

**MSCI 中国 A 股交易型开放式指数
证券投资基金
2016 年年度报告**

2016 年 12 月 31 日

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一七年三月二十九日

§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 2017 年 3 月 27 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。

本报告中的财务资料经审计，普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	1
§2 基金简介.....	3
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....	4
3.1 主要会计数据和财务指标.....	4
3.2 基金净值表现.....	5
3.3 自基金合同生效以来基金的利润分配情况.....	6
§4 管理人报告.....	6
§5 托管人报告.....	12
§6 审计报告.....	12
§7 年度财务报表.....	13
7.1 资产负债表.....	13
7.2 利润表.....	15
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16
7.4 报表附注.....	17
§8 投资组合报告.....	42
8.1 期末基金资产组合情况.....	42
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	42
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.....	43
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	67
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	69
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.....	69
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.....	69
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.....	69
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.....	69
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	69
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	70
8.12 投资组合报告附注.....	70
§9 基金份额持有人信息.....	71
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	71
9.2 期末上市基金前十名持有人.....	71
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	72
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情况.....	72
§10 开放式基金份额变动.....	72
§11 重大事件揭示.....	72
§12 备查文件目录.....	75

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	华夏 MSCI 中国 A 股 ETF
场内简称	MSCIA 股
基金主代码	512990
交易代码	512990
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2015 年 2 月 12 日
基金管理人	华夏基金管理有限公司
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	333,515,418 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2015 年 3 月 25 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化，以期获得与标的指数收益相似的回报。
投资策略	本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为 MSCI 中国 A 股指数。
风险收益特征	本基金属于股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，在股票基金中属于较高风险、较高收益的产品。

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		华夏基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	张静	王永民
	联系电话	400-818-6666	010-66594896
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-818-6666	95566
传真		010-63136700	010-66594942
注册地址		北京市顺义区天竺空港工业区 A 区	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址		北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 8 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号

邮政编码	100033	100818
法定代表人	杨明辉	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.ChinaAMC.com
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

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 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号
注册登记机构	华夏基金管理有限公司	北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 8 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	2016 年	2015 年 2 月 12 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-32,487,675.79	724,286,451.91
本期利润	-59,552,982.74	717,702,010.35
加权平均基金份额本期利润	-0.1511	0.5672
本期加权平均净值利润率	-16.10%	50.04%
本期基金份额净值增长率	-9.43%	8.98%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末
期末可供分配利润	-4,324,887.50	43,855,075.60
期末可供分配基金份额利润	-0.0130	0.0898
期末基金资产净值	329,190,530.50	532,370,493.60
期末基金份额净值	0.9870	1.0898
3.1.3 累计期末指标	2016 年末	2015 年末
基金份额累计净值增长率	-1.30%	8.98%

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期末可供分配利润为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。

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	2.08%	0.69%	0.63%	0.70%	1.45%	-0.01%
过去六个月	7.13%	0.76%	3.48%	0.77%	3.65%	-0.01%
过去一年	-9.43%	1.48%	-14.74%	1.53%	5.31%	-0.05%
自基金合同生效起至今	-1.30%	1.99%	-4.29%	2.06%	2.99%	-0.07%

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

MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金

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

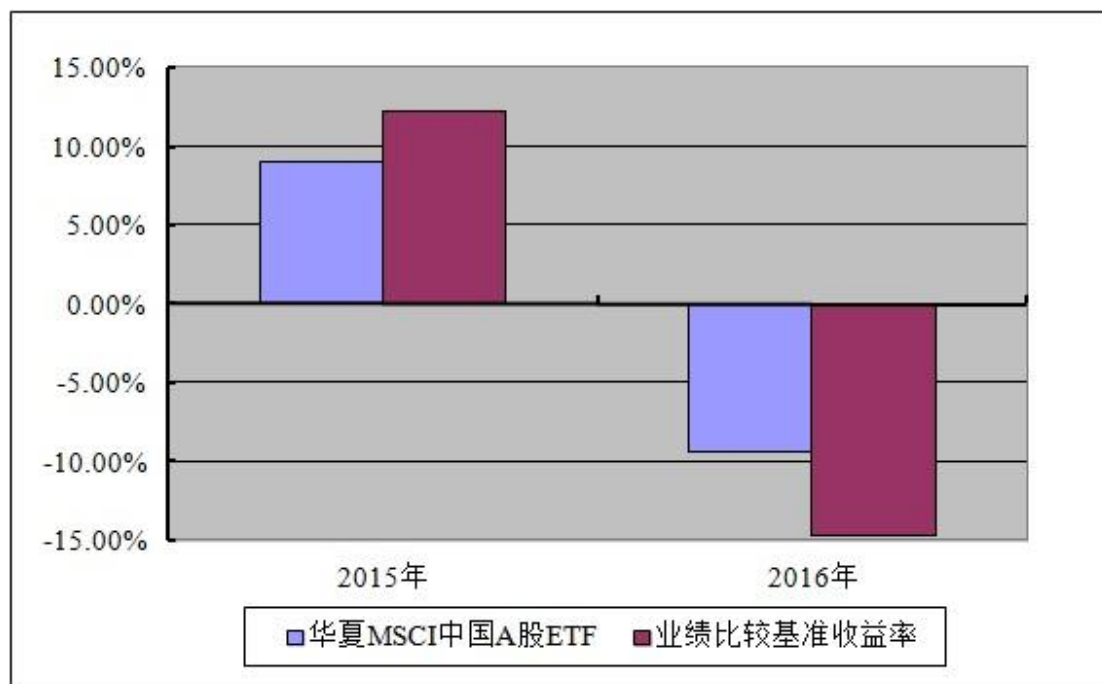
(2015 年 2 月 12 日至 2016 年 12 月 31 日)



3.2.3 自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

MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金

自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对比图



注：本基金合同于 2015 年 2 月 12 日生效，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 自基金合同生效以来基金的利润分配情况

本基金自基金合同生效以来无利润分配事项。

§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

华夏基金管理有限公司成立于 1998 年 4 月 9 日，是经中国证监会批准成立的首批全国性基金管理公司之一。公司总部设在北京，在北京、上海、深圳、成都、南京、杭州、广州和青岛设有分公司，在香港、深圳、上海设有子公司。公司是首批全国社保基金管理人、首批企业年金基金管理人、境内首批 QDII 基金管理人、境内首只 ETF 基金管理人、境内首只沪港通 ETF 基金管理人、首批内地与香港基金互认基金管理人、首批基本养老保险基金投资管理人资格，以及特定客户资产管理人、保险资金投资管理人，香港子公司是首批 RQFII 基金管理人。华夏基金是业务领域最广泛的基金管理公司之一。

华夏基金是境内 ETF 基金资产管理规模最大的基金管理公司之一，在 ETF

基金管理方面积累了丰富的经验，目前旗下管理华夏沪深 300ETF、华夏 MSCI 中国 A 股 ETF、华夏中证 500ETF、华夏上证 50ETF、华夏中小板 ETF、华夏消费 ETF、华夏金融 ETF、华夏医药 ETF、华夏恒生 ETF、华夏沪港通恒生 ETF、华夏上证 50AH 优选指数（LOF）和华夏快线 ETF，初步形成了覆盖宽基指数、大盘蓝筹指数、中小盘指数、行业指数、海外市场指数等的产品线。

2016 年，在《中国证券报》主办的第十三届中国基金业金牛奖的评选中，华夏基金获得“2015 年度被动投资金牛基金公司”奖；在《上海证券报》主办的第十三届中国“金基金”奖评选中，华夏基金获得“2015 年度金基金·债券投资回报基金管理公司”奖。

在客户服务方面，2016 年，华夏基金继续以客户需求为导向，努力提高客户使用的便利性和服务体验：（1）改进业务流程，客户可通过网上交易系统自助办理退款、重置密码、上传换卡资料等业务，还可自助办理资产证明和盖章对账单，业务处理更加高效便捷；（2）增加交易渠道，与滴滴出行合作推出滴滴金桔宝理财，并上线华夏财富网上交易系统，增加直销定投通等功能，为客户提供更多优惠便捷的理财渠道，提高交易便利性；（3）开展“你定，我投”、“客户个性化白皮书”、“2016 活期通年底晒账单”、2016 北京马拉松等系列宣传活动，为客户提供多样化的关怀服务。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张弘弢	本基金的基金经理、董事总经理	2015-02-12	-	16 年	硕士。2000 年 4 月加入华夏基金管理有限公司，曾任研究发展部总经理、数量投资部副总经理、上证能源交易型开放式指数发起式证券投资基金基金经理（2013 年 3 月 28 日至 2016 年 3 月 28 日期间）等。
荣膺	本基金的基金经理、数量投资部高级副总裁	2016-10-20	-	6 年	北京大学光华管理学院会计学硕士。2010 年 7 月加入华夏基金管理有限公司，曾任研究发展部高级产品

					经理，数量投资部研究员、投资经理、基金经理助理等。
--	--	--	--	--	---------------------------

注：①上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

②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

报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司开展投资、研究活动防控内幕交易指导意见》、基金合同和其他有关法律法规，本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

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

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《华夏基金管理有限公司公平交易制度》。公司通过科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，通过监察稽核、事后分析和信息披露来保证公平交易过程和结果的监督。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《华夏基金管理有限公司公平交易制度》的规定。

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（1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

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，未出现涉及本基金的交易所公开竞价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 5%的情况。

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

本基金跟踪的标的指数为 MSCI 中国 A 股指数, MSCI 中国 A 股指数是国际指数公司 MSCI 为中国 A 股市场创建的独立国家指数, 旨在为当前投资 A 股市场的广大投资者提供一个股票表现基准, 该指数力图反映国内 A 股投资者的投资过程和制约因素, 同时也可成为国际投资者了解和参与中国 A 股市场的一个工具。该指数自 2005 年 5 月起正式发布, 以 A 股沪深两市大中盘股票为成份股样本, 以其经调整的自由流通市值为权数计算得到; 截至 2016 年 12 月 31 日, 该指数成份股样本共计 861 只。本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好地跟踪标的指数, 实现基金投资目标。

2016 年, 国际方面, 美国经济稳定增长, 美联储年末将联邦基金利率提升 25 个基点至 0.5%-0.75%, 美国总统大选也落下帷幕, 特朗普获胜加强了美国基建投资预期, 使得全球通货膨胀预期提升; 欧洲央行自年初降低三大利率后维持主要政策利率不变, 年末延长 QE 至 2017 年 12 月, 报告期欧洲经济温和复苏, 但年内英国脱欧公投、意大利修宪公投失败都给全球市场带来不小波动。国内方面, 政府继续以推进供给侧结构性改革为主线, 同时适度扩大总需求, 全年经济有所企稳, GDP 同比增长 6.7%。PPI (生产物价指数) 同比一举扭转数年以来的下降态势实现转正, CPI 也温和上涨。货币政策方面, 为引导经济去杠杆, 央行下半年持续锁短放长, 货币政策由相对宽松逐渐回归中性。

市场方面, 年初在人民币短期快速贬值以及相关监管措施出台等诸多因素影响下, A 股经历了一波较大幅度的调整, 之后在基本面企稳、工业品价格持续上涨等因素带动下, 市场走出一波震荡修复式行情, 纵观全年, 由于各种黑天鹅事件频发, 震荡可谓剧烈。

基金投资运作方面, 报告期内, 本基金在做好跟踪标的指数的基础上, 认真应对投资者日常申购、赎回及成份股调整等工作。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2016 年 12 月 31 日, 本基金份额净值为 0.9870 元, 本报告期份额净值增长率为-9.43%, 同期业绩比较基准增长率为-14.74%。本基金本报告期跟踪偏

离度为+5.31%，与业绩比较基准产生偏离的主要原因为成份股分红、日常运作费用、指数结构调整、申购赎回等产生的差异。

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 2017 年，国际方面，美元的加息节奏仍是牵动市场神经的关键因素，而特朗普政府的政策走向也成为市场的重大不确定因素；与此同时，英国脱欧流程的启动、欧洲政治经济格局的重构，都使得我们将面临一个更加不确知的外部世界。国内方面，为维持经济平稳增长，政府会继续展开供给侧改革尤其是“补短板”行动，混合所有制等改革也将扎实推进，与此同时，也需密切关注美国新一届政府的政策走向及我国政府的应对策略。财政政策方面，料将继续积极有为，货币政策大概率会维持中性。如果经济企稳得到进一步验证或有超预期的改革举措，MSCI 中国 A 股指数将会有较好的投资机会；反之，则可能呈震荡走势。

我们将继续有效控制基金的跟踪偏离度和跟踪误差，以实现投资者获取指数投资收益及其他模式盈利的投资目标。同时，我们也积极争取推动产品的进一步创新，充分发挥 ETF 的功能，为各类投资者提供更多、更好的投资机会。

珍惜基金份额持有人的每一分投资和每一份信任，本基金将继续奉行华夏基金管理有限公司“为信任奉献回报”的经营理念，规范运作，审慎投资，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求长期、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，基金管理人持续加强合规管理、风险控制和监察稽核工作。在合规管理方面，公司制定了合规风险管理制度、风险隔离制度、员工违规违纪处理制度，修订了保密管理制度和员工培训制度，进一步完善合规制度建设；公司开展多种形式的合规培训，重点加强了投资研究和基金销售业务条线的合规教育，不断提升员工的合规守法意识；强化事前事中合规风险管理，严格审核信息披露文件、基金宣传推介材料，加强了对微信等新媒体宣传材料的合规审核，防范各类合规风险。在风险管理方面，公司秉承全员风险管理的理念，采取事前防范、事中控制和事后监督等三阶段工作，加强对日常投资运作的管理和监控，督促投研交易业务的合规开展；在监察稽核方面，公司定期和不定期开展多项内部稽核，对投资研究、基金交易、市场销售、后台运作等关键业务和岗位进行检查监督，促进公司业务合规运作、稳健经营。

报告期内，本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规。本基金管理人将继续以风险控制为核心，坚持基金份额持有人利益优先的原则，提高监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金安全、合规运作。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及基金合同约定，本基金管理人应严格按照新准则、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。会计师事务所所在估值调整导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上时对所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。其中，本基金管理人为了确保估值工作的合规开展，建立了负责估值工作决策和执行的专门机构，组成人员包括主管基金运营的公司领导或其授权人、督察长、投资风控工作负责人、证券研究工作负责人、合规负责人及基金会计工作负责人等，以上人员具有丰富的风控、证券研究、合规、会计方面的专业经验。同时，根据基金管理公司制定的相关制度，估值工作决策机构的成员中不包括基金经理。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金基金合同规定，本基金的收益分配原则为：每份基金份额享有同等分配权。基金收益评价日核定的基金累计报酬率超过同期标的指数累计报酬率达到 1% 以上时，可进行收益分配。基金收益分配采用现金方式。在符合基金收益分配条件的情况下，本基金收益每年最多分配 4 次，每次基金收益分配数额的确定原则为使收益分配后基金累计报酬率尽可能贴近标的指数同期累计报酬率。若基金合同生效不满 3 个月则可不进行收益分配。法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

本基金本报告期末未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

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

报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§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 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金（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

普华永道中天审字(2017)第 20575 号

MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人：

我们审计了后附的 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“华夏 MSCI 中国 A 股 ETF 基金”）的财务报表，包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表、2016 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。

6.1 管理层对财务报表的责任

编制和公允列报财务报表是华夏 MSCI 中国 A 股 ETF 基金的基金管理人华夏基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括：（1）按照企业会计准则和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财务报表，并使其实现公允反映；（2）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。

6.2 注册会计师的责任

我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。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。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，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。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。

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。

6.3 审计意见

我们认为，上述华夏 MSCI 中国 A 股 ETF 基金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，公允反映了华夏 MSCI 中国 A 股 ETF 基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和基金净值变动情况。

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙） 注册会计师 许康玮 赵雪

上海市湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼

2017 年 3 月 10 日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
----	-----	-------------------------	--------------------------

资产：			
银行存款	7.4.7.1	12,854,628.00	33,757,871.63
结算备付金		2,888,999.49	8,604,269.41
存出保证金		4,914,047.05	9,773,241.67
交易性金融资产	7.4.7.2	302,125,249.67	482,770,494.02
其中：股票投资		302,125,249.67	482,582,597.22
基金投资		-	-
债券投资		-	187,896.80
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	5,700,000.00	-
应收证券清算款		1,016,202.32	623,135.29
应收利息	7.4.7.5	12,647.16	12,805.01
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		329,511,773.69	535,541,817.03
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 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		-	1,945,867.18
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		143,016.49	234,401.53
应付托管费		28,603.30	46,880.32
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	15,700.11	56,184.95
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	133,923.29	887,989.45

负债合计		321,243.19	3,171,323.43
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	333,515,418.00	488,515,418.00
未分配利润	7.4.7.10	-4,324,887.50	43,855,075.60
所有者权益合计		329,190,530.50	532,370,493.60
负债和所有者权益总计		329,511,773.69	535,541,817.03

注：①报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.9870 元，基金份额总额 333,515,418 份。

②本基金合同于 2015 年 2 月 12 日生效，上年度可比期间自 2015 年 2 月 12 日至 2015 年 12 月 31 日。

7.2 利润表

会计主体：MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 2 月 12 日 (基金合同生效 日) 至 2015 年 12 月 31 日
一、收入		-56,758,157.84	729,566,774.43
1.利息收入		265,467.22	2,914,046.36
其中：存款利息收入	7.4.7.11	243,830.30	1,871,129.60
债券利息收入		248.86	116.54
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		21,388.06	1,042,800.22
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-30,126,859.71	728,520,399.73
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-33,775,884.33	704,747,764.68
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	57,073.08	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.14	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.15	-	-
衍生工具收益	7.4.7.16	-2,199,500.00	10,763,800.00
股利收益	7.4.7.17	5,791,451.54	13,008,835.05
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	-27,065,306.95	-6,584,441.56

4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.19	168,541.60	4,716,769.90
减：二、费用		2,794,824.90	11,864,764.08
1.管理人报酬		1,855,832.99	6,447,035.27
2.托管费		371,166.54	1,289,406.94
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	7.4.7.20	204,743.58	3,440,480.37
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.其他费用	7.4.7.21	363,081.79	687,841.50
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-59,552,982.74	717,702,010.35
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-59,552,982.74	717,702,010.35

注：本基金合同于 2015 年 2 月 12 日生效，上年度可比期间自 2015 年 2 月 12 日至 2015 年 12 月 31 日。

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 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）	488,515,418.00	43,855,075.60	532,370,493.60
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-59,552,982.74	-59,552,982.74
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）	-155,000,000.00	11,373,019.64	-143,626,980.36
其中：1.基金申购款	75,000,000.00	-6,687,807.27	68,312,192.73
2.基金赎回款	-230,000,000.00	18,060,826.91	-211,939,173.09
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）	333,515,418.00	-4,324,887.50	329,190,530.50

项目	上年度可比期间 2015 年 2 月 12 日（基金合同生效日）至 2015 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）	4,136,570,680.00	-	4,136,570,680.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	717,702,010.35	717,702,010.35
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）	-3,648,055,262.00	-673,846,934.75	-4,321,902,196.75
其中：1.基金申购款	391,944,738.00	37,370,493.64	429,315,231.64
2.基金赎回款	-4,040,000,000.00	-711,217,428.39	-4,751,217,428.39
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）	488,515,418.00	43,855,075.60	532,370,493.60

注：本基金合同于 2015 年 2 月 12 日生效，上年度可比期间自 2015 年 2 月 12 日至 2015 年 12 月 31 日。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

_____ 杨明辉	_____ 汪贵华	_____ 汪贵华
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）已获中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2014]870 号《关于准予 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金注册的批复》，由华夏基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金基金合同》及其他有关法律法规负责公开募集。本基金为交易型开放式，存续期限为不定期。本基金自 2015 年 1 月 19 日至 2015 年 2 月 6 日期间共募集 4,136,470,618.00 元（不含认购资金利息），

业经德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）德师报（验）字（15）第 0145 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2015 年 2 月 12 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 4,136,570,680 份基金份额，其中认购资金利息折合 100,062 份基金份额。本基金的基金管理人为华夏基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股、替代性股票。为更好地实现投资目标，基金还可投资于非成份股、债券（含中小企业私募债券）、股指期货、权证、货币市场工具、国债期货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（但须符合中国证监会相关规定）。

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 日及其后颁布和修订的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会发布的《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>》和中国证监会、中国基金业协会允许的如财务报表附注 7.4.4 所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 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。本基金目前暂无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具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。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表以衍生金融资产列示外，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、买入返售金融资产和各类应收款项等。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。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债包括交易性金融负债及衍生金融负债等。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

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，于交易日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；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利、债券或资产支持证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。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及金融负债按照公允价值进行后续计量，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。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成

本按移动加权平均法于交易日结转。

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、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具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，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

2、存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

3、当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

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。当本基金依法有权抵销债权债务且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。对于曾经实施份额拆分或折算的基金，由于基金份额拆分或折算引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日或基金份额折算日根据拆分前或折算前的基金份额数及确定的拆分或折算比例计算认列。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。对于已开放转换业务的基金，上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

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。

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。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分确认为利息收入。

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；处置时其公允价值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。赎回转出股票投资收益/(损失)于赎回当日按转出股票以当日市场交易收盘价计算的市值与其成本的差额确认。

当本基金申购或赎回对价中包含可以现金替代或退补现金替代时，在本基金补足或卖出被替代股票(或采取强制退款)之前，该股票估值日与申购日或赎回日估值的差额确认为“公允价值变动收益/(损失)”。

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按直线法近似计算。

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按直线法近似计算。

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。期末可供分配利润指期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。基金

收益评价日核定的基金累计报酬率超过标的指数同期累计报酬率达到 1%以上，方可进行收益分配。

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 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、对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》之附件《非公开发行股票有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

2、在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

3、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)，于 2015 年 3 月 20 日起按照中证指数有限公司根据《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》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

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

根据财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]103 号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、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、以发行基金方式募集资金不属于营业税或增值税征收范围，不征收营业税或增值税。

2、基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税或增值税，暂不征收企业所得税。

3、存款利息收入不征收增值税。

4、国债、地方政府债利息收入，金融同业往来利息收入免征增值税。

5、对基金取得的债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

6、对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利收入时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。基金从上市公司分配取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，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，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。

7、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。

8、基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

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 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
活期存款	12,854,628.00	33,757,871.63
定期存款	-	-
其他存款	-	-
合计	12,854,628.00	33,757,871.63

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	335,655,018.18	302,125,249.67	-33,529,768.51
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	335,655,018.18	302,125,249.67	-33,529,768.51
项目	上年度末 2015年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	488,839,695.58	482,582,597.22	-6,257,098.36
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	150,000.00	187,896.80
	银行间市场	-	-
	合计	150,000.00	187,896.80
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	488,989,695.58	482,770,494.02	-6,219,201.56

注：股票投资的估值增值和股票投资的公允价值均包含可退替代款的估值增值。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	24,480,960.00	-	-	-
其中：股指期货	24,480,960.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	24,480,960.00	-	-	-
项目	上年度末 2015 年 12 月 31 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	47,885,240.00	-	-	-
其中：股指期货	47,885,240.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	47,885,240.00	-	-	-

注：期货投资采用当日无负债结算制度，相关价值已包含在结算备付金中，具体投资情况详见下表（买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示）：

金额单位：人民币元

代码	名称	持仓量 (买/ 卖)(单 位：手)	合约市值	公允价值变动	风险说明
IC1701	中证 500 股指期货 IC1701 合约	7	8,704,080.00	60,080.00	买入股指期货多头合约的目的是进行更有效地流动性管理。
IF1701	沪深 300 股指期货 IF1701 合约	14	13,826,400.00	-130,080.00	买入股指期货多头合约的目的是进行更有效地流动性管理。

IF1703	沪深 300 股指期货 IF1703 合约	2	1,950,480.00	-49,980.00	买入股指期货多头合约的目的是进行更有效地流动性管理。
公允价值变动总额合计					-119,980.00
股指期货投资本期收益					-2,199,500.00
股指期货投资本期公允价值变动					245,260.00

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
银行间同业市场买入返售金融资产	-	-
交易所市场买入返售金融资产	5,700,000.00	-
合计	5,700,000.00	-
项目	上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
银行间同业市场买入返售金融资产	-	-
交易所市场买入返售金融资产	-	-
合计	-	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	2,557.87	7,122.77
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	2,480.57	5,468.57
应收债券利息	-	116.54
应收买入返售证券利息	7,599.81	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	8.91	97.13

合计	12,647.16	12,805.01
----	-----------	-----------

7.4.7.6 其他资产

无。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	15,700.11	56,184.95
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	15,700.11	56,184.95

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付指数使用费	62,761.36	451,292.44
预提费用	60,000.00	140,000.00
可退替代款	8,411.90	97,862.30
应退替代款	2,750.03	198,834.71
合计	133,923.29	887,989.45

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	488,515,418.00	488,515,418.00
本期申购	75,000,000.00	75,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-230,000,000.00	-230,000,000.00
本期末	333,515,418.00	333,515,418.00

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	218,810,047.73	-174,954,972.13	43,855,075.60

本期利润	-32,487,675.79	-27,065,306.95	-59,552,982.74
本期基金份额交易产生的变动数	-59,964,571.35	71,337,590.99	11,373,019.64
其中：基金申购款	29,252,488.47	-35,940,295.74	-6,687,807.27
基金赎回款	-89,217,059.82	107,277,886.73	18,060,826.91
本期已分配利润	-	-	-
本期末	126,357,800.59	-130,682,688.09	-4,324,887.50

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 2 月 12 日（基金合同 生效日）至 2015 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	128,826.33	1,582,231.17
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	114,348.26	256,627.56
其他	655.71	32,270.87
合计	243,830.30	1,871,129.60

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 2 月 12 日（基金合同 生效日）至 2015 年 12 月 31 日
股票投资收益--买卖股票差价收入	-7,854,017.07	301,940,945.03
股票投资收益--赎回差价收入	-25,921,867.26	402,806,819.65
股票投资收益——申购差价收入	-	-
合计	-33,775,884.33	704,747,764.68

7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 2 月 12 日（基金 合同生效日）至
----	---	--

		2015 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	131,877,814.14	1,988,142,209.29
减：卖出股票成本总额	139,731,831.21	1,686,201,264.26
买卖股票差价收入	-7,854,017.07	301,940,945.03

7.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 2 月 12 日（基金合同 生效日）至 2015 年 12 月 31 日
赎回基金份额对价总额	211,939,173.09	4,751,217,428.39
减：现金支付赎回款总额	83,553,712.09	1,777,091,472.39
减：赎回股票成本总额	154,307,328.26	2,571,319,136.35
赎回差价收入	-25,921,867.26	402,806,819.65

7.4.7.12.4 股票投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 2 月 12 日（基金合 同生效日）至 2015 年 12 月 31 日
卖出债券（、债转股及债券 到期兑付）成交总额	448,536.48	-
减：卖出债券（、债转股及 债券到期兑付）成本总额	391,300.00	-
减：应收利息总额	163.40	-
买卖债券差价收入	57,073.08	-

7.4.7.14 资产支持证券投资收益

无。

7.4.7.15 贵金属投资收益

7.4.7.15.1 贵金属投资收益项目构成

无。

7.4.7.15.2 贵金属投资——买卖贵金属差价收入

无。

7.4.7.15.3 贵金属投资——赎回差价收入

无。

7.4.7.15.4 贵金属投资——申购差价收入

无。

7.4.7.16 衍生工具收益

7.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

7.4.7.16.2 衍生工具收益——其他衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 2 月 12 日（基金合同生效 日）至 2015 年 12 月 31 日
股指期货投资收益	-2,199,500.00	10,763,800.00
合计	-2,199,500.00	10,763,800.00

7.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 2 月 12 日（基金合 同生效日）至 2015 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	5,791,451.54	13,008,835.05
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	5,791,451.54	13,008,835.05

7.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 2 月 12 日（基金合同 生效日）至 2015 年 12 月 31 日
1.交易性金融资产	-27,310,566.95	-6,219,201.56
——股票投资	-27,272,670.15	-6,257,098.36
——债券投资	-37,896.80	37,896.80
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
2.衍生工具	245,260.00	-365,240.00

——权证投资	-	-
——期货投资	245,260.00	-365,240.00
3.其他	-	-
合计	-27,065,306.95	-6,584,441.56

7.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 2 月 12 日（基金合同 生效日）至 2015 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	-	-
替代损益	168,541.60	3,767,619.24
其他	-	949,150.66
合计	168,541.60	4,716,769.90

7.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 2 月 12 日（基金合同 生效日）至 2015 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	204,743.58	3,440,480.37
银行间市场交易费用	-	-
合计	204,743.58	3,440,480.37

7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 2 月 12 日（基金合同 生效日）至 2015 年 12 月 31 日
审计费用	60,000.00	70,000.00
信息披露费	80,000.00	70,000.00
指数使用费	157,528.28	451,292.44
上市费	60,000.00	75,000.00
银行费用	5,353.51	21,549.06
其他	200.00	-
合计	363,081.79	687,841.50

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，本基金无或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》(财税[2017]2 号)，要求 2017 年 7 月 1 日(含)以后，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，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在 2017 年 7 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。资管产品运营过程中发生增值税应税行为的具体征收管理办法，由国家税务总局另行制定。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

上述通知是对财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的《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》(财税[2016]140 号)的补充，该通知要求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，自 2016 年 5 月 1 日起执行。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
华夏基金管理有限公司	基金管理人
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	基金托管人
中信证券股份有限公司(“中信证券”)	基金管理人的股东
山东省农村经济开发投资公司	基金管理人的股东
POWER CORPORATION OF CANADA	基金管理人的股东
青岛海鹏科技投资有限公司	基金管理人的股东
南方工业资产管理有限责任公司	基金管理人的股东
中信期货有限公司(“中信期货”)	基金管理人股东控股的公司
MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金联接基金(“华夏 MSCI 中国 A 股 ETF 联接”)	该基金是本基金的联接基金

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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 债券交易

无。

7.4.10.1.4 债券回购交易

无。

7.4.10.1.5 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 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 2 月 12 日（基金合同 生效日）至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,855,832.99	6,447,035.27

注：①支付基金管理人的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 0.5%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

②基金管理人报酬计算公式为：日基金管理人报酬＝前一日基金资产净值×0.5%/当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 2 月 12 日（基金合同生 效日）至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的 托管费	371,166.54	1,289,406.94

注：①支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值 0.1%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

②基金托管费计算公式为：日基金托管费＝前一日基金资产净值×0.1%/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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2016 年 12 月 31 日		上年度末 2015 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
华夏 MSCI 中国 A 股 ETF 联接	93,172,883.00	27.94%	103,804,738.00	21.25%

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的相关费用符合基金招募说明书、交易所、登记结算机构的有关规定。

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 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2015 年 2 月 12 日(基金合同生效日) 至 2015 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
中国银行活期 存款	12,854,628.00	128,826.33	33,757,871.63	1,582,231.17

注：本基金的活期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

金额单位：人民币元

本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位: 股/张)	总金额
中信证券	110032	三一转债	老股东优先 配售	680	68,000.00
中信证券	600489	中金黄金	老股东配售	8,382	52,136.04
上年度可比期间 2015 年 2 月 12 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	

				数量(单位: 股/张)	总金额
中信证券	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期通过中信期货买卖股指期货成交额 619,257,560.00 元（上年度可比期间：1,340,367,480.00 元），支付给中信期货的佣金为 22,362.17 元（上年度可比期间：34,402.00 元）。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配事项。

7.4.12 期末（2016 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：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
601375	中原证券	2016-12-20	2017-01-03	新发流 通受限	4.00	4.00	26,695	106,780.00	106,780.00	-
603877	太平鸟	2016-12-29	2017-01-09	新发流 通受限	21.30	21.30	3,180	67,734.00	67,734.00	-
300583	赛托生物	2016-12-29	2017-01-06	新发流 通受限	40.29	40.29	1,582	63,738.78	63,738.78	-
603689	皖天然气	2016-12-30	2017-01-10	新发流 通受限	7.87	7.87	4,818	37,917.66	37,917.66	-
603228	景旺电子	2016-12-28	2017-01-06	新发流 通受限	23.16	23.16	1,455	33,697.80	33,697.80	-
603035	常熟汽饰	2016-12-27	2017-01-05	新发流 通受限	10.44	10.44	2,316	24,179.04	24,179.04	-
603266	天龙股份	2016-12-30	2017-01-10	新发流 通受限	14.63	14.63	1,562	22,852.06	22,852.06	-
300587	天铁股份	2016-12-28	2017-01-05	新发流 通受限	14.11	14.11	1,438	20,290.18	20,290.18	-
002840	华统股份	2016-12-29	2017-01-10	新发流 通受限	6.55	6.55	1,814	11,881.70	11,881.70	-
002838	道恩股份	2016-12-28	2017-01-06	新发流 通受限	15.28	15.28	681	10,405.68	10,405.68	-
603186	华正新材	2016-12-26	2017-01-03	新发流 通受限	5.37	5.37	1,874	10,063.38	10,063.38	-

603032	德新交运	2016-12-27	2017-01-05	新发流通受限	5.81	5.81	1,628	9,458.68	9,458.68	-
300586	美联新材	2016-12-26	2017-01-04	新发流通受限	9.30	9.30	1,006	9,355.80	9,355.80	-
300591	万里马	2016-12-30	2017-01-10	新发流通受限	3.07	3.07	2,397	7,358.79	7,358.79	-
300588	熙菱信息	2016-12-27	2017-01-05	新发流通受限	4.94	4.94	1,380	6,817.20	6,817.20	-

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(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000166	申万宏源	2016-12-21	重大事项	6.25	2017-01-26	6.29	158,941	1,554,124.51	993,381.25	-
600649	城投控股	2016-12-06	重大事项	20.34	-	-	31,600	453,025.53	642,744.00	-
600406	国电南瑞	2016-12-29	重大事项	16.63	-	-	35,191	564,839.64	585,226.33	-
601727	上海电气	2016-08-31	重大事项	8.42	-	-	54,900	981,913.04	462,258.00	-
000540	中天城投	2016-11-28	重大事项	6.93	2017-01-03	7.00	66,650	474,867.97	461,884.50	-
000887	中鼎股份	2016-11-18	重大事项	25.94	2017-02-15	23.99	17,170	364,951.50	445,389.80	-
000750	国海证券	2016-12-15	重大事项	6.97	2017-01-20	6.27	61,400	514,660.51	427,958.00	-
000748	长城信息	2016-11-01	重大事项	20.31	-	-	17,912	419,793.43	363,792.72	-
000547	航天发展	2016-04-19	重大事项	15.36	2017-01-03	16.90	23,100	431,716.66	354,816.00	-
002129	中环股份	2016-04-25	重大事项	8.27	-	-	41,300	459,854.62	341,551.00	-
600797	浙大网新	2016-10-27	重大事项	18.00	2017-01-06	17.95	18,900	251,059.73	340,200.00	-
600485	信威集团	2016-12-26	重大事项	14.60	-	-	23,100	410,927.67	337,260.00	-
601168	西部矿业	2016-12-19	重大事项	7.83	-	-	40,869	355,405.64	320,004.27	-
002400	省广股份	2016-11-28	重大事项	13.79	-	-	23,196	361,361.13	319,872.84	-
600654	中安消	2016-12-14	重大事项	17.43	-	-	17,300	445,046.78	301,539.00	-

000697	炼石有色	2016-11-17	重大事项	23.51	-	-	12,800	309,248.31	300,928.00	-
600673	东阳光科	2016-11-15	重大事项	7.29	-	-	40,580	307,878.35	295,828.20	-
600875	东方电气	2016-12-09	重大事项	10.79	-	-	26,300	438,785.05	283,777.00	-
000050	深天马 A	2016-09-12	重大事项	18.82	2017-03-23	20.70	14,900	310,127.70	280,418.00	-
002491	通鼎互联	2016-12-22	重大事项	15.54	2017-01-03	15.89	17,500	338,885.55	271,950.00	-
000516	国际医学	2016-12-05	重大事项	7.90	-	-	34,400	377,820.84	271,760.00	-
002075	沙钢股份	2016-09-19	重大事项	16.12	-	-	16,700	206,650.52	269,204.00	-
600655	豫园商城	2016-12-20	重大事项	11.42	-	-	22,700	308,021.25	259,234.00	-
002602	世纪华通	2016-12-15	重大事项	46.89	2017-01-09	50.00	5,500	112,280.99	257,895.00	-
002509	天广中茂	2016-09-21	重大事项	12.68	-	-	18,900	214,180.40	239,652.00	-
600687	刚泰控股	2016-07-25	重大事项	16.42	2017-01-18	16.38	14,300	280,994.63	234,806.00	-
000829	天音控股	2016-09-29	重大事项	11.28	-	-	20,300	418,255.96	228,984.00	-
600161	天坛生物	2016-12-06	重大事项	39.40	2017-03-24	43.34	5,500	207,272.33	216,700.00	-
600151	航天机电	2016-11-11	重大事项	10.97	-	-	19,600	218,442.33	215,012.00	-
000982	中银绒业	2016-11-22	重大事项	9.15	-	-	23,200	136,631.30	212,280.00	-
002462	嘉事堂	2016-09-28	重大事项	42.53	2017-01-12	38.98	4,900	203,921.67	208,397.00	-
000563	陕国投 A	2016-10-14	重大事项	7.48	2017-01-18	6.73	27,708	170,740.76	207,255.84	-
600711	盛屯矿业	2016-12-19	重大事项	7.02	2017-01-11	7.38	29,500	268,853.62	207,090.00	-
603986	兆易创新	2016-09-19	重大事项	177.97	2017-03-13	195.77	1,133	26,353.58	201,640.01	-
600645	中源协和	2016-12-13	重大事项	26.80	-	-	7,101	347,101.11	190,306.80	-
002440	闰土股份	2016-10-24	重大事项	16.34	2017-01-12	15.22	11,200	234,449.08	183,008.00	-
002396	星网锐捷	2016-09-12	重大事项	19.70	2017-02-21	18.35	9,000	196,588.63	177,300.00	-

600171	上海贝岭	2016-12-14	重大事项	14.05	2017-02-16	14.90	12,500	252,867.03	175,625.00	-
600763	通策医疗	2016-12-19	重大事项	33.54	2017-01-03	34.80	5,100	220,564.66	171,054.00	-
000558	莱茵体育	2016-10-17	重大事项	14.75	-	-	11,500	222,387.79	169,625.00	-
600855	航天长峰	2016-11-08	重大事项	28.89	-	-	5,800	211,745.27	167,562.00	-
600807	天业股份	2016-11-21	重大事项	13.73	-	-	12,000	198,162.72	164,760.00	-
002025	航天电器	2016-09-12	重大事项	25.20	-	-	6,500	168,019.47	163,800.00	-
002156	通富微电	2016-12-28	重大事项	11.38	2017-01-05	11.65	13,200	156,952.93	150,216.00	-
603111	康尼机电	2016-12-26	重大事项	14.70	-	-	9,850	116,758.07	144,795.00	-
600331	宏达股份	2016-10-21	重大事项	6.36	2017-01-23	5.85	22,300	152,528.96	141,828.00	-
000676	智度股份	2016-11-17	重大事项	19.73	2017-01-24	18.25	6,900	121,994.59	136,137.00	-
600400	红豆股份	2016-12-29	重大事项	8.56	-	-	15,700	153,800.31	134,392.00	-
002151	北斗星通	2016-11-16	重大事项	31.90	2017-01-12	31.00	4,200	147,331.75	133,980.00	-
002239	奥特佳	2016-10-18	重大事项	15.69	2017-02-07	14.12	8,000	90,843.99	125,520.00	-
600859	王府井	2016-09-27	重大事项	16.28	-	-	7,506	155,119.41	122,197.68	-
600577	精达股份	2016-05-03	重大事项	4.18	2017-03-02	4.60	25,100	160,374.25	104,918.00	-
002681	奋达科技	2016-12-19	重大事项	12.93	-	-	8,000	154,051.15	103,440.00	-
601005	重庆钢铁	2016-06-02	重大事项	2.52	-	-	19,400	48,857.20	48,888.00	-

注：1、根据长城信息产业股份有限公司(以下简称“长城信息”)于2016年10月25日公布的《关于中国长城计算机深圳股份有限公司换股合并公司事宜的提示性公告》和中国长城计算机深圳股份有限公司(以下简称“长城电脑”)于2017年1月20日公布的《中国长城计算机深圳股份有限公司换股合并长城信息产业股份有限公司及重大资产置换和发行股份购买资产并募集配套资金暨关联交易报告书(修订稿)》，长城电脑将向长城信息全体股东发行A股股票，以换股比例1:0.5424取得长城信息股东持有的长城信息全部股票，吸收合并

长城信息；长城信息自 2016 年 11 月 1 日起连续停牌。换股合并后新增的长城电脑股票于 2017 年 1 月 18 日上市流通，当日开盘单价为 10.63 元。长城信息人民币普通股股票自 2017 年 1 月 18 日起终止上市并摘牌。

2、上述股票的复牌日期及复牌开盘单价更新截至本财务报表批准日。

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

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金一贯的风险管理政策是使基金投资风险可测、可控、可承担。本基金管理人建立了由风险管理委员会、督察长、法律部、合规部、稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的多层次风险管理架构体系。风险管理团队在识别、衡量投资风险后，通过正式报告的方式，将分析结果及时传达给基金经理、投资总监、投资决策委员会和风险管理委员会，协助制定风险控制决策，实现风险管理目标。

本基金管理人主要通过定性分析和定量分析的方法，估测各种金融工具风险可能产生的损失。本基金管理人从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重性；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的金融工具特征，通过特定的风险量化指标、模型和日常的量化报告，参考压力测试结果，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时对各种风险进行监督、检查和评估，并制定相应决策，将风险控制在预期可承受的范围内。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指由于基金所投资债券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息，债券发行人信用评级降低导致债券价格下降，或基金在交易过程中发生交收违约，而造成基金资产损失的可能性。

本基金管理人通过信用分析团队建立了内部评级体系和交易对手库，对发行人及债券投资进行内部评级，对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能出现的信用风险。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是在市场或持有资产流动性不足的情况下，基金管理人可能无法迅速、低成本地调整基金投资组合，从而对基金收益造成不利影响。

本基金所投资的证券在证券交易所或银行间市场交易，除在“7.4.12 期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制的情况外，其余均能及时变现。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指由于市场变化或波动所引起的资产损失的可能性，本基金管理人通过监测组合敏感性指标来衡量市场风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率变动引起组合中资产特别是债券投资的市场价格变动，从而影响基金投资收益的风险。

本基金为指数型基金，采用完全复制策略。本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。因此，利率风险不是本基金的主要风险。

7.4.13.4.2 外汇风险

本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险为除市场利率和外汇汇率以外的市场因素发生变动时产生的价格波动风险。本基金的其他价格风险主要为市场价格变化或波动所引起的股票资产损失的可能性。

本基金为指数型基金，采用完全复制策略。本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。本基金管理人通常用敏感性指标来衡量市场价格风险。

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 2016 年 12 月 31 日		上年度末 2015 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	302,125,249.67	91.78	482,582,597.22	90.65
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-

衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
合计	302,125,249.67	91.78	482,582,597.22	90.65

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1、估测组合市场价格风险的数据为 MSCI 中国 A 股指数变动时，各类持仓资产相应的理论变动值对基金资产净值的影响金额。		
	2、假定 MSCI 中国 A 股指数变化 5%，其他市场变量均不发生变化。		
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 （2016 年 12 月 31 日）	上年度末 （2015 年 12 月 31 日）
	+5%	16,008,535.50	25,260,979.92
	-5%	-16,008,535.50	-25,260,979.92

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

根据企业会计准则的相关规定，以公允价值计量的金融工具，其公允价值的计量可分为三个层次：

第一层次：对存在活跃市场报价的金融工具，可以相同资产/负债在活跃市场上的报价确定公允价值。

第二层次：对估值日活跃市场无报价的金融工具，可以类似资产/负债在活跃市场上的报价为依据做必要调整确定公允价值；对估值日不存在活跃市场的金融工具，可以相同或类似资产/负债在非活跃市场上的报价为依据做必要调整确定公允价值。

第三层次：对无法获得相同或类似资产可比市场交易价格的金融工具，可以其他反映市场参与者对资产/负债定价时所使用的参数为依据确定公允价值。

7.4.14.2 各层次金融工具公允价值

截至 2016 年 12 月 31 日止，本基金持有的以公允价值计量的金融工具第一层次的余额为 302,125,249.67 元，第二层次的余额为 0 元，第三层次的余额为 0 元。（截至 2015 年 12 月 31 日止：第一层次的余额为 482,770,494.02 元，第二层次的余额为 0 元，第三层次的余额为 0 元。）

7.4.14.3 公允价值所属层次间的重大变动

对于收盘价异常的债券，本基金将相关债券公允价值所属层次于其进行估值调整之日起从第一层次转入第二层次或第三层次，于债券收盘价能体现公允价值

并恢复市价估值之日起从第二层次或第三层次转入第一层次。对于持有的非公开发行股票，本基金于限售期内将相关股票公允价值所属层次列入第二层次，于限售期满并恢复市价估值之日起从第二层次转入第一层次。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)，本基金于 2015 年 3 月 20 日起改为采用中证指数有限公司根据《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》所独立提供的估值结果确定公允价值，并将其公允价值从第一层次调整至第二层次。

7.4.14.4 第三层次公允价值本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量的金融工具第三层次公允价值本期未发生变动。

§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	302,125,249.67	91.69
	其中：股票	302,125,249.67	91.69
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	5,700,000.00	1.73
	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	15,743,627.49	4.78
7	其他各项资产	5,942,896.53	1.80
8	合计	329,511,773.69	100.00

注：股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值。

8.2 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	2,101,250.20	0.64

B	采矿业	9,346,383.67	2.84
C	制造业	133,842,202.43	40.66
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,757,428.08	2.96
E	建筑业	11,272,035.86	3.42
F	批发和零售业	10,427,501.74	3.17
G	交通运输、仓储和邮政业	9,045,298.70	2.75
H	住宿和餐饮业	123,732.00	0.04
I	信息传输、软件和信息技术服务业	15,607,593.40	4.74
J	金融业	72,034,056.51	21.88
K	房地产业	17,187,668.91	5.22
L	租赁和商务服务业	3,619,311.80	1.10
M	科学研究和技术服务业	190,306.80	0.06
N	水利、环境和公共设施管理业	1,308,656.60	0.40
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	612,693.00	0.19
R	文化、体育和娱乐业	3,741,910.39	1.14
S	综合	1,907,219.58	0.58
	合计	302,125,249.67	91.78

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

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	229,238	8,121,902.34	2.47
2	600016	民生银行	625,237	5,677,151.96	1.72
3	600036	招商银行	300,152	5,282,675.20	1.60
4	601166	兴业银行	302,316	4,879,380.24	1.48
5	600000	浦发银行	285,929	4,634,909.09	1.41
6	600519	贵州茅台	11,475	3,834,371.25	1.16
7	000002	万科 A	180,075	3,700,541.25	1.12
8	000651	格力电器	145,864	3,591,171.68	1.09
9	600030	中信证券	195,080	3,132,984.80	0.95
10	601668	中国建筑	317,305	2,811,322.30	0.85
11	601169	北京银行	261,471	2,551,956.96	0.78
12	601328	交通银行	415,446	2,397,123.42	0.73
13	600837	海通证券	149,736	2,358,342.00	0.72
14	600887	伊利股份	128,216	2,256,601.60	0.69

15	000333	美的集团	76,797	2,163,371.49	0.66
16	601288	农业银行	622,300	1,929,130.00	0.59
17	601398	工商银行	427,800	1,886,598.00	0.57
18	601766	中国中车	189,830	1,854,639.10	0.56
19	601211	国泰君安	91,500	1,700,985.00	0.52
20	000001	平安银行	181,688	1,653,360.80	0.50
21	601601	中国太保	58,242	1,617,380.34	0.49
22	601989	中国重工	218,465	1,548,916.85	0.47
23	000725	京东方 A	538,750	1,540,825.00	0.47
24	600900	长江电力	116,389	1,473,484.74	0.45
25	601818	光大银行	368,400	1,440,444.00	0.44
26	600050	中国联通	196,167	1,433,980.77	0.44
27	000858	五 粮 液	40,229	1,387,095.92	0.42
28	600104	上汽集团	58,362	1,368,588.90	0.42
29	600048	保利地产	147,060	1,342,657.80	0.41
30	601988	中国银行	390,300	1,342,632.00	0.41
31	600518	康美药业	72,162	1,288,091.70	0.39
32	600276	恒瑞医药	27,864	1,267,812.00	0.39
33	600015	华夏银行	113,040	1,226,484.00	0.37
34	601688	华泰证券	64,800	1,157,328.00	0.35
35	002450	康得新	60,498	1,156,116.78	0.35
36	002415	海康威视	48,384	1,152,023.04	0.35
37	601186	中国铁建	91,900	1,099,124.00	0.33
38	600028	中国石化	202,200	1,093,902.00	0.33
39	601390	中国中铁	123,200	1,091,552.00	0.33
40	000166	申万宏源	158,941	993,381.25	0.30
41	002024	苏宁云商	86,100	985,845.00	0.30
42	601006	大秦铁路	137,603	974,229.24	0.30
43	000538	云南白药	12,677	965,353.55	0.29
44	601939	建设银行	177,447	965,311.68	0.29
45	601009	南京银行	88,350	957,714.00	0.29
46	000776	广发证券	54,700	922,242.00	0.28
47	001979	招商蛇口	52,274	856,770.86	0.26
48	000100	TCL 集团	238,700	787,710.00	0.24
49	000063	中兴通讯	49,339	786,957.05	0.24
50	600999	招商证券	45,990	751,016.70	0.23
51	600958	东方证券	48,000	745,440.00	0.23

52	601377	兴业证券	97,300	744,345.00	0.23
53	000625	长安汽车	49,752	743,294.88	0.23
54	601099	太平洋	144,260	742,939.00	0.23
55	600795	国电电力	233,900	741,463.00	0.23
56	601985	中国核电	102,800	725,768.00	0.22
57	002594	比亚迪	14,508	720,757.44	0.22
58	600690	青岛海尔	72,568	716,971.84	0.22
59	600585	海螺水泥	42,215	715,966.40	0.22
60	000423	东阿阿胶	13,034	702,141.58	0.21
61	002304	洋河股份	9,933	701,269.80	0.21
62	601899	紫金矿业	209,000	698,060.00	0.21
63	000503	海虹控股	16,462	692,227.10	0.21
64	601857	中国石油	85,600	680,520.00	0.21
65	600109	国金证券	51,800	674,954.00	0.21
66	000783	长江证券	65,734	672,458.82	0.20
67	600804	鹏博士	30,400	666,672.00	0.20
68	601901	方正证券	87,200	662,720.00	0.20
69	000413	东旭光电	58,800	662,088.00	0.20
70	002202	金风科技	38,387	656,801.57	0.20
71	600705	中航资本	106,736	653,224.32	0.20
72	600637	东方明珠	27,818	648,159.40	0.20
73	600703	三安光电	48,400	648,076.00	0.20
74	002230	科大讯飞	23,869	646,611.21	0.20
75	600649	城投控股	31,600	642,744.00	0.20
76	600660	福耀玻璃	34,400	640,872.00	0.19
77	600066	宇通客车	32,119	629,211.21	0.19
78	600547	山东黄金	17,165	626,694.15	0.19
79	600089	特变电工	68,491	625,322.83	0.19
80	000768	中航飞机	29,260	622,067.60	0.19
81	000839	中信国安	67,300	617,814.00	0.19
82	600309	万华化学	28,606	615,887.18	0.19
83	600383	金地集团	47,474	615,263.04	0.19
84	600068	葛洲坝	66,876	614,590.44	0.19
85	601600	中国铝业	145,586	614,372.92	0.19
86	600031	三一重工	100,559	613,409.90	0.19
87	002673	西部证券	29,424	611,136.48	0.19
88	002252	上海莱士	26,331	607,982.79	0.18

89	600009	上海机场	22,849	605,955.48	0.18
90	601336	新华保险	13,800	604,164.00	0.18
91	600010	包钢股份	215,290	600,659.10	0.18
92	002142	宁波银行	36,092	600,570.88	0.18
93	600886	国投电力	89,776	598,805.92	0.18
94	600100	同方股份	43,148	597,599.80	0.18
95	600535	天士力	14,383	596,750.67	0.18
96	600893	中航动力	18,072	591,677.28	0.18
97	600111	北方稀土	47,927	588,064.29	0.18
98	002241	歌尔股份	22,160	587,683.20	0.18
99	600406	国电南瑞	35,191	585,226.33	0.18
100	002456	欧菲光	16,904	579,469.12	0.18
101	601555	东吴证券	43,553	577,948.31	0.18
102	000066	长城电脑	45,200	562,288.00	0.17
103	601088	中国神华	34,752	562,287.36	0.17
104	600019	宝钢股份	87,400	554,990.00	0.17
105	600196	复星医药	23,621	546,589.94	0.17
106	600739	辽宁成大	30,361	545,283.56	0.17
107	600570	恒生电子	11,325	533,860.50	0.16
108	600369	西南证券	74,500	531,185.00	0.16
109	601628	中国人寿	22,000	529,980.00	0.16
110	601669	中国电建	72,700	527,802.00	0.16
111	600029	南方航空	74,200	520,884.00	0.16
112	600352	浙江龙盛	55,900	514,839.00	0.16
113	000623	吉林敖东	16,508	511,582.92	0.16
114	000630	铜陵有色	164,190	505,705.20	0.15
115	002736	国信证券	32,403	503,866.65	0.15
116	601618	中国中冶	107,342	500,213.72	0.15
117	601933	永辉超市	101,600	498,856.00	0.15
118	600489	中金黄金	41,048	496,270.32	0.15
119	601788	光大证券	30,900	494,091.00	0.15
120	002466	天齐锂业	15,180	492,591.00	0.15
121	600271	航天信息	24,400	486,780.00	0.15
122	000568	泸州老窖	14,726	485,958.00	0.15
123	002065	东华软件	20,733	483,078.90	0.15
124	000793	华闻传媒	42,591	480,852.39	0.15
125	600221	海南航空	147,000	479,220.00	0.15

126	002008	大族激光	21,041	475,526.60	0.14
127	002236	大华股份	34,550	472,644.00	0.14
128	600177	雅戈尔	33,700	471,126.00	0.14
129	600340	华夏幸福	19,552	467,292.80	0.14
130	600741	华域汽车	29,188	465,548.60	0.14
131	000009	中国宝安	44,643	462,501.48	0.14
132	601727	上海电气	54,900	462,258.00	0.14
133	002465	海格通信	39,648	461,899.20	0.14
134	000540	中天城投	66,650	461,884.50	0.14
135	600867	通化东宝	20,950	459,433.50	0.14
136	000338	潍柴动力	46,100	459,156.00	0.14
137	600115	东方航空	64,876	458,673.32	0.14
138	600085	同仁堂	14,537	456,171.06	0.14
139	600820	隧道股份	41,400	455,814.00	0.14
140	000895	双汇发展	21,750	455,227.50	0.14
141	000157	中联重科	99,600	452,184.00	0.14
142	000069	华侨城 A	65,050	452,097.50	0.14
143	600522	中天科技	42,538	447,925.14	0.14
144	000402	金 融 街	43,400	447,020.00	0.14
145	000887	中鼎股份	17,170	445,389.80	0.14
146	600118	中国卫星	14,127	441,327.48	0.13
147	002007	华兰生物	12,267	438,545.25	0.13
148	600079	人福医药	21,976	438,421.20	0.13
149	600153	建发股份	40,835	436,934.50	0.13
150	600415	小商品城	50,400	435,960.00	0.13
151	000750	国海证券	61,400	427,958.00	0.13
152	600487	亨通光电	22,900	427,314.00	0.13
153	600122	宏图高科	34,800	425,256.00	0.13
154	002310	东方园林	30,050	425,207.50	0.13
155	000686	东北证券	33,875	418,695.00	0.13
156	002739	万达院线	7,700	416,339.00	0.13
157	000728	国元证券	20,700	411,930.00	0.13
158	002475	立讯精密	19,705	408,878.75	0.12
159	600219	南山铝业	131,150	405,253.50	0.12
160	600674	川投能源	46,564	405,106.80	0.12
161	600751	天海投资	48,400	404,624.00	0.12
162	000917	电广传媒	28,070	403,927.30	0.12

163	600150	中国船舶	14,546	401,615.06	0.12
164	601607	上海医药	20,366	398,358.96	0.12
165	000415	渤海金控	55,200	394,680.00	0.12
166	002183	怡 亚 通	36,100	392,046.00	0.12
167	601888	中国国旅	9,018	391,381.20	0.12
168	600023	浙能电力	72,000	390,960.00	0.12
169	600011	华能国际	55,300	389,865.00	0.12
170	600718	东软集团	19,755	388,383.30	0.12
171	601012	隆基股份	29,000	388,310.00	0.12
172	600816	安信信托	16,310	385,242.20	0.12
173	002405	四维图新	19,700	381,195.00	0.12
174	002085	万丰奥威	19,220	379,787.20	0.12
175	601333	广深铁路	74,700	378,729.00	0.12
176	000661	长春高新	3,360	375,816.00	0.11
177	000709	河钢股份	112,223	374,824.82	0.11
178	601229	上海银行	16,100	374,808.00	0.11
179	600027	华电国际	75,200	372,240.00	0.11
180	600158	中体产业	15,777	371,863.89	0.11
181	000656	金科股份	70,800	370,992.00	0.11
182	600682	南京新百	9,900	368,973.00	0.11
183	000826	启迪桑德	11,150	367,727.00	0.11
184	600201	生物股份	11,602	366,507.18	0.11
185	600584	长电科技	20,628	364,084.20	0.11
186	000748	长城信息	17,912	363,792.72	0.11
187	000963	华东医药	5,047	363,737.29	0.11
188	600588	用友网络	17,319	360,581.58	0.11
189	000559	万向钱潮	27,180	360,406.80	0.11
190	000060	中金岭南	32,284	359,966.60	0.11
191	002572	索菲亚	6,600	357,456.00	0.11
192	600839	四川长虹	85,400	356,972.00	0.11
193	601018	宁波港	70,313	355,783.78	0.11
194	600256	广汇能源	75,978	354,817.26	0.11
195	000547	航天发展	23,100	354,816.00	0.11
196	600482	中国动力	11,600	354,264.00	0.11
197	000998	隆平高科	16,500	353,595.00	0.11
198	600166	福田汽车	114,400	353,496.00	0.11
199	600643	爱建集团	28,463	353,225.83	0.11

200	002340	格林美	53,822	352,534.10	0.11
201	600977	中国电影	15,200	350,968.00	0.11
202	600583	海油工程	46,718	344,778.84	0.10
203	601198	东兴证券	17,100	343,026.00	0.10
204	002129	中环股份	41,300	341,551.00	0.10
205	002407	多氟多	12,500	341,125.00	0.10
206	600797	浙大网新	18,900	340,200.00	0.10
207	600485	信威集团	23,100	337,260.00	0.10
208	600978	宜华生活	31,400	334,410.00	0.10
209	000977	浪潮信息	15,700	332,840.00	0.10
210	000012	南 玻 A	29,300	332,262.00	0.10
211	000425	徐工机械	97,900	330,902.00	0.10
212	600208	新潮中宝	79,200	329,472.00	0.10
213	601800	中国交建	21,600	328,104.00	0.10
214	601106	中国一重	60,299	326,217.59	0.10
215	002074	国轩高科	10,500	325,395.00	0.10
216	600895	张江高科	18,300	324,276.00	0.10
217	002508	老板电器	8,700	320,160.00	0.10
218	601168	西部矿业	40,869	320,004.27	0.10
219	002400	省广股份	23,196	319,872.84	0.10
220	600497	驰宏锌锗	45,500	319,865.00	0.10
221	002426	胜利精密	38,600	319,222.00	0.10
222	600005	武钢股份	92,968	317,020.88	0.10
223	601919	中远海控	60,500	317,020.00	0.10
224	600642	申能股份	53,970	316,803.90	0.10
225	600297	广汇汽车	37,000	316,720.00	0.10
226	600252	中恒集团	68,900	315,562.00	0.10
227	002460	赣锋锂业	11,900	315,469.00	0.10
228	600498	烽火通信	12,500	315,125.00	0.10
229	002500	山西证券	26,100	313,722.00	0.10
230	000997	新 大 陆	16,120	313,211.60	0.10
231	600879	航天电子	20,549	313,166.76	0.10
232	600170	上海建工	65,948	311,934.04	0.09
233	000876	新 希 望	38,600	310,730.00	0.09
234	600315	上海家化	11,460	310,680.60	0.09
235	600332	白云山	12,937	310,229.26	0.09
236	600110	诺德股份	29,100	310,206.00	0.09

237	002385	大北农	43,377	307,976.70	0.09
238	600061	国投安信	19,600	305,956.00	0.09
239	600446	金证股份	12,081	303,595.53	0.09
240	600737	中粮屯河	24,300	302,778.00	0.09
241	600138	中青旅	14,438	302,764.86	0.09
242	600266	北京城建	22,700	302,591.00	0.09
243	600868	梅雁吉祥	50,100	302,103.00	0.09
244	600663	陆家嘴	13,640	301,853.20	0.09
245	600654	中安消	17,300	301,539.00	0.09
246	002081	金螳螂	30,755	301,091.45	0.09
247	000697	炼石有色	12,800	300,928.00	0.09
248	600074	保千里	22,400	296,576.00	0.09
249	002044	美年健康	22,500	296,550.00	0.09
250	601258	庞大集团	107,000	296,390.00	0.09
251	600673	东阳光科	40,580	295,828.20	0.09
252	600060	海信电器	17,200	294,464.00	0.09
253	600919	江苏银行	30,500	293,715.00	0.09
254	000039	中集集团	20,071	293,438.02	0.09
255	000690	宝新能源	31,600	292,932.00	0.09
256	600759	洲际油气	29,780	292,439.60	0.09
257	002030	达安基因	12,471	289,327.20	0.09
258	600143	金发科技	37,100	288,638.00	0.09
259	601998	中信银行	44,900	287,809.00	0.09
260	600875	东方电气	26,300	283,777.00	0.09
261	600426	华鲁恒升	21,380	283,285.00	0.09
262	000983	西山煤电	33,475	283,198.50	0.09
263	600376	首开股份	23,900	282,259.00	0.09
264	600018	上港集团	55,100	282,112.00	0.09
265	601718	际华集团	30,600	281,826.00	0.09
266	002092	中泰化学	23,194	280,647.40	0.09
267	000050	深天马 A	14,900	280,418.00	0.09
268	600037	歌华有线	18,300	280,356.00	0.09
269	600401	海润光伏	120,700	280,024.00	0.09
270	600200	江苏吴中	14,500	279,995.00	0.09
271	601801	皖新传媒	15,900	279,363.00	0.08
272	002176	江特电机	23,300	277,969.00	0.08
273	600525	长园集团	19,880	277,326.00	0.08

274	600827	百联股份	19,208	275,826.88	0.08
275	002422	科伦药业	17,044	274,749.28	0.08
276	002292	奥飞娱乐	12,100	274,670.00	0.08
277	000712	锦龙股份	11,710	274,482.40	0.08
278	600635	大众公用	45,645	274,326.45	0.08
279	000930	中粮生化	20,400	274,176.00	0.08
280	000581	威孚高科	12,186	273,453.84	0.08
281	000778	新兴铸管	52,844	273,203.48	0.08
282	600362	江西铜业	16,264	272,096.72	0.08
283	002491	通鼎互联	17,500	271,950.00	0.08
284	000516	国际医学	34,400	271,760.00	0.08
285	600521	华海药业	12,281	270,550.43	0.08
286	002146	荣盛发展	34,442	270,369.70	0.08
287	002075	沙钢股份	16,700	269,204.00	0.08
288	002701	奥瑞金	31,004	267,874.56	0.08
289	002038	双鹭药业	9,977	266,485.67	0.08
290	000400	许继电气	14,592	264,844.80	0.08
291	600528	中铁二局	19,201	264,205.76	0.08
292	601117	中国化学	38,900	263,353.00	0.08
293	600157	永泰能源	65,580	262,975.80	0.08
294	600503	华丽家族	31,700	262,793.00	0.08
295	000961	中南建设	25,250	262,600.00	0.08
296	002470	金正大	33,200	262,280.00	0.08
297	600567	山鹰纸业	72,400	262,088.00	0.08
298	600038	中直股份	5,400	261,468.00	0.08
299	600436	片仔癀	5,697	260,865.63	0.08
300	600388	龙净环保	21,050	260,388.50	0.08
301	002439	启明星辰	12,500	259,875.00	0.08
302	002179	中航光电	7,160	259,836.40	0.08
303	000738	中航动控	10,500	259,770.00	0.08
304	601216	君正集团	55,794	259,442.10	0.08
305	600594	益佰制药	15,574	259,307.10	0.08
306	600418	江淮汽车	22,429	259,279.24	0.08
307	600655	豫园商城	22,700	259,234.00	0.08
308	002131	利欧股份	16,200	258,390.00	0.08
309	002602	世纪华通	5,500	257,895.00	0.08
310	002353	杰瑞股份	12,700	257,810.00	0.08

311	600435	北方导航	19,700	256,888.00	0.08
312	603799	华友钴业	7,300	256,741.00	0.08
313	601866	中远海发	62,900	256,632.00	0.08
314	600500	中化国际	21,900	255,354.00	0.08
315	603993	洛阳钼业	68,600	255,192.00	0.08
316	000059	华锦股份	21,400	254,660.00	0.08
317	000046	泛海控股	27,350	254,081.50	0.08
318	600664	哈药股份	29,609	254,045.22	0.08
319	002271	东方雨虹	11,648	252,645.12	0.08
320	600021	上海电力	20,800	252,512.00	0.08
321	002366	台海核电	4,700	252,014.00	0.08
322	600312	平高电气	16,078	251,138.36	0.08
323	002004	华邦健康	27,667	250,939.69	0.08
324	600872	中炬高新	17,800	250,624.00	0.08
325	000806	银河生物	15,800	250,272.00	0.08
326	000598	兴蓉环境	43,300	249,408.00	0.08
327	002311	海大集团	16,520	248,626.00	0.08
328	600688	上海石化	38,500	247,940.00	0.08
329	000566	海南海药	19,400	246,574.00	0.07
330	002573	清新环境	14,100	246,327.00	0.07
331	601992	金隅股份	55,202	246,200.92	0.07
332	601997	贵阳银行	15,600	246,168.00	0.07
333	000970	中科三环	18,300	244,305.00	0.07
334	002018	华信国际	23,980	243,876.60	0.07
335	002294	信立泰	8,326	243,452.24	0.07
336	000878	云南铜业	20,605	243,345.05	0.07
337	600172	黄河旋风	13,600	243,168.00	0.07
338	000078	海王生物	38,550	242,865.00	0.07
339	601872	招商轮船	49,045	242,282.30	0.07
340	600811	东方集团	33,800	241,670.00	0.07
341	600699	均胜电子	7,300	241,557.00	0.07
342	600601	方正科技	52,200	240,120.00	0.07
343	601155	新城控股	20,400	239,700.00	0.07
344	000718	苏宁环球	27,770	239,655.10	0.07
345	002509	天广中茂	18,900	239,652.00	0.07
346	000988	华工科技	15,300	239,445.00	0.07
347	600777	新潮能源	59,660	239,236.60	0.07

348	601611	中国核建	13,900	238,941.00	0.07
349	000671	阳光城	42,865	238,758.05	0.07
350	002219	恒康医疗	19,880	238,162.40	0.07
351	002049	紫光国芯	7,206	237,365.64	0.07
352	600568	中珠医疗	9,400	235,000.00	0.07
353	600996	贵广网络	12,500	234,875.00	0.07
354	601098	中南传媒	14,096	234,839.36	0.07
355	600687	刚泰控股	14,300	234,806.00	0.07
356	600666	奥瑞德	8,700	234,465.00	0.07
357	600704	物产中大	22,680	234,284.40	0.07
358	000792	盐湖股份	12,239	233,397.73	0.07
359	600755	厦门国贸	28,400	232,880.00	0.07
360	002501	利源精制	18,900	231,903.00	0.07
361	600516	方大炭素	25,000	231,500.00	0.07
362	000959	首钢股份	34,900	231,038.00	0.07
363	600856	中天能源	16,700	230,460.00	0.07
364	002013	中航机电	12,585	230,179.65	0.07
365	600565	迪马股份	31,000	230,020.00	0.07
366	000939	凯迪生态	17,825	229,407.75	0.07
367	600598	北大荒	18,800	229,360.00	0.07
368	000979	中弘股份	86,850	229,284.00	0.07
369	000829	天音控股	20,300	228,984.00	0.07
370	600959	江苏有线	20,210	228,373.00	0.07
371	000758	中色股份	28,500	227,715.00	0.07
372	000960	锡业股份	17,355	227,697.60	0.07
373	601179	中国西电	40,700	227,106.00	0.07
374	002191	劲嘉股份	21,812	227,062.92	0.07
375	600240	华业资本	21,091	226,517.34	0.07
376	600307	酒钢宏兴	82,600	225,498.00	0.07
377	600881	亚泰集团	41,200	225,364.00	0.07
378	002051	中工国际	9,820	225,074.40	0.07
379	002001	新和成	11,373	222,910.80	0.07
380	601699	潞安环能	27,660	222,663.00	0.07
381	600633	浙报传媒	12,600	222,516.00	0.07
382	600410	华胜天成	20,460	222,400.20	0.07
383	002411	必康股份	8,200	221,810.00	0.07
384	600549	厦门钨业	10,073	221,807.46	0.07

385	600478	科力远	22,130	221,300.00	0.07
386	600108	亚盛集团	38,600	220,792.00	0.07
387	600694	大商股份	5,527	220,693.11	0.07
388	002299	圣农发展	10,400	220,688.00	0.07
389	600373	中文传媒	10,900	220,180.00	0.07
390	002108	沧州明珠	10,800	219,996.00	0.07
391	600967	北方创业	16,200	219,834.00	0.07
392	002389	南洋科技	9,500	219,260.00	0.07
393	000006	深振业 A	23,174	218,994.30	0.07
394	002138	顺络电子	12,600	218,106.00	0.07
395	600572	康恩贝	29,750	217,472.50	0.07
396	600161	天坛生物	5,500	216,700.00	0.07
397	002223	鱼跃医疗	6,975	216,364.50	0.07
398	601118	海南橡胶	31,000	215,760.00	0.07
399	000627	天茂集团	28,200	215,730.00	0.07
400	600325	华发股份	16,800	215,040.00	0.07
401	600151	航天机电	19,600	215,012.00	0.07
402	000488	晨鸣纸业	20,706	214,514.16	0.07
403	603019	中科曙光	7,700	214,214.00	0.07
404	002583	海能达	16,200	214,002.00	0.07
405	600372	中航电子	11,500	213,440.00	0.06
406	600056	中国医药	11,200	213,136.00	0.06
407	000031	中粮地产	23,889	213,089.88	0.06
408	000982	中银绒业	23,200	212,280.00	0.06
409	000786	北新建材	20,604	212,015.16	0.06
410	600575	皖江物流	36,800	211,600.00	0.06
411	600511	国药股份	7,028	211,542.80	0.06
412	600120	浙江东方	7,300	211,116.00	0.06
413	600499	科达洁能	27,908	210,984.48	0.06
414	601111	中国国航	29,300	210,960.00	0.06
415	600343	航天动力	10,029	210,809.58	0.06
416	600787	中储股份	23,200	210,424.00	0.06
417	601877	正泰电器	10,520	210,400.00	0.06
418	000800	一汽轿车	19,346	210,291.02	0.06
419	002266	浙富控股	36,480	210,124.80	0.06
420	600008	首创股份	51,100	210,021.00	0.06
421	002273	水晶光电	10,550	209,945.00	0.06

422	002050	三花智控	18,966	209,384.64	0.06
423	002424	贵州百灵	11,036	209,021.84	0.06
424	603589	口子窖	6,500	208,845.00	0.06
425	002462	嘉事堂	4,900	208,397.00	0.06
426	600884	杉杉股份	14,800	208,384.00	0.06
427	002221	东华能源	16,800	208,152.00	0.06
428	600183	生益科技	18,900	207,900.00	0.06
429	600039	四川路桥	43,846	207,830.04	0.06
430	603766	隆鑫通用	10,000	207,800.00	0.06
431	000563	陕国投 A	27,708	207,255.84	0.06
432	000825	太钢不锈	52,600	207,244.00	0.06
433	600711	盛屯矿业	29,500	207,090.00	0.06
434	002665	首航节能	23,520	206,035.20	0.06
435	002276	万马股份	13,700	205,911.00	0.06
436	002603	以岭药业	11,900	205,156.00	0.06
437	600409	三友化工	21,800	204,702.00	0.06
438	600391	成发科技	5,800	204,450.00	0.06
439	600064	南京高科	12,200	204,350.00	0.06
440	002281	光迅科技	2,600	204,100.00	0.06
441	600098	广州发展	17,981	201,746.82	0.06
442	603986	兆易创新	1,133	201,640.01	0.06
443	600198	大唐电信	12,703	201,596.61	0.06
444	002152	广电运通	15,100	200,528.00	0.06
445	002640	跨境通	10,900	199,470.00	0.06
446	002195	二三四五	17,600	199,232.00	0.06
447	000543	皖能电力	26,000	197,860.00	0.06
448	600026	中远海能	29,000	197,490.00	0.06
449	600490	鹏欣资源	25,300	197,340.00	0.06
450	000883	湖北能源	43,000	196,940.00	0.06
451	002250	联化科技	12,138	196,392.84	0.06
452	600715	文投控股	8,900	196,245.00	0.06
453	002489	浙江永强	25,900	196,063.00	0.06
454	600770	综艺股份	18,910	195,718.50	0.06
455	000089	深圳机场	24,400	195,200.00	0.06
456	000875	吉电股份	29,700	195,129.00	0.06
457	000938	紫光股份	3,400	195,126.00	0.06
458	002410	广联达	13,359	195,041.40	0.06

459	600125	铁龙物流	24,132	194,986.56	0.06
460	000028	国药一致	2,908	194,545.20	0.06
461	601633	长城汽车	17,492	193,461.52	0.06
462	002714	牧原股份	8,300	193,224.00	0.06
463	002477	雏鹰农牧	38,200	191,764.00	0.06
464	600998	九州通	9,200	190,808.00	0.06
465	600614	鼎立股份	16,300	190,710.00	0.06
466	600298	安琪酵母	10,700	190,674.00	0.06
467	000999	华润三九	7,700	190,421.00	0.06
468	600645	中源协和	7,101	190,306.80	0.06
469	000410	沈阳机床	14,200	189,712.00	0.06
470	000592	平潭发展	28,000	189,280.00	0.06
471	600863	内蒙华电	61,400	189,112.00	0.06
472	600611	大众交通	28,777	189,064.89	0.06
473	002185	华天科技	15,632	188,834.56	0.06
474	600851	海欣股份	14,600	188,778.00	0.06
475	002022	科华生物	9,438	188,760.00	0.06
476	002544	杰赛科技	6,700	188,538.00	0.06
477	600176	中国巨石	19,160	188,534.40	0.06
478	000937	冀中能源	27,929	188,241.46	0.06
479	600600	青岛啤酒	6,386	188,003.84	0.06
480	600380	健康元	18,900	187,677.00	0.06
481	000901	航天科技	5,700	187,302.00	0.06
482	002354	天神娱乐	2,700	186,732.00	0.06
483	600320	振华重工	36,565	186,481.50	0.06
484	600316	洪都航空	9,425	185,295.50	0.06
485	600094	大名城	20,800	185,120.00	0.06
486	600267	海正药业	14,062	184,915.30	0.06
487	600634	中技控股	10,400	184,496.00	0.06
488	002390	信邦制药	18,550	183,459.50	0.06
489	002440	闰土股份	11,200	183,008.00	0.06
490	000601	韶能股份	21,300	182,967.00	0.06
491	000519	江南红箭	12,273	182,867.70	0.06
492	002122	天马股份	14,400	182,736.00	0.06
493	600067	冠城大通	25,500	182,580.00	0.06
494	000935	四川双马	6,100	182,573.00	0.06
495	002019	亿帆医药	11,900	181,951.00	0.06

496	000729	燕京啤酒	26,106	181,436.70	0.06
497	000882	华联股份	39,600	180,972.00	0.05
498	600160	巨化股份	17,100	180,918.00	0.05
499	000766	通化金马	10,300	180,868.00	0.05
500	002555	三七互娱	11,000	180,400.00	0.05
501	002155	湖南黄金	15,729	180,097.05	0.05
502	000027	深圳能源	26,192	179,939.04	0.05
503	000902	新洋丰	15,900	179,034.00	0.05
504	000513	丽珠集团	3,006	178,857.00	0.05
505	600808	马钢股份	63,165	178,756.95	0.05
506	000816	智慧农业	28,100	178,716.00	0.05
507	002023	海特高新	12,900	178,536.00	0.05
508	002078	太阳纸业	26,700	178,356.00	0.05
509	002308	威创股份	12,100	178,354.00	0.05
510	002622	融钰集团	12,200	177,876.00	0.05
511	603000	人民网	10,072	177,871.52	0.05
512	600491	龙元建设	15,400	177,716.00	0.05
513	600717	天津港	17,600	177,408.00	0.05
514	002396	星网锐捷	9,000	177,300.00	0.05
515	600277	亿利洁能	24,900	177,039.00	0.05
516	002595	豪迈科技	8,400	176,820.00	0.05
517	002384	东山精密	9,000	176,490.00	0.05
518	600652	游久游戏	13,700	176,045.00	0.05
519	601928	凤凰传媒	16,800	175,896.00	0.05
520	600171	上海贝岭	12,500	175,625.00	0.05
521	600366	宁波韵升	8,900	175,241.00	0.05
522	600255	鑫科材料	36,200	175,208.00	0.05
523	002070	众和股份	12,600	174,888.00	0.05
524	002444	巨星科技	11,200	174,720.00	0.05
525	000667	美好置业	47,300	174,537.00	0.05
526	002643	万润股份	4,800	174,240.00	0.05
527	600086	东方金钰	16,000	174,080.00	0.05
528	002280	联络互动	12,400	173,228.00	0.05
529	600146	商赢环球	5,100	172,635.00	0.05
530	600216	浙江医药	13,600	172,448.00	0.05
531	000687	华讯方舟	11,200	172,032.00	0.05
532	002375	亚厦股份	16,257	171,999.06	0.05

533	002217	合力泰	9,600	171,840.00	0.05
534	601929	吉视传媒	41,000	171,790.00	0.05
535	600728	佳都科技	20,220	171,263.40	0.05
536	601880	大连港	61,130	171,164.00	0.05
537	600763	通策医疗	5,100	171,054.00	0.05
538	600348	阳泉煤业	25,300	170,269.00	0.05
539	001696	宗申动力	18,100	170,140.00	0.05
540	000777	中核科技	7,600	170,088.00	0.05
541	600562	国睿科技	5,585	169,895.70	0.05
542	000558	莱茵体育	11,500	169,625.00	0.05
543	000008	神州高铁	18,200	169,624.00	0.05
544	600597	光明乳业	12,960	169,257.60	0.05
545	002522	浙江众成	9,400	169,106.00	0.05
546	002153	石基信息	6,937	169,054.69	0.05
547	000751	锌业股份	29,700	168,993.00	0.05
548	002073	软控股份	14,887	168,967.45	0.05
549	600422	昆药集团	12,500	168,875.00	0.05
550	600662	强生控股	15,217	168,756.53	0.05
551	002589	瑞康医药	5,200	168,740.00	0.05
552	601898	中煤能源	29,000	168,490.00	0.05
553	002657	中科金财	3,900	168,324.00	0.05
554	600587	新华医疗	6,693	168,061.23	0.05
555	002437	誉衡药业	20,300	167,881.00	0.05
556	601608	中信重工	29,900	167,739.00	0.05
557	002127	南极电商	14,600	167,608.00	0.05
558	600855	航天长峰	5,800	167,562.00	0.05
559	600284	浦东建设	12,700	167,513.00	0.05
560	601966	玲珑轮胎	6,200	166,718.00	0.05
561	600557	康缘药业	9,836	166,523.48	0.05
562	000650	仁和药业	23,600	166,380.00	0.05
563	600282	南钢股份	53,600	166,160.00	0.05
564	000061	农产品	13,400	165,758.00	0.05
565	002002	鸿达兴业	22,571	165,671.14	0.05
566	600765	中航重机	11,561	165,669.13	0.05
567	000860	顺鑫农业	7,530	165,660.00	0.05
568	002358	森源电气	8,600	164,948.00	0.05
569	600807	天业股份	12,000	164,760.00	0.05

570	600880	博瑞传播	18,789	164,591.64	0.05
571	600651	飞乐音响	15,600	164,268.00	0.05
572	000021	深科技	17,400	164,082.00	0.05
573	002570	贝因美	12,500	164,000.00	0.05
574	002025	航天电器	6,500	163,800.00	0.05
575	002268	卫 士 通	5,200	163,384.00	0.05
576	000848	承德露露	14,589	163,250.91	0.05
577	601519	大智慧	21,500	162,970.00	0.05
578	000898	鞍钢股份	32,335	162,968.40	0.05
579	002343	慈文传媒	3,600	162,612.00	0.05
580	000666	经纬纺机	7,600	162,412.00	0.05
581	600495	晋西车轴	22,360	162,333.60	0.05
582	600210	紫江企业	30,000	162,300.00	0.05
583	601958	金钼股份	21,194	162,134.10	0.05
584	002028	思源电气	12,300	162,114.00	0.05
585	600416	湘电股份	11,000	161,810.00	0.05
586	600517	置信电气	16,600	161,518.00	0.05
587	600685	中船防务	5,432	161,330.40	0.05
588	002672	东江环保	9,100	160,160.00	0.05
589	002047	宝鹰股份	17,000	158,950.00	0.05
590	600536	中国软件	6,593	158,627.58	0.05
591	002099	海翔药业	18,700	158,576.00	0.05
592	002479	富春环保	10,700	158,574.00	0.05
593	002161	远 望 谷	13,700	157,961.00	0.05
594	002610	爱康科技	48,300	157,941.00	0.05
595	000616	海航投资	30,200	157,644.00	0.05
596	002089	新 海 宜	11,100	157,509.00	0.05
597	601717	郑煤机	22,400	157,472.00	0.05
598	600053	九鼎投资	3,400	156,604.00	0.05
599	600885	宏发股份	4,900	156,555.00	0.05
600	002055	得润电子	6,600	156,486.00	0.05
601	601021	春秋航空	4,256	156,365.44	0.05
602	000807	云铝股份	23,300	156,110.00	0.05
603	600073	上海梅林	13,600	155,720.00	0.05
604	600269	赣粤高速	30,900	155,427.00	0.05
605	600169	太原重工	38,461	154,997.83	0.05
606	002104	恒宝股份	13,138	154,897.02	0.05

607	002041	登海种业	8,185	154,532.80	0.05
608	002123	梦网荣信	10,300	154,500.00	0.05
609	002431	棕榈股份	16,850	154,346.00	0.05
610	002434	万里扬	9,600	153,600.00	0.05
611	000401	冀东水泥	12,900	153,510.00	0.05
612	002429	兆驰股份	15,412	153,503.52	0.05
613	002326	永太科技	9,400	153,314.00	0.05
614	000975	银泰资源	9,800	153,272.00	0.05
615	002368	太极股份	4,997	152,958.17	0.05
616	600399	抚顺特钢	22,250	152,857.50	0.05
617	600017	日照港	37,700	152,685.00	0.05
618	600261	阳光照明	21,100	152,342.00	0.05
619	600004	白云机场	10,800	152,172.00	0.05
620	002325	洪涛股份	18,980	152,029.80	0.05
621	600058	五矿发展	9,980	151,995.40	0.05
622	600392	盛和资源	11,400	151,962.00	0.05
623	002512	达华智能	9,300	151,869.00	0.05
624	603188	亚邦股份	8,500	151,810.00	0.05
625	000620	新华联	17,900	151,792.00	0.05
626	600458	时代新材	10,713	151,588.95	0.05
627	000685	中山公用	13,600	151,368.00	0.05
628	603678	火炬电子	2,000	151,300.00	0.05
629	002399	海普瑞	8,302	151,262.44	0.05
630	002130	沃尔核材	10,700	151,084.00	0.05
631	601222	林洋能源	18,700	150,909.00	0.05
632	600273	嘉化能源	15,700	150,877.00	0.05
633	601588	北辰实业	36,100	150,537.00	0.05
634	600481	双良节能	20,000	150,400.00	0.05
635	601311	骆驼股份	9,200	150,236.00	0.05
636	002156	通富微电	13,200	150,216.00	0.05
637	002563	森马服饰	14,600	149,942.00	0.05
638	600745	中茵股份	7,000	149,800.00	0.05
639	601000	唐山港	37,300	149,573.00	0.05
640	002063	远光软件	11,328	148,849.92	0.05
641	002285	世联行	19,560	148,656.00	0.05
642	002005	德豪润达	25,837	148,562.75	0.05
643	600433	冠豪高新	18,516	148,498.32	0.05

644	601890	亚星锚链	16,800	147,672.00	0.04
645	600970	中材国际	20,800	147,472.00	0.04
646	000587	金洲慈航	9,900	147,312.00	0.04
647	002312	三泰控股	16,825	147,218.75	0.04
648	002303	美盈森	14,300	147,004.00	0.04
649	002474	榕基软件	10,830	146,854.80	0.04
650	000732	泰禾集团	8,300	146,827.00	0.04
651	600062	华润双鹤	6,600	146,718.00	0.04
652	002064	华峰氨纶	26,700	146,583.00	0.04
653	600809	山西汾酒	5,853	146,442.06	0.04
654	600835	上海机电	7,500	146,400.00	0.04
655	002428	云南锗业	11,500	145,705.00	0.04
656	600736	苏州高新	16,100	145,383.00	0.04
657	002244	滨江集团	20,800	145,184.00	0.04
658	600006	东风汽车	21,100	145,168.00	0.04
659	000150	宜华健康	4,700	145,089.00	0.04
660	600057	象屿股份	12,600	144,900.00	0.04
661	603111	康尼机电	9,850	144,795.00	0.04
662	601011	宝泰隆	20,300	144,739.00	0.04
663	600259	广晟有色	3,404	144,635.96	0.04
664	002067	景兴纸业	21,600	144,288.00	0.04
665	002261	拓维信息	12,100	144,232.00	0.04
666	600206	有研新材	14,500	144,130.00	0.04
667	002445	中南文化	9,600	144,096.00	0.04
668	600072	钢构工程	8,300	143,922.00	0.04
669	002190	成飞集成	4,500	143,910.00	0.04
670	002117	东港股份	4,800	143,760.00	0.04
671	601233	桐昆股份	10,000	143,600.00	0.04
672	600175	美都能源	29,000	143,550.00	0.04
673	002210	飞马国际	7,780	143,541.00	0.04
674	002373	千方科技	10,400	143,520.00	0.04
675	000801	四川九洲	13,500	143,505.00	0.04
676	600580	卧龙电气	15,669	142,587.90	0.04
677	000969	安泰科技	13,500	142,290.00	0.04
678	600331	宏达股份	22,300	141,828.00	0.04
679	002601	佰利联	11,200	141,792.00	0.04
680	000528	柳 工	19,300	141,083.00	0.04

681	002421	达实智能	21,300	140,154.00	0.04
682	600571	信雅达	7,300	140,014.00	0.04
683	000541	佛山照明	14,220	139,924.80	0.04
684	601666	平煤股份	28,700	139,769.00	0.04
685	000652	泰达股份	25,235	139,297.20	0.04
686	002056	横店东磁	10,000	139,100.00	0.04
687	002481	双塔食品	15,300	138,771.00	0.04
688	002550	千红制药	19,200	138,624.00	0.04
689	600289	亿阳信通	10,700	138,565.00	0.04
690	002707	众信旅游	8,900	138,395.00	0.04
691	600270	外运发展	8,366	138,373.64	0.04
692	600862	中航高科	11,300	138,312.00	0.04
693	603077	和邦生物	27,000	138,240.00	0.04
694	002418	康盛股份	13,500	138,105.00	0.04
695	600291	西水股份	7,200	138,096.00	0.04
696	000156	华数传媒	7,700	137,907.00	0.04
697	002284	亚太股份	9,800	137,886.00	0.04
698	600428	中远海特	22,500	137,700.00	0.04
699	002283	天润曲轴	17,700	137,529.00	0.04
700	002413	雷科防务	11,860	137,338.80	0.04
701	002269	美邦服饰	27,400	137,274.00	0.04
702	000016	深康佳 A	30,400	137,104.00	0.04
703	600123	兰花科创	17,000	136,680.00	0.04
704	600826	兰生股份	5,000	136,600.00	0.04
705	002498	汉缆股份	31,700	136,310.00	0.04
706	000676	智度股份	6,900	136,137.00	0.04
707	600220	江苏阳光	31,300	135,842.00	0.04
708	002471	中超控股	22,400	135,744.00	0.04
709	600582	天地科技	27,300	135,681.00	0.04
710	600653	申华控股	34,100	135,377.00	0.04
711	600323	瀚蓝环境	9,400	134,984.00	0.04
712	000726	鲁 泰 A	10,500	134,505.00	0.04
713	600566	济川药业	4,300	134,418.00	0.04
714	002433	太安堂	12,400	134,416.00	0.04
715	600400	红豆股份	15,700	134,392.00	0.04
716	002151	北斗星通	4,200	133,980.00	0.04
717	000034	神州数码	6,000	133,920.00	0.04

718	000861	海印股份	27,600	133,860.00	0.04
719	002249	大洋电机	15,500	133,765.00	0.04
720	000815	美利云	6,500	133,575.00	0.04
721	600595	中孚实业	23,700	133,194.00	0.04
722	600873	梅花生物	20,400	133,008.00	0.04
723	002215	诺普信	12,000	132,960.00	0.04
724	002642	荣之联	6,600	132,660.00	0.04
725	601010	文峰股份	25,200	132,552.00	0.04
726	600750	江中药业	4,300	132,526.00	0.04
727	000418	小天鹅 A	4,100	132,512.00	0.04
728	002128	露天煤业	15,400	132,440.00	0.04
729	002505	大康农业	37,360	132,254.40	0.04
730	000733	振华科技	7,400	132,090.00	0.04
731	601777	力帆股份	13,800	131,928.00	0.04
732	000555	神州信息	6,200	131,626.00	0.04
733	600783	鲁信创投	5,800	131,196.00	0.04
734	601127	小康股份	4,900	131,026.00	0.04
735	002367	康力电梯	9,900	130,779.00	0.04
736	600805	悦达投资	15,400	130,746.00	0.04
737	002256	兆新股份	20,300	130,326.00	0.04
738	000607	华媒控股	11,000	130,020.00	0.04
739	600639	浦东金桥	7,000	129,920.00	0.04
740	600033	福建高速	37,400	129,404.00	0.04
741	600438	通威股份	20,300	129,311.00	0.04
742	000739	普洛药业	17,100	128,763.00	0.04
743	000158	常山股份	10,300	128,750.00	0.04
744	002329	皇氏集团	9,100	128,492.00	0.04
745	603588	高能环境	4,100	128,330.00	0.04
746	000989	九芝堂	5,900	128,089.00	0.04
747	600823	世茂股份	18,210	127,834.20	0.04
748	000802	北京文化	6,600	127,644.00	0.04
749	002625	龙生股份	3,400	127,364.00	0.04
750	000918	嘉凯城	16,900	126,919.00	0.04
751	000501	鄂武商 A	6,500	126,880.00	0.04
752	002721	金一文化	7,600	126,768.00	0.04
753	002709	天赐材料	3,000	126,510.00	0.04
754	002237	恒邦股份	11,000	126,500.00	0.04

755	002318	久立特材	12,650	126,500.00	0.04
756	002157	正邦科技	18,900	125,874.00	0.04
757	600812	华北制药	20,100	125,826.00	0.04
758	600894	广日股份	9,200	125,764.00	0.04
759	002029	七匹狼	12,312	125,705.52	0.04
760	002547	春兴精工	13,300	125,685.00	0.04
761	002239	奥特佳	8,000	125,520.00	0.04
762	002262	恩华药业	5,990	125,191.00	0.04
763	002467	二六三	11,900	125,188.00	0.04
764	600775	南京熊猫	9,000	125,100.00	0.04
765	002588	史丹利	11,000	124,850.00	0.04
766	002364	中恒电气	6,000	124,800.00	0.04
767	002345	潮宏基	10,300	124,424.00	0.04
768	600729	重庆百货	5,300	124,179.00	0.04
769	600754	锦江股份	4,200	123,732.00	0.04
770	603823	百合花	3,762	123,167.88	0.04
771	002488	金固股份	7,400	122,840.00	0.04
772	002170	芭田股份	13,200	122,628.00	0.04
773	600896	览海投资	9,900	122,364.00	0.04
774	600859	王府井	7,506	122,197.68	0.04
775	600630	龙头股份	7,900	121,976.00	0.04
776	600300	维维股份	18,200	121,576.00	0.04
777	600103	青山纸业	21,500	121,475.00	0.04
778	000662	天夏智慧	5,700	121,353.00	0.04
779	000090	天健集团	12,540	121,136.40	0.04
780	600096	云天化	12,700	120,523.00	0.04
781	600337	美克家居	8,500	120,360.00	0.04
782	600330	天通股份	11,500	120,175.00	0.04
783	600648	外高桥	6,081	120,038.94	0.04
784	002174	游族网络	4,500	119,025.00	0.04
785	002011	盾安环境	12,500	119,000.00	0.04
786	002519	银河电子	5,300	118,720.00	0.04
787	002344	海宁皮城	10,484	118,678.88	0.04
788	600139	西部资源	10,600	118,508.00	0.04
789	000572	海马汽车	22,100	118,456.00	0.04
790	002251	步步高	7,200	118,440.00	0.04
791	600317	营口港	34,132	118,438.04	0.04

792	002482	广田集团	12,800	118,400.00	0.04
793	600280	中央商场	13,600	117,096.00	0.04
794	002551	尚荣医疗	5,872	116,911.52	0.04
795	600869	智慧能源	15,000	116,100.00	0.04
796	000626	远大控股	4,700	115,855.00	0.04
797	600555	海航创新	18,500	115,625.00	0.04
798	600022	山东钢铁	46,100	115,250.00	0.04
799	002690	美亚光电	5,444	115,195.04	0.03
800	002093	国脉科技	10,400	115,128.00	0.03
801	600550	保变电气	18,800	114,868.00	0.03
802	601908	京运通	16,100	114,632.00	0.03
803	002298	中电鑫龙	8,300	114,623.00	0.03
804	600185	格力地产	19,700	114,457.00	0.03
805	002636	金安国纪	7,000	114,450.00	0.03
806	002371	七星电子	4,300	114,380.00	0.03
807	002506	协鑫集成	20,700	114,264.00	0.03
808	600292	远达环保	9,230	114,175.10	0.03
809	002517	恺英网络	3,400	114,104.00	0.03
810	002309	中利科技	8,000	113,680.00	0.03
811	002242	九阳股份	6,300	113,589.00	0.03
812	002631	德尔未来	6,100	113,277.00	0.03
813	601558	华锐风电	47,900	112,086.00	0.03
814	600612	老凤祥	3,000	111,690.00	0.03
815	002699	美盛文化	3,300	111,540.00	0.03
816	600825	新华传媒	12,800	111,232.00	0.03
817	600466	蓝光发展	11,500	111,205.00	0.03
818	601001	大同煤业	18,200	111,202.00	0.03
819	000088	盐 田 港	15,560	110,942.80	0.03
820	600757	长江传媒	13,300	110,523.00	0.03
821	600395	盘江股份	13,600	109,752.00	0.03
822	600020	中原高速	24,400	109,556.00	0.03
823	002414	高德红外	4,800	109,344.00	0.03
824	000550	江铃汽车	4,025	108,675.00	0.03
825	000681	视觉中国	5,700	108,642.00	0.03
826	002095	生 意 宝	2,700	108,108.00	0.03
827	000767	漳泽电力	27,800	107,030.00	0.03
828	601375	中原证券	26,695	106,780.00	0.03

829	600650	锦江投资	4,600	106,352.00	0.03
830	600578	京能电力	25,200	105,840.00	0.03
831	002663	普邦股份	17,396	105,593.72	0.03
832	600076	康欣新材	11,200	105,168.00	0.03
833	000062	深圳华强	3,700	105,117.00	0.03
834	600577	精达股份	25,100	104,918.00	0.03
835	600986	科达股份	6,800	103,632.00	0.03
836	600748	上实发展	12,650	103,603.50	0.03
837	002681	奋达科技	8,000	103,440.00	0.03
838	600686	金龙汽车	7,200	102,312.00	0.03
839	002416	爱施德	6,800	100,164.00	0.03
840	600640	号百控股	4,999	99,880.02	0.03
841	002658	雪迪龙	5,700	98,040.00	0.03
842	000810	创维数字	6,900	97,083.00	0.03
843	600180	瑞茂通	7,033	95,226.82	0.03
844	600676	交运股份	10,400	93,288.00	0.03
845	601636	旗滨集团	24,000	93,120.00	0.03
846	600726	华电能源	18,800	93,060.00	0.03
847	600329	中新药业	5,312	92,641.28	0.03
848	601369	陕鼓动力	13,468	92,255.80	0.03
849	002527	新时达	6,800	91,188.00	0.03
850	002203	海亮股份	11,300	91,078.00	0.03
851	002653	海思科	5,824	91,029.12	0.03
852	000838	财信发展	10,000	90,900.00	0.03
853	002539	云图控股	8,100	89,586.00	0.03
854	603298	杭叉集团	3,641	88,403.48	0.03
855	600776	东方通信	10,300	88,168.00	0.03
856	000958	东方能源	6,000	87,180.00	0.03
857	002181	粤传媒	10,925	86,089.00	0.03
858	002698	博实股份	5,500	85,635.00	0.03
859	000869	张裕 A	2,345	84,420.00	0.03
860	600874	创业环保	10,100	82,113.00	0.02
861	000796	凯撒旅游	5,200	78,780.00	0.02
862	002192	融捷股份	3,600	78,768.00	0.02
863	002832	比音勒芬	1,158	70,290.60	0.02
864	603577	汇金通	2,460	69,642.60	0.02
865	603218	日月股份	1,652	68,805.80	0.02

866	603877	太平鸟	3,180	67,734.00	0.02
867	002577	雷柏科技	2,200	66,748.00	0.02
868	300583	赛托生物	1,582	63,738.78	0.02
869	603878	武进不锈	1,571	62,840.00	0.02
870	603416	信捷电气	1,076	53,886.08	0.02
871	601005	重庆钢铁	19,400	48,888.00	0.01
872	002833	弘亚数控	2,743	48,331.66	0.01
873	603058	永吉股份	3,869	42,675.07	0.01
874	603689	皖天然气	4,818	37,917.66	0.01
875	603886	元祖股份	2,085	36,904.50	0.01
876	300582	英飞特	1,359	35,157.33	0.01
877	603228	景旺电子	1,455	33,697.80	0.01
878	603239	浙江仙通	924	29,059.80	0.01
879	002835	同为股份	1,126	24,220.26	0.01
880	603035	常熟汽饰	2,316	24,179.04	0.01
881	603266	天龙股份	1,562	22,852.06	0.01
882	300587	天铁股份	1,438	20,290.18	0.01
883	603929	亚翔集成	2,193	15,592.23	0.00
884	002840	华统股份	1,814	11,881.70	0.00
885	002838	道恩股份	681	10,405.68	0.00
886	603186	华正新材	1,874	10,063.38	0.00
887	603032	德新交运	1,628	9,458.68	0.00
888	300586	美联新材	1,006	9,355.80	0.00
889	300591	万里马	2,397	7,358.79	0.00
890	300588	熙菱信息	1,380	6,817.20	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	601211	国泰君安	1,102,205.00	0.21
2	600271	航天信息	887,815.65	0.17
3	000001	平安银行	773,460.00	0.15
4	000333	美的集团	697,295.00	0.13
5	600016	民生银行	678,395.00	0.13
6	601318	中国平安	622,536.00	0.12
7	002594	比亚迪	592,341.00	0.11

8	600015	华夏银行	588,587.00	0.11
9	601166	兴业银行	573,521.00	0.11
10	600028	中国石化	569,771.00	0.11
11	600485	信威集团	562,633.00	0.11
12	000166	申万宏源	530,392.00	0.10
13	600751	天海投资	511,551.00	0.10
14	002131	利欧股份	510,882.00	0.10
15	600023	浙能电力	510,557.00	0.10
16	600000	浦发银行	508,820.80	0.10
17	000750	国海证券	498,270.98	0.09
18	000661	长春高新	479,715.80	0.09
19	600919	江苏银行	476,767.00	0.09
20	600977	中国电影	475,042.48	0.09

注：“买入金额”按买入成交金额（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	000002	万科 A	3,429,977.82	0.64
2	000001	平安银行	2,074,474.35	0.39
3	000333	美的集团	1,461,125.30	0.27
4	600036	招商银行	1,423,809.00	0.27
5	000725	京东方 A	1,233,901.00	0.23
6	000858	五粮液	1,167,053.55	0.22
7	600271	航天信息	1,104,406.96	0.21
8	002024	苏宁云商	981,775.96	0.18
9	000748	长城信息	891,648.19	0.17
10	601318	中国平安	865,188.00	0.16
11	600383	金地集团	861,090.52	0.16
12	002415	海康威视	848,011.46	0.16
13	000651	格力电器	763,892.00	0.14
14	002018	华信国际	761,804.27	0.14
15	000166	申万宏源	750,444.33	0.14
16	601988	中国银行	739,964.00	0.14
17	002450	康得新	707,333.29	0.13

18	002219	恒康医疗	690,194.97	0.13
19	000538	云南白药	674,403.95	0.13
20	000776	广发证券	660,597.14	0.12

注：“卖出金额”按卖出成交金额（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

买入股票成本（成交）总额	100,000,616.47
卖出股票收入（成交）总额	131,877,814.14

注：“买入股票成本”、“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

本基金本报告期末未持有债券。

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

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。

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

金额单位：人民币元

代码	名称	持仓量 (买/卖)(单位:手)	合约市值	公允价值变动	风险说明
IC1701	中证 500 股指期货 IC1701 合	7	8,704,080.00	60,080.00	买入股指期货多头合约的目的是进行更有效地流动性管

	约				理。
IF1701	沪深 300 股指期货 IF1701 合约	14	13,826,400.00	-130,080.00	买入股指期货多头合约的目的是进行更有效地流动性管理。
IF1703	沪深 300 股指期货 IF1703 合约	2	1,950,480.00	-49,980.00	买入股指期货多头合约的目的是进行更有效地流动性管理。
公允价值变动总额合计					-119,980.00
股指期货投资本期收益					-2,199,500.00
股指期货投资本期公允价值变动					245,260.00

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金为指数型基金，主要投资标的为指数成份股和备选成份股。基金留存的现金头寸根据基金合同规定，投资于基础资产与标的指数相关性较高的股指期货组合，旨在配合基金日常投资管理需要，更有效地进行流动性管理，以更好地跟踪标的指数，实现投资目标。

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

本基金本报告期末无国债期货投资。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货投资。

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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期出现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。

8.12.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

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	4,914,047.05

2	应收证券清算款	1,016,202.32
3	应收股利	-
4	应收利息	12,647.16
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,942,896.53

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§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		华夏 MSCI 中国 A 股 ETF 联接	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
4,014	83,088.05	51,725,156.00	15.51%	188,617,379.00	56.55%	93,172,883.00	27.94%

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	中邮创业基金—华夏银行—华夏银行 股份有限公司	30,412,312	9.12%
2	厦门市担保有限公司	5,500,000	1.65%
3	安英慧	5,038,800	1.51%
4	海通资产管理(香港)有限公司—客 户资金	3,934,700	1.18%
5	蒋化民	3,500,000	1.05%

6	田雪芝	3,153,600	0.95%
7	曹茂秋	2,622,800	0.79%
8	金怡	2,156,500	0.65%
9	国信证券股份有限公司	2,129,729	0.64%
10	黄瑞贵	1,856,700	0.56%
11	中国银行股份有限公司－MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金联接基金	93,172,883	27.94%

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	-	-

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 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015年2月12日）基金份额总额	4,136,570,680
本报告期期初基金份额总额	488,515,418
本报告期基金总申购份额	75,000,000
减：本报告期基金总赎回份额	230,000,000
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	333,515,418

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

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

根据本基金管理人发布的相关公告，孙毅先生自 2016 年 1 月 1 日起任华夏基金管理有限公司副总经理，自 2016 年 6 月 30 日起不再担任华夏基金管理有限公司副总经理。

2016 年 12 月，郭德秋先生担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。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

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期应支付给普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为 60,000 元人民币。截至本报告期末，该事务所已向本基金提供 2 年的审计服务。

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

本基金管理人、基金托管人涉及托管业务的部门及其高级管理人员在本报告期内未受到任何处分。

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	
国泰君安证券	4	167,119,726.49	73.63%	21,942.31	73.62%	-
中国银河证券	5	59,865,631.38	26.37%	7,862.19	26.38%	-

注：①为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即：

i 经营行为规范，在近一年内无重大违规行为。

ii 公司财务状况良好。

iii 有良好的内控制度，在业内有良好的声誉。

iv 有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告。

v 建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯和服务。

②券商专用交易单元选择程序：

i 对交易单元候选券商的研究服务进行评估

本基金管理人组织相关人员依据交易单元选择标准对交易单元候选券商的服务质量和研究实力进行评估，确定选用交易单元的券商。

ii 协议签署及通知托管人

本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

③除本表列示外，本基金还选择了东方证券、高华证券、国信证券、海通证券、华泰证券、瑞银证券、申万宏源证券、西部证券、招商证券、中金公司、中信建投证券、中信证券、中银国际证券、兴业证券的交易单元作为本基金交易单元，本报告期无股票交易及应付佣金。

④在上述租用的券商交易单元中，东方证券的交易单元为本基金本期新增的交易单元。本期没有剔除的券商交易单元。

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	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例
国泰君安证券	373,359.00	83.24%	50,300,000.00	100.00%
中国银河证券	75,177.48	16.76%	-	-

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	华夏基金管理有限公司公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-01-04
2	华夏基金管理有限公司关于指数熔断当日旗下基金申购、赎回等业务安排的提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-01-04
3	华夏基金管理有限公司关于指数熔断期间旗下基金场内申赎业务安排的提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-01-05
4	华夏基金管理有限公司关于旗下基金认购关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-01-06
5	华夏基金管理有限公司关于指数熔断当日旗下基金申购、赎回等业务安排的提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-01-07
6	华夏基金管理有限公司关于公司董事、监事、高级管理人员及其他从业人员在子公司兼职等情况的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-01-13
7	华夏基金管理有限公司关于设立上海华夏财富投资管理有限公司的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-01-30
8	华夏基金管理有限公司关于公司董事、监事、高级管理人员及其他从业人员在子公司兼职等情况的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-03-04

9	华夏基金管理有限公司关于新增 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金一级交易商的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-03-19
10	华夏基金管理有限公司关于旗下基金认购关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-05-26
11	华夏基金管理有限公司公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-07-02
12	华夏基金管理有限公司关于公司董事、监事、高级管理人员及其他从业人员在子公司兼职等情况的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-07-02
13	华夏基金管理有限公司关于公司董事、监事、高级管理人员及其他从业人员在子公司兼职等情况的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-09-20
14	华夏基金管理有限公司关于增聘 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金基金经理的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-10-22
15	华夏基金管理有限公司关于公司董事、监事、高级管理人员及其他从业人员在子公司兼职等情况的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-11-18

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

12.1.1 中国证监会准予基金注册的文件；

12.1.2 《MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；

12.1.3 《MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；

12.1.4 法律意见书；

12.1.5 基金管理人业务资格批件、营业执照；

12.1.6 基金托管人业务资格批件、营业执照。

12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

12.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的住所免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

华夏基金管理有限公司

二〇一七年三月二十九日