华安安信消费服务混合型证券投资基金 2017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:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一八年三月二十七日

§1 重要提示

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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年3月22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2017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	华安安信消费混合
基金主代码	519002
交易代码	519002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年6月24日
基金管理人	华安基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	422,279,016.59份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金重点投资于消费服务相关的子行业或企业,在严格控制风险的前提下,力争把握标的行业投资机会,实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金采用自上而下和自下而上相结合的方法,通过对消费服务相关子行业的精选以及对行业内相关股票的深入分析,挖掘该类型企业的投资价值。
业绩比较基准	中证消费服务领先指数收益率
风险收益特征	本基金为混合型基金,基金的风险与预期收益高于债券型基金和货币市场基金,低于股票型基金,属于证券投资基金中的中高风险投资品种。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	钱根	郭明
	联系电话	021-38969999	010-66106799
	电子邮箱	qiangkun@huaanfunds.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400888009９	95588
传真		021-68863414	010-66106798

2.4 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.huaanfunds.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层、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	2017年	2016年	2015年
本期已实现收益	172,773,546.38	31,212,046.19	337,970,634.83
本期利润	176,685,235.17	-18,302,995.80	297,829,791.34
加权平均基金份额本期利润	0.25 18	-0.0603	0.1597
本期基金份额净值增长率	8.10%	-2.69%	62.96%
3.1.2 期末数据和指标	2017年末	2016年末	2015年末
期末可供分配基金份额利润	0.4668	0.6440	0.6192
期末基金资产净值	612,277,105.57	564,299,395.06	462,703,097.19
期末基金份额净值	1.450	1.627	1.672

注:1.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

3. 期末可供分配利润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(为期末金额,不是当期发生数)。

4.本基金于2013年6月24日对原安信证券投资基金进市时的基金份额进行了折算,基金折算比例为1:1.016880461。

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

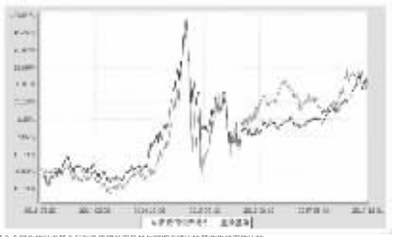
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-2.88%	1.20%	7.58%	0.96%	-10.46%	0.24%
过去六个月	11.28%	1.16%	12.48%	0.79%	-1.20%	0.37%
过去一年	8.10%	1.02%	25.55%	0.70%	-17.45%	0.32%
过去三年	71.42%	2.22%	37.15%	1.65%	34.27%	0.57%
自基金成立起至今	70.82%	1.92%	70.82%	1.51%	0.00%	0.41%

注:本基金业绩比较基准:中证消费服务领先指数收益率

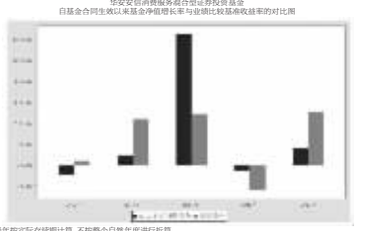
根据本基金合同的有关规定:本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的A股股票等权益类证券(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票、权证等),债券(包括中小企业私募债券等),货币市场工具、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但照符合中国证监会的相关规定。

本基金的股票资产投资比例为基金资产的60%-95%,其中,投资于消费服务相关的股票的比例不低于股票资产的80%,权证的投资比例不超过基金资产净值的3%。现金、债券资产及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产比例为5%-40%,其中,持有现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

3.2.2日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



3.2.3 日基金合同生效以来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



注:合同生效当年按实际存续期计算,不按整个日然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

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	2.730	68,4,233,179.23	2,472,947.24	656,706,126.47	-
合计	2.730	68,4,233,179.23	2,472,947.24	656,706,126.47	-

§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15亿元人民币,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、改革、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90只开放式基金,管理资产规模达到185.12亿元人民币。

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		
饶晓鹏	本基金的基金经理	2015-09-07	-	10年	硕士,10年基金行业从业经验,曾任银河基金管理有限公司研究员,国联安基金基金经理。2015年9月加入华安基金管理有限公司,2015年9月起同时担任本基金及华安升级主题混合型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,国以公告日为准。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 管理人对投资纪律及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,将券商研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 管理人对投资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》,将对闭式基金、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、交易执行等方面全面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,使用商业数据、邮件发送、登录在研究服务管理系统中等方式确保所有类投资组合管理人可以公平享有信息获取权。在投资环节,公司将投资组合经理根据投资组合的风格和投资策略,制定并维持好交易决策规则,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,在证券投资基金信息披露规定进行业务申报,集中交易室以投资组合名义对外进行申报。若流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。若中签超过小无法合理进行比例分配,且以公司名义获得,则按资源广的合规监察员直接参与下,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,通过内需共同即Wind终端,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规定范围内,交易员以此进行投标,分析与评估结果后,公司风险管理部对公司旗下的各投资组合按照询价走势情况,上市交易的投资品种,进行场外的非公开发行股票申购,以及参与一级市场申购,不同投资组合经理以投资基金分额拆分结果的公告》的有关规定,安信消费服务股票基金于2013年6月24日进行了基金份额拆分,拆分比例为1:1.016880461,并于2013年6月25日进行了变更登记。

安信消费服务股票基金自2013年5月29日至2013年6月19日期间内开放期中申购,其券集集中申购资金911,286,695.29元,其中包括所合为基金份额的集中申购资金利息459,327.86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(2013)第368号审验报告予以验证。上述集中申购募集资金已经2013年6月24日基金份额拆算后的基金份额净值1.000元折合为911,286,695.29份基金份额,其中包括集中申购资金利息折合的459,327.86份基金份额,并于2013年6月25日进行了确认登记。

根据2014年中国证监会令第104号《公开募集证券投资基金运作管理办法》,华安安信消费服务股票型证券投资基金于2015年8月6日公告后更名为华安安信消费服务混合型证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安安信消费服务混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的A股股票等权益类证券(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票、权证等),债券(包括中小企业私募债券等),货币市场工具,资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但照符合中国证监会的相关规定。本基金的股票资产投资比例为基金资产的60%-95%,其中,投资于消费服务相关的股票的比例不低于股票资产的80%,权证的投资比例不超过基金资产净值的3%。现金、债券资产及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产比例为5%-40%,其中,持有现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准为:中证消费服务领先指数收益率。

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》、《华安安信消费服务混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

7.4.4本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

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《关于全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》,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》及其他相关财政法规和实务操作,主要税项列示如下:

7

(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,按股期限在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)基金卖出股票的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
中国工商银行股份有限公司(“工商银行”)	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股权由上海证券(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。

7.4.8本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1股票交易

无。

7.4.8.1.2权证交易

无。

7.4.8.1.3债券交易

无。

7.4.8.1.4 应支付关联方的佣金

无。

7.4.8.2关联方报酬

7.4.8.2.1基金管理费

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
当期发生的基金应支付的管理费	15,030,715.98	7,034,137.36
其中:支付销售机构的客户维护费	406,594.18	202,340.65

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15%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日管理人报酬＝前一日基金资产净值×1.5%/当年天数。

7.4.8.2.2基金托管费

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
当期发生的基金应支付的托管费	2,506,119.31	1,172,356.21

注:支付基金托管人 中国工商银行 的托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日托管费＝前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

7.4.8.3与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.8.4各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.8.4.2报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位:份

关联方名称	本期末2017年12月31日		上年度末2016年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
上海国际信托有限公司	18,303,848.00	4.33%	18,303,848.00	5.28%

7.4.8.5由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年12月31日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
工商银行	48,790,415.42	1,223,377.23	49,800,148.83	361,182.95

注:本基金的银行存款由基金托管人 中国工商银行 保管,按银行同业利率计息。

7.4.8.6本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.8.7其他关联交易事项的说明

无。

7.4.9期末(2017年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

7.4.9.2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
000688	建新矿业	2017-09-06	重大事项	10.13	2018-02-07	9.86	3,294,401.00	35,960,306.75	33,372,282.13	-
300383	光环新网	2017-11-07	重大事项	12.12	2018-03-19	14.51	3,034,341.00	43,742,730.55	36,776,212.92	-
30073 0	科创信息	2017-12-25	重大事项	41.56	2018-01-02	45.71	821.00	6,863.56	34,112.55	-
601003	柳钢股份	2017-10-17	重大事项	7.73	2018-01-18	7.50	4,662,579.00	35,935,066.36	36,041,735.67	-
601600	中国铝业	2017-09-12	重大事项	6.67	2018-02-26	7.28	8,683,700.00	62,389,142.03	57,920,279.00	-

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。

7.4.9.3期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1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。

7.4.9.3.2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。

7.4.10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393,300,820.62元,属于第二层次的余额为164,144,622.27元,无属于第三层次的余额;2016年12月31日:第一层次510,088,723.40元,第二层次4,658,868.00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

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

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

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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

(2) 增值税

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

根据财政部、国家税务总局于2017年6月30日颁布的财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知1)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。

§5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	557,445,442.89	88.69
	其中:股票	557,445,442.89	88.69
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
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	银行存款和结算备付金合计	58,696,207.55	9.34
7	其他各项资产	12,359,037.97	1.97
8	合计	628,500,688.41	100.00

8.2报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	26,210,891.92	4.28
B	采矿业	53,878,704.13	8.80
C	制造业	329,004,377.75	53.73
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	35,204,386.30	5.75
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	38,273,325.47	6.25
J	金融业	9,272,064.00	1.51
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	31,519,084.46	5.15
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	27,923,792.86	4.56
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	6,168,826.00	1.01
S	综合	-	-
	合计	557,445,442.89	91.04

8.3期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	601600	中国铝业	8,683,700	57,920,279.00	9.46
2	300383	光环新网	3,034,341	36,776,212.92	6.01
3	601003	柳钢股份	4,662,579	36,041,735.67	5.89
4	000688	建新矿业	3,294,401	33,372,282.13	5.45
5	600138	中青旅	1,510,258	31,519,084.46	5.15
6	002120	韵达股份	676,685	30,978,639.30	5.06
7	600054	黄山旅游	1,956,818	27,923,792.86	4.56
8	000998	隆平高科	1,019,086	26,210,891.92	4.28
9	600519	贵州茅台	36,922	25,762,725.78	4.21
10	603566	普莱柯	1,149,527	25,508,004.13	4.17

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	601988	中国银行	264,526,735.90	46.88
2	601318	中国平安	236,090,442.85	41.84
3	600292	南钢股份	225,976,806.53	40.05
4	601288	农业银行	210,347,713.90	37.28
5	600233	圆通速递	197,217,746.72	34.95
6	601336	新华保险	197,121,978.20	34.93
7	000998	隆平高科	191,841,201.76	34.00
8	601328	交通银行	184,272,529.74	32.66
9	000933	神火股份	183,909,822.07	32.59
10	000897	云铝股份	181,321,539.33	32.13
11	000661	长春高新	177,094,398.71	31.38
12	300271	华宇软件	177,023,671.95	31.37
13	300383	光环新网	164,449,132.37	29.14
14	601006	大秦铁路	163,599,311.77	28.99
15	002640	跨境通	155,714,509.02	27.59
16	601225	陕西煤业	152,188,721.58	26.97
17	002120	韵达股份	149,632,330.91	26.52
18	000717	韶钢松山	138,099,332.05	24.46
19	600867	通化东宝	137,920,944.95	24.44
20	002027	分众传媒	137,779,310.17	24.42
21	000001	平安银行	137,427,646.88	24.35
22	600782	新钢股份	135,378,302.86	23.99
23	600685	海螺水泥	135,366,604.94	23.99
24	601600	中国铝业	121,399,635.46	21.50
25	600036	招商银行	114,624,367.05	20.31
26	600703	三安光电	111,051,790.18	19.68
27	300166	东方国信	106,065,528.34	18.80
28	002311	海大集团	99,409,244.57	17.62
29	600188	兖州煤业	98,333,028.91	17.43
30	601166	兴业银行	98,014,368.05	17.37
31	600971	恒源煤电	90,448,425.76	16.03
32	600507	方大特钢	90,191,359.00	15.98
33	600808	马钢股份	88,301,950.04	15.65
34	600521	华海药业	86,179,633.02	15.27
35	601699	潞安环能	85,867,814.19	15.22
36	000825	太钢不锈	85,593,608.25	15.17
37	600581	八一钢铁	84,924,229.96	15.05
38	300203	聚光科技	81,471,627.38	14.44
39	600567	山鹰纸业	77,845,461.03	13.80
40	000560	昆百大A	76,936,691.79	13.63
41	300630	普利制药	76,607,586.28	13.58
42	603868	飞科电器	76,453,546.74	13.55
43	600720	祁连山	75,912,618.89	13.45
44	600388	龙净环保	75,237,927.15	13.33
45	000932	*ST华菱	73,613,432.94	13.05
46	601003	柳钢股份	73,301,909.14	12.99
47	002712	思美传媒	72,990,642.80	12.93
48	600231	凌钢股份	72,011,462.97	12.76
49	002092	中泰化学	71,125,268.41	12.60
50	300336	新文化	70,984,605.58	12.58
51	000768	中航飞机	69,806,121.87	12.37
52	600990	四创电子	69,266,746.29	12.27
53	600569	安阳钢铁	68,741,338.24	12.18
54	002020	京新药业	63,028,913.19	11.17
55	600688	用友网络	62,092,232.26	11.00
56	002352	顺丰控股	60,452,156.85	10.71
57	000761	本钢板材	58,755,037.94	10.41
58	601939	建设银行	58,667,072.31	10.40
59	000951	中国重汽	58,527,604.76	10.37
60	600695	中字实业	58,382,324.98	10.35
61	603660	苏州科达	56,545,198.00	10.02
62	002174	游族网络	56,456,921.61	10.00
63	601766	中国中车	56,410,457.43	10.00
64	603639	海利尔	56,015,732.94	9.93
65	600028	中国石化	55,576,682.40	9.85
66	001979	招商蛇口	55,375,354.93	9.81
67	002343	慈文传媒	54,759,567.16	9.70
68	002429	兆驰股份	54,618,738.87	9.68
69	600801	华新水泥	54,344,440.83	9.63
70	603757	大元泵业	54,263,983.28	9.62
71	601390	中国中铁	54,002,146.65	9.57
72	000688	建新矿业	53,301,419.84	9.45
73	002376	新北洋	53,066,612.27	9.40
74	600029	南方航空	52,395,344.86	9.29
75	600141	兴发集团	51,347,614.10	9.10
76	600104	上汽集团	48,795,595.24	8.65
77	603288	海天味业	48,531,655.94	8.60
78	002221	东华能源	48,527,435.72	8.60
79	603203	快克股份	48,521,501.24	8.60
80	600958	东方证券	48,464,668.00	8.59
81	600519	贵州茅台	47,325,586.44	8.39
82	601857	中国石油	47,144,270.63	8.36
83	601669	中国电建	46,541,098.63	8.25
84	002110	三钢闽光	45,163,076.93	8.00
85	600362	江西铜业	44,893,457.96	7.95
86	300335	迪森股份	44,722,263.58	7.93
87	601666	平煤股份	43,968,979.51	7.79
88	603167	渤海轮渡	43,518,382.03	7.71
89	000650	仁和药业	43,494,683.32	7.71
90	002748	世龙实业	43,287,854.56	7.67
91	002449	国星光电	42,523,036.34	7.54
92	002589	瑞康医药	41,586,526.64	7.37
93	601818	光大银行	41,447,274.00	7.34
94	002536	西泵股份	40,567,048.22	7.19
95	600316	洪都航空	40,474,409.92	7.17
96	002026	山东威达	39,901,947.50	7.07
97	002142	宁波银行	39,402,125.26	6.98
98	600999	招商证券	38,038,856.61