华安大中华升级股票型证券投资基金 2018年年度报告摘要

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:二〇一九年三月三十日

§1 重要提示

1.1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年3月26日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告期自2018年1月1日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1基金基本情况

基金简称	华安大中华升级股票(QDII)
基金主代码	040021
交易代码	040021
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年5月17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	63,880,933.48份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在合理控制投资风险和保障基金资产流动性的基础上,追求中长期资本增值,力求为投资者获取超越业绩比较基准的回报。
投资策略	本基金以价值和成长投资理念为导向,采用"自上而下"和"自下而上"相结合的选股策略。 行业层面以经济升级受益作为行业配置和个股挖掘的主要线索。通过对于经济结构调整的跟踪和研究,以及对于地区资源禀赋比较,对各行业的发展趋势和发展阶段进行预期,选择优势行业作为主要投资目标。 个股方面通过对大中华地区的股票基本面的分析和研究,考察公司的产业竞争环境、业务模式、盈利模式和增长模式、公司治理结构以及公司股票的估值水平,挖掘受益于中国地区经济升级,并具备中长期持续增长或阶段性高速成长、且股票估值水平偏低的上市公司进行投资。
业绩比较基准	MSCI 金龙净总收益指数(MSCI Golden Dragon Net Total Return Index)
风险收益特征	本基金是一只主动投资的股票型基金,基金的风险与预期收益都要高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金,属于证券投资基金中的高风险品种。

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	陆莲	王永民
	联系电话	021-38969999	010-66594896
	电子邮箱	luying@huaan.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		4008850099	95566
传真		021-68863414	010-66594942

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	-	Bank of China (Hong Kong) Limited
	中文	-	中国银行(香港)有限公司
注册地址		-	香港花园道1号中银大厦
办公地址		-	香港花园道1号中银大厦
邮政编码		-	-

2.5 信息披露方式

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

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2018年	2017年	2016年
本期已实现收益	9,158,903.02	6,942,810.39	-9,712,258.92
本期利润	-18,202,886.01	60,113,156.54	-2,059,755.81
加权平均基金份额本期利润	-0.2433	0.3339	-0.0088
本期基金份额净值增长率	-20.71%	25.38%	-0.25%
3.1.2 期末数据和指标	2018年末	2017年末	2016年末
期末可供分配基金份额利润	-0.0315	-0.1369	-0.1919
期末基金资产净值	75,803,076.37	163,718,566.76	263,322,412.49
期末基金份额净值	1.187	1.497	1.194

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(例如:封闭式基金交易佣金、开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等),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)。

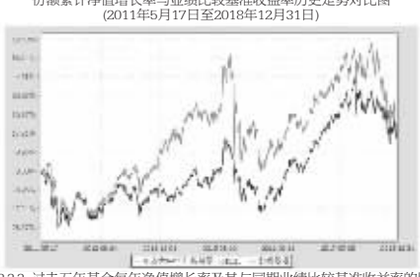
3.2 基金净值表现

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	-14.48%	1.98%	-10.59%	1.65%	-3.89%	0.33%
过去六个月	-21.86%	1.72%	-11.24%	1.34%	-10.62%	0.38%
过去一年	-20.71%	1.56%	-12.63%	1.24%	-8.08%	0.32%
过去三年	-0.84%	1.22%	26.51%	1.02%	-27.35%	0.20%
过去五年	5.32%	1.37%	27.14%	1.04%	-21.82%	0.33%
自基金合同生效起至今	18.70%	1.29%	16.10%	1.09%	2.60%	0.20%

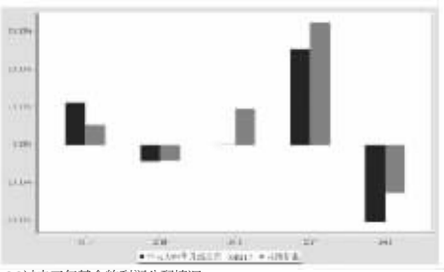
3.2.2自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华安大中华升级股票型证券投资基金
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
(2011年5月17日至2018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

华安大中华升级股票型证券投资基金
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



3.3过去三年基金的利润分配情况

无。

§4管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1基金管理人及其管理基金的经验

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证券股份有限公司、上海上国投资产管理有限公司、上海锦江国际投资管理有限公司、上海工业投资(集团)有限公司和国泰君安投资管理股份有限公司。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2018年12月31日,公司旗下共管理华安创新混合、华安未来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108只开放式基金,管理资产规模达到2756.06亿元人民币。

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		
俞启森	本基金的基金经理,副总经理,首席投资官	2011-05-17	-	22年	工业工程学硕士,22年证券、基金行业从业经历,具有中国大陆基金从业资格,曾在台湾IP证券任金融产业分析师及投资经理,台湾摩根富林明投信投资管理部任基金经理,台湾中信证券投资信监助理,台湾保德信投信任基金经理。2008年4月加入华安基金管理有限公司,任全球投资部总监。2010年9月起担任华安香港精选股票型证券投资基金的基金经理。2011年5月起同时担任本基金的基金经理。2014年6月起担任基金投资部兼全球投资部高级总监。2014年3月至2016年9月同时担任华安长利混合型证券投资基金的基金经理,2014年4月起同时担任华安大国新经济股票型证券投资基金的基金经理。2014年6月起担任基金投资部兼全球投资部高级总监。2015年2月至2016年9月同时担任华安安顺灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2015年3月起担任公司总经理助理。2015年3月起同时担任华安物联网主题股票型证券投资基金的基金经理。2015年4月至2016年9月同时担任华安安利配置证券投资基金,华安生态优先混合型证券投资基金的基金经理。
苏祈扬	本基金的基金经理,全球投资部副总监	2011-05-17	-	14年	博士研究生,14年证券、基金从业经历,持有基金从业执业证书。2004年6月加入华安基金管理有限公司,曾先后于研究发展部、战略策划部工作,担任行业研究员和产品经理职务。目前任职于全球投资部,担任基金经理职务。2010年9月起担任华安香港精选股票型证券投资基金的基金经理。2011年5月起同时担任本基金的基金经理。2015年4月至2016年9月同时担任华安国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016年3月至2018年3月同时担任华安沪港深外延增长灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016年3月至2018年2月同时担任华安全球美元收益债券型证券投资基金的基金经理。2016年4月至2018年2月同时担任华安全球美元票息债券型证券投资基金的基金经理。2017年2月起,同时担任华安沪港深通精选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017年5月至2018年9月,同时担任华安沪港深机会灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017年6月起,同时担任华安文体健康主题灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017年8月起,同时担任华安大安全主题灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018年10月起,同时担任华安CES港股通精选100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。

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境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

无。

4.3管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《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。

4.4管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.1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端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。

4.4.2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。

4.4.3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4次,未出现异常交易。

4.5管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.5.1报告期内基金投资策略和运作分析

下半年,尤其是4季度开始,美国经济见顶,企业盈利增速见顶的预期正在成为市场一致预期,市场对于联储加息预期发生改变,预期2019年的加息次数显著下行(1-2次)。美国加息预期下行,以及美股的调整,导致1-10月饱受资金流出影响的新兴市场压力缓解,新兴市场股票跑赢发达市场。

期内S&P500指数累计下跌6.24%,斯托克50指数下跌14.34%,而MSCI新兴市场指数累计下跌16.63%,新兴市场显著跑输发达市场。

香港市场,跟随新兴市场出现震荡走势,恒生指数下跌13.61%,恒生国企指数下跌13.53%。台股下跌8.6%

在报告期内,基于我们对于市场结构的判断,我们好业绩稳定的内需,医药,公用事业类股(风电,高速公路),以及业绩成长确定性高,财政政策逆周期投资的板块,高铁,5G,基建等有望领先。

4.5.2报告期内基金的业绩表现

截至2018年12月31日,本基金份额净值为1.187元,本报告期份额净值增长率为-20.71%,同期业绩比较基准增长率为-12.63%。

4.6管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

对于2019年港股,我们判断可能仍是震荡市,前低后高。首先从历史数据来看,港股估值和盈利增长呈现很强的正相关性,在明年上半年宏观仍有下行压力,企业盈利增速仍有大幅下调的预期下,港股出现估值扩张的可能较小。市场的机会可能在于经济下行迫使政策托底导致的反弹行情。

1季度我们认为市场进入底部区域,估值继续大幅下行可能较小,部分盈利确定性高的类股或高股息类股,可能获得资金青睐,如果伴随MSCI纳入A股权重增加,价值股有望跑赢成长股。

对于台股,我们仍看好苹果价格促销后,对于产业链企业的拉动效应。同时,我们认为2019年下半年,半导体的需求有望在5G,汽车等需求拉动下启动,相关产业链公司值得关注。

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

本报告期不进行收益分配。

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

本基金报告期内不存在基金持有人数低于200人或基金资产净值低于5000万元的情形。

§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")在对华安大中华升级股票型证券投资基金(以下称"本基金")的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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

本报告期的基金财务会计报告经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计,注册会计师 单 峰 魏 佳 亮签字出具了普华永道中天审字(2019)第23356号标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:华安大中华升级股票型证券投资基金
报告截止日:2018年12月31日

单位:人民币元

资产	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
资产:	-	-
银行存款	4,531,480.05	8,312,814.27
结算备付金	-	-
存出保证金	-	-
交易性金融资产	71,820,958.47	155,021,109.04
其中:股票投资	71,820,958.47	155,021,109.04
基金投资	-	-
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	2,169,752.49
应收利息	194.02	432.55
应收股利	56.95	-
应收申购款	19,176.56	58,069.92
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	76,371,866.05	165,562,178.27
负债和所有者权益	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
负债:	-	-
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	100,336.00	1,253,103.96
应付管理人报酬	99,405.18	208,564.47
应付托管费	19,881.07	41,712.88
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	-	-
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	349,167.43	340,230.20
负债合计	568,789.68	1,843,611.51
所有者权益:	-	-
实收基金	63,880,933.48	109,347,852.33
未分配利润	11,922,142.89	54,370,714.43
所有者权益合计	75,803,076.37	163,718,566.76
负债和所有者权益总计	76,371,866.05	165,562,178.27

注:报告截止日2018年12月31日,基金份额净值1.187元,基金份额总额63,880,933.48份。

7.2 利润表

会计主体:华安大中华升级股票型证券投资基金
本报告期:2018年1月1日至2018年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
一、收入	-15,623,497.77	65,538,840.90
1.利息收入	15,250.46	29,224.82
其中:存款利息收入	15,250.46	29,224.82
债券利息收入	-	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	11,695,941.96	12,266,646.03
其中:股票投资收益	10,002,086.12	8,164,055.00
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	1,693,855.84	4,102,591.03
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-27,361,789.03	53,170,346.15
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	20,578.31	43,054.73
5.其他收入(损失以"-"号填列)	6,520.53	29,569.17
减:二、费用	2,579,388.24	5,425,684.36
1.管理人报酬	1,626,482.33	3,716,326.60
2.托管费	325,296.55	743,265.30
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	246,239.99	580,523.43
5.利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6.税金及附加	-	-
7.其他费用	381,369.37	385,569.03
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	-18,202,886.01	60,113,156.54
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	-18,202,886.01	60,113,156.54

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:华安大中华升级股票型证券投资基金
本报告期:2018年1月1日至2018年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018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)	109,347,852.33	54,370,714.43	163,718,566.76
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-18,202,886.01	-18,202,886.01
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)	-45,466,918.85	-24,245,685.53	-69,712,604.38
其中:1.基金申购款	3,970,942.83	1,798,213.43	5,769,156.26
2.基金赎回款	-49,437,861.68	-26,043,898.96	-75,481,760.64
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)	63,880,933.48	11,922,142.89	75,803,076.37
项目	上年度可比期间 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)	220,478,006.35	42,844,406.14	263,322,412.49
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	60,113,156.54	60,113,156.54
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)	-111,130,154.02	-48,586,848.25	-159,717,002.27
其中:1.基金申购款	10,099,295.14	3,631,269.95	13,730,565.09
2.基金赎回款	-121,229,449.16	-52,218,118.20	-173,447,567.36
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)	109,347,852.33	54,370,714.43	163,718,566.76

注:报告期末基金份额总额63,880,933.48份。

§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	71,820,958.47	94.04
	其中:普通股	71,820,958.47	94.04
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中:远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	4,531,480.05	5.93
8	其他各项资产	19,427.53	0.03
9	合计	76,371,866.05	100.00

8.2期末在各个国家(地区)证券市场的权益投资分布

金额单位:人民币元

国家(地区)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
中国香港	52,897,541.57	69.78
中国台湾	18,923,235.44	24.96
美国	181.46	0.00
合计	71,820,958.47	94.75

8.3期末按行业分类的权益投资组合

金额单位:人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
信息技术	25,907,217.64	34.18
工业	10,979,921.11	14.48
保健	9,739,846.47	12.85
非必需消费品	8,995,163.54	11.87
金融	7,208,844.36	9.51
材料	4,182,505.66	5.52
公用事业	2,693,149.66	3.55
能源	1,637,591.51	2.16
必需消费品	476,718.52	0.63
合计	71,820,958.47	94.75

注:以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

8.4期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权益投资明细

金额单位:人民币元

序号	公司名称(英文)	公司名称(中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家(地区)	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	LARGAN PRECISION CO LTD	大立光	3008 TT	台湾	中国台湾	7,000	5,055,046.31	6.67
2	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	台积电	2330 TT	台湾	中国台湾	96,000	4,862,547.99	6.41
3	TENCENT HOLDINGS LTD	腾讯控股	700 HK	香港	中国香港	10,700	2,943,856.76	3.88
4	CHINA MERCHANTS BANK-H	招商银行	3968 HK	香港	中国香港	100,000	2,514,694.00	3.32
5	XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	金风科技	2208 HK	香港	中国香港	381,800	2,321,660.13	3.06
6	CHINA TRADITIONAL CHINESE ME	中国中药	570 HK	香港	中国香港	544,000	2,173,536.77	2.87
7	SUNNY OPTICAL TECH	舜宇光学科技	2382 HK	香港	中国香港	33,800	2,061,242.98	2.72
8	ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRI-H	中车时代电气	3898 HK	香港	中国香港	51,800	1,969,802.74	2.60
9	TAIMED BIOLOGICS INC	中裕新药	4147 TT	台湾	中国台湾	51,000	1,895,895.06	2.50
10	CHINA EASTERN AIRLINES CO-H	东方航空	670 HK	香港	中国香港	460,000	1,757,306.72	2.32

8.5报告期内权益投资组合的重大变动

8.5.1累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

金额单位:人民币元

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	2208 HK	5,059,707.55	3.09
2	CHINA NATIONAL BUILD	3323 HK	3,399,648.33	2.08
3	CHINA CITIC BANK COR	998 HK	3,023,081.48	1.85
4	DONGYUE GROUP	189 HK	2,423,742.30	1.48
5	CHINA MERCHANTS BANK-H	3968 HK	2,012,606.73	1.23
6	SPT ENERGY GROUP INC	1251 HK	1,802,151.78	1.10
7	SUNNY OPTICAL TECH	2382 HK	1,766,284.47	1.08
8	CHINA ORIENTAL GROUP CO LTD	581 HK	1,584,665.67	0.97
9	CIMC ENRIC HOLDINGS LTD	3899 HK	1,554,432.26	0.95
10	CHINA MAPLE LEAF EDUCATIONAL	1317 HK	1,538,717.80	0.94
11	CHINA EDUCATION GROUP HOLDIN	839 HK	1,406,912.39	0.86
12	CHINA EASTERN AIRLINES CO-H	670 HK	1,235,841.24	0.75
13	CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	916 HK	950,131.41	0.58
14	CHINA EVERBRIGHT GREENTECH L	1257 HK	650,108.98	0.40
15	HUANENG RENEWABLES CORP-H	958 HK	601,439.49	0.37
16	HONG KONG EXCHANGES	388 HK	444,372.52	0.27
17	JINCHUAN GROUP INTERNATIONAL	2362 HK	271,128.84	0.17

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。

8.5.2累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

金额单位:人民币元

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	TENCENT HOLDINGS LTD	700 HK	9,748,566.82	5.95
2	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	2318 HK	6,924,921.66	4.23
3	CHINA CONSTRUCTION B	939 HK	4,229,158.83	2.58
4	AIA GROUP LTD	1299 HK	3,809,260.58	2.33
5	LIJUN INTL PHARMACET	2005 HK	3,383,833.01	2.07
6	CHINA MAPLE LEAF EDUCATIONAL	1317 HK	3,088,148.38	1.89
7	TAIMED BIOLOGICS INC	4147 TT	2,906,077.89	1.78
8	CHINA NATIONAL BUILD	3323 HK	2,891,292.75	1.77
9	YANGTZE OPTICAL FIBRE AND-H	6869 HK	2,713,901.73	1.66
10	CHINA CITIC BANK COR	998 HK	2,649,563.45	1.62
11	CHINA MERCHANTS BANK-H	3968 HK	2,479,591.54	1.51
12	TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	2330 TT	2,282,632.81	1.39
13	NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	1336 HK	2,020,632.71	1.23
14	XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	2208 HK	1,815,639.47	1.11
15	AAC TECHNOLOGIES HOL	2018 HK	1,814,176.52	1.11
16	CHINA SOUTH LOCOMOTI	1766 HK	1,798,061.31	1.10
17	FLEXIUM INTERCONNECT INC	6269 TT	1,656,052.95	1.01
18	PICC PROPERTY & CASU	2328 HK	1,583,454.57	0.97
19	CHINA MOLYBDENUM CO	3993 HK	1,485,521.73	0.91
20	HONG KONG EXCHANGES	388 HK	1,258,367.34	0.77

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。

8.5.3权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位:人民币元

买入成本(成交)总额	29,724,973.24
卖出收入(成交)总额	95,565,420.90

8.6期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.7期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.8期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.9期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

8.10期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

8.11投资组合报告附注

8.11.1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。

8.11.2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。

8.11.3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	应收证券清算款	-
3	应收股利	56.95
4	应收利息	194.02
5	应收申购款	19,176.56
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	19,427.53

8.11.4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。

8.11.5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。

§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