80	002465	海格通信	1,946,990.00	7.32

81	002176	江特电机	1,941,410.00	7.30
82	000983	西山煤电	1,911,200.00	7.19
83	300017	网宿科技	1,893,873.00	7.12
84	000039	中集集团	1,879,979.04	7.07
85	000009	中国宝安	1,873,093.01	7.05
86	300115	长盈精密	1,855,305.00	6.98
87	000008	神州高铁	1,829,192.00	6.88
88	000786	北新建材	1,824,390.82	6.86
89	000066	中国长城	1,807,553.72	6.80
90	000977	浪潮信息	1,797,950.00	6.76
91	002558	巨人网络	1,794,281.29	6.75
92	002007	华兰生物	1,793,086.04	6.74
93	000876	新希望	1,787,895.78	6.73
94	000559	万向钱潮	1,776,021.13	6.68
95	300433	蓝思科技	1,773,749.00	6.67
96	000686	东北证券	1,765,221.00	6.64
97	000997	新大陆	1,750,837.00	6.59
98	002714	牧原股份	1,748,280.00	6.58
99	300315	掌趣科技	1,744,109.00	6.56
100	300027	华谊兄弟	1,733,674.86	6.52
101	000488	晨鸣纸业	1,728,603.00	6.50
102	000046	泛海控股	1,723,928.99	6.48
103	000402	金融街	1,707,108.00	6.42
104	000970	中科三环	1,690,962.00	6.36
105	300296	利亚德	1,664,178.00	6.26
106	002179	中航光电	1,653,355.00	6.22
107	000887	中鼎股份	1,648,131.63	6.20
108	000581	威孚高科	1,639,033.94	6.17
109	000778	新兴铸管	1,613,312.26	6.07
110	300199	翰宇药业	1,612,574.20	6.07
111	002273	水晶光电	1,607,035.47	6.05
112	000516	国际医学	1,606,403.55	6.04
113	002450	康得新	1,595,878.01	6.00
114	000690	宝新能源	1,590,242.00	5.98
115	002195	二三四五	1,581,127.00	5.95
116	002311	海大集团	1,561,346.00	5.87
117	002573	清新环境	1,557,547.00	5.86
118	300015	爱尔眼科	1,556,850.98	5.86
119	002001	新和成	1,556,402.00	5.85
120	002185	华天科技	1,552,774.00	5.84
121	002049	紫光国芯	1,538,669.40	5.79
122	002422	科伦药业	1,523,184.00	5.73
123	002385	大北农	1,521,952.00	5.73
124	002407	多氟多	1,515,994.50	5.70

125	300026	红日药业	1,502,224.25	5.65
126	002294	信立泰	1,499,940.00	5.64
127	002074	国轩高科	1,479,534.30	5.57
128	002250	联化科技	1,463,302.40	5.50
129	002038	双鹭药业	1,448,067.00	5.45
130	300182	捷成股份	1,439,550.52	5.42
131	000656	金科股份	1,434,327.00	5.40
132	002280	联络互动	1,423,309.40	5.35
133	300418	昆仑万维	1,416,800.00	5.33
134	000685	中山公用	1,416,083.12	5.33
135	002410	广联达	1,411,702.00	5.31
136	000878	云南铜业	1,405,563.65	5.29
137	000917	电广传媒	1,404,388.00	5.28
138	002390	信邦制药	1,398,193.71	5.26
139	002019	亿帆医药	1,389,564.29	5.23
140	000807	云铝股份	1,389,060.00	5.23
141	002368	太极股份	1,386,220.57	5.21
142	000825	太钢不锈	1,383,559.00	5.20
143	300144	宋城演艺	1,381,242.00	5.20
144	002217	合力泰	1,372,975.81	5.16
145	000961	中南建设	1,372,525.98	5.16
146	000415	渤海金控	1,371,286.81	5.16
147	002223	鱼跃医疗	1,363,560.00	5.13
148	300055	万邦达	1,356,504.00	5.10
149	002489	浙江永强	1,342,148.72	5.05
150	002439	启明星辰	1,329,996.00	5.00
151	300033	同花顺	1,329,015.90	5.00
152	000960	锡业股份	1,302,450.00	4.90
153	000829	天音控股	1,297,772.94	4.88
154	000671	阳光城	1,292,245.79	4.86
155	000988	华工科技	1,276,113.50	4.80
156	000999	华润三九	1,275,648.00	4.80
157	300058	蓝色光标	1,274,270.72	4.79
158	300166	东方国信	1,271,876.00	4.78
159	000598	兴蓉环境	1,243,128.00	4.68
160	300146	汤臣倍健	1,238,858.76	4.66
161	002138	顺络电子	1,231,771.00	4.63
162	002583	海能达	1,225,014.84	4.61
163	000627	天茂集团	1,220,762.00	4.59
164	002408	齐翔腾达	1,213,420.00	4.56
165	002437	誉衡药业	1,211,107.00	4.56
166	002013	中航机电	1,208,097.00	4.54
167	300168	万达信息	1,206,251.00	4.54
168	000883	湖北能源	1,202,995.22	4.53

169	000400	许继电气	1,184,925.00	4.46
170	002657	中科金财	1,160,921.09	4.37
171	300014	亿纬锂能	1,153,170.00	4.34
172	002030	达安基因	1,144,760.00	4.31
173	002051	中工国际	1,137,652.00	4.28
174	002366	台海核电	1,120,721.00	4.22
175	002326	永太科技	1,119,504.00	4.21
176	000938	紫光股份	1,119,402.96	4.21
177	000059	华锦股份	1,116,862.00	4.20
178	000898	鞍钢股份	1,113,286.90	4.19
179	000078	海王生物	1,094,735.50	4.12
180	002108	沧州明珠	1,079,941.70	4.06
181	300251	光线传媒	1,079,002.00	4.06
182	000758	中色股份	1,069,987.00	4.02
183	000800	一汽轿车	1,066,414.00	4.01
184	300273	和佳股份	1,066,101.88	4.01
185	002610	爱康科技	1,053,612.00	3.96
186	000712	锦龙股份	1,050,174.00	3.95
187	002444	巨星科技	1,041,828.00	3.92
188	000028	国药一致	1,038,275.00	3.91
189	000732	泰禾集团	1,035,876.00	3.90
190	002491	通鼎互联	1,026,690.00	3.86
191	000012	南玻 A	1,019,941.25	3.84
192	002493	荣盛石化	1,012,294.00	3.81
193	002665	首航节能	1,004,906.52	3.78
194	300002	神州泰岳	1,004,817.00	3.78
195	002343	慈文传媒	1,004,812.00	3.78
196	002153	石基信息	1,004,643.00	3.78
197	000729	燕京啤酒	1,002,187.00	3.77
198	002522	浙江众成	1,000,698.00	3.76
199	000738	航发控制	995,399.00	3.74
200	002601	龙蟠佰利	993,432.00	3.74
201	300113	顺网科技	991,069.00	3.73
202	002292	奥飞娱乐	983,959.59	3.70
203	000519	中兵红箭	982,421.00	3.70
204	002389	南洋科技	981,248.00	3.69
205	002268	卫士通	976,599.44	3.67
206	002131	利欧股份	976,148.00	3.67
207	002191	劲嘉股份	972,446.00	3.66
208	002477	雏鹰农牧	971,041.00	3.65
209	300253	卫宁健康	970,476.00	3.65
210	000957	中通客车	967,450.00	3.64
211	002152	广电运通	967,388.00	3.64
212	000539	粤电力 A	949,865.67	3.57

213	002252	上海莱士	947,538.53	3.56
214	002624	完美世界	939,917.57	3.54
215	300383	光环新网	937,529.00	3.53
216	002004	华邦健康	934,142.00	3.51
217	300133	华策影视	930,373.40	3.50
218	300244	迪安诊断	921,282.14	3.47
219	000718	苏宁环球	919,739.00	3.46
220	000566	海南海药	919,078.50	3.46
221	300159	新研股份	914,143.00	3.44
222	300068	南都电源	905,592.00	3.41
223	002563	森马服饰	905,035.16	3.40
224	002501	利源精制	896,222.94	3.37
225	300207	欣旺达	888,343.00	3.34
226	002470	金正大	885,971.00	3.33
227	002400	省广股份	876,101.76	3.30
228	000563	陕国投 A	872,416.70	3.28
229	000930	中粮生化	865,440.00	3.26
230	300077	国民技术	864,000.60	3.25
231	000027	深圳能源	857,118.97	3.22
232	002018	华信国际	848,170.10	3.19
233	000617	中油资本	845,312.40	3.18
234	002431	棕榈股份	840,224.00	3.16
235	002353	杰瑞股份	833,862.00	3.14
236	000762	西藏矿业	832,137.00	3.13
237	000937	冀中能源	829,881.77	3.12
238	002352	顺丰控股	828,823.00	3.12
239	002424	贵州百灵	826,679.50	3.11
240	002506	协鑫集成	824,465.00	3.10
241	300367	东方网力	823,602.00	3.10
242	002002	鸿达兴业	819,397.00	3.08
243	300073	当升科技	793,767.00	2.99
244	002411	必康股份	787,426.23	2.96
245	002468	申通快递	777,617.00	2.93
246	300474	景嘉微	774,742.00	2.91
247	300001	特锐德	768,330.00	2.89
248	300020	银江股份	751,893.00	2.83
249	002329	皇氏集团	749,353.00	2.82
250	002709	天赐材料	745,824.21	2.81
251	300496	中科创达	744,760.00	2.80
252	002716	金贵银业	740,896.00	2.79
253	002155	湖南黄金	735,612.05	2.77
254	000156	华数传媒	720,098.97	2.71
255	002120	韵达股份	700,217.00	2.63
256	002276	万马股份	697,545.00	2.62

257	300090	盛运环保	695,546.00	2.62
258	002602	世纪华通	681,103.00	2.56
259	002643	万润股份	662,722.00	2.49
260	000901	航天科技	660,818.00	2.49
261	000687	华讯方舟	653,723.28	2.46
262	000547	航天发展	646,936.00	2.43
263	002631	德尔未来	646,247.00	2.43
264	000062	深圳华强	538,996.00	2.03
265	002010	传化智联	533,277.00	2.01

注：本项“卖出金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

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

注：本项“买入股票的成本（成交）总额”和“卖出股票的收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	1,231,400.00	0.21
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-

10	合计	1,231,400.00	0.21
----	----	--------------	------

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	128024	宁行转债	5,862	586,200.00	0.10
2	123006	东财转债	3,282	328,200.00	0.06
3	123003	蓝思转债	1,195	119,500.00	0.02
4	123004	铁汉转债	678	67,800.00	0.01
5	123005	万信转债	652	65,200.00	0.01

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的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。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证投资。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

无。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

无。

8.12 投资组合报告附注

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

8.12.2 本基金投资的前十名股票中，不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

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

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002470	金正大	1,902,394.80	0.32	重大资产重组
2	002366	台海核电	1,793,310.00	0.30	重大资产重组
3	000547	航天发展	1,690,563.00	0.29	重大资产重组
4	000930	中粮生化	1,678,172.00	0.29	重大资产重组

5	300383	光环新网	1,590,144.00	0.27	重大资产重组
6	000006	深振业 A	1,520,741.50	0.26	重大资产重组
7	000566	海南海药	1,408,799.66	0.24	重大资产重组
8	000979	中弘股份	1,376,069.16	0.23	重大资产重组
9	300159	新研股份	1,215,760.00	0.21	重大资产重组
10	300090	盛运环保	1,034,880.00	0.18	重大资产重组

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例
1,169	481,360.40	543,832,208.76	96.65%	18,878,102.14	3.35%

9.2 期末上市基金前十名持有人

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

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
----	------------	----------

基金管理人所有从业人员持有 本基金	1,769.32	0.00%
----------------------	----------	-------

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

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

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2011 年 9 月 2 日)基金份额总额	608,040,554.70
本报告期期初基金份额总额	22,240,279.75
本报告期基金总申购份额	3,775,604,234.40
减：本报告期基金总赎回份额	3,235,134,203.25
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	562,710,310.90

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本基金管理人重大人事变动如下：

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

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

2、本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动如下：

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

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内无基金投资策略的改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘为基金审计的会计师事务所。

报告年度支付给聘任会计师事务所的报酬情况: 58,000.00 元。

目前的审计机构已提供审计服务的连续年限: 自基金合同生效日起至今。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内无管理人、托管人及其高级管理人员受证券监管部门稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位: 人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
西南证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	1,574,274,217.41	95.04%	1,434,647.17	95.04%	-
长江证券	1	82,141,570.28	4.96%	74,855.80	4.96%	-

注: 1、券商专用交易单元选择标准:

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

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

2、券商专用交易单元选择程序:

(1) 对交易单元候选券商的综合服务进行评估

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

(2) 填写《新增交易单元申请审核表》

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

(3) 候选交易单元名单提交分管领导审批

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

(4) 协议签署及通知托管人

基金管理人与被选择的券商签订《证券交易单元租用协议》, 并通知基金托管人。

3、报告期内基金租用券商交易单元的变更情况:

无

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位: 人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总	成交金额	占当期回购成交总	成交金额	占当期权证成交总

		额的比例		额的比例		额的比例
西南证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	196,618.93	62.42%	-	-	-	-
长江证券	118,351.80	37.58%	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于旗下部分基金增加济安财富为销售机构并参加费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-01-11
2	关于旗下部分基金增加泰诚财富为销售机构并参加费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-01-18
3	关于旗下部分基金增加北京肯特瑞为销售机构并参加费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-02-08
4	关于基金电子交易平台延长工行直联结算方式费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-02-13
5	华安基金关于参加平安银行优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-02-22
6	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“掌趣科技”股票估值调整的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-03-04
7	关于旗下部分基金增加华夏财富为销售机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-03-21
8	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“南都电源”股票估值调整的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-03-21
9	关于电子直销平台延长“微钱宝”账户交易费率优惠活动时间公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-03-28
10	关于华安基金管理有限公司旗下基金参加交通银行费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-04-22
11	关于“微钱宝”快速取现服务升级的公告	《上海证券报》、《证券	2017-04-25

		时报》、《中国证券报》 和公司网站	
12	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“乐视网”股票估值调整的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2017-04-26
13	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“炼石有色”股票估值调整的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2017-04-28
14	关于基金电子交易平台延长工行直联结算方式费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2017-05-10
15	关于旗下部分基金增加武汉伯嘉为销售机构并参加费率优惠的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2017-05-17
16	关于旗下部分基金增加中民财富为销售机构并参加费率优惠的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2017-06-07
17	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“天夏智慧”、“长信科技”股票估值调整的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2017-06-10
18	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“万达信息”股票估值调整的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2017-06-15
19	关于电子直销平台延长“微钱宝”账户交易费率优惠活动时间公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2017-06-27
20	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“中国神华”、“大富科技”股票估值调整的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2017-07-10
21	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“乐视网”股票估值调整的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2017-07-11
22	华安基金管理有限公司关于华安旗下部分基金增加新兰德为销售机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2017-07-15
23	华安基金管理有限公司关于副总经理变更的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2017-08-09
24	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中信期货为销售机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2017-08-17
25	华安基金管理有限公司关于旗下华安深证 300 指数基金增加申万宏源西部证券为销售机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》 和公司网站	2017-08-18

26	华安基金关于参加东莞农商行优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-08-18
27	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加江南农商行为销售机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-08-19
28	华安深证 300 指数证券投资基金 (LOF) 分红公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-08-23
29	华安基金关于参加江南银行优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-08-30
30	关于基金电子交易平台延长工行直联结算方式费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-09-13
31	关于旗下部分基金增加宜信普泽为销售机构并参加费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-09-15
32	关于电子直销平台延长“微钱宝”账户交易费率优惠时间的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-09-27
33	华安基金管理有限公司关于公司股东变更的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-10-17
34	关于旗下基金持有的“乐视网”股票估值调整的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-10-31
35	关于华安基金电子直销平台开通协助投资者购买合作商户实物黄金业务的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-11-02
36	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“乐视网”股票估值调整的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-11-17
37	华安基金管理有限公司关于旗下基金持有的“光环新网”股票估值调整的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-11-30
38	关于基金电子交易平台延长工行直联结算方式费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-12-19
39	关于华安基金管理有限公司旗下基金参加交通银行费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2017-12-29

注：前款所涉重大事件已作为临时报告在《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站www.huaan.com.cn上披露。

12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20171001-20171231	533,265,068.15	0.00	39,493,680.88	493,771,387.27	87.75%
产品特有风险							
本基金报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过20%的情形。如该单一投资者大额赎回将可能导致基金份额净值波动风险、基金流动性风险等特定风险。							

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、《华安深证 300 指数证券投资基金(LOF)基金合同》
- 2、《华安深证 300 指数证券投资基金(LOF)招募说明书》
- 3、《华安深证 300 指数证券投资基金(LOF)托管协议》
- 4、中国证监会批准华安深证 300 指数证券投资基金(LOF)设立的文件；
- 5、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告原件；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
- 7、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 8、华安基金管理有限公司开放式基金业务规则；

13.2 存放地点

基金管理人和基金托管人住所，并登载于基金管理人互联网站 <http://www.huaan.com.cn>。

13.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站查阅，或在营业时间内至基金管理人或基金托管人的办公场所免费查阅。

华安基金管理有限公司

二〇一八年三月二十七日