

## 摘要

112	000673	当代东方	8,662,060	3.28
114	300008	长信科技	8,051,063.28	3.28
116	300014	亿纬锂能	8,619,162.66	3.19

130	000026	中国铝业	7,017,307.33	2.88
131	000027	华能国际	7,000,000.00	2.87
132	000029	张裕A	7,000,000.00	2.87
133	000046	中国中期	7,000,000.00	2.81
134	000047	招商局A	7,000,000.00	2.81
135	000056	南方股份	7,000,000.00	2.81
136	000053	深赛格	7,000,000.00	2.81
137	000059	华发集团	7,000,000.00	2.81
138	000060	中金公司	7,000,000.00	2.81
139	000068	华信能源	7,000,000.00	2.81
140	000069	华侨城A	7,000,000.00	2.81
141	000072	深圳国际	7,000,000.00	2.81
142	000076	华发股份	7,000,000.00	2.81
143	000078	深圳机场	7,000,000.00	2.81
144	000079	华发股份	7,000,000.00	2.81
145	000082	深华发A	7,000,000.00	2.81
146	000083	深赛格	7,000,000.00	2.81
147	000086	华发股份	7,000,000.00	2.81
148	000088	华发股份	7,000,000.00	2.81
149	000089	华发股份	7,000,000.00	2.81
150	000090	华发股份	7,000,000.00	2.81
151	000091	华发股份	7,000,000.00	2.81
152	000092	华发股份	7,000,000.00	2.81
153	000093	华发股份	7,000,000.00	2.81
154	000094	华发股份	7,000,000.00	2.81
155	000095	华发股份	7,000,000.00	2.81
156	000096	华发股份	7,000,000.00	2.81
157	000097	华发股份	7,000,000.00	2.81
158	000098	华发股份	7,000,000.00	2.81
159	000099	华发股份	7,000,000.00	2.81
160	000100	华发股份	7,000,000.00	2.81
161	000101	华发股份	7,000,000.00	2.81
162	000102	华发股份	7,000,000.00	2.81
163	000103	华发股份	7,000,000.00	2.81
164	000104	华发股份	7,000,000.00	2.81
165	000105	华发股份	7,000,000.00	2.81
166	000106	华发股份	7,000,000.00	2.81
167	000107	华发股份	7,000,000.00	2.81
168	000108	华发股份	7,000,000.00	2.81
169	000109	华发股份	7,000,000.00	2.81
170	000110	华发股份	7,000,000.00	2.81
171	000111	华发股份	7,000,000.00	2.81
172	000112	华发股份	7,000,000.00	2.81
173	000113	华发股份	7,000,000.00	2.81
174	000114	华发股份	7,000,000.00	2.81
175	000115	华发股份	7,000,000.00	2.81
176	000116	华发股份	7,000,000.00	2.81
177	000117	华发股份	7,000,000.00	2.81
178	000118	华发股份	7,000,000.00	2.81
179	000119	华发股份	7,000,000.00	2.81
180	000120	华发股份	7,000,000.00	2.81
181	000121	华发股份	7,000,000.00	2.81
182	000122	华发股份	7,000,000.00	2.81
183	000123	华发股份	7,000,000.00	2.81
184	000124	华发股份	7,000,000.00	2.81
185	000125	华发股份	7,000,000.00	2.81
186	000126	华发股份	7,000,000.00	2.81
187	000127	华发股份	7,000,000.00	2.81
188	000128	华发股份	7,000,000.00	2.81
189	000129	华发股份	7,000,000.00	2.81
190	000130	华发股份	7,000,000.00	2.81
191	000131	华发股份	7,000,000.00	2.81
192	000132	华发股份	7,000,000.00	2.81

146	00001	恒信證券	7,071,038.23	2.01
149	000253	聯華股份	6,338,219.73	2.01
157	000077	華光股份	6,185,182.41	2.01
160	000122	豐林股份	6,163,344.48	2.02
148	000126	華光電器	6,100,765.81	2.02
150	000256	廣生股份	6,041,281.33	2.02
152	000090	國華證券	6,040,777.08	2.02
153	000049	宏安科技	6,023,156.71	2.06
154	000009	宏安證券	6,020,281.93	2.04
154	000009	宏安證券	6,037,962.61	2.06
156	000512	"ST"神火	6,014,286.37	2.41
159	000168	茂源實業	6,426,256.62	2.41
159	000168	茂源實業	6,478,262.71	2.41
160	002451	利和興業	6,437,186.22	2.37
160	002451	利和興業	6,437,186.22	2.37

905	000000	無償資金	6,306,460.25	2.57
905	000001	無償資金	6,306,460.25	2.58
905	000002	無償資金	6,306,460.25	2.59
905	000003	無償資金	6,306,460.25	2.60
905	000004	無償資金	6,306,460.25	2.61
905	000005	無償資金	6,306,460.25	2.62
905	000006	無償資金	6,306,460.25	2.63
905	000007	無償資金	6,306,460.25	2.64
905	000008	無償資金	6,306,460.25	2.65
905	000009	無償資金	6,306,460.25	2.66
905	000010	無償資金	6,306,460.25	2.67
905	000011	無償資金	6,306,460.25	2.68
905	000012	無償資金	6,306,460.25	2.69
905	000013	無償資金	6,306,460.25	2.70
905	000014	無償資金	6,306,460.25	2.71
905	000015	無償資金	6,306,460.25	2.72
905	000016	無償資金	6,306,460.25	2.73
905	000017	無償資金	6,306,460.25	2.74
905	000018	無償資金	6,306,460.25	2.75
905	000019	無償資金	6,306,460.25	2.76
905	000020	無償資金	6,306,460.25	2.77
905	000021	無償資金	6,306,460.25	2.78
905	000022	無償資金	6,306,460.25	2.79
905	000023	無償資金	6,306,460.25	2.80
905	000024	無償資金	6,306,460.25	2.81
905	000025	無償資金	6,306,460.25	2.82
905	000026	無償資金	6,306,460.25	2.83
905	000027	無償資金	6,306,460.25	2.84
905	000028	無償資金	6,306,460.25	2.85
905	000029	無償資金	6,306,460.25	2.86
905	000030	無償資金	6,306,460.25	2.87
905	000031	無償資金	6,306,460.25	2.88
905	000032	無償資金	6,306,460.25	2.89
905	000033	無償資金	6,306,460.25	2.90
905	000034	無償資金	6,306,460.25	2.91
905	000035	無償資金	6,306,460.25	2.92
905	000036	無償資金	6,306,460.25	2.93
905	000037	無償資金	6,306,460.25	2.94
905	000038	無償資金	6,306,460.25	2.95
905	000039	無償資金	6,306,460.25	2.96
905	000040	無償資金	6,306,460.25	2.97
905	000041	無償資金	6,306,460.25	2.98
905	000042	無償資金	6,306,460.25	2.99
905	000043	無償資金	6,306,460.25	3.00
905	000044	無償資金	6,306,460.25	3.01
905	000045	無償資金	6,306,460.25	3.02
905	000046	無償資金	6,306,460.25	3.03
905	000047	無償資金	6,306,460.25	3.04
905	000048	無償資金	6,306,460.25	3.05
905	000049	無償資金	6,306,460.25	3.06
905	000050	無償資金	6,306,460.25	3.07
905	000051	無償資金	6,306,460.25	3.08
905	000052	無償資金	6,306,460.25	3.09
905	000053	無償資金	6,306,460.25	3.10
905	000054	無償資金	6,306,460.25	3.11
905	000055	無償資金	6,306,460.25	3.12
905	000056	無償資金	6,306,460.25	3.13
905	000057	無償資金	6,306,460.25	3.14
905	000058	無償資金	6,306,460.25	3.15
905	000059	無償資金	6,306,460.25	3.16
905	000060	無償資金	6,306,460.25	3.17
905	000061	無償資金	6,306,460.25	3.18
905	000062	無償資金	6,306,460.25	3.19

1001	000001	大同种化	6,620,077.76	2.15
1011	002006	联华电子	5,791,195.60	2.14
102	000021	南玻集团	6,774,474.61	2.13
103	000004	国农水利	5,765,282.82	2.12
104	000047	香港恒特	5,763,502.00	2.11
105	000049	西药行	6,747,342.67	2.12
106	001012	耀世昌	5,739,812.00	2.12
107	001018	中国香港	6,758,184.12	2.12
108	000023	金明纸业	5,736,726.80	2.12
109	000022	中国国立	5,734,381.06	2.12

130	032252	奥飞娱乐	5.084, 104.638	2.10
131	032172	海康科技	5.050, 404.81	2.07
132	030711	通威股份	5.036, 412.14	2.07
133	300018	博彦科技	5.076, 500.30	2.06
134	032543	金智通达	5.074, 703.13	2.06
135	030252	金盾股份	5.068, 1110.11	2.06
136	300497	富祥药业	5.010, 397.00	2.05
137	032543	金智通达	5.006, 620.00	2.04
138	000409	山东路桥	5.003, 360.10	2.03
139	032629	普天股份	5.042, 233.62	2.01

2017	000000	公允价值变动损益	5,426,104.00	210
2017	000000	公允价值变动损益	5,426,104.00	210
2017	000000	公允价值变动损益	5,418,187.20	210

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

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

			单位：人民币元
买入股票成本（成交）总额		3,643,030,028.20	
卖出股票收入（成交）总额		3,066,722,882.71	

注：“买入股票成本”或“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填写，不考虑相关交易费用。

8.7 期末按债券品种分类的债券投资组合  
本基金期末尚未持有债券资产。

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细  
本基金期末尚未持有债券资产。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细  
本基金期末尚未持有资产支持证券。

8.10 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  
本基金期末尚未持有贵金属资产。

8.11 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。

<p>8.10 报告期内本基金投资的股指期货交易情况说明</p> <p>8.10.1 报告期内本基金投资的股指期货投资符合中国证监会和中国证监会核准的本基金投资范围内无股指期货投资</p> <p>8.10.2 本基金股指期货投资的股指期货投资政策</p> <p>8.10.3 本基金报告期内无股指期货投资</p> <p>8.11 报告期内本基金投资的国债期货交易情况说明</p> <p>8.11.1 本基金国债期货投资政策</p> <p>8.11.2 本基金报告期内无国债期货投资情况</p> <p>8.11.3 报告期内本基金投资的国债期货投资符合中国证监会和中国证监会核准</p>					
代码	名称	持仓量(买)	合约市值	公允价值变动	风险指标说明

	美元	欧元	英镑	美元
公允价值变动总额合计(元)				--
国债期货投资本期收益(元)				--
国债期货投资本期公允价值变动(元)				--

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

本基金本报告期末无国债期货投资情况。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现在被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

本基金投资前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	156,856.01
2	应收证券清算款	11,269,491.41

3	应收股利	-
4	应收利息	5,922.81
5	应收申购款	66,723.43
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,432,957.66

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300323	华光光电	3,876,463.00	2.81	重大事项

8.12.6 报告期末公允价值计量的其他文字描述部分

持有人户数(户)		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
10,000	10,000	10,000	100.00%	10,000	100.00%

9.3	期末基金管理人及基金从业人员持有本基金的情况	7.94%	10,444,836	0.04%	0.04%	83,497,863.72	100.00%
	项目	持有份额总数(元)		占基金总份额比例			
	基金管理人所有从业人员持有	129,860.76		0.1566%			
	本基金						
9.4	期末基金管理人及基金从业人员持有本开放式基金前10名无限售的情况						
	项目	持有基金份额总数的数量区间(万份)					
	本公司高级管理人员、基金投资和研究人员(含)						0

开放式基金管理人持有本基金基金份额	0
<b>§ 10 开放式基金份额变动</b>	
	单位:份
基金合同生效日(2012年5月29日)基金份额总额	450,466,308.321
本报告期初基金份额总额	114,407,336.06
本报告期末基金总申购份额	56,912,987.07
减:本报告期基金总赎回份额	87,873,062.43

本报告期基金净值变动分析(份额减少以“-”填列)	-
本报告期期末基金份额总额	83,497,160.72

**§ 11 重大事件揭示**

**1.1 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。

**1.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动**

1.经安永大基金管理有限公司第二届董事会第二十一次会议审议通过,由陈树先生接替肖宇鹏先生担任公司督察长职务,自即日起为2016年1月21日,该事项已于2016年1月22日公告。

生任公司人力资源管理部，任职日期为2016年6月1日至2016年12月31日止。于2016年12月31日公告。

3、控管友安基金资产管理有限公2016年第三次股东大会审议通过《关于更换第二届董事会会议的议案》，因陈伯叶杨婉婷女士代替王登宝先生出任董事职务。

4、2016年12月，郭朝兴先生担任中国银行股份有限公司证券业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公示。

1.3.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内，本券无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

1.3.4 基金投资运作的重大关联方

报告期内对基金运作没有重大影响。

1. 本报告期内, 基金管理人、基金托管人及基金销售机构不存在任何重大违法违规行为。

1.1 为基金资产提供审计的会计师事务所情况

报告期内, 本基金聘请会计师事务所为普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)已为本基金提供审计服务。报告期内, 会计师事务所为基金提供的报酬为 890,000.00 元。

1.2 被管理人、托管人及其高级管理人员受行政处罚或处分等情况

1. 本报告期内, 基金管理人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

2. 本报告期内, 本基金托管人的托管业务没有受到中国证监会及其派出机构无警告处罚等。

1.3 基金租用证券公司交易单元的有关情况

1.3.1 基金租用证券公司交易单元用于进行证券投资及佣金支付情况

券商名称	交易单元数量	股票交易		应收证券清算资金		备注
		成交金额	占当期股票 成交总额的比例	持仓	占当期股票 总持仓的比例	
平安证券	2	1,406,226,307.32	20.51%	1,407,830.02	22.39%	-
民生证券	2	869,047,136.17	12.10%	649,420.06	10.24%	-
招商证券	2	636,563,394.01	9.34%	636,466.41	10.07%	-
方正证券	1	536,379,169.07	7.82%	500,088.19	7.88%	-

西南证券	1	517,061,266.23	7.06%	369,098.79	5.80%
方正证券	2	400,227,216.74	6.04%	447,242.03	7.02%
中金公司	3	446,797,899.12	6.07%	415,087.44	6.54%
国金证券	4	412,185,059.31	5.70%	320,465.46	5.14%
中信证券	5	413,260,960.98	5.63%	354,888.78	6.07%
东方财富	2	268,526,306.16	3.67%	228,058.68	4.38%
安信证券	2	246,987,424.26	3.39%	151,996.66	2.29%
恒泰证券	1	343,726,883.04	4.71%	173,000.06	2.72%

兴业证券	1	187,594,860.00	2.56%	175,080.00	2.20%	-
中国证券	1	168,908,148.00	2.30%	120,143.00	1.00%	-
中信建投	1	100,182,474.00	1.36%	73,363.32	1.10%	-
国信证券	2	69,100,436.30	1.22%	66,228.03	1.03%	-
长城证券	2	66,097,726.02	0.76%	30,902.44	0.03%	-
兴业证券	1	31,380,151.40	0.43%	22,661.15	0.36%	-
兴证证券	2	30,129,061.40	0.27%	14,651.89	0.23%	-

银河证券	2	4,383,493.52	0.00%	2,975.24	0.00%	--
湘财证券	1	--	--	--	--	--
中泰证券	1	--	--	--	--	新增1个
东方证券	2	--	--	--	--	--
中国证券	1	--	--	--	--	--
国海证券	2	--	--	--	--	--

1、本报告期内无基金租用证券公司交易单元变更情况  
2、截至本报告期末基金租用证券公司交易单元情况如下：

2.基金交易单元的选择标准如下:

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

3.本基金管理人会根据上述选择标准,考察后与确定交易单元的券商签订交易单元租约协议。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元用于其他证券投资的情况

金耀单位:人民币元		
债券交易	股票/期权交易	权证交易
无	无	无

券商名称	成交金额	券商佣金占成交总额的比例	成交金额	券商佣金占成交总额的比例	成交金额	券商佣金占成交总额的比例
平安证券	30,514,992.04	20.99%	--	--	--	--
民生证券	13,111,283.20	951%	16,600,000.00	100.00%	--	--
招商证券	29,886,796.25	20.56%	--	--	--	--
广发证券	19,602,800.13	13.55%	--	--	--	--
西南证券	5,687,744.04	3.91%	--	--	--	--

方正证券	35,343.00	0.02%	
中金公司	1,417,319.00	0.98%	
国金证券	4,164,580.20	2.87%	
中信证券	14,198,002.00	9.77%	
申万证券	—	—	
安信证券	23,161,327.01	15.93%	
华泰证券	2,780,124.01	1.91%	
长江证券	—	—	

中银证券	—	—	—	—	—
中信建投	—	—	—	—	—
国信证券	—	—	—	—	—
长城证券	—	—	—	—	—
中投证券	—	—	—	—	—
兴业证券	—	—	—	—	—
银河证券	—	—	—	—	—
湘财证券	—	—	—	—	—

中泰证券	--	--	--	--	--	--
东方证券	--	--	--	--	--	--
中航证券	--	--	--	--	--	--
国海证券	--	--	--	--	--	--

平安大华基金管理有限公司  
2017年3月30日