

工银瑞信基本面量化策略混合型证券投资 基金 2017 年年度报告

2017 年 12 月 31 日

基金管理人：工银瑞信基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：二〇一八年三月二十七日

§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 2018 年 3 月 20 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。

本报告期自 2017 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 其他指标.....	9
3.4 过去三年基金的利润分配情况.....	9
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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.....	16
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	16
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	16
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	17
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	18
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.....	18
§5 托管人报告	19
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	19
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	19
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.....	19
§6 审计报告	20
6.1 审计报告基本信息.....	20
6.2 审计报告的基本内容.....	20
§7 年度财务报表	23
7.1 资产负债表.....	23
7.2 利润表.....	24
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	25
7.4 报表附注.....	26
§8 投资组合报告	54
8.1 期末基金资产组合情况.....	54
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	54
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.....	55
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	65
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.....	70
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.....	70
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.....	70
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	70
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.....	71
§9 基金份额持有人信息.....	73
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	73
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	73
9.3 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的情况.....	73
§10 开放式基金份额变动.....	74
§11 重大事件揭示.....	75
11.1 基金份额持有人大会决议.....	75
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.....	75
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	75
11.4 基金投资策略的改变.....	75
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	75
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.....	75
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	76
11.8 其他重大事件.....	78
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	83
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	83
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	83
§13 备查文件目录.....	84
13.1 备查文件目录.....	84
13.2 存放地点.....	84
13.3 查阅方式.....	84

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	工银瑞信基本面量化策略混合型证券投资基金
基金简称	工银量化策略混合
基金主代码	481017
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012 年 4 月 26 日
基金管理人	工银瑞信基金管理有限公司
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	85,569,797.74 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	合理分散投资，有效控制投资组合风险，追求超越业绩基准的长期投资收益。
投资策略	本基金在基本面分析的基础上，采用数量化投资管理系统，对股票进行多角度、多视野、系统化分析研究，精选股票构建投资组合，在控制风险的前提下实现收益最大化，实现超越市场平均水平的长期投资业绩。主要包括大类资产配置策略、行业配置策略、股票资产投资策略、债券及其他金融工具投资策略。
业绩比较基准	$80\% \times \text{中证 800 指数收益率} + 20\% \times \text{上证国债指数收益率}$ 。
风险收益特征	本基金是混合型基金，其预期收益及风险水平高于货币型基金和债券型基金，低于股票型基金。本基金基于数量化投资管理系统进行投资，在混合型基金中属于风险中性的投资产品。

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		工银瑞信基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	朱碧艳	王永民
	联系电话	400-811-9999	010-66594896
	电子邮箱	customerservice@icbccs.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-811-9999	95566
传真		010-66583158	010-66594942
注册地址		北京市西城区金融大街 5 号、甲 5 号 6 层甲 5 号 601、甲 5 号 7 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号

	甲 5 号 701、甲 5 号 8 层甲 5 号 801、甲 5 号 9 层甲 5 号 901	
办公地址	北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 A 座 6-9 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	郭特华	陈四清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、证券时报、上海证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.icbccs.com.cn
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	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 16 层
注册登记机构	工银瑞信基金管理有限公司	北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 A 座 6-9 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	19,801,448.51	-25,716,550.51	91,995,369.99
本期利润	30,003,147.24	-31,370,911.73	82,978,746.33
加权平均基金份额本期利润	0.3663	-0.3128	0.9612
本期加权平均净值利润率	17.43%	-16.80%	50.25%
本期基金份额净值增长率	18.72%	-15.10%	60.30%
3.1.2 期末数据和指标	2017 年末	2016 年末	2015 年末
期末可供分配利润	109,808,951.97	66,803,730.08	110,810,758.51
期末可供分配基金份额利润	1.2833	0.9230	1.2654
期末基金资产净值	195,378,749.71	139,178,423.61	198,383,210.31
期末基金份额净值	2.283	1.923	2.265
3.1.3 累计期末指标	2017 年末	2016 年末	2015 年末
基金份额累计净值增长率	128.30%	92.30%	126.50%

注：1、上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、本期已实现收益是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、所列数据截止到报告期最后一日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

4、本基金基金合同生效日为 2012 年 4 月 26 日。

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	0.93%	0.85%	1.74%	0.61%	-0.81%	0.24%
过去六个月	9.81%	0.84%	6.21%	0.56%	3.60%	0.28%
过去一年	18.72%	0.78%	12.20%	0.52%	6.52%	0.26%
过去三年	61.57%	1.97%	15.94%	1.38%	45.63%	0.59%
过去五年	137.81%	1.72%	59.37%	1.25%	78.44%	0.47%
自基金合同生效以来	128.30%	1.64%	52.83%	1.22%	75.47%	0.42%

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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

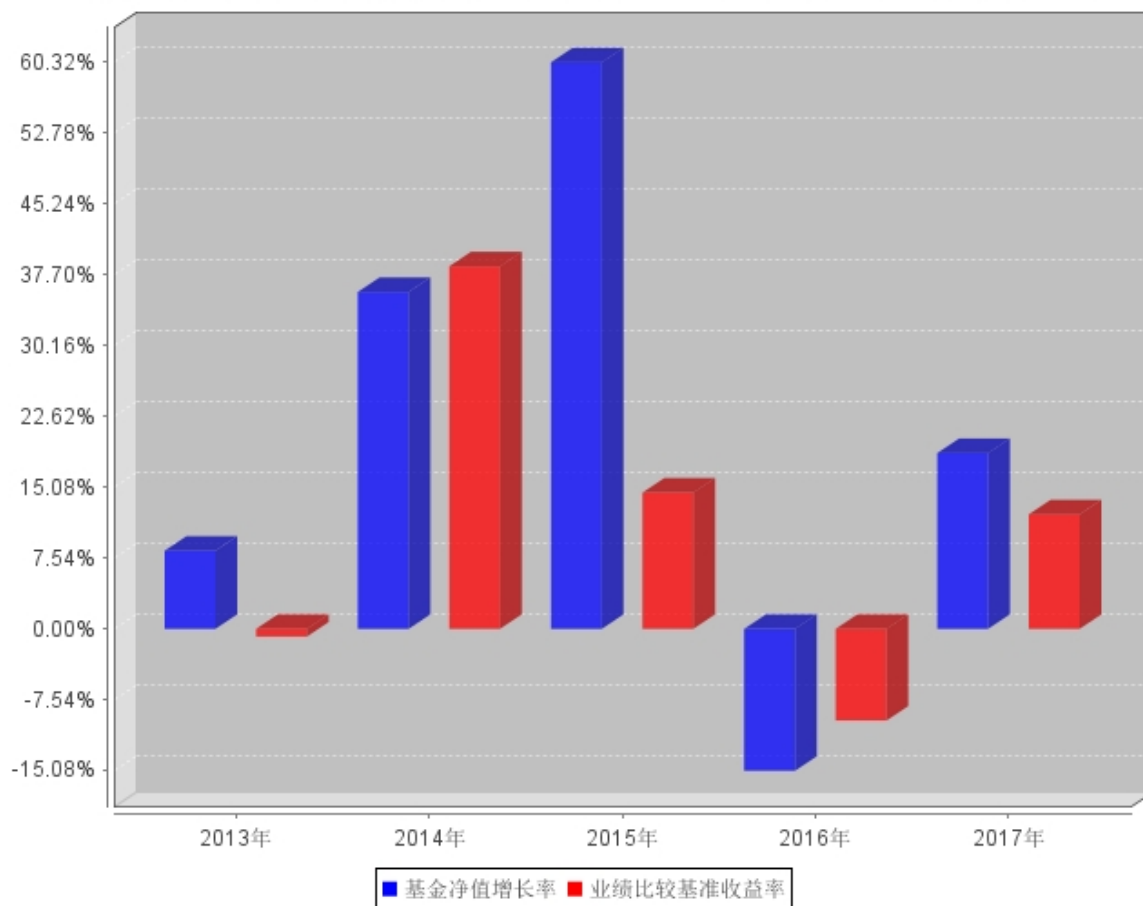


注：1、本基金基金合同于 2012 年 4 月 26 日生效；

2、按基金合同规定，本基金建仓期为 6 个月。截至报告期末，本基金的各项投资比例符合基金合同关于投资范围、投资禁止行为与限制的规定：本基金的股票资产占基金资产的比例为 60%–95%，债券、现金等金融工具占基金资产的比例为 5%–40%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：1、本基金基金合同生效日为 2012 年 4 月 26 日。

2、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 其他指标

无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

无。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为工银瑞信基金管理有限公司，成立于 2005 年 6 月，是我国第一家由银行直接发起设立并控股的合资基金管理公司。公司目前在北京、上海、深圳设有分公司，在香港和上海设有全资子公司——工银瑞信资产管理（国际）有限公司、工银瑞信投资管理有限公司。

公司（含子公司）拥有公募基金、特定资产管理、企业年金基金投资管理、全国社会保障基金境内外投资管理、基本养老保险基金证券投资管理、保险资产管理、企业年金养老金产品投资管理、QDII、QFII、RQFII 等多项业务资格。

截至 2017 年 12 月 31 日，公司旗下管理工银瑞信核心价值混合型证券投资基金、工银瑞信货币市场基金、工银瑞信中国机会全球配置股票型证券投资基金、工银瑞信沪深 300 指数证券投资基金、工银瑞信添颐债券型证券投资基金、工银瑞信消费服务行业混合型证券投资基金、工银瑞信 60 天理财债券型证券投资基金、工银瑞信金融地产行业混合型证券投资基金、工银瑞信医疗保健行业股票型证券投资基金、工银瑞信沪港深股票型证券投资基金、深证红利交易型开放式指数证券投资基金、工银瑞信香港中小盘股票型证券投资基金（QDII）等 113 只公募基金。

公司始终坚持“以稳健的投资管理，为客户提供卓越的理财服务”为使命，依托强大的股东背景、稳健的经营理念、科学的投研体系、严密的风控机制和资深的管理团队，立足市场化、专业化、规范化和国际化，坚持“稳健投资、价值投资、长期投资”，致力于为广大投资者提供一流的投资管理服务。

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（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
游凇峰	本基金的基金经理	2012 年 4 月 26 日	-	22	斯坦福大学统计学专业博士；先后在 Merrill Lynch Investment Managers 担任美林集中基金和美林保本基金基金经理，Fore Research & Management 担任 Fore Equity Market Neutral 组合基金经理，Jasper

				Asset Management 担任 Jasper Gemini Fund 基金基金经理；2009 年加入工银瑞信基金管理有限公司，现任权益投资部量化投资团队负责人；2009 年 12 月 25 日至今，担任工银瑞信中国机会全球配置股票基金的基金经理；2010 年 5 月 25 日至今，担任工银全球精选股票基金的基金经理；2012 年 4 月 26 日至今担任工银瑞信基本面量化策略混合型证券投资基金基金经理；2014 年 6 月 26 日至今，担任工银瑞信绝对收益混合型基金基金经理；2015 年 12 月 15 日至 2017 年 12 月 22 日，担任工银瑞信新趋势灵活配置混合型基金基金经理；2016 年 3 月 9 日至 2017 年 10 月 9 日，担任工银瑞信香港中小盘股票型基金基金经理；2016 年 10 月 10 日至今，担任工银瑞信新焦点灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2017 年 4 月 14 日至今，担任工银瑞信新机遇灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2017 年 4 月 27 日至今，担任工银瑞信新价值灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--

注：1、任职日期为基金合同生效日或本基金管理人对外披露的任职日期；离职日期为本基金管理人对外披露的离职日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券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，本基金管理人严格按照《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，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金持有人利益的行为。

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

1、公平交易原则

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，为公平对待不同基金份额持有人，公平对待基金持有人和其他资产委托人，在投资管理活动中公平对待公司所管理的不同基金财产和客户资产，不得直接或通过第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。

2、适用范围

本制度适用于本公司所管理的不同投资组合，包括封闭式基金、开放式基金，以及社保组合、企业年金、特定客户资产管理组合等其他受托资产。基金经理，指管理公募基金基金经理，如封闭式基金、开放式基金。投资经理，指管理其他受托资产的投资经理，如企业年金、特定客户资产管理等专项受托资产。

3、公平交易的具体措施

3.1 在研究和投资决策环节：

3.1.1 在公司股票池的基础上，研究部根据不同投资组合的投资目标、投资风格、投资范围和关联交易限制等，参考公司《股票池管理办法》，建立股票池，各基金基金经理、其他受托资产投资经理在此基础上根据投资授权构建具体的投资组合。

3.1.2 各基金基金经理、其他受托资产投资经理投资决策参照《投资授权管理办法》执行，在授权的范围内，独立、自主、审慎决策。

3.1.3 基金经理不得兼任投资经理，且各投资组合的基金经理、投资经理投资系统权限要严格分离。

3.1.4 对于涉及到关联交易的投资行为，参考公司《关联交易管理制度》执行。

3.2 在交易执行环节：

3.2.1 交易人员、投资交易系统权限的适当分离。在必要的情况下，对于社保基金或其他专项受托资产组合配备专门的交易员，未经授权，其他交易员不得参与社保基金或其他专项受托资

产组合的日常交易，并进行交易系统权限的屏蔽。

3.2.2 公平交易执行原则：价格优先、时间优先、综合平衡、比例实施，保证交易在不同基金资产、不同受托资产间的公正，保证公司所管理的不同基金资产、受托资产间的利益公平。

3.2.3 公平交易执行方法：

3.2.3.1 交易员必须严格按照“价格优先、时间优先”的交易执行原则，及时、迅速、准确地执行。

3.2.3.2 在投资交易系统中设置“公平交易模块”，对于涉及到同一证券品种的交易执行，系统自动通过公平交易模块完成。

公平交易模块执行原理如下：

1) 同向交易指令：

a) 限价指令：交易员采用投资交易系统中的公平委托系统，按照各组合委托数量设置委托比例，按比例具体执行；b) 市价指令：对于市价同向交易指令，交易员首先应该按照“时间优先”的原则执行交易指令，并在接到后到达指令后按照先到指令剩余数量和新到指令数量采用公平委托系统执行；对于同时同向交易指令，交易员应采用投资交易系统中的公平委托模块，按照各基金委托数量设置委托比例，按比例具体执行；c) 部分限价指令与部分市价指令：对于不同基金经理下达的不同类型的同向交易指令，交易员应该按照“价格优先”的原则执行交易指令，在市场价格未达到限价时，先执行市价指令、后执行限价指令；

2) 反向交易指令

a) 交易员不得接受可能导致同一投资组合或不同投资组合之间对敲的同一证券品种的指令，并由风险中台在投资系统中设置严禁所有产品在证券交易时对敲。b) 根据证监会 2011 年修订的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》中相关条款，公司规定同一公募基金、年金、专户、社保组合或前述组合之间不允许同日针对同一证券的反向投资指令；c) 同一公募基金不允许两日内针对同一证券的反向投资指令。d) 确因投资组合要求的投资策略或流动性等需求而发生的同日反向交易，按要求投资组合经理要填写反向交易申请表，并要求相关投资经理提供决策依据，并保留记录备查。e) 以上反向交易要求完全按照指数的构成进行投资的组合等除外。

3.2.4 对于银行间市场交易、交易所大宗交易、债券一级市场申购等非集中竞价交易，涉及到两个或以上基金或投资组合参与同一证券交易的情况，各基金/投资经理在交易前独立确定各投资组合的交易价格和数量，中央交易室按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配。参照《集中交易管理办法》，银行间市场债券买卖和回购交易，由交易员填写《银行间市场交易审批单》，经相关基金经理/投资经理、交易主管审批，并由交易员双人复核后方可执行。公司对

非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购的申购方案和分配过程进行审核和监控，保证分配结果符合公平交易的原则。交易所大宗交易，填写《大宗交易申请表》，经公司内部审批后执行。债券一级市场交易，填写《债券投标审批表》及《债券分销审批表》，经公司内部审批后执行。其他非集中竞价交易，参考上述审批流程执行。

3.2.5 对于非公开发行股票申购，各基金/投资经理在申购前参照《投资流通受限证券工作流程》，独立确定申购价格和数量，中央交易室按照价格优先、比例分配的原则进行分配。

3.2.6 对于由于特殊原因不能参与公平交易程序的交易指令，中央交易室填写《公平交易审批单》，经公司内部审批后执行。

3.2.7 公平交易争议处理

在公平交易执行过程中若发生争议，或出现基金/投资经理对交易员执行公平交易结果不满情况，交易主管将具体情况报告公司主管领导，公司主管领导与相关基金/投资经理、交易主管就争议内容进行协调处理。

3.3 公平交易的检查和价格监控

3.3.1 内控稽核部可通过投资交易系统对于公平交易的执行情况进行稽核，并定期向督察长报告。如发现有疑问的交易情况，就交易时间、交易价格、交易数量、交易理由等提出疑问，由基金/投资经理作出合理解释。

3.3.2 风险管理部根据市场公认的第三方信息，对于投资组合与交易对手之间议价交易的交易价格公允性进行审查，如发现异常情况的，基金/投资经理应对交易价格的异常情况进行合理性解释。

3.3.3 内控稽核部应对不同投资组合在交易所公开竞价交易中同日同向交易的交易时机和交易价差进行监控，同时对不同投资组合临近交易日的同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行分析，如发现异常应向基金/投资经理提出，相关基金/投资经理应对异常交易情况进行合理性解释。风险管理部和内控稽核部应对其他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，对于异常交易发生前后不同投资组合买卖该异常交易证券的情况进行分析。相关基金/投资经理应对异常交易情况进行合理性解释。

3.4 评估和分析

3.4.1 风险管理部应分别于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行分析，对连续四个季度期间内、不同时间窗下（如日内、3日内、5日内）公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析，由投资组合经理、督察长、总经理签署后，妥善保存分析报告备查。如果在上述分析期间内，公司管理的所有

投资组合向交易价差出现异常情况，应重新核查公司投资决策和交易执行环节的内部控制，针对潜在问题完善公平交易制度，进行专项说明，提交内控稽核部，内控稽核部应将此说明载入监察稽核季度报告和年度报告中对此做专项说明。

3.4.2 中央交易室负责在各投资组合的定期报告中披露公司整体公平交易制度执行情况。风险管理部负责在各投资组合的定期报告中对异常交易行为进行专项说明，其中，如果报告期内所有投资组合参与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的 5%，应说明该类交易的次数及原因。各投资组合的年度报告中，除上述内容外，还应披露公平交易制度和控制方法，并在公司整体公平交易制度执行情况中，对当年度同向交易价差做专项分析。

4. 报告

公司相关部门如果发现涉嫌违背公平交易原则的行为，应及时向公司管理层汇报并采取相关控制和改进措施。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

为了公平对待各类投资人，保护各类投资人利益，避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为，公司根据《证券投资基金法》、《基金管理公司特定客户资产管理业务试点办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规和公司内部规章，拟定了《公平交易管理办法》、《异常交易管理办法》，对公司管理的各类资产的公平对待做了明确具体的规定，并规定对买卖股票、债券时候的价格和市场价格差距较大，可能存在操纵股价、利益输送等违法违规情况进行监控。本报告期，按照时间优先、价格优先的原则，本公司对满足限价条件且对同一证券有相同交易需求的基金等投资组合，均采用了系统中的公平交易模块进行操作，实现了公平交易；未出现清算不到位的情况，且本基金及本基金与本基金管理人管理的其他投资组合之间未发生法律法规禁止的反向交易及交叉交易。

公司于每季度和年度对公司管理的不同投资组合进行了同向交易价差分析，采用了日内、3 日内、5 日内的时间窗口，假设不同组合间价差为零，进行了 T 分布检验。对于没有通过检验的交易，公司根据交易价格、交易频率、交易数量、交易时间进行了具体分析。经分析，本报告期未出现公司管理的不同投资组合间有同向交易价差异常的情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金本报告期内未出现异常交易的情况。本报告期内，本公司所有投资组合参与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的 5% 的情况有 3 次。投资

组合经理因投资组合的投资策略而发生同日反向交易，未导致不公平交易和利益输送。

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

回顾 2017 年，A 股市场整体维持震荡上行的走势，但具体到行业和个股上呈现明显的分化特征。受益于全球经济逐步复苏影响，2017 年全球股指普遍上扬，在这种外部环境下，叠加国内供给侧改革取得显著效果，龙头上市公司盈利普遍改善，使得 A 股整体在盈利驱动下走出一轮“慢牛”行情。与此同时，受金融监管趋严、盈利增长分化、流动性分化等因素的影响，大盘股与小盘股呈现明显分化，A 股主要指数中，上证 50 指数涨幅最高，创业板指数跌幅最深，蓝筹股指数出现普涨。从行业来看，食品饮料、家电、煤炭等盈利增速较为确定的行业涨幅较好，计算机、传媒、纺织服装等行业跌幅较大。

本基金操作一贯以量化指标为主，选择具有稳定成长及合理估值的优质公司股票。年初配置中成长类优质股占比较大，导致期初略微跑输基准，随后本基金在配置上进行了调整，优化了个股选择方式，增加了价值类优质公司的配置。经过调整，全年基金收益超越业绩基准。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金净值增长率为 18.72%，业绩比较基准收益率为 12.20%。

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 2018 年，从基本面角度看，全球主要经济体大概率仍将处于复苏周期，这将有利于中国出口的提升，同时随着经济发展及生活水平提高，消费升级有望为经济提供较强支撑，因此中国经济大概率仍将平稳运行，但重点将由高速增长转向高质量增长。资金方面，金融去杠杆仍将延续，但优质权益类资产已具备较好配置价值，有望吸引增量资金入市。风格方面因为更多的国际投资资本的介入，市场偏好还会继续延续近两年的趋势，以盈利能力、稳定性、成长的确性为主导的投资风格。整体来看，我们认为 2018 年 A 股市场仍然稳中向好，应重点关注结构性机会，我们将从基本面和估值两个方面优选业绩稳定并具有良好发展前景的优质公司和行业。

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法律合规风险管理和监察稽核工作，使得法律合规风险被及时识别并得到控制，保障公司各项业务的合法合规。

合规管理方面，一是积极跟踪法律法规的变化和监管动态，及时向业务部门解读、传达最新法规和监管要求及其对公司业务的影响，落实各项要求的责任部门，使得公司从业人员知法、守法；二是严格事前的监督审查和控制机制，保障业务开展的合法合规性。事前合法合规审核全面覆盖公司的新产品设计、基金募集和持续营销、宣传推介、基金等各受托资产的投资交易管理、基金信息披露等业务，并利用系统对相关投资组合的投资合规风险实现事前控制。三是严格的事中指标监控机制，保证投资过程的合规性：公司设置专人专岗监控投资指标，利用系统和人工结合的方式，实现重点监控环节的刚性控制，系统无法实现控制的环节进行人工审核与复核。四是及时的事后风险管理机制，保证潜在合规风险得到及时解决：通过系统事后监测并提示各投资组合的被动超标情况，跟踪其限期回归到合规范围之内；五是继续开展合规培训，不断增强公司员工合规意识，促进公司合规文化的建设。公司通过对新员工的合规培训、对全体人员的年度合规培训、对投研人员、销售人员等的专项培训等多种形式，结合新出台的法律法规和行业风险事件，加深员工对法律法规和 risk 的理解，从而使得相关法规、政策、制度在公司内部更有效的得到落实。

监察稽核方面，一是定期对本基金投研交易、销售和后台运营等各项业务开展情况、内部规章制度执行情况、合规控制和风险控制情况进行系统全面的检查和评价，跟进后续改进情况，向监管机构报送监察稽核季报。同时，按照年度监察稽核计划开展有针对性的专项稽核工作。二是持续完善制度流程和监控模型，采用有效手段，日常监控投资管理人员的个人行为，利用公平交易、异常交易监控模型分析投资人员的投资行为，防范出现违反“三条底线”的情形。三是关注内部控制的健全性和有效性，全面梳理各项业务的工作流程，对其中的各项风险进行识别、评估，并对现有的控制手段提出改进性建议。同时，结合出台的法律法规和行业的新要求，督促公司及时制定、更新规章制度和完善业务流程。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

4.7.1 参与估值流程各方及人员（或小组）的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历

4.7.1.1 职责分工

参与估值小组成员为 4 人，分别是公司运作部负责人、研究部负责人、风险管理部负责人和法律合规部负责人，组长由运作部负责人担任。

各部门负责人也可推荐代表各部门参与估值小组的成员，如需更换，由相应部门负责人提出。小组成员需经运作部主管副总批准同意。

4.7.1.2 专业胜任能力及相关工作经历

小组由具有多年从事估值运作、证券行业研究、风险管理及熟悉业内法律法规的专家型人员组成。

4.7.2 基金经理参与或决定估值的程度

本公司基金经理参与讨论估值原则及方法，但不参与最终估值决策。

4.7.3 参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4.7.4 已签约的与估值相关的任何定价服务的性质与程度

尚无已签约的任何定价服务。本基金所采用的估值流程及估值结果均已经过会计师事务所鉴证，并经托管银行复核确认。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，本基金未实施利润分配，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

本基金在报告期内没有触及 2014 年 8 月 8 日生效的《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条规定的条件。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对工银瑞信基本面量化策略混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2018）审字第 60802052_A17 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	工银瑞信基本面量化策略混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了工银瑞信基本面量化策略混合型证券投资基金的财务报表，包括 2017 年 12 月 31 日的资产负债表，2017 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的工银瑞信基本面量化策略混合型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了工银瑞信基本面量化策略混合型证券投资基金 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年度的经营成果和净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>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。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于工银瑞信基本面量化策略混合型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。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。</p>
强调事项	—
其他事项	—
其他信息	<p>工银瑞信基本面量化策略混合型证券投资基金管理层（以下简称“管理层”）对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p>

	<p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、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。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估工银瑞信基本面量化策略混合型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督工银瑞信基本面量化策略混合型证券投资基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于</p>

	<p>舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，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。</p> <p>(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对工银瑞信基本面量化策略混合型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致工银瑞信基本面量化策略混合型证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报、结构和内容（包括披露），并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	徐艳 贺耀
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼16层
审计报告日期	2018年3月23日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：工银瑞信基本面量化策略混合型证券投资基金

报告截止日：2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	3,592,321.70	8,835,580.26
结算备付金		1,928,221.66	762,667.54
存出保证金		62,269.90	106,821.11
交易性金融资产	7.4.7.2	190,365,899.37	125,991,948.33
其中：股票投资		179,603,707.07	125,991,948.33
基金投资		-	-
债券投资		10,762,192.30	-
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	-	-
应收证券清算款		1,511,057.83	5,000,769.86
应收利息	7.4.7.5	157,798.49	2,555.39
应收股利		-	-
应收申购款		92,920.85	15,162.86
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		197,710,489.80	140,715,505.35
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 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		1,226,081.09	68.18
应付赎回款		219,643.05	278,005.92
应付管理人报酬		245,713.89	172,349.62
应付托管费		40,952.33	28,724.94
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	254,280.78	912,996.42
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	345,068.95	144,936.66
负债合计		2,331,740.09	1,537,081.74
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	85,569,797.74	72,374,693.53
未分配利润	7.4.7.10	109,808,951.97	66,803,730.08
所有者权益合计		195,378,749.71	139,178,423.61
负债和所有者权益总计		197,710,489.80	140,715,505.35

注：1、本基金基金合同生效日为 2012 年 4 月 26 日。

2、报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值为人民币 2.283 元，基金份额总额为 85,569,797.74 份。

7.2 利润表

会计主体：工银瑞信基本面量化策略混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	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
一、收入		34,836,875.14	-23,172,531.42
1. 利息收入		430,328.12	476,597.15
其中：存款利息收入	7.4.7.11	70,608.81	103,859.97
债券利息收入		142,713.51	165,186.19
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		217,005.80	207,550.99
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		24,150,672.17	-18,143,868.10
其中：股票投资收益	7.4.7.12	22,160,677.36	-19,781,718.90
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	93,568.20	6,480.00
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	1,896,426.61	1,631,370.80
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	10,201,698.73	-5,654,361.22
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-

5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	54,176.12	149,100.75
减：二、费用		4,833,727.90	8,198,380.31
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	2,570,243.62	2,792,117.53
2. 托管费	7.4.10.2.2	428,373.97	465,352.93
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	1,460,730.99	4,705,788.26
5. 利息支出		990.92	4,737.74
其中：卖出回购金融资产支出		990.92	4,737.74
6. 其他费用	7.4.7.20	373,388.40	230,383.85
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		30,003,147.24	-31,370,911.73
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		30,003,147.24	-31,370,911.73

注：本基金基金合同生效日为 2012 年 4 月 26 日。

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：工银瑞信基本面量化策略混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	72,374,693.53	66,803,730.08	139,178,423.61
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	30,003,147.24	30,003,147.24
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）	13,195,104.21	13,002,074.65	26,197,178.86
其中：1. 基金申购款	41,831,097.78	45,537,403.03	87,368,500.81
2. 基金赎回款	-28,635,993.57	-32,535,328.38	-61,171,321.95
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）	85,569,797.74	109,808,951.97	195,378,749.71
项目	上年度可比期间 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）	87,572,451.80	110,810,758.51	198,383,210.31
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-31,370,911.73	-31,370,911.73
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）	-15,197,758.27	-12,636,116.70	-27,833,874.97
其中：1. 基金申购款	55,064,366.23	51,779,617.40	106,843,983.63
2. 基金赎回款	-70,262,124.50	-64,415,734.10	-134,677,858.60
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）	72,374,693.53	66,803,730.08	139,178,423.61

注：本基金基金合同生效日为 2012 年 4 月 26 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：

<u>郭特华</u>	<u>赵紫英</u>	<u>朱辉毅</u>
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

工银瑞信基本面量化策略混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）（原名“工银瑞信基本面量化策略股票型证券投资基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2012]204号文《关于核准工银瑞信基本面量化策略股票型证券投资基金募集的批复》的批准，由工银瑞信基金管理有限公司向社会公开募集，基金合同于 2012 年 4 月 26 日正式生效，首次设立规模为 2,433,435,148.52 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。

本基金的基金管理人和注册登记机构均为工银瑞信基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金的投资范围限于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括创业板股票、中小板股票以及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、权证、中央银行票据、中期票据、银行存款、债券回购、资产支持证券，以及法律法规允许或经中国证监会批准允许基金投资的其它金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。其中，股票资产占基金资产的比例为 60%-95%，债券、现金等金融工具占基金资产的比例为 5%-40%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为： $80\% \times \text{中证 800 指数收益率} + 20\% \times \text{上证国债指数收益率}$ 。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息根据下列依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

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主要包括股票投资、债券投资和衍生工具等；

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

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

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有

转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债；

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

(1) 股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

卖出股票于成交日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(2) 债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

(3) 权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(4) 分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

(5) 回购协议

本基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的

有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的股票投资、债券投资和权证投资等投资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，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。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损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益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收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益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利得/（损失）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确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 衍生工具收益/（损失）于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(8) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公

司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(9) 公允价值变动收益/（损失）系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、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(10) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

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等费用在费用涵盖期间按基金合同或相关公告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则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 基金收益分配采用现金方式或红利再投资方式，基金份额持有人可自行选择收益分配方式；基金份额持有人事先未做出选择的，默认的分红方式为现金红利；选择红利再投资的，现金红利则按除权日经除权后的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；如投资者在不同销售机构选择的分红方式不同，注册登记机构将以投资者最后一次选择的分红方式为准；

(2) 每一基金份额享有同等分配权；

(3) 基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值，基金收益分配基准日即期末可供分配利润计算截止日；

(4) 在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益分配每年至多四次；每次基金收益分配比例不得低于期末可供分配利润的 30%。基金的收益分配比例以期末可供分配利润为基准计算，期末可供分配利润以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为准。基金合同生效不满三个月，可不进行收益分配；

(5) 基金红利发放日距离收益分配基准日的时间不超过 15 个工作日；

(6) 法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 分部报告

无。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

无。

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

无。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

7.4.5.3 差错更正的说明

无。

7.4.6 税项

7.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

7.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有

金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《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、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，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（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人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，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

7.4.6.3 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资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，股权的股息、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。

7.4.6.4 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《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》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按 25% 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；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《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》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

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 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
活期存款	3,592,321.70	8,835,580.26
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	3,592,321.70	8,835,580.26

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日

	成本	公允价值	公允价值变动
股票	169,384,041.18	179,603,707.07	10,219,665.89
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	806,100.00	815,192.30
	银行间市场	9,987,460.00	9,947,000.00
	合计	10,793,560.00	10,762,192.30
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	180,177,601.18	190,365,899.37	10,188,298.19
项目	上年度末 2016年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	126,005,348.87	125,991,948.33	-13,400.54
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	126,005,348.87	125,991,948.33	-13,400.54

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

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

无。

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 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
应收活期存款利息	639.82	2,125.16

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	954.85	377.43
应收债券利息	156,173.02	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	30.80	52.80
合计	157,798.49	2,555.39

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 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
交易所市场应付交易费用	254,157.81	912,821.42
银行间市场应付交易费用	122.97	175.00
合计	254,280.78	912,996.42

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	568.95	436.66
预提审计费	40,000.00	40,000.00
预提信息披露费	300,000.00	100,000.00
预提账户维护费	4,500.00	4,500.00
合计	345,068.95	144,936.66

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	72,374,693.53	72,374,693.53

本期申购	41,831,097.78	41,831,097.78
本期赎回（以“-”号填列）	-28,635,993.57	-28,635,993.57
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	85,569,797.74	85,569,797.74

注：如有相应情况，申购含红利再投、转换入份额及金额，赎回含转换出份额及金额。

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	86,212,256.97	-19,408,526.89	66,803,730.08
本期利润	19,801,448.51	10,201,698.73	30,003,147.24
本期基金份额交易产生的变动数	16,309,182.97	-3,307,108.32	13,002,074.65
其中：基金申购款	53,543,965.61	-8,006,562.58	45,537,403.03
基金赎回款	-37,234,782.64	4,699,454.26	-32,535,328.38
本期已分配利润	-	-	-
本期末	122,322,888.45	-12,513,936.48	109,808,951.97

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年12月31日	2016年1月1日至2016年12月31日
活期存款利息收入	54,034.98	69,681.24
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	15,621.29	31,200.84
其他	952.54	2,977.89
合计	70,608.81	103,859.97

7.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2017年1月1日至2017年12月31日	2016年1月1日至2016年12月31日
卖出股票成交总额	543,392,238.90	1,574,553,884.73
减：卖出股票成本总额	521,231,561.54	1,594,335,603.63
买卖股票差价收入	22,160,677.36	-19,781,718.90

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

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
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	93,568.20	6,480.00
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	93,568.20	6,480.00

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

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
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	1,030,840.20	17,946,894.10
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	937,000.00	17,708,910.00
减：应收利息总额	272.00	231,504.10
买卖债券差价收入	93,568.20	6,480.00

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

无。

7.4.7.14 贵金属投资收益

无。

7.4.7.15 衍生工具收益**7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

无。

7.4.7.15.2 衍生工具收益 ——其他投资收益

无。

7.4.7.16 股利收益

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
股票投资产生的股利收益	1,896,426.61	1,631,370.80
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	1,896,426.61	1,631,370.80

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	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
1. 交易性金融资产	10,201,698.73	-5,654,361.22
——股票投资	10,233,066.43	-5,653,581.22
——债券投资	-31,367.70	-780.00
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
合计	10,201,698.73	-5,654,361.22

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	39,400.64	125,425.04
其他	4,587.00	-
基金转换费收入	10,188.48	23,675.71
合计	54,176.12	149,100.75

7.4.7.19 交易费用

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
交易所市场交易费用	1,460,555.99	4,705,438.26
银行间市场交易费用	175.00	350.00
合计	1,460,730.99	4,705,788.26

7.4.7.20 其他费用

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
审计费用	40,000.00	40,000.00
信息披露费	300,000.00	150,000.00
账户维护费	18,000.00	18,000.00
银行费用	15,388.40	22,383.85
合计	373,388.40	230,383.85

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

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，除 7.4.6.2 增值税中披露的事项外，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
工银瑞信基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司	基金管理人股东、基金销售机构
瑞士信贷银行股份有限公司	基金管理人股东
工银瑞信资产管理（国际）有限公司	基金管理人的子公司
工银瑞信投资管理有限公司	基金管理人的子公司

注：以下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

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 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	2,570,243.62	2,792,117.53
其中：支付销售机构的客户维护费	914,396.65	742,743.75

注：1、基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.50% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

2、基金管理费每日计提，按月支付。

7.4.10.2.2 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	428,373.97	465,352.93

注：1、基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

2、基金托管费每日计提，按月支付。

7.4.10.2.3 销售服务费

无。

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

无。

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 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
中国银行股份有限公司	3,592,321.70	54,034.98	8,835,580.26	69,681.24

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末进行利润分配。

7.4.12 期末（2017 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
300664	鹏鹞环保	2017 年 12 月 28 日	2018 年 1 月 5 日	新股流通受限	8.88	8.88	3,640	32,323.20	32,323.20	-
603161	科华控股	2017 年 12 月 28 日	2018 年 1 月 5 日	新股流通受限	16.75	16.75	1,239	20,753.25	20,753.25	-
002923	润都股份	2017 年 12 月 28 日	2018 年 1 月 5 日	新股流通受限	17.01	17.01	954	16,227.54	16,227.54	-
603080	新疆火炬	2017 年 12 月 25 日	2018 年 1 月 3 日	新股流通受限	13.60	13.60	1,187	16,143.20	16,143.20	-

7.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
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：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
128024	宁行转债	2017 年 12 月 6 日	2018 年 1 月 12 日	新债流通受限	100.00	100.00	6,548	654,800.00	654,800.00	-
128029	太阳转债	2017 年 12 月 25 日	2018 年 1 月 16 日	新债流通受限	100.00	100.00	173	17,300.00	17,300.00	-

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
603986	兆易创新	2017年11月1日	重大事项	163.12	2018年3月2日	150.00	18,980	1,847,074.08	3,096,017.60	-
600309	万华化学	2017年12月5日	重大事项	37.94	-	-	16,599	496,034.86	629,766.06	-
601600	中国铝业	2017年9月12日	重大事项	6.67	2018年2月26日	7.28	20,700	88,389.00	138,069.00	指数法估值
600332	白云山	2017年10月31日	重大事项	32.14	2018年1月8日	30.15	4,200	119,254.55	134,988.00	-
600162	香江控股	2017年11月10日	重大事项	3.37	2018年1月12日	3.71	26,830	105,471.69	90,417.10	-
300730	科创信息	2017年12月25日	重大事项	41.55	2018年1月2日	45.71	821	6,863.56	34,112.55	-
002919	名臣健康	2017年12月28日	重大事项	35.26	2018年1月2日	38.79	821	10,311.76	28,948.46	-
000540	中天金融	2017年8月21日	重大事项	7.35	-	-	2,100	13,524.00	15,435.00	-
600150	中国船舶	2017年9月27日	重大事项	24.67	2018年3月21日	22.20	600	13,476.00	14,802.00	-
000006	深振业A	2017年9月11日	重大事项	9.85	2018年3月8日	8.87	1,300	11,063.00	12,805.00	-

注：本基金因重大事项停牌的股票中包含按指数收益法确定公允价值的长期停牌股票，该类股票估值采用中国证券业协会基金估值小组提供的估值方法，并于 2017 年 12 月 31 日对资产净值和

本期净利润的影响均为人民币-29,394.00 元。

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

本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

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

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人的风险管理机构由董事会下属的公司治理与风险控制委员会、督察长、公司风险管理委员会、法律合规部、风险管理部以及各个业务部门组成。

公司实行全面、系统的风险管理，风险管理覆盖公司所有战略环节、业务环节和操作环节。同时制定了系统化的风险管理程序，对风险管理的整个流程进行评估和改进。公司构建了分工明确、相互协作、彼此牵制的风险管理组织结构，形成了由四大防线共同筑成的风险管理体系：第一道防线由各个业务部门构成，各业务部门总监作为风险责任人，负责制订本部门的作业流程以及风险控制措施；第二道监控防线由公司专属风险管理部门法律合规部和风险管理部构成，法律合规部负责对公司业务的法律合规风险进行监控管理，风险管理部负责对公司投资管理风险和运作风险进行监控管理；第三道防线是由公司经营管理层和风险管理委员会构成，公司管理层通过执行委员会下的风险管理委员会对风险状况进行全面监督并及时制定相应的对策和实施监控措施；在上述这三道风险监控防线中，公司督察长和监察稽核人员对风险控制措施和合规风险情况进行全面检查、监督，并视所发生问题情节轻重及时反馈给各部门经理、公司总经理、公司治理与风险控制委员会、董事会、监管机构。督察长独立于公司其他业务部门和公司管理层，对内部控制制度的执行情况实行严格检查和及时反馈，并独立报告；第四道监控防线由董事会和公司治理与风险控制委员会构成，公司治理与风险控制委员会通过督察长和监察稽核人员的工作，掌握整体风险状况并进行决策。公司治理与风险控制委员会负责检查公司业务的内控制度的实施情

况，监督公司对相关法律法规和公司制度的执行。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而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金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级的债券投资。

7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
AAA	764,388.50	-
AAA 以下	50,803.80	-
未评级	-	-
合计	815,192.30	-

注：1、表中所列示的债券投资为除短期融资券以外的信用债券。

2、上述评级均取自第三方评级机构的债项评级。

3、本基金上年度末未持有按长期信用评级的债券投资。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除小部分流通受限证券外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

7.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金

融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	3,592,321.70	-	-	-	-	-	3,592,321.70
结算备付金	1,928,221.66	-	-	-	-	-	1,928,221.66
存出保证金	62,269.90	-	-	-	-	-	62,269.90
交易性金融资产	-	-	9,947,000.00	23,670.80	791,521.50	179,603,707.07	190,365,899.37
应收证券清算款	-	-	-	-	-	1,511,057.83	1,511,057.83
应收利息	-	-	-	-	-	157,798.49	157,798.49
应收申购款	-	-	-	-	-	92,920.85	92,920.85
资产总计	5,582,813.26	-	9,947,000.00	23,670.80	791,521.50	181,365,484.24	197,710,489.80
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	1,226,081.09	1,226,081.09
应付赎回款	-	-	-	-	-	219,643.05	219,643.05
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	245,713.89	245,713.89

应付托管费	-	-	-	-	-	40,952.33	40,952.33
应付交易费用	-	-	-	-	-	254,280.78	254,280.78
其他负债	-	-	-	-	-	345,068.95	345,068.95
负债总计	-	-	-	-	-	2,331,740.09	2,331,740.09
利率敏感度缺口	5,582,813.26	-9,947,000.00	23,670.80	791,521.50	179,033,744.15	195,378,749.71	
上年度末 2016年 12月31 日	1个月以内	1-3 个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	8,835,580.26	-	-	-	-	-	8,835,580.26
结算备付金	762,667.54	-	-	-	-	-	762,667.54
存出保证金	106,821.11	-	-	-	-	-	106,821.11
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-125,991,948.33	125,991,948.33
应收证券清算款	-	-	-	-	-	5,000,769.86	5,000,769.86
应收利息	-	-	-	-	-	2,555.39	2,555.39
应收申购款	-	-	-	-	-	15,162.86	15,162.86
资产总计	9,705,068.91	-	-	-	-	-131,010,436.44	140,715,505.35
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	68.18	68.18
应付赎回款	-	-	-	-	-	278,005.92	278,005.92
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	172,349.62	172,349.62

应付托管费	-	-	-	-	28,724.94	28,724.94
应付交易费用	-	-	-	-	912,996.42	912,996.42
其他负债	-	-	-	-	144,936.66	144,936.66
负债总计	-	-	-	-	1,537,081.74	1,537,081.74
利率敏感度缺口	9,705,068.91	-	-	-	-129,473,354.70	139,178,423.61

注：表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	该利率敏感性分析基于本基金报表日的利率风险状况；		
	假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他变量不变；		
	此项影响并未考虑管理层为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。		
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（2017 年 12 月 31 日）	上年度末（2016 年 12 月 31 日）
	利率增加 25 基准点	-25,361.30	-
	利率减少 25 基准点	25,592.26	-

注：本基金上年度末未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

7.4.13.4.2 外汇风险

无。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

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 2017 年 12 月 31 日		上年度末 2016 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	179,603,707.07	91.93	125,991,948.33	90.53
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	10,762,192.30	5.51	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	190,365,899.37	97.43	125,991,948.33	90.53

注：1、基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 60%-95%，债券、现金等金融工具占基金资产的比例为 5%-40%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

2、由于四舍五入的原因公允价值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定本基金的业绩比较基准变化 5%，其他变量不变；		
	用期末时点比较基准浮动 5%基金资产净值相应变化来估测组合市场价格风险；		
	Beta 系数是根据组合的净值数据和基准指数数据回归得出，反映了基金和基准的相关性。		
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（2017 年 12 月 31 日）	上年度末（2016 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准增加 5%	13,108,349.49	9,405,069.67
业绩比较基准减少 5%	-13,108,349.49	-9,405,069.67	

7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

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 公允价值

本基金非以公允价值计量的金融工具，因其剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

(1) 各层次金融工具公允价值

本基金本报告期末持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 175,465,991.41 元，属于第二层次的余额为人民币 14,899,907.96 元，属于第三层次的余额为人民币 0.00 元（上年度末：第一层次人民币 114,409,143.98 元，第二层次人民币 11,582,804.85 元，第三层次人民币 0.00 元）。

(2) 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可转换债券等证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关证券的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的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，确定相关证券公允价值应属第二层次或第三层次。本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。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（上年度：无）。

7.4.14.2 承诺事项

无。

7.4.14.3 其他事项

无。

§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	179,603,707.07	90.84
	其中：股票	179,603,707.07	90.84
2	固定收益投资	10,762,192.30	5.44
	其中：债券	10,762,192.30	5.44
	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	5,520,543.36	2.79
7	其他各项资产	1,824,047.07	0.92
8	合计	197,710,489.80	100.00

注：由于四舍五入的原因金额占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

8.2 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

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	28,404.54	0.01
B	采矿业	7,978,920.87	4.08
C	制造业	96,469,540.92	49.38
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	956,778.80	0.49
E	建筑业	2,378,764.56	1.22
F	批发和零售业	3,234,130.16	1.66
G	交通运输、仓储和邮政业	5,229,323.84	2.68
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,703,729.61	4.97
J	金融业	30,517,574.75	15.62
K	房地产业	8,203,461.44	4.20

L	租赁和商务服务业	9,813,393.04	5.02
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	372,221.72	0.19
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	12,731.18	0.01
R	文化、体育和娱乐业	4,695,448.80	2.40
S	综合	9,282.84	0.00
	合计	179,603,707.07	91.93

注：由于四舍五入的原因公允价值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

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	002027	分众传媒	696,558	9,807,536.64	5.02
2	600183	生益科技	465,120	8,027,971.20	4.11
3	000333	美的集团	129,812	7,195,479.16	3.68
4	000423	东阿阿胶	105,531	6,360,353.37	3.26
5	000651	格力电器	131,421	5,743,097.70	2.94
6	600188	兖州煤业	375,665	5,454,655.80	2.79
7	000567	海德股份	184,668	4,432,032.00	2.27
8	002179	中航光电	110,337	4,345,071.06	2.22
9	600176	中国巨石	248,800	4,052,952.00	2.07
10	600115	东方航空	457,700	3,757,717.00	1.92
11	002410	广联达	189,125	3,706,850.00	1.90
12	601169	北京银行	484,299	3,462,737.85	1.77
13	002582	好想你	275,689	3,225,561.30	1.65
14	600519	贵州茅台	4,557	3,178,461.93	1.63
15	000915	山大华特	103,010	3,104,721.40	1.59
16	603986	兆易创新	18,980	3,096,017.60	1.58
17	300373	扬杰科技	103,153	3,091,495.41	1.58
18	600016	民生银行	358,088	3,004,358.32	1.54
19	601166	兴业银行	176,071	2,991,446.29	1.53
20	300059	东方财富	208,309	2,697,601.55	1.38

21	600036	招商银行	92,640	2,688,412.80	1.38
22	600197	伊力特	105,900	2,480,178.00	1.27
23	000001	平安银行	186,327	2,478,149.10	1.27
24	601318	中国平安	35,407	2,477,781.86	1.27
25	002142	宁波银行	134,173	2,389,621.13	1.22
26	002343	慈文传媒	64,336	2,291,004.96	1.17
27	600570	恒生电子	48,206	2,236,758.40	1.14
28	002048	宁波华翔	87,342	2,078,739.60	1.06
29	000858	五粮液	25,864	2,066,016.32	1.06
30	601009	南京银行	266,338	2,061,456.12	1.06
31	601939	建设银行	268,399	2,061,304.32	1.06
32	000895	双汇发展	75,800	2,008,700.00	1.03
33	300251	光线传媒	190,500	1,990,725.00	1.02
34	600409	三友化工	202,600	1,942,934.00	0.99
35	000975	银泰资源	128,375	1,715,090.00	0.88
36	000963	华东医药	31,400	1,691,832.00	0.87
37	601336	新华保险	22,865	1,605,123.00	0.82
38	002043	兔宝宝	121,242	1,486,426.92	0.76
39	600585	海螺水泥	45,061	1,321,639.13	0.68
40	603989	艾华集团	32,800	1,260,176.00	0.64
41	600887	伊利股份	38,600	1,242,534.00	0.64
42	000568	泸州老窖	18,314	1,208,724.00	0.62
43	600885	宏发股份	28,400	1,174,908.00	0.60
44	300285	国瓷材料	57,812	1,156,240.00	0.59
45	600056	中国医药	45,857	1,141,380.73	0.58
46	002705	新宝股份	79,587	978,124.23	0.50
47	601058	赛轮金宇	242,255	874,540.55	0.45
48	600667	太极实业	93,500	837,760.00	0.43
49	601288	农业银行	204,366	782,721.78	0.40
50	002051	中工国际	37,275	686,978.25	0.35
51	000703	恒逸石化	31,700	683,769.00	0.35
52	002372	伟星新材	36,277	652,260.46	0.33
53	600309	万华化学	16,599	629,766.06	0.32
54	600690	青岛海尔	30,590	576,315.60	0.29
55	600030	中信证券	31,100	562,910.00	0.29
56	000725	京东方A	96,300	557,577.00	0.29
57	601601	中国太保	12,896	534,152.32	0.27
58	600000	浦发银行	41,800	526,262.00	0.27
59	000002	万科A	16,750	520,255.00	0.27

60	000596	古井贡酒	7,744	508,548.48	0.26
61	600487	亨通光电	12,500	505,250.00	0.26
62	300661	圣邦股份	5,200	489,840.00	0.25
63	300443	金雷风电	28,000	471,240.00	0.24
64	600048	保利地产	32,400	458,460.00	0.23
65	601998	中信银行	67,100	416,020.00	0.21
66	601229	上海银行	28,260	400,726.80	0.21
67	601233	桐昆股份	17,599	395,801.51	0.20
68	002493	荣盛石化	26,331	377,849.85	0.19
69	600019	宝钢股份	43,714	377,688.96	0.19
70	600346	恒力股份	29,900	368,667.00	0.19
71	002304	洋河股份	3,200	368,000.00	0.19
72	601006	大秦铁路	39,817	361,140.19	0.18
73	600703	三安光电	13,500	342,765.00	0.18
74	601390	中国中铁	39,800	333,922.00	0.17
75	600741	华域汽车	10,900	323,621.00	0.17
76	601628	中国人寿	10,581	322,191.45	0.16
77	600015	华夏银行	35,600	320,400.00	0.16
78	600383	金地集团	25,348	320,145.24	0.16
79	000338	潍柴动力	37,500	312,750.00	0.16
80	601088	中国神华	13,400	310,478.00	0.16
81	601155	新城控股	10,400	304,720.00	0.16
82	600031	三一重工	33,100	300,217.00	0.15
83	000425	徐工机械	63,700	294,931.00	0.15
84	300070	碧水源	16,200	281,394.00	0.14
85	600362	江西铜业	13,900	280,363.00	0.14
86	600066	宇通客车	11,400	274,398.00	0.14
87	002078	太阳纸业	29,400	272,832.00	0.14
88	000039	中集集团	11,808	269,812.80	0.14
89	000671	阳光城	34,200	269,154.00	0.14
90	002916	深南电路	3,068	267,621.64	0.14
91	600795	国电电力	85,601	267,075.12	0.14
92	600522	中天科技	18,814	262,267.16	0.13
93	601225	陕西煤业	32,100	261,936.00	0.13
94	002146	荣盛发展	27,386	260,988.58	0.13
95	600325	华发股份	35,160	258,777.60	0.13
96	601669	中国电建	35,800	258,476.00	0.13
97	000153	丰原药业	32,600	257,866.00	0.13
98	601111	中国国航	20,745	255,578.40	0.13

99	600886	国投电力	34,626	254,154.84	0.13
100	002440	闰土股份	12,900	254,001.00	0.13
101	002405	四维图新	9,600	253,344.00	0.13
102	600893	航发动力	9,400	252,954.00	0.13
103	603885	吉祥航空	16,500	252,285.00	0.13
104	002241	歌尔股份	14,500	251,575.00	0.13
105	600606	绿地控股	34,459	251,550.70	0.13
106	600688	上海石化	39,321	248,901.93	0.13
107	002415	海康威视	6,350	247,650.00	0.13
108	601222	林洋能源	24,406	247,476.84	0.13
109	000513	丽珠集团	3,720	247,194.00	0.13
110	601377	兴业证券	33,793	246,013.04	0.13
111	000060	中金岭南	21,700	242,389.00	0.12
112	600705	中航资本	43,800	241,776.00	0.12
113	600566	济川药业	6,320	241,108.00	0.12
114	002092	中泰化学	18,000	239,580.00	0.12
115	600219	南山铝业	64,700	238,096.00	0.12
116	600208	新湖中宝	45,500	237,510.00	0.12
117	601877	正泰电器	9,000	235,350.00	0.12
118	000999	华润三九	8,618	234,409.60	0.12
119	600068	葛洲坝	28,500	233,700.00	0.12
120	000429	粤高速 A	28,630	232,189.30	0.12
121	600153	建发股份	20,845	231,796.40	0.12
122	002635	安洁科技	8,840	230,635.60	0.12
123	600588	用友网络	10,800	228,420.00	0.12
124	601678	滨化股份	28,100	228,172.00	0.12
125	601231	环旭电子	14,382	226,804.14	0.12
126	600584	长电科技	10,600	226,098.00	0.12
127	000830	鲁西化工	14,100	224,472.00	0.11
128	002648	卫星石化	13,500	224,100.00	0.11
129	600466	蓝光发展	23,700	221,595.00	0.11
130	600177	雅戈尔	24,049	220,529.33	0.11
131	000728	国元证券	19,800	217,800.00	0.11
132	000528	柳 工	25,500	217,515.00	0.11
133	600507	方大特钢	16,900	214,461.00	0.11
134	600511	国药股份	7,700	214,060.00	0.11
135	002713	东易日盛	9,000	213,210.00	0.11
136	600079	人福医药	11,900	212,296.00	0.11
137	600477	杭萧钢构	19,710	210,305.70	0.11

138	000581	威孚高科	8,700	208,800.00	0.11
139	000876	新希望	28,000	208,600.00	0.11
140	600170	上海建工	55,900	207,948.00	0.11
141	600498	烽火通信	7,200	207,576.00	0.11
142	000402	金融街	18,500	205,535.00	0.11
143	601928	凤凰传媒	25,303	205,207.33	0.11
144	600919	江苏银行	27,800	204,330.00	0.10
145	600729	重庆百货	8,100	202,986.00	0.10
146	000776	广发证券	12,100	201,828.00	0.10
147	600612	老凤祥	4,900	201,684.00	0.10
148	000951	中国重汽	11,500	200,445.00	0.10
149	002185	华天科技	23,500	200,220.00	0.10
150	600966	博汇纸业	33,300	199,800.00	0.10
151	600420	现代制药	15,700	199,704.00	0.10
152	000666	经纬纺机	10,184	197,773.28	0.10
153	600479	千金药业	14,100	197,682.00	0.10
154	002195	二三四五	33,600	196,224.00	0.10
155	002091	江苏国泰	21,812	195,653.64	0.10
156	002385	大北农	32,200	195,132.00	0.10
157	600449	宁夏建材	17,200	195,048.00	0.10
158	600004	白云机场	13,135	193,084.50	0.10
159	600582	天地科技	41,400	192,510.00	0.10
160	600998	九州通	10,115	191,679.25	0.10
161	002354	天神娱乐	11,200	191,520.00	0.10
162	601098	中南传媒	13,672	189,904.08	0.10
163	000898	鞍钢股份	29,900	189,865.00	0.10
164	000501	鄂武商A	11,700	186,732.00	0.10
165	000921	海信科龙	13,400	186,528.00	0.10
166	600390	五矿资本	15,800	186,440.00	0.10
167	002088	鲁阳节能	14,300	185,042.00	0.09
168	000780	*ST平能	36,800	183,632.00	0.09
169	600011	华能国际	29,600	182,632.00	0.09
170	002920	德赛西威	4,569	178,784.97	0.09
171	000059	华锦股份	17,900	170,587.00	0.09
172	002737	葵花药业	5,500	169,510.00	0.09
173	600027	华电国际	43,947	163,043.37	0.08
174	002087	新野纺织	27,600	160,632.00	0.08
175	000050	深天马A	7,938	156,457.98	0.08
176	601600	中国铝业	20,700	138,069.00	0.07

177	600332	白云山	4,200	134,988.00	0.07
178	600581	八一钢铁	8,700	118,842.00	0.06
179	000065	北方国际	5,408	98,425.60	0.05
180	600859	王府井	4,800	97,920.00	0.05
181	600162	香江控股	26,830	90,417.10	0.05
182	601668	中国建筑	8,789	79,276.78	0.04
183	601012	隆基股份	2,135	77,799.40	0.04
184	600682	南京新百	2,000	75,580.00	0.04
185	603919	金徽酒	3,780	68,229.00	0.03
186	603608	天创时尚	4,796	53,907.04	0.03
187	600085	同仁堂	1,664	53,647.36	0.03
188	300735	光弘科技	3,575	51,444.25	0.03
189	300136	信维通信	900	45,630.00	0.02
190	000418	小天鹅 A	664	45,052.40	0.02
191	601818	光大银行	10,450	42,322.50	0.02
192	002230	科大讯飞	670	39,623.80	0.02
193	600872	中炬高新	1,584	39,219.84	0.02
194	002597	金禾实业	1,490	38,620.80	0.02
195	600377	宁沪高速	3,917	38,582.45	0.02
196	002915	中欣氟材	1,085	38,181.15	0.02
197	603477	振静股份	1,955	37,027.70	0.02
198	600029	南方航空	3,066	36,546.72	0.02
199	600900	长江电力	2,314	36,075.26	0.02
200	600350	山东高速	5,873	35,179.27	0.02
201	002074	国轩高科	1,569	34,925.94	0.02
202	000910	大亚圣象	1,525	34,922.50	0.02
203	300730	科创信息	821	34,112.55	0.02
204	002050	三花智控	1,855	34,020.70	0.02
205	300664	鹏鹞环保	3,640	32,323.20	0.02
206	600801	华新水泥	2,213	31,269.69	0.02
207	000538	云南白药	298	30,333.42	0.02
208	600702	沱牌舍得	645	30,095.70	0.02
209	000069	华侨城 A	3,496	29,681.04	0.02
210	601607	上海医药	1,223	29,584.37	0.02
211	002919	名臣健康	821	28,948.46	0.01
212	001979	招商蛇口	1,467	28,694.52	0.01
213	000786	北新建材	1,233	27,742.50	0.01
214	600837	海通证券	2,100	27,027.00	0.01
215	600808	马钢股份	6,223	25,700.99	0.01

216	002008	大族激光	510	25,194.00	0.01
217	300033	同花顺	462	23,090.76	0.01
218	600641	万业企业	1,662	22,270.80	0.01
219	600398	海澜之家	2,294	22,251.80	0.01
220	002922	伊戈尔	1,245	22,248.15	0.01
221	002589	瑞康医药	1,654	22,246.30	0.01
222	601211	国泰君安	1,200	22,224.00	0.01
223	601567	三星医疗	2,258	21,902.60	0.01
224	002202	金风科技	1,137	21,432.45	0.01
225	603161	科华控股	1,239	20,753.25	0.01
226	601117	中国化学	3,050	20,587.50	0.01
227	002294	信立泰	450	20,335.50	0.01
228	000826	启迪桑德	615	20,307.30	0.01
229	002456	欧菲科技	975	20,075.25	0.01
230	002311	海大集团	850	19,890.00	0.01
231	002714	牧原股份	375	19,822.50	0.01
232	603283	赛腾股份	1,349	19,614.46	0.01
233	002003	伟星股份	1,692	19,373.40	0.01
234	600761	安徽合力	1,797	18,904.44	0.01
235	000400	许继电气	1,430	18,861.70	0.01
236	002032	苏泊尔	454	18,332.52	0.01
237	603329	上海雅仕	1,183	17,957.94	0.01
238	601997	贵阳银行	1,332	17,795.52	0.01
239	600548	深高速	1,981	17,789.38	0.01
240	600373	中文传媒	1,047	17,725.71	0.01
241	600282	南钢股份	3,614	17,491.76	0.01
242	000042	中洲控股	1,059	17,187.57	0.01
243	600518	康美药业	765	17,105.40	0.01
244	600742	一汽富维	1,036	17,104.36	0.01
245	601636	旗滨集团	2,725	17,004.00	0.01
246	601899	紫金矿业	3,584	16,450.56	0.01
247	600597	光明乳业	1,074	16,271.10	0.01
248	002923	润都股份	954	16,227.54	0.01
249	002533	金杯电工	2,406	16,216.44	0.01
250	601933	永辉超市	1,605	16,210.50	0.01
251	603080	新疆火炬	1,187	16,143.20	0.01
252	002543	万和电气	689	15,764.32	0.01
253	600340	华夏幸福	500	15,695.00	0.01
254	000100	TCL 集团	3,976	15,506.40	0.01

255	000540	中天金融	2,100	15,435.00	0.01
256	600297	广汇汽车	1,900	15,238.00	0.01
257	600496	精工钢构	3,613	15,210.73	0.01
258	300124	汇川技术	521	15,119.42	0.01
259	600150	中国船舶	600	14,802.00	0.01
260	002244	滨江集团	1,850	14,707.50	0.01
261	600967	内蒙一机	1,200	14,460.00	0.01
262	300212	易华录	531	14,390.10	0.01
263	600446	金证股份	930	14,080.20	0.01
264	600298	安琪酵母	424	13,873.28	0.01
265	601788	光大证券	1,033	13,873.19	0.01
266	002019	亿帆医药	616	13,706.00	0.01
267	000488	晨鸣纸业	800	13,336.00	0.01
268	600547	山东黄金	418	13,033.24	0.01
269	603328	依顿电子	900	12,915.00	0.01
270	600781	辅仁药业	561	12,897.39	0.01
271	300287	飞利信	1,740	12,893.40	0.01
272	300219	鸿利智汇	1,141	12,813.43	0.01
273	000006	深振业 A	1,300	12,805.00	0.01
274	300244	迪安诊断	539	12,731.18	0.01
275	600021	上海电力	1,369	12,512.66	0.01
276	600388	龙净环保	715	12,369.50	0.01
277	600637	东方明珠	732	12,195.12	0.01
278	300113	顺网科技	642	11,742.18	0.01
279	300308	中际旭创	200	11,700.00	0.01
280	600755	厦门国贸	1,147	11,584.70	0.01
281	603766	隆鑫通用	1,650	11,583.00	0.01
282	300684	中石科技	827	11,528.38	0.01
283	000726	鲁泰 A	1,050	11,497.50	0.01
284	002636	金安国纪	700	11,081.00	0.01
285	002268	卫士通	469	10,796.38	0.01
286	601800	中国交建	825	10,560.00	0.01
287	600035	楚天高速	2,000	10,420.00	0.01
288	600879	航天电子	1,306	10,239.04	0.01
289	601618	中国中冶	2,100	10,164.00	0.01
290	000063	中兴通讯	275	9,999.00	0.01
291	600823	世茂股份	2,000	9,880.00	0.01
292	600090	同济堂	1,250	9,862.50	0.01
293	601666	平煤股份	1,554	9,790.20	0.01

294	002626	金达威	506	9,472.32	0.00
295	000901	航天科技	400	9,344.00	0.00
296	600455	博通股份	258	9,282.84	0.00
297	002475	立讯精密	393	9,211.92	0.00
298	600166	福田汽车	3,240	9,104.40	0.00
299	600995	文山电力	1,000	9,100.00	0.00
300	300017	网宿科技	843	8,969.52	0.00
301	600997	开滦股份	1,450	8,932.00	0.00
302	002001	新和成	233	8,867.98	0.00
303	600075	新疆天业	1,136	8,826.72	0.00
304	600528	中铁工业	727	8,825.78	0.00
305	300429	强力新材	371	8,811.25	0.00
306	300458	全志科技	303	8,623.38	0.00
307	600593	大连圣亚	307	8,516.18	0.00
308	600738	兰州民百	1,066	8,410.74	0.00
309	603655	朗博科技	881	8,193.30	0.00
310	002236	大华股份	353	8,150.77	0.00
311	600213	亚星客车	751	8,013.17	0.00
312	601633	长城汽车	697	8,008.53	0.00
313	600980	北矿科技	510	7,986.60	0.00
314	600444	国机通用	502	7,796.06	0.00
315	601766	中国中车	638	7,726.18	0.00
316	601258	庞大集团	3,057	7,642.50	0.00
317	600073	上海梅林	928	7,535.36	0.00
318	300115	长盈精密	375	7,526.25	0.00
319	600448	华纺股份	1,350	7,465.50	0.00
320	600312	平高电气	738	7,372.62	0.00
321	600605	汇通能源	541	7,357.60	0.00
322	600385	山东金泰	558	7,064.28	0.00
323	600898	国美通讯	586	6,973.40	0.00
324	000911	南宁糖业	736	6,888.96	0.00
325	601727	上海电气	1,012	6,770.28	0.00
326	600560	金白天正	648	6,739.20	0.00
327	000635	英力特	462	6,712.86	0.00
328	000028	国药一致	109	6,567.25	0.00
329	600731	湖南海利	919	6,515.71	0.00
330	600561	江西长运	792	6,494.40	0.00
331	600299	安迪苏	626	6,328.86	0.00
332	300029	天龙光电	820	6,273.00	0.00

333	000878	云南铜业	425	6,030.75	0.00
334	002624	完美世界	180	6,022.80	0.00
335	000718	苏宁环球	1,371	5,936.43	0.00
336	600778	友好集团	962	5,800.86	0.00
337	600782	新钢股份	850	5,593.00	0.00
338	600540	*ST 新赛	1,087	5,348.04	0.00
339	002567	唐人神	633	4,899.42	0.00
340	601688	华泰证券	275	4,746.50	0.00
341	601168	西部矿业	575	4,715.00	0.00
342	000938	紫光股份	61	4,393.83	0.00
343	300433	蓝思科技	143	4,268.55	0.00
344	600816	安信信托	317	4,146.36	0.00
345	600971	恒源煤电	375	3,911.25	0.00
346	600875	东方电气	325	3,649.75	0.00
347	002024	苏宁易购	295	3,625.55	0.00
348	000761	本钢板材	625	3,250.00	0.00
349	600598	北大荒	300	3,234.00	0.00
350	600380	健康元	283	3,166.77	0.00
351	601985	中国核电	425	3,123.75	0.00
352	601866	中远海发	908	3,096.28	0.00
353	600252	中恒集团	700	3,073.00	0.00
354	600221	海航控股	950	3,030.50	0.00
355	000415	渤海金控	515	2,966.40	0.00
356	600415	小商品城	500	2,890.00	0.00
357	000413	东旭光电	300	2,814.00	0.00
358	600236	桂冠电力	485	2,788.75	0.00
359	000959	首钢股份	450	2,691.00	0.00
360	600376	首开股份	282	2,619.78	0.00
361	600873	梅花生物	506	2,610.96	0.00
362	600067	冠城大通	400	2,608.00	0.00
363	002790	瑞尔特	98	2,602.88	0.00
364	600026	中远海能	425	2,601.00	0.00
365	000883	湖北能源	549	2,541.87	0.00
366	000716	黑芝麻	447	2,503.20	0.00
367	600583	海油工程	406	2,496.90	0.00
368	601000	唐山港	526	2,477.46	0.00
369	000755	*ST 三维	363	2,475.66	0.00
370	600835	上海机电	101	2,474.50	0.00
371	600062	华润双鹤	96	2,376.00	0.00

372	600675	中华企业	375	2,325.00	0.00
373	002341	新纶科技	84	2,310.00	0.00
374	600210	紫江企业	470	2,237.20	0.00
375	601991	大唐发电	534	2,216.10	0.00
376	600642	申能股份	378	2,215.08	0.00
377	600418	江淮汽车	226	2,137.96	0.00
378	000768	中航飞机	126	2,128.14	0.00
379	600020	中原高速	425	2,065.50	0.00
380	601808	中海油服	182	1,921.92	0.00
381	600578	京能电力	504	1,864.80	0.00
382	000997	新大陆	100	1,793.00	0.00
383	600739	辽宁成大	100	1,760.00	0.00
384	002439	启明星辰	71	1,657.85	0.00
385	600986	科达股份	150	1,644.00	0.00
386	600683	京投发展	287	1,627.29	0.00
387	300450	先导智能	28	1,595.16	0.00
388	000987	越秀金控	150	1,477.50	0.00
389	600888	新疆众和	211	1,420.03	0.00
390	601158	重庆水务	200	1,292.00	0.00
391	601018	宁波港	205	1,088.55	0.00
392	600100	同方股份	92	901.60	0.00
393	000673	当代东方	67	881.72	0.00
394	002426	胜利精密	144	839.52	0.00
395	601101	昊华能源	100	810.00	0.00
396	000030	富奥股份	79	640.69	0.00
397	000912	*ST 天化	17	98.26	0.00
398	300224	正海磁材	6	57.36	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	002027	分众传媒	17,972,206.02	12.91
2	002074	国轩高科	17,611,979.24	12.65
3	600183	生益科技	14,643,047.22	10.52

4	601169	北京银行	10,339,236.20	7.43
5	600446	金证股份	8,824,924.96	6.34
6	000567	海德股份	8,710,338.46	6.26
7	000423	东阿阿胶	8,546,327.80	6.14
8	300059	东方财富	8,477,200.00	6.09
9	601166	兴业银行	8,378,635.00	6.02
10	000333	美的集团	8,208,199.00	5.90
11	002460	赣锋锂业	8,165,828.00	5.87
12	000651	格力电器	8,159,686.43	5.86
13	600019	宝钢股份	8,035,359.00	5.77
14	300496	中科创达	8,015,650.17	5.76
15	603986	兆易创新	7,000,916.00	5.03
16	002466	天齐锂业	6,909,369.00	4.96
17	600016	民生银行	6,898,956.00	4.96
18	002410	广联达	6,863,174.21	4.93
19	002179	中航光电	6,552,222.70	4.71
20	000001	平安银行	6,193,275.00	4.45
21	002343	慈文传媒	6,127,499.00	4.40
22	600188	兖州煤业	5,909,373.00	4.25
23	601009	南京银行	5,899,057.67	4.24
24	002439	启明星辰	5,773,272.12	4.15
25	600570	恒生电子	5,674,181.00	4.08
26	000065	北方国际	5,410,950.38	3.89
27	601222	林洋能源	5,403,006.36	3.88
28	601318	中国平安	5,253,049.00	3.77
29	601058	赛轮金宇	5,055,189.00	3.63
30	600036	招商银行	4,965,617.96	3.57
31	002142	宁波银行	4,943,219.70	3.55
32	000970	中科三环	4,929,981.81	3.54
33	300033	同花顺	4,765,645.00	3.42
34	002281	光迅科技	4,743,850.31	3.41
35	300373	扬杰科技	4,654,032.58	3.34
36	601336	新华保险	4,472,980.12	3.21
37	603799	华友钴业	4,424,913.00	3.18
38	300224	正海磁材	4,393,310.00	3.16
39	300302	同有科技	4,331,146.99	3.11

40	300014	亿纬锂能	4,280,186.00	3.08
41	002582	好想你	4,267,751.74	3.07
42	002635	安洁科技	4,173,021.27	3.00
43	601668	中国建筑	4,084,247.00	2.93
44	000636	风华高科	4,025,077.43	2.89
45	002048	宁波华翔	3,939,008.60	2.83
46	000915	山大华特	3,903,957.98	2.81
47	600176	中国巨石	3,877,338.00	2.79
48	600197	伊力特	3,746,770.52	2.69
49	600115	东方航空	3,684,047.00	2.65
50	600585	海螺水泥	3,465,378.57	2.49
51	300450	先导智能	3,418,757.52	2.46
52	601939	建设银行	3,302,692.00	2.37
53	300285	国瓷材料	3,289,823.00	2.36
54	600438	通威股份	3,276,495.00	2.35
55	000858	五粮液	3,254,351.47	2.34
56	300236	上海新阳	3,156,349.40	2.27
57	600519	贵州茅台	3,049,686.00	2.19
58	002458	益生股份	2,913,151.00	2.09
59	002234	民和股份	2,859,306.60	2.05

注：1、买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票；

2、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	002074	国轩高科	16,897,773.58	12.14
2	002027	分众传媒	12,196,075.64	8.76
3	002460	赣锋锂业	9,460,486.72	6.80
4	300496	中科创达	8,579,500.00	6.16
5	600183	生益科技	8,225,831.73	5.91
6	600446	金证股份	8,186,601.09	5.88
7	002466	天齐锂业	8,069,019.54	5.80
8	600019	宝钢股份	7,864,523.06	5.65

9	601169	北京银行	7,562,474.51	5.43
10	002635	安洁科技	7,552,886.23	5.43
11	002439	启明星辰	7,519,238.60	5.40
12	000538	云南白药	7,334,558.67	5.27
13	300059	东方财富	6,557,188.39	4.71
14	000970	中科三环	6,468,246.25	4.65
15	300302	同有科技	6,228,507.36	4.48
16	601222	林洋能源	5,937,778.27	4.27
17	300033	同花顺	5,814,704.00	4.18
18	002456	欧菲科技	5,811,912.31	4.18
19	601166	兴业银行	5,782,031.03	4.15
20	000651	格力电器	5,764,932.32	4.14
21	601668	中国建筑	5,682,849.96	4.08
22	603986	兆易创新	5,281,878.72	3.80
23	601058	赛轮金宇	5,130,517.57	3.69
24	000065	北方国际	5,081,653.93	3.65
25	000636	风华高科	4,927,041.85	3.54
26	300136	信维通信	4,920,333.02	3.54
27	601009	南京银行	4,898,347.29	3.52
28	002142	宁波银行	4,830,153.43	3.47
29	603799	华友钴业	4,528,600.49	3.25
30	002281	光迅科技	4,435,304.50	3.19
31	300014	亿纬锂能	4,416,054.12	3.17
32	002343	慈文传媒	4,379,977.57	3.15
33	600155	宝硕股份	4,363,555.21	3.14
34	300224	正海磁材	4,278,749.17	3.07
35	000001	平安银行	4,251,731.75	3.05
36	600056	中国医药	4,229,819.00	3.04
37	000567	海德股份	4,162,790.63	2.99
38	601318	中国平安	3,926,136.92	2.82
39	300327	中颖电子	3,761,938.12	2.70
40	300450	先导智能	3,697,515.48	2.66
41	600438	通威股份	3,682,419.44	2.65
42	002410	广联达	3,641,635.06	2.62
43	300236	上海新阳	3,562,226.24	2.56
44	002567	唐人神	3,533,767.89	2.54
45	600570	恒生电子	3,451,737.03	2.48
46	600016	民生银行	3,398,795.79	2.44

47	002179	中航光电	3,323,870.44	2.39
48	300458	全志科技	3,280,632.78	2.36
49	002458	益生股份	3,170,300.31	2.28
50	600036	招商银行	3,131,673.33	2.25
51	002230	科大讯飞	3,007,634.14	2.16
52	600585	海螺水泥	2,952,009.30	2.12
53	601336	新华保险	2,928,152.15	2.10
54	300285	国瓷材料	2,927,167.97	2.10

注：1、卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票；

2、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	564,610,253.85
卖出股票收入（成交）总额	543,392,238.90

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	9,947,000.00	5.09
	其中：政策性金融债	9,947,000.00	5.09
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	815,192.30	0.42
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	10,762,192.30	5.51

注：由于四舍五入的原因公允价值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	170410	17 农发 10	100,000	9,947,000.00	5.09
2	128024	宁行转债	6,548	654,800.00	0.34
3	113011	光大转债	1,050	109,588.50	0.06
4	113015	隆基转债	220	26,050.20	0.01
5	128029	太阳转债	173	17,300.00	0.01

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投资。

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

本基金本报告期末未持有股指期货投资，也无期间损益。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本报告期内，本基金未运用股指期货进行投资。

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

本报告期内，本基金未运用国债期货进行投资。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货投资，也无期间损益。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本报告期内，本基金未运用国债期货进行投资。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期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、处罚的投资决策程序说明：

分众传媒

本报告期，本基金持有分众传媒，其发行主体因部分临时报告信息未披露、披露不及时、不完整，2015 年年报信息披露存在遗漏、未在股东大会授权范围内购买银行理财产品等违规行为，被中国证监会广东监管局采取出具警示函的监管措施。

上述情形对上市公司的财务和经营状况无重大影响，投资决策流程符合基金管理人的制度要求。

8.12.2 本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	62,269.90
2	应收证券清算款	1,511,057.83
3	应收股利	-
4	应收利息	157,798.49
5	应收申购款	92,920.85
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,824,047.07

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113011	光大转债	109,588.50	0.06

注：上表包含期末持有的处于转股期的可转换债券和可交换债券明细。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§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	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
6,897	12,406.81	13,032,411.72	15.23%	72,537,386.02	84.77%

9.2 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	507,598.16	0.59%

9.3 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的情况

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（2012年4月26日）基金份额总额	2,433,435,148.52
本报告期期初基金份额总额	72,374,693.53
本报告期基金总申购份额	41,831,097.78
减:本报告期基金总赎回份额	28,635,993.57
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	85,569,797.74

注：1、报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额；

2、报告期期间基金总赎回份额含转换出份额。

§ 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

1、基金管理人

基金管理人于 2017 年 2 月 8 日发布《工银瑞信基金管理有限公司董事长变更公告》，经基金管理人第六十一次股东会和第四届董事会第二十六次会议审议通过，沈立强先生辞去公司董事长职务，董事长变更为尚军先生。

基金管理人于 2017 年 4 月 25 日发布《工银瑞信基金管理有限公司关于副总经理变更的公告》，郝炜先生自 2017 年 4 月 19 日起担任工银瑞信基金管理有限公司副总经理。

2、基金托管人托管部门

2017 年 8 月，陈四清先生担任中国银行股份有限公司董事长、执行董事、董事会战略发展委员会主席及委员等职务。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

本报告期内，无涉及基金管理业务、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

本基金本报告期无投资策略的改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内应支付给安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）审计费用肆万元整，该审计机构自基金合同生效日起向本基金提供审计服务。

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

本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

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	
民生证券	1	345,126,136.33	31.34%	217,689.84	26.56%	-
招商证券	1	202,796,858.31	18.41%	184,809.20	22.55%	-
东方证券	1	189,397,341.49	17.20%	115,777.74	14.13%	-
兴业证券	1	130,370,763.86	11.84%	117,631.90	14.35%	-
长江证券	1	67,457,454.83	6.13%	47,982.44	5.85%	-
国信证券	1	52,930,236.97	4.81%	32,356.36	3.95%	-
银河证券	2	51,182,303.49	4.65%	47,666.67	5.82%	-
国泰君安	1	41,248,172.69	3.75%	38,414.57	4.69%	-
光大证券	1	15,362,107.29	1.39%	13,999.45	1.71%	-
瑞银证券	1	5,411,865.50	0.49%	3,308.22	0.40%	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
中金	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-

注：1. 券商的选择标准和程序

(1) 选择标准：注重综合服务能力

a) 券商财务状况良好、经营行为规范、风险管理先进、投资风格与工银瑞信有互补性、在最近一年内无重大违规行为。

b) 券商具有较强的综合研究能力：能及时、全面、定期提供高质量的关于宏观、行业、资本市场、个股分析报告及其他丰富全面的信息咨询服务；有很强的分析能力，能根据工银瑞信所管理基金的特定要求，提供专门研究报告；具有开发量化投资组合模型的能力以及其他综合服务能力。

力。

c) 与其他券商相比，该券商能够提供最佳交易执行和优惠合理的佣金率。

(2) 选择程序

a) 新增券商的选定：根据以上标准对券商进行考察、选择和确定。在合作之前，券商需提供至少两个季度的服务，并与其他已合作券商一起参与投资研究部门（权益投资部，固定收益部，专户投资部，研究部和中央交易室）两个季度对券商的研究服务评估。公司投委会根据对券商研究服务评估结果决定是否作为新增合作券商。

b) 签订委托协议：与被选择的券商签订委托代理协议，明确签定协议双方的公司名称、委托代理期限、佣金率、双方的权利义务等，经签章有效。

2. 券商的评估，保留和更换程序

(1) 席位的租用期限暂定为一年，合同到期 15 天内，投资研究部门将根据各券商研究在服务期间的综合证券服务质量等情况，进行评估。

(2) 对于符合标准的券商，工银瑞信将与其续约；对于不能达到标准的券商，不与其续约，并根据券商选择标准和程序，重新选择其它经营稳健、研究能力强、综合服务质量高的证券经营机构，租用其交易席位。

(3) 若券商提供的综合证券服务不符合要求，工银瑞信有权按照委托协议规定，提前中止租用其交易席位。

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		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
民生证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	998,280.00	96.84%	243,100,000.00	17.68%	-	-
兴业证券	14,211.00	1.38%	798,600,000.00	58.07%	-	-
长江证券	18,349.20	1.78%	136,000,000.00	9.89%	-	-

国信证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	171,500,000.00	12.47%	-	-
国泰君安	-	-	26,000,000.00	1.89%	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
中金	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

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	工银瑞信基金管理有限公司董事长变更公告	中国证监会指定的媒介	2017年2月8日
2	工银瑞信基金管理有限公司关于旗下基金参加交通银行手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	中国证监会指定的媒介	2017年2月23日
3	工银瑞信基金管理有限公司关于泛华普益基金销售有限公司基金销售费率调整的公告	中国证监会指定的媒介	2017年3月10日
4	工银瑞信基金管理有限公司关于宜信普泽投资顾问（北京）有限公司基金销售费率调整的公告	中国证监会指定的媒介	2017年3月10日
5	关于增加江海证券有限公司为工银瑞信基金管理有限公司旗下部分基金销售机构的公告	中国证监会指定的媒介	2017年3月23日

6	关于增加北京肯特瑞财富投资管理有限公司为旗下基金销售机构 并进行费率调整的公告	中国证监会指定的 媒介	2017 年 4 月 20 日
7	工银瑞信基金管理有限公司关于 旗下基金参加交通银行手机银行 渠道基金申购及定期定额投资手 续费率优惠活动的公告	中国证监会指定的 媒介	2017 年 4 月 22 日
8	工银瑞信基金管理有限公司关于 副总经理变更的公告	中国证监会指定的 媒介	2017 年 4 月 25 日
9	工银瑞信基金管理有限公司关于 一路财富（北京）信息科技股份 有限公司基金销售费率调整的公 告	中国证监会指定的 媒介	2017 年 5 月 15 日
10	工银瑞信基金管理有限公司关于 金惠家保险代理有限公司基金销 售费率调整的公告	中国证监会指定的 媒介	2017 年 5 月 24 日
11	关于直销电子自助交易系统开展 基金转换费率优惠活动的公告	中国证监会指定的 媒介	2017 年 6 月 26 日
12	关于增加上海通华财富资产管理 有限公司为旗下基金销售机构的 公告	中国证监会指定的 媒介	2017 年 6 月 30 日
13	工银瑞信基金管理有限公司关于 旗下基金参加交通银行手机银行 渠道基金申购及定期定额投资手 续费率优惠活动的公告	中国证监会指定的 媒介	2017 年 7 月 3 日
14	工银瑞信基金管理有限公司关于 旗下基金参加交通银行网上银行 基金申购手续费费率优惠活动的 公告	中国证监会指定的 媒介	2017 年 7 月 3 日

15	关于增加弘业期货股份有限公司为工银瑞信基金管理有限公司旗下部分基金销售机构的公告	中国证监会指定的媒介	2017 年 7 月 5 日
16	关于增加上海华夏财富投资管理有限公司为旗下基金销售机构的公告	中国证监会指定的媒介	2017 年 7 月 7 日
17	关于增加北京蛋卷基金销售有限公司为旗下基金销售机构的公告	中国证监会指定的媒介	2017 年 7 月 11 日
18	工银瑞信基金管理有限公司关于增加北京植信基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证监会指定的媒介	2017 年 8 月 8 日
19	工银瑞信基金管理有限公司关于天津国美基金销售有限公司基金销售费率调整的公告	中国证监会指定的媒介	2017 年 8 月 15 日
20	工银瑞信基金管理有限公司关于增加济安财富（北京）资本管理有限公司为旗下基金销售机构并进行基金销售费率调整的公告	中国证监会指定的媒介	2017 年 8 月 17 日
21	关于增加大有期货有限公司为工银瑞信基金管理有限公司旗下部分基金销售机构的公告	中国证监会指定的媒介	2017 年 8 月 25 日
22	关于增加大泰金石基金销售有限公司为旗下基金销售机构并进行基金销售费率调整的公告	中国证监会指定的媒介	2017 年 8 月 25 日
23	关于增加中原银行股份有限公司为工银瑞信基金管理有限公司旗下部分基金销售机构的公告	中国证监会指定的媒介	2017 年 10 月 26 日
24	关于增加上海挖财金融信息服务	中国证监会指定的	2017 年 11 月 8 日

	有限公司为旗下基金销售机构并 进行费率调整的公告	媒介	
25	工银瑞信基金管理有限公司关于 上海基煜基金销售有限公司基金 销售费率调整的公告	中国证监会指定的 媒介	2017 年 11 月 27 日
26	工银瑞信基金管理有限公司关于 旗下基金调整流通受限股票估值 方法的公告	中国证监会指定的 媒介	2017 年 12 月 21 日
27	工银瑞信基金管理有限公司关于 旗下基金参加工商银行网上银 行、手机银行基金定投申购费率 优惠活动的公告	中国证监会指定的 媒介	2017 年 12 月 29 日
28	关于直销电子自助交易系统开展 基金转换费率优惠活动的公告	中国证监会指定的 媒介	2017 年 12 月 29 日
29	工银瑞信基金管理有限公司关于 旗下基金参加苏州银行股份有限 公司网上银行、手机银行、网点 低柜基金申购及定期定额申购费 率优惠活动的公告	中国证监会指定的 媒介	2017 年 12 月 30 日
30	工银瑞信基金管理有限公司关于 旗下基金参加中国邮政储蓄银行 股份有限公司个人网上银行、手 机银行基金申购费率优惠活动的 公告	中国证监会指定的 媒介	2017 年 12 月 30 日
31	工银瑞信基金管理有限公司关于 旗下基金参加交通银行手机银行 渠道基金申购及定期定额投资手 续费率优惠活动的公告	中国证监会指定的 媒介	2017 年 12 月 30 日
32	工银瑞信基金管理有限公司关于	中国证监会指定的	2017 年 12 月 30 日

	旗下公开募集证券投资基金缴纳 增值税的公告	媒介	
--	--------------------------	----	--

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准工银瑞信基本面量化策略混合型证券投资基金募集的文件
- 2、《工银瑞信基本面量化策略混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《工银瑞信基本面量化策略混合型证券投资基金托管协议》
- 4、《工银瑞信基本面量化策略混合型证券投资基金招募说明书》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照
- 7、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告

13.2 存放地点

基金管理人或基金托管人的住所。

13.3 查阅方式

投资者可于营业时间免费查阅，或登录基金管理人网站查阅。也可在支付工本费后，在合理时间内取得上述文件的复印件。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人——工银瑞信基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-811-9999

网址：www.icbccs.com.cn