华安科技动力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:中国建设银行股份有限公司
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。

基金托管人中国建设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	华安科技动力混合
基金主代码	040025
交易代码	040025
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年12月20日
基金管理人	华安基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	984,220,670.17份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金重点投资于以科学技术为动力在产业价值链中占据优势地位的行业或企业,关注其科技创新或技术突破后产生的增长动能,在严格控制风险的前提下,力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金采取相对稳定的资产配置策略,一般情况下将保持投资组合的相对稳定,避免因过于主动的仓位调整带来额外的风险。个股选择中以产业链价值结构为主要判断基准,选取以科学技术为动力在产业价值链中占据优势地位的行业或企业,同时从市场广度、技术深度、产业宽度和政策强度等方面寻找选取财务状况良好、盈利能力较强且资产质量较好的公司并作为重点投资对象。
业绩比较基准	80%×中证800指数收益率+20%×中国债券总指数收益率
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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	钱昶	田青
	联系电话	021-38969999	010-67595096
	电子邮箱	qianchang@huaan.com.cn	tianqing.1.zh@ccb.com
客户服务电话		400999.5099	010-67595096
传真		021-68863414	010-66275853

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.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	2017年	2016年	2015年
本期已实现收益	347,926,147.07	97,196,704.47	359,676,887.75
本期利润	393,286,095.12	59,862,107.75	331,755,411.66
加权平均基金份额本期利润	0.5636	0.3331	1.6902
本期基金份额净值增长率	18.02%	6.22%	64.83%
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	2.2801	2.2807	2.0893
期末基金资产净值	3,246,009,376.41	897,614,116.58	367,668,218.82
期末基金份额净值	3.298	3.281	3.089

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)。

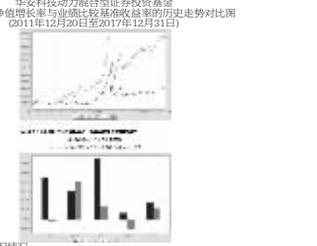
3.2 基金净值表现

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	2.87%	0.74%	1.41%	0.61%	1.46%	0.13%
过去六个月	10.95%	0.87%	5.78%	0.56%	5.17%	0.12%
过去一年	18.02%	0.66%	11.28%	0.52%	6.74%	0.14%
过去三年	106.62%	1.83%	11.47%	1.28%	95.15%	0.45%
过去五年	290.73%	1.64%	53.24%	1.25%	237.49%	0.39%
自基金合同生效起至今	287.21%	1.52%	57.45%	1.21%	229.76%	0.31%

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

华安科技动力混合型证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2011年12月20日至2017年12月31日)



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	5.550	656,787,963.61	107,603,202.79	764,391,166.40	-
合计	5.550	656,787,963.61	107,603,202.79	764,391,166.40	-

§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、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		
谢振东	本基金的基金经理	2015-03-25	-	7年	天津大学理学学士,加州大学洛杉矶分校工学硕士研究生,7年证券、基金行业从业经验。曾任华泰联合证券行业研究员,2011年9月加入华安基金,曾任股票研究部高级研究员、基金投资部基金经理助理,2016年3月起同时担任本基金、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月至2016年9月同时担任华安动态灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2015年3月至2017年12月同时担任华安稳健主题灵活配置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,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。

4.3 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。同时严格执行公司决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体责任权利机制,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,集中交易室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wind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,则各投资组合经理根据以各投资组合义向集中交易室下达投资意向,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,进行场外时非公开发行配售原则、以公司名义进行的债券一级市场申购、不同投资组合间同时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以价交易的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个项分析,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确日反向交易的检查;风险管理部于每日对交易分析系统,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

报告期内,资本市场表现相对稳定,但结构性差异较大;本基金维持自下而上的选股思路,继续配置在中长期具有安全边际和成长空间、符合新消费、科技创新、以及相关行业的优势公司,整体略跑赢比较基准。期间,新消费、新科技等标的的配置对于基金净值产生了较大正面贡献。

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3.298元,本报告期份额净值增长率为18.02%,同期业绩比较基准增长率为11.28%。

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18年,我们倾向于认为中国经济仍将继续呈现稳健增长的态势,其周期性复苏的驱动力主要来自产能、库存调整到位,使得供需两端回归到相对良性的关系;我们不排除经济出现阶段性下行压力,但在转型背景下,新经济加速发力,增长质量将明显提升,其中制造业投资修复和居民消费需求的释放可能是需求端的主要亮点;

就市场而言,经济的相对平稳和偏紧的资金环境仍然是影响A股市场表现的重要因素;基于此,我们对后市持谨慎乐观的观点:股票市场可能继续呈现震荡和分化,结构性机会层出不穷,这对于目下而言上选股创造了较好的环境。

本基金将在以下几个方面寻找投资机会:1.持续提高竞争壁垒的行业优势企业:市场对于大行业优势公司基本面的挖掘可能已经相对充分,伴随着的是市场估值体系的优化;同样部分细分行业优势企业在经历了多轮经济周期洗礼后,通过持续的高研发投入、行业整并和市场开拓,不仅实现了远超行业的增速,而且在国内外实现了强大话语权,而其估值优势正在显现;2.符合国民消费升级又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。

4.7.7 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、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司("中国建设银行")	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)总公司将全部其所持有的国泰君安创新投资有限公司、华安基金管理有限公司七个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 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

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
当期发生的基金应支付的管理费	35,104,468.52	8,083,329.67
其中:支付销售机构的客户维护费	5,383,844.73	2,359,135.65

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1.50%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:

日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.50%/当年天数。

7.4.8.2.2 基金托管费

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
当期发生的基金应支付的托管费	5,850,744.83	1,347,221.66

注:支付基金托管人 中国建设银行 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

无。

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
中国建设银行	426,527,231.38	2,284,778.82	180,107,782.35	667,222.85

注:本基金的银行存款由基金托管人 中国建设银行保管,按银行同业利率计息。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与或不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

金额单位:人民币元

7.4.9.1.1 受限证券类别:股票									
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002923	润都股份	2017-12-28	2018-01-05	网下中签	17.01	17.01	954.00	16,227.54	16,227.54	-
300664	鹏鹞环保	2017-12-28	2018-01-05	网下中签	8.88	8.88	3,640.00	32,323.20	32,323.20	-
603080	新疆火炬	2017-12-25	2018-01-03	网下中签	13.60	13.60	1,187.00	16,143.20	16,143.20	-
603161	科华控股	2017-12-28	2018-01-05	网下中签	16.75	16.75	1,239.00	20,753.25	20,753.25	-

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
002366	台海核电	2017-12-06	重大资产重组	26.45	-	-	200,000	4,828,078.12	5,290,000.00	-
002507	涪陵榨菜	2017-12-04	重大事项	17.94	-	-	2,000,000	27,784,578.19	35,880,000.00	-
002723	万达电影	2017-07-04	重大资产重组	52.04	-	-	400,000	21,236,762.90	20,816,000.00	-
002391	长信蓝ภู	2017-12-28	重大事项	35.26	2018-01-02	38.79	821	10,311.76	28,948.46	-
300730	科创信息	2017-12-25	重大事项	41.56	2018-01-02	45.71	821	6,863.56	34,112.56	-
600309	万华化学	2017-12-06	重大资产重组	37.94	-	-	200,000	7,039,486.18	7,588,000.00	-
601003	柳钢股份	2017-10-17	重大资产重组	7.73	2018-01-18	7.50	2,000,000	14,829,483.78	15,460,000.00	-

注:本基金截至2017年12月31日正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

无。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

无。

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2,777,882,167.57元,属于第二层次的余额为85,182,508.20元,无属于第三层次的余额(2016年12月31日:第一层次2,798,089,272.73元,第二层次16,267,769.32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,本基金会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间或发售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次;并根据估值调整计提相应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》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。

§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	2,863,064,675.77	84.82
	其中:股票	2,863,064,675.77	84.82
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	438,335,749.58	12.99
7	其他各项资产	74,174,349.92	2.20
8	合计	3,375,574,775.27	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	77,160,000.00	2.38
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,617,918,025.96	49.84
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	49,712,143.20	1.53
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	163,807,600.00	5.05
G	交通运输、仓储和邮政业	16,437,967.94	0.51
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	53,238,112.56	1.64
J	金融业	563,247,772.96	17.04
K	房地产业	102,168,000.00	3.15
L	租赁和商务服务业	124,140,000.00	3.82
M	科学研究和技术服务业	8,920,000.00	0.27
N	水利、环境和公共设施管理业	48,477,756.96	1.49
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	8,749,312.20	0.27
R	文化、体育和娱乐业	39,088,000.00	1.20
S	综合	-	-
	合计	2,863,064,675.77	88.20

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	601318	中国平安	2,200,000	153,956,000.00	4.74
2	601288	农业银行	26,000,000	99,580,000.00	3.07
3	600297	广汇汽车	12,000,000	96,240,000.00	2.96
4	601398	工商银行	15,500,000	96,100,000.00	2.96
5	000895	双汇发展	3,400,000	90,100,000.00	2.78
6	600867	通化东宝	3,549,920	81,267,968.80	2.50
7	002027	分众传媒	5,700,000	80,256,000.00	2.47
8	300257	开山股份	5,700,035	79,800,490.00	2.46
9	000898	鞍钢股份	3,000,000	77,160,000.00	2.38
10	300408	三环集团	3,600,000	72,576,000.00	2.24

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	601398	工商银行	276,460,832.28	30.80
2	600893	新奥股份	222,624,025.18	24.80
3	601318	中国平安	200,458,813.86	22.33
4	600048	保利地产	174,680,918.05	19.46
5	601766	中国中车	169,782,359.06	18.91
6	600519	贵州茅台	167,389,653.17	18.65
7	601288	农业银行	166,998,164.22	18.59
8	600297	广汇汽车	162,974,156.28	18.16
9	002027	分众传媒	148,964,079.29	16.60
10	600030	中信证券	146,986,218.95	16.38
11	600066	宇通客车	141,135,612.79	15.72
12	000858	五粮液	132,575,557.68	14.77
13	600782	新钢股份	132,039,783.40	14.71
14	300257	开山股份	131,215,975.46	14.62
15	000998	隆平高科	128,629,859.41	14.33
16	000333	美的集团	127,941,752.63	14.25
17	002126	银轮股份	119,862,457.38	13.35
18	000709	河钢股份	118,466,868.31	13.20
19	601336	新华保险	118,072,682.84	13.15
20	000933	神火股份	117,313,072.16	13.07
21	002001	新和成	116,802,075.54	13.01
22	300408	三环集团	116,488,778.25	12.98
23	600019	宝钢股份	108,987,309.53	12.14
24	002456	欧菲科技	104,469,347.23	11.64
25	300336	新文化	101,998,614.45	11.36
26	002110	三钢闽光	101,846,530.00	11.35
27	600808	马钢股份	98,132,976.96	10.93
28	000725	京东方A	97,374,472.84	10.85
29	600741	华域汽车	97,166,529.49	10.82
30	002517	恺英网络	95,523,440.03	10.64
31	601688	华泰证券	92,982,010.53	10.36
32	000895	双汇发展	91,171,412.34	10.16
33	000002	万科A	89,828,730.27	10.01
34	600176	中国巨石	88,774,421.44	9.89
35	600585	海螺水泥	88,248,693.55	9.83
36	600153	建发股份	87,389,231.75	9.74
37	601933	永辉超市	86,484,756.04	9.63
38	600340	华夏幸福	85,309,811.16	9.50
39	002127	南极电商	84,087,548.08	9.37
40	002159	三特索道	83,771,070.78	9.33
41	002081	金螳螂	78,077,788.16	8.70
42	603986	龙马环卫	75,358,810.07	8.40
43	600967	内蒙一机	73,450,296.04	8.18
44	000063	中兴通讯	71,362,812.96	7.96
45	002454	松芝股份	67,427,372.50	7.51
46	600705	中航资本	66,796,148.15	7.44
47	600516	方大炭素	66,775,283.51	7.44
48	601996	丰林集团	65,406,294.67	7.29
49	300043	星辉娱乐	65,144,629.48	7.26
50	601601	中国太保	64,336,219.49	7.17
51	600625	长园集团	64,297,075.60	7.16
52	000060	中金岭南	63,005,683.93	7.02
53	000581	威孚高科	62,594,396.47	6.97
54	600362	江西铜业	60,922,638.68	6.79
55	002768	国恩股份	59,578,000.58	6.64
56	600518	康美药业	57,974,351.01	6.46
57	600352	浙江龙盛	57,711,506.48	6.43
58	002479	富春环保	57,496,431.19	6.41
59	601166	兴业银行	56,358,417.50	6.28
60	600498	烽火通信	54,368,765.26	6.06
61	600428	中远海特	54,312,880.39	6.05
62	002507	涪陵榨菜	51,977,368.07	5.79
63	600383	金地集团	51,831,227.61	5.77
64	600497	驰宏锌锗	51,741,130.91	5.76
65	000423	东阿阿胶	51,332,901.04	5.72
66	300017	网宿科技	50,879,511.69	5.67
67	002039	黔源电力	50,877,343.81	5.67
68	600600	青岛啤酒	50,580,901.69	5.64
69	000839	中信国安	49,396,563.88	5.50
70	600456	宝钛股份	48,440,709.43	5.40
71	000630	铜陵有色	45,966,000.00	5.12
72	002436	兴森科技	45,697,372.91	5.09
73	600061	飞乐音响	45,315,340.97	5.05
74	002236	海康威视	43,512,664.82	4.85
75	000639	西王食品	43,010,130.91	4.79
76	601233	桐昆股份	42,816,630.43	4.77
77	000717	韶钢松山	42,606,170.13	4.75
78	600875	东方电气	42,049,038.47	4.68
79	300223	华灿光电	41,943,267.54	4.67
80	002466	天齐锂业	41,527,589.41	4.63
81	600885	宏发股份	41,505,785.10	4.62
82	000625	长安汽车	41,391,723.94	4.61
83	600507	方大特钢	41,137,566.01	4.58
84	001979	招商蛇口	41,097,757.97	4.58
85	600305	恒顺醋业	41,056,263.91	4.57
86	600521	华海药业	41,012,528.76	4.57
87	000976	华铁股份	40,776,156.05	4.54
88	600887	伊利股份	40,456,735.30	4.51
89	601600	中国铝业	40,288,449.34	4.49
90	600050	中国联通	40,210,503.00	4.48
91	002640	跨境通	39,757,057.11	4.43
92	000930	中粮生化	39,564,371.52	4.41
93	000932	华菱钢铁	39,208,467.00	4.37
94	002366	台海核电	39,193,694.89	4.37
95	601857	中国石油	38,730,626.60	4.31
96	600867	通化东宝	38,722,589.28	4.31
97	000568	泸州老窖	38,148,952.40	4.25
98	002729	万达电影	37,193,840.33	4.14
99	601003	柳钢股份	37,073,709.46	4.13
100	000800	一汽轿车	36,800,481.42	4.10
101	601117	中国化学	36,494,858.70	4.07
102	002493	荣盛石化	35,923,741.93	4.00