

# 华润元大安鑫灵活配置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：华润元大基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2018 年 3 月 28 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 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。

本报告财务资料已经审计，德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

|  |           |
|--|-----------|
| <b>§1 重要提示及目录</b> .....                      | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示.....                                | 2         |
| 1.2 目录.....                                  | 3         |
| <b>§2 基金简介</b> .....                         | <b>5</b>  |
| 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.....                         | 6         |
| 2.4 信息披露方式.....                              | 6         |
| 2.5 其他相关资料.....                              | 6         |
| <b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....         | <b>8</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标.....                         | 8         |
| 3.2 基金净值表现.....                              | 8         |
| 3.3 过去三年基金的利润分配情况.....                       | 10        |
| <b>§4 管理人报告</b> .....                        | <b>11</b> |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况.....                        | 11        |
| 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.....             | 13        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....             | 13        |
| 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....                 | 14        |
| 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....                | 14        |
| 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....                 | 15        |
| 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.....       | 15        |
| <b>§5 托管人报告</b> .....                        | <b>16</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....                  | 16        |
| 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..... | 16        |
| 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.....      | 16        |
| <b>§6 审计报告</b> .....                         | <b>17</b> |
| 6.1 审计报告基本信息.....                            | 17        |
| 6.2 审计报告的基本内容.....                           | 17        |
| <b>§7 年度财务报表</b> .....                       | <b>19</b> |
| 7.1 资产负债表.....                               | 19        |
| 7.2 利润表.....                                 | 20        |
| 7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....                      | 21        |
| 7.4 报表附注.....                                | 22        |
| <b>§8 投资组合报告</b> .....                       | <b>44</b> |
| 8.1 期末基金资产组合情况.....                          | 44        |
| 8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....                      | 44        |
| 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.....       | 45        |
| 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....                     | 45        |
| 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....                    | 51        |
| 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.....      | 51        |
| 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.....   | 52        |

|   |           |
|---|-----------|
| 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 ..... | 52        |
| 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 .....    | 52        |
| 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....             | 52        |
| 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....             | 52        |
| 8.12 投资组合报告附注 .....                         | 52        |
| <b>§9 基金份额持有人信息.....</b>                    | <b>54</b> |
| 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                 | 54        |
| 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....              | 54        |
| 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 .....     | 54        |
| <b>§10 开放式基金份额变动.....</b>                   | <b>55</b> |
| <b>§ 11 重大事件揭示.....</b>                     | <b>56</b> |
| 11.1 基金份额持有人大会决议 .....                      | 56        |
| 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 .....      | 56        |
| 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....           | 56        |
| 11.4 基金投资策略的改变 .....                        | 56        |
| 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....                 | 56        |
| 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 .....         | 57        |
| 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....                | 57        |
| 11.8 其他重大事件 .....                           | 59        |
| <b>§12 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>              | <b>66</b> |
| 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 .....    | 66        |
| <b>§13 备查文件目录.....</b>                      | <b>68</b> |
| 13.1 备查文件目录 .....                           | 68        |
| 13.2 存放地点 .....                             | 68        |
| 13.3 查阅方式 .....                             | 68        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                     |
|------------|---------------------|
| 基金名称       | 华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金 |
| 基金简称       | 华润元大安鑫灵活配置混合        |
| 基金主代码      | 000273              |
| 基金运作方式     | 契约型开放式              |
| 基金合同生效日    | 2014 年 9 月 18 日     |
| 基金管理人      | 华润元大基金管理有限公司        |
| 基金托管人      | 中国农业银行股份有限公司        |
| 报告期末基金份额总额 | 24,966,306.14 份     |
| 基金合同存续期    | 不定期                 |

### 2.2 基金产品说明

|      |  |
|------|--|
| 投资目标 | 本基金根据对宏观经济形势的研究，判断经济所处的经济周期阶段、景气循环状况和未来运行趋势，积极把握股票、债券等市场发展趋势，注重大类资产配置轮换特征、重点挖掘价值低洼，在适度控制风险的前提下，追求基金资产的长期稳定增值。  |
| 投资策略 | <p>1、资产配置策略</p> <p>本基金在资产配置中贯彻“自上而下”的策略，根据宏观经济环境、财政及货币政策趋势以及基金管理人对大类资产走势的判断，并通过战略资产配置策略和战术资产配置策略的有机结合，持续、动态、优化确定投资组合的资产配置比例。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>本基金将运用“价值和成长并重”的投资策略来确定具体选股标准。该策略通过建立统一的价值评估框架，综合考虑上市公司的增长潜力和市场估值水平，以寻找具有增长潜力且价格合理或被低估的股票。同时，本基金将综合考虑投资回报的稳定性、持续性与成长性，通过精细化风险管理和组合优化技术，实现行业与风格类资产的均衡配置，从而实现风险调整后收益的最大化。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>本基金将采用“自上而下”的投资策略，对债券类资产进行合理有效的配置，并在配置框架下进行具有针对性的券种选择。</p> <p>4、权证投资策略</p> <p>本基金以被动投资权证为主要策略，包括投资因持有股票而派发的权证和参与分离转债申购而获得的权证，以获取这部分权证带来的增量收益。同时，本基金将在严格控制风险的前提下，以价值分析为基础，</p> |

|        |  |
|--------|--|
|        | <p>主动进行部分权证投资。</p> <p>5、股指期货投资策略</p> <p>本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本。</p> |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率×35%+中债综合指数收益率×65%   |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金，属于中等预期收益和预期风险水平的投资品种。   |

### 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目      |      | 基金管理人   | 基金托管人                         |
|---------|------|---|-------------------------------|
| 名称      |      | 华润元大基金管理有限公司                                  | 中国农业银行股份有限公司                  |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 刘豫皓   | 贺倩                            |
|         | 联系电话 | 0755-88399015                                 | 010-66060069                  |
|         | 电子邮箱 | lyh@cryuantafund.com                          | tgxxpl@abchina.com            |
| 客户服务电话  |      | 4000-1000-89                                  | 95599                         |
| 传真      |      | 0755-88399045                                 | 010-68121816                  |
| 注册地址    |      | 深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室(入驻深圳市前海商务秘书有限公司) | 北京市东城区建国门内大街 69 号             |
| 办公地址    |      | 深圳市福田区中心四路 1-1 号嘉里建设广场第三座 7 层                 | 北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 9 层 |
| 邮政编码    |      | 518048  | 100031                        |
| 法定代表人   |      | 邹新  | 周慕冰                           |

### 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》、《上海证券报》、《证券时报》  |
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | <a href="http://www.cryuantafund.com">http://www.cryuantafund.com</a> |
| 基金年度报告备置地点          | 基金管理人和基金托管人的办公场所  |

### 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称                 | 办公地址                     |
|--------|--------------------|--------------------------|
| 会计师事务所 | 德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙) | 中国上海市延安东路 222 号外滩中心 30 楼 |
| 注册登记机构 | 华润元大基金管理有限公司       | 深圳市福田区中心四路 1-1 号嘉里       |

---

|  |  |             |
|--|--|-------------|
|  |  | 建设广场第三座 7 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       | 10,846,995.41 | -11,449,508.25 | 12,781,281.64  |
| 本期利润          | 11,489,358.58 | -11,531,373.67 | 11,143,904.28  |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.2576        | -0.0524        | 0.0910         |
| 本期加权平均净值利润率   | 16.36%        | -2.95%         | 5.17%          |
| 本期基金份额净值增长率   | 26.35%        | -1.37%         | 51.75%         |
| 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      | 7,741,248.41  | 13,927,852.88  | 226,297,554.06 |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.3101        | 0.7964         | 0.8207         |
| 期末基金资产净值      | 37,166,638.75 | 31,416,741.01  | 502,050,314.82 |
| 期末基金份额净值      | 1.489         | 1.796          | 1.821          |
| 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   | 126.92%       | 79.60%         | 77.83%         |

注：1、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。

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的申购赎回费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

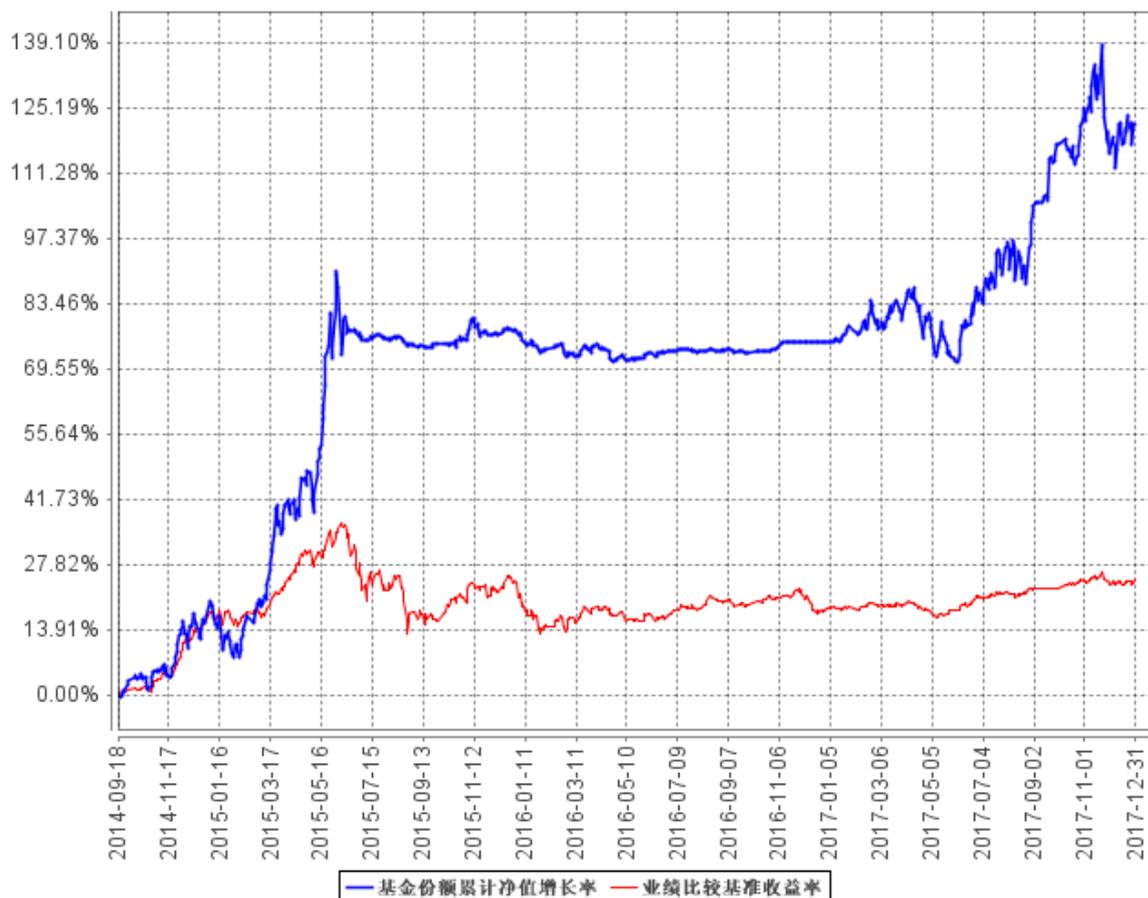
### 3.2 基金净值表现

#### 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      | 1.99%    | 1.35%       | 1.03%      | 0.28%         | 0.96%  | 1.07% |
| 过去六个月      | 19.18%   | 1.29%       | 2.57%      | 0.24%         | 16.61% | 1.05% |
| 过去一年       | 26.35%   | 1.08%       | 4.89%      | 0.23%         | 21.46% | 0.85% |
| 过去三年       | 89.10%   | 0.98%       | 6.58%      | 0.59%         | 82.52% | 0.39% |
| 自基金合同生效起至今 | 126.92%  | 0.99%       | 27.87%     | 0.52%         | 99.05% | 0.47% |

### 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

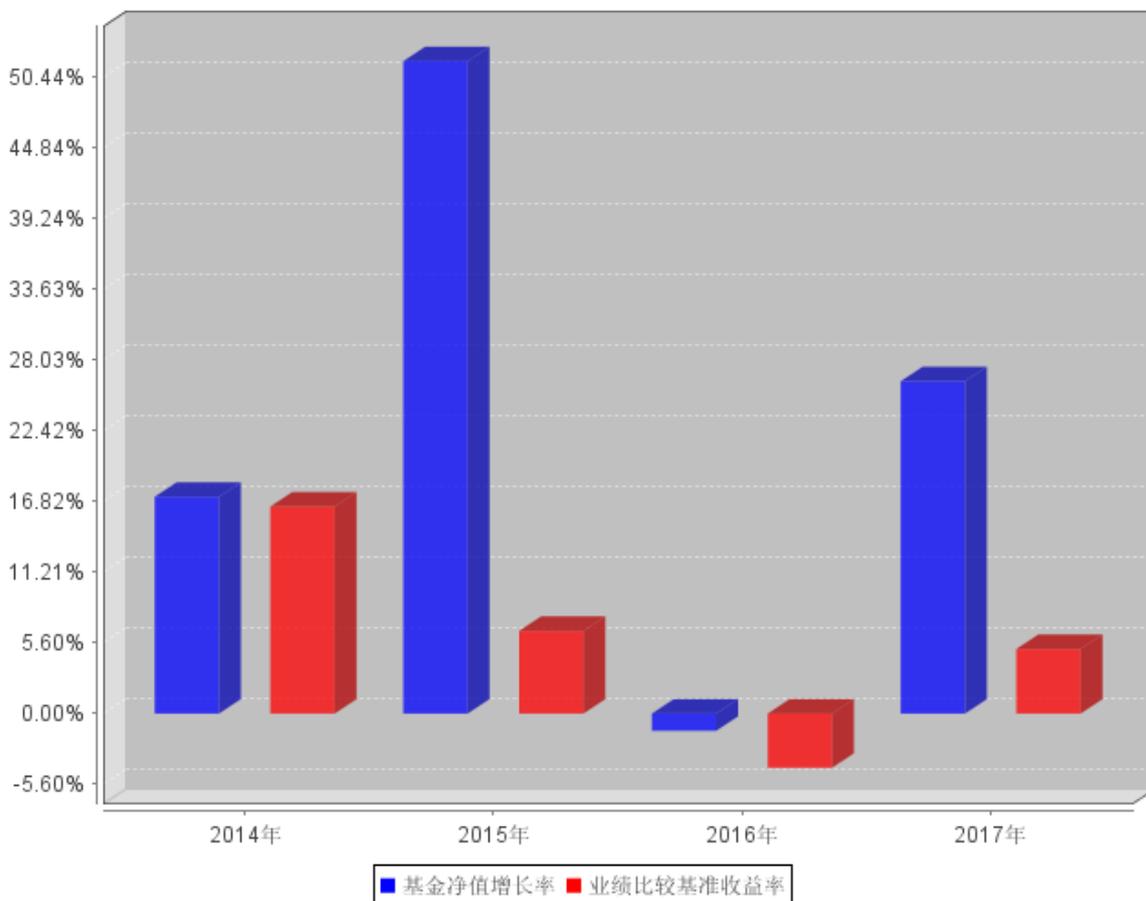
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：自 2014 年 9 月 18 日起，华润元大保本混合型证券投资基金转型为华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金。

### 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

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：本基金基金合同生效日为 2014 年 9 月 18 日，基金合同生效日至 2014 年 12 月 31 日，本基金运作时间未满一年。图示中 2014 年本基金的净值增长率及业绩基准的收益率根据当年实际存续期（2014 年 9 月 18 日至 2014 年 12 月 31 日）计算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

| 年<br>度 | 每 10 份 基金 份<br>额 分 红 数 | 现 金 形 式 发 放 总<br>额 | 再 投 资 形 式 发<br>放 总 额 | 年 度 利 润 分 配 合<br>计 | 备 注 |
|--------|------------------------|--------------------|----------------------|--------------------|-----|
| 2017   | 7.2200                 | 862,633,113.92     | 2,327,891.38         | 864,961,005.30     | -   |
| 2016   | -                      | -                  | -                    | -                  | -   |
| 2015   | -                      | -                  | -                    | -                  | -   |
| 合 计    | 7.2200                 | 862,633,113.92     | 2,327,891.38         | 864,961,005.30     | -   |

## § 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

华润元大基金管理有限公司经中国证监会证监许可【2012】1746 号文批准，于 2013 年 1 月 17 日完成工商登记注册，总部位于深圳，注册资本 3 亿元人民币。公司由华润深国投信托有限公司和台湾元大证券投资信托股份有限公司共同发起设立，占股比例分别为 51% 和 49%。截至 2017 年 12 月 31 日，本基金管理人共管理十一只开放式基金：华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金，华润元大现金收益货币市场基金，华润元大信息传媒科技混合型证券投资基金，华润元大医疗保健量化混合型证券投资基金，华润元大富时中国 A50 指数型证券投资基金，华润元大中创 100 交易型开放式指数证券投资基金，华润元大稳健收益债券型证券投资基金，华润元大中创 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金，华润元大现金货币市场基金，华润元大润鑫债券型证券投资基金，华润元大润泰双鑫债券型证券投资基金。

#### 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 |        |   |
| 袁华涛 | 华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理、华润元大医疗保健量化混合型证券投资基金基金经理、华润元大信息传媒科技混合型证券投资基金基金经理、华润元大中创 100 交易型开放式指数 | 2015 年 9 月 16 日 | -    | 8 年    | 曾任华泰证券股份有限公司研究员，华泰证券（上海）资产管理有限公司量化投资经理。2015 年 9 月 16 日起担任华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2015 年 9 月 16 日起担任华润元大医疗保健量化混合型证券投资基金基金经理，2016 年 8 月 5 日起担任华润元大信息传媒科技混合型证券投资基金基金经理，2017 年 8 月 2 日起担任华润元大中创 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。中国，西南财经大学金融学博士，具有基金从业资格。 |

|  |                            |  |  |  |  |
|--|----------------------------|--|--|--|--|
|  | 证券投资<br>基金联接<br>基金基金<br>经理 |  |  |  |  |
|--|----------------------------|--|--|--|--|

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、本基金基金合同和其他相关法律法规的规定，并本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定，没有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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》和《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，公司制订了《华润元大基金管理有限公司公平交易管理办法》，对投资决策的内部控制、研究的内部控制、交易执行的内部控制、公平交易的实施效果评估与监察稽核、信息披露和报告等进行了规定，以确保公司旗下管理的不同投资组合得到公平对待，保护投资者合法权益。公司对所有投资品种实行集中交易制度，严格遵循时间优先、价格优先的公平交易原则，同时对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，对不同投资组合间同向交易的交易价差进行分析，防止利益输送的发生。

### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，基金管理人严格遵守法律法规及公司内部制度关于公平交易的相关规定，在投资管理活动中公平对待不同投资组合，公平交易制度执行情况良好，未发生违反公平交易制度的行为。

本报告期内，基金管理人旗下管理的不同投资组合间在连续四个季度期间内、不同时间窗下（日内、3日内、5日内）的同向交易交易价差进行分析，分析结果表明旗下组合的同向交易情况正常，价差均在可合理解释范围之内。

### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金存在异常交易行为。基金管理人管理的所有投资组合未存在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% 的情形。

## 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

2017 年中国股票市场延续近两年来的震荡分化走势，结构性牛市和结构性熊市并存，结构上消费好于成长、大盘好于小盘、绩优股好于亏损股、低估值组合好于高估值。具体看，2017 全年，上证 50 指数上涨 25.08%，上证综指上涨 6.5%，沪深 300 上涨 21.77%，创业板指数下跌 10.67%，中证 TMT 指数下跌 6.68%，中证 1000 指数下跌 17.35%。中信一级 29 个行业中食品饮料（54.57%）、家电（44.94%）、煤炭（19.31%）板块表现较好，涨幅居于前 3；而计算机（-18.81%）、传媒（-21.65%）、纺织服装（-23.02%）板块走势明显较弱，跌幅居前。申万风格指数方面，2017 年绩优股指数上涨 42.92%，低市盈率指数上涨 25.98%，大盘指数上涨 12.29%，而小盘股指数下跌 12.81%，亏损股指数下跌 15.73%，高市盈率指数下跌 22.90%。2017 年来看，在股指震荡上行中，本基金大多时间保持了较高股票仓位，并根据市场环境精选估值水平和业绩增速相匹配的优质核心公司组合。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2017 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 1.489 元、累计净值 2.211，报告期内的份额净值增长率为 26.35%，同期业绩比较基准收益率为 4.89%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2017 年，世界经济增长步伐加快，复苏稳健，是近年来表现最好的一年。据世界银行 2018 年 1 月的预测，2017 年，世界经济增速将达 3%，比 2016 年加快 0.6 个百分点。2017 年，中国经济增长 6.9%，远高于世界平均增速，成为世界经济增长的主要动力源。2017 年，我国经济增长总体平稳，经济结构不断优化，服务业对经济增长的贡献持续提升，消费需求仍是经济增长的主要拉动力，新动能成为经济增长的重要动力，经济增长质量不断提高。从对经济增长的贡献率来看，2017 年三次产业的贡献率分别为 4.9%、36.3%和 58.8%，第三产业对经济增长的贡献率比第二产业高 22.5 个百分点，比上年提高 1.3 个百分点。2017 年，最终消费支出对经济增长的贡献率为 58.8%，比上年下降 7.7 个百分点；资本形成总额对经济增长的贡献率为 32.1%，比上年下降 11.0 个百分点；货物和服务净出口对经济增长的贡献率为 9.1%，比上年提高 18.7 个百分点。2017 年全国规模以上工业企业实现利润总额 75187.1 亿元，比上年增长 21%，增速比 2016 年加快 12.5 个百分点。2017 年，全国居民消费价格上涨 1.6%，涨幅比 2016 年回落 0.4 个百分点；工业生产者出厂价格由 2016 年下降 1.4%，转为上涨 6.3%，结束了 2012 年以来连续五年的下降态势。总体上看，居民消费价格温和上涨，物价水平保持平稳；工业生产者出厂价格持续恢复性上涨，但涨势趋稳。2018 年，全球经济继续景气向上，在出口、消费和房地产乐观走势的支持下，中国经济周期性恢复仍有望延续。这意味着中国的权益类资产价值有望得到全面重估。在过去几年在近乎

衰退式的经济下行中，A 股传统行业公司估值显著低于国际同行，而随着经济开始复苏低估值开始得到修复。而从经济增长的速度和稳定性看，中国经济在全球都是相对较好的，未来价值重估的目标应当是从“修复”到“溢价”。市场展望方面，A 股或已进入新一轮大的上涨趋势之中，房住不炒、金融去杠杆、中国居民资产配置中股票占比会增加，A 股成功纳入 MSCI 指数，大类资产配置继续转向股票，上市公司业绩将逐步改善，改革和转型加速提高风险偏好，市场有望从震荡市演变为牛市。展望 2018 年，市场风格依然是业绩为王、整体偏价值，我们看好估值重估的金融、新时代美好生活的消费、估值与业绩增速匹配成长龙头等高质量的核心资产公司。

#### 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，本基金管理人坚持一切从规范运作、防范风险、保护基金持有人利益出发，依照公司内部控制的整体要求，继续致力于内控机制的完善，加强内部风险的控制与防范，确保各项法规和管理制度的落实，保证基金合同得到严格履行。

公司按照规定的权限和程序，通过实时监控、现场检查、重点抽查和人员询问等方法，独立地开展基金运作和公司管理的合规性稽核，发现问题及时提出改进建议并督促业务部门进行整改，同时定期向董事会和公司管理层出具监察稽核报告。

公司采取事前防范、事中控制和事后监督等三阶段工作，加强了对日常投资运作的管理和监控，保证投资遵循既定的投资决策程序与业务流程，基金各项投资符合比例控制的要求，严格执行分级授权制度，保证基金投资独立、公平。

本基金管理人承诺将坚持以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，为基金持有人谋求最大利益。

#### 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，组成人员包括督察长、投资风险负责人、证券研究工作负责人、法律监察负责人及基金会计负责人等。该机构成员均具备专业胜任能力和相关从业资格，精通各自领域的理论知识，熟悉相关政策法规，并具有丰富的实践经验。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

在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每份基金份额每次基金收益分配比例不得低于基金收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 10%，若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配。本报告期内共进行 1 次收益分配，收益分配基准日为 2017 年 9 月 1 日。截止基准日，本基金基金份额净值为 2.093 元，可供分配利润为 5,557,208.90 元，每 10 份基金份额分配 7.22 元，符合本基金基金合同的约定。

#### 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

本报告期内，本基金存在连续六十个工作日以上基金资产净值低于五千万元的情形，本基金管理人已向中国证监会报告本基金的解决方案。本报告期内，本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形。

## § 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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—华润元大基金管理有限公司 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

### 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

本托管人认为，华润元大基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 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

本托管人认为，华润元大基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

## § 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     | 德师报(审)字(18)第 P01802 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         | 华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人   |
| 审计意见            | <p>我们审计了华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“华润元大安鑫灵活配置混合”)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,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制,公允反映了华润元大安鑫灵活配置混合 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。</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,我们独立于华润元大安鑫灵活配置混合,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>华润元大安鑫灵活配置混合的管理人华润元大基金管理有限公司管理层对其他信息负责。其他信息包括华润元大安鑫灵活配置混合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> |
| 管理层和治理层对财务报表的责任 | <p>华润元大安鑫灵活配置混合的基金管理人华润元大基金管理有限公司负责按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表,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>编制财务报表时,基金管理人负责评估华润元大安鑫灵活配置混合</p>  |

|                        |   |
|------------------------|---|
|                        | <p>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，除非基金管理人计划清算华润元大安鑫灵活配置混合、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督华润元大安鑫灵活配置混合的财务报告过程。</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)评价基金管理人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)对基金管理人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，就可能对华润元大安鑫灵活配置混合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华润元大安鑫灵活配置混合不能持续经营。</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>我们与基金管理人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> |
| <p>会计师事务所的名称</p>       | <p>德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)</p>   |
| <p>注册会计师的姓名</p>        | <p>许湘照 吴迪</p>   |
| <p>会计师事务所的地址</p>       | <p>上海市黄浦区延安东路 222 号外滩中心 30 楼</p>  |
| <p>审计报告日期</p>          | <p>2018 年 3 月 28 日</p>  |

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：华润元大安鑫灵活配置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<br>2017 年 12 月 31 日         | 上年度末<br>2016 年 12 月 31 日         |
|-----------------|------------|---------------------------------|----------------------------------|
| <b>资产：</b>      |            |                                 |                                  |
| 银行存款            | 7.4.7.1    | 890,358.44                      | 2,835,428.15                     |
| 结算备付金           |            | 463,265.56                      | 850,000.00                       |
| 存出保证金           |            | 325,661.85                      | 102,888.20                       |
| 交易性金融资产         | 7.4.7.2    | 35,057,682.80                   | -                                |
| 其中：股票投资         |            | 33,754,556.00                   | -                                |
| 基金投资            |            | -                               | -                                |
| 债券投资            |            | 1,303,126.80                    | -                                |
| 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    | -                               | 27,000,000.00                    |
| 应收证券清算款         |            | -                               | 1,009,693.06                     |
| 应收利息            | 7.4.7.5    | 32,347.73                       | 13,446.02                        |
| 应收股利            |            | -                               | -                                |
| 应收申购款           |            | 1,186,454.07                    | 2,964.43                         |
| 递延所得税资产         |            | -                               | -                                |
| 其他资产            | 7.4.7.6    | -                               | -                                |
| 资产总计            |            | 37,955,770.45                   | 31,814,419.86                    |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2017 年 12 月 31 日</b> | <b>上年度末<br/>2016 年 12 月 31 日</b> |
| <b>负 债：</b>     |            |                                 |                                  |
| 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         |            | 266,349.62                      | -                                |
| 应付赎回款           |            | 15,862.61                       | 203.63                           |
| 应付管理人报酬         |            | 42,425.67                       | 37,317.66                        |
| 应付托管费           |            | 6,060.82                        | 5,331.12                         |
| 应付销售服务费         |            | -                               | -                                |
| 应付交易费用          | 7.4.7.7    | 158,416.13                      | 4,825.68                         |
| 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  | 300,016.85    | 350,000.76    |
| 负债合计          |          | 789,131.70    | 397,678.85    |
| <b>所有者权益：</b> |          |               |               |
| 实收基金          | 7.4.7.9  | 24,966,306.14 | 17,488,888.13 |
| 未分配利润         | 7.4.7.10 | 12,200,332.61 | 13,927,852.88 |
| 所有者权益合计       |          | 37,166,638.75 | 31,416,741.01 |
| 负债和所有者权益总计    |          | 37,955,770.45 | 31,814,419.86 |

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.489 元，基金份额总额 24,966,306.14 份。

## 7.2 利润表

会计主体：华润元大安鑫灵活配置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<br>2017 年 1 月 1 日至<br>2017 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2016 年 1 月 1 日至<br>2016 年 12 月 31 日 |
|------------------------|------------|---|--|
| <b>一、收入</b>            |            | 14,455,630.16                             | -3,159,490.20                                  |
| 1. 利息收入                |            | 789,870.40                                | 9,525,497.48                                   |
| 其中：存款利息收入              | 7.4.7.11   | 380,695.71                                | 755,212.30                                     |
| 债券利息收入                 |            | 7,627.43                                  | 3,334,962.88                                   |
| 资产支持证券利息收入             |            | -   | -  |
| 买入返售金融资产收入             |            | 401,547.26                                | 5,435,322.30                                   |
| 其他利息收入                 |            | -   | -  |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）      |            | -478,059.49                               | -13,179,355.53                                 |
| 其中：股票投资收益              | 7.4.7.12   | -578,763.96                               | -10,027,692.73                                 |
| 基金投资收益                 |            | -   | -  |
| 债券投资收益                 | 7.4.7.13   | -14.00                                    | -3,445,313.58                                  |
| 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   | 100,718.47                                | 293,650.78                                     |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 7.4.7.17   | 642,363.17                                | -81,865.42                                     |
| 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   | 13,501,456.08                             | 576,233.27                                     |
| <b>减：二、费用</b>          |            | 2,966,271.58                              | 8,371,883.47                                   |
| 1. 管理人报酬               | 7.4.10.2.1 | 914,830.89                                | 5,562,127.12                                   |
| 2. 托管费                 | 7.4.10.2.2 | 130,690.12                                | 794,589.66                                     |
| 3. 销售服务费               |            | -   | -  |
| 4. 交易费用                | 7.4.7.19   | 1,675,605.72                              | 1,590,037.28                                   |

|                            |          |               |                |
|----------------------------|----------|---------------|----------------|
| 5. 利息支出                    |          | -             | -              |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |          | -             | -              |
| 6. 其他费用                    | 7.4.7.20 | 245,144.85    | 425,129.41     |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |          | 11,489,358.58 | -11,531,373.67 |
| 减：所得税费用                    |          | -             | -              |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |          | 11,489,358.58 | -11,531,373.67 |

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华润元大安鑫灵活配置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<br>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）                        | 17,488,888.13                               | 13,927,852.88    | 31,416,741.01     |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -   | 11,489,358.58    | 11,489,358.58     |
| 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）      | 7,477,418.01                                | 851,744,126.45   | 859,221,544.46    |
| 其中：1. 基金申购款                            | 1,232,324,525.61                            | 1,330,217,885.41 | 2,562,542,411.02  |
| 2. 基金赎回款                               | -1,224,847,107.60                           | -478,473,758.96  | -1,703,320,866.56 |
| 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） | -   | -864,961,005.30  | -864,961,005.30   |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 24,966,306.14                               | 12,200,332.61    | 37,166,638.75     |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>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）                        | 275,752,760.76                              | 226,297,554.06   | 502,050,314.82    |

|  |                 |                 |                 |
|--|-----------------|-----------------|-----------------|
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -               | -11,531,373.67  | -11,531,373.67  |
| 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）      | -258,263,872.63 | -200,838,327.51 | -459,102,200.14 |
| 其中：1. 基金申购款                            | 16,280,471.06   | 12,866,161.56   | 29,146,632.62   |
| 2. 基金赎回款                               | -274,544,343.69 | -213,704,489.07 | -488,248,832.76 |
| 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）                        | 17,488,888.13   | 13,927,852.88   | 31,416,741.01   |

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：

|              |              |              |
|--------------|--------------|--------------|
| _____<br>孙晔伟 | _____<br>黄晓芳 | _____<br>黄晓芳 |
| 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

华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)系由华润元大保本混合型证券投资基金第一个保本周期到期后转型而来。华润元大保本混合型证券投资基金经中国证监会证监许可[2013]872号文予以募集注册,自2013年8月19日至2013年9月6日期间向全社会公开募集。募集有效认购总户数为6,465户,募集资金及其产生的利息共计630,303,516.04元,折合基金份额630,303,516.04份,于2013年9月11日基金合同正式生效。根据《华润元大保本混合型证券投资基金基金合同》的约定,2014年9月11日,华润元大保本混合型证券投资基金第一个保本周期到期后,未能符合保本基金存续条件,自2014年9月18日起变更为本基金。同时,基金的投资目标、投资范围、投资策略以及基金费率等相关内容根据《华润元大保本混合型证券投资基金基金合同》的相关约定作相应修改为《华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同》。上述变更无须经基金份额持有人大会决议,在报中国证监会备案后,提前在临时公告或《华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》中予以说明。本基金的基金管理人为华润元大基金管理有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司(以下简称“中国农业银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法公开发行

上市交易的股票（包括中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票）、一级市场新股或增发的股票、衍生工具（权证、股指期货等）、债券资产（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产、现金及到期日在一年以内的政府债券，以及法律法规或中国证监会允许投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金的投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例为 0% - 95%，权证投资占基金资产净值的比例为 0% - 3%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，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：沪深 300 指数收益率×35%+中债综合指数收益率×65%。

#### 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颁布的企业会计准则及相关规定（以下统称“企业会计准则”）和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，同时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发布的若干基金行业实务操作。

本基金的基金管理人华润元大基金管理有限公司对本基金自 2017 年 12 月 31 日起 12 个月的持续经营能力进行了评价，未发现对持续经营能力产生重大怀疑的事项和情况。因此，本财务报表系在持续经营假设的基础上编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，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。

#### 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

#### (1) 金融资产的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将所持有的金融资产在初始确认时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和贷款及应收款项。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，其他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中以交易性金融资产列示。

本基金持有的各类应收款项、买入返售金融资产等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分类为贷款及应收款项。

#### (2) 金融负债的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将持有的金融负债在初始确认时划分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。本基金暂无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。

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

### 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或债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。贷款及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，公允价值变动形成的利得或损失以及与该等金融资产相关的股利和利息收入计入当期损益；贷款及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。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才能终止确认该金融负债或其一部分。金融负债全部或部分终止确认的，将终止确认部分的账面价值与支付的对价（包括转出的非现金资产或承担的新金融负债）之间的差额，计入当期损益。

#### 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。本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债根据对计量整体具有重大意义的最低层次的输入值确定公允价值计量层次。第一层次输入值是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；第二层次输入值是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；第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。

(1) 对于银行间市场交易的固定收益品种，以及交易所上市交易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），按照第三方估值机构提供的估值确定公允价值。

(2) 对存在活跃市场的其他投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值；估值日无市价，且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，采用最近交易市价确定公允价值；对于发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行时股票公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，按照监管机构或行业协会的有关规定确定公允价值。

(3) 对存在活跃市场的其他投资品种，如估值日无市价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或基金管理人估值委员会认为必要时，应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，确定公允价值。

(4) 当投资品种不再存在活跃市场，基金管理人估值委员会认为必要时，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，确定投资品种的公允价值。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

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，且该种法定权利是当前可执行的，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。申购、赎回、转换及红利再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金指申购、赎回、转入、转出及红利再投资等事项导致基金份额变动时，相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配(未分配利润)已实现与未实现部分各自占基金净值的比例，损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入利润分配(未分配利润)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

##### 1. 利息收入

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

(2) 除贴息债外的债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除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，逐日确认债券利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后，逐日确认债券利息收入。

(3) 买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提。

##### 2. 投资收益

(1) 股票投资收益为卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本的差额确认。

(2) 债券投资收益为卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本与应收利息(若有)后的差额确认。

(3) 衍生工具投资收益为交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本后的差额确认。

(4) 股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

##### 3. 公允价值变动收益

公允价值变动收益于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值变动形成的利得或损失确认，并于相关金融资产卖出或到期时转出计入投资收益。

##### 4. 其他收入

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在费用涵盖期间按基金合同及相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的交易费用发生时按照确定的金额计入交易费用。

卖出回购金融资产支出按卖出回购金融资产款的摊余成本在回购期内以实际利率法逐日计提，若合同利率与实际利率差异较小，则采用合同利率计算确定利息支出。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每份基金份额每次基金收益分配比例不得低于基金收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 10%，若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(2) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(3) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即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；

(4) 每一基金份额享有同等分配权；

(5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 7.4.4.12 分部报告

根据本基金的内部组织机构、管理要求及内部报告制度，本基金整体为一个报告分部，且向管理层报告时采用的会计政策及计量基础与编制财务报表时的会计政策及计量基础一致。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金在本报告期内无其他重要的会计政策和会计估计。

### 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

本基金本报告期无需要说明的重大会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需要说明的重大会计估计变更。

### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无需要说明的重大会计差错更正。

### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、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》、财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008 年 9 月 18 日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、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[2014]48 号《关于实施全国中小企业股份转让系统挂牌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]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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、债券免征营业税和增值税; 2018 年 1 月 1 日起, 公开募集证券投资基金运营过程中发生的其他增值税应税行为, 以基金管理人为增值税纳税人, 暂适用简易计税方法, 按照 3% 的征收率缴纳增值税。

(2) 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, 暂不缴纳企业所得税。

(3) 对基金取得的股票股息、红利收入, 由上市公司在收到相关扣收税款当月的法定申报期内向主管税务机关申报缴纳; 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, 股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 对基金取得的债券利息收入, 由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税, 暂不缴纳企业所得税。

(5) 对于基金从事 A 股买卖, 出让方按 0.10% 的税率缴纳证券(股票)交易印花税, 对受让方不再缴纳印花税。

## 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<br>2017年12月31日 | 上年度末<br>2016年12月31日 |
|--------------|--------------------|---------------------|
| 活期存款         | 890,358.44         | 2,835,428.15        |
| 定期存款         | -                  | -                   |
| 其中：存款期限1-3个月 | -                  | -                   |
| 其他存款         | -                  | -                   |
| 合计：          | 890,358.44         | 2,835,428.15        |

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2017年12月31日  |               |              |
|---------------|---------------------|---------------|--------------|
|               | 成本                  | 公允价值          | 公允价值变动       |
| 股票            | 33,112,154.03       | 33,754,556.00 | 642,401.97   |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | -                   | -             | -            |
| 债券            | 交易所市场               | 1,303,165.60  | 1,303,126.80 |
|               | 银行间市场               | -             | -            |
|               | 合计                  | 1,303,165.60  | 1,303,126.80 |
| 资产支持证券        | -                   | -             | -            |
| 基金            | -                   | -             | -            |
| 其他            | -                   | -             | -            |
| 合计            | 34,415,319.63       | 35,057,682.80 | 642,363.17   |
| 项目            | 上年度末<br>2016年12月31日 |               |              |
|               | 成本                  | 公允价值          | 公允价值变动       |
| 股票            | -                   | -             | -            |
| 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            | -                   | -             | -            |

### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产和衍生金融负债。

### 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<br>2017 年 12 月 31 日  |           |
|--------|--------------------------|-----------|
|        | 账面余额                     | 其中：买断式逆回购 |
| 项目     | 上年度末<br>2016 年 12 月 31 日 |           |
|        | 账面余额                     | 其中：买断式逆回购 |
| 买入返售证券 | 27,000,000.00            | -         |
| 合计     | 27,000,000.00            | -         |

#### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末均无买断式逆回购交易中取得的债券。

### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目         | 本期末<br>2017 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2016 年 12 月 31 日 |
|------------|-------------------------|--------------------------|
| 应收活期存款利息   | 144.12                  | 430.13                   |
| 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  | 208.50                  | 382.50                   |
| 应收债券利息     | 31,848.51               | -                        |
| 应收买入返售证券利息 | -                       | 12,587.09                |
| 应收申购款利息    | -                       | -                        |
| 应收黄金合约拆借孳息 | -                       | -                        |
| 其他         | 146.60                  | 46.30                    |
| 合计         | 32,347.73               | 13,446.02                |

注：其他为应收结算保证金利息。

### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末均未持有其他资产。

### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2017 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2016 年 12 月 31 日 |
|-------------|-------------------------|--------------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 158,296.13              | 4,510.68                 |
| 银行间市场应付交易费用 | 120.00                  | 315.00                   |
| 合计          | 158,416.13              | 4,825.68                 |

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2017 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2016 年 12 月 31 日 |
|-------------|-------------------------|--------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                       | -                        |
| 应付赎回费       | 16.85                   | 0.76                     |
| 预提审计费       | 50,000.00               | 50,000.00                |
| 预提信息披露费     | 250,000.00              | 300,000.00               |
| 合计          | 300,016.85              | 350,000.76               |

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>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          | 17,488,888.13                          | 17,488,888.13     |
| 本期申购          | 1,232,324,525.61                       | 1,232,324,525.61  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -1,224,847,107.60                      | -1,224,847,107.60 |
| - 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           | 24,966,306.14                          | 24,966,306.14     |

注：申购份额含红利再投、转换入份额，赎回份额含转换出份额。

#### 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           | 16,033,214.66    | -2,105,361.78   | 13,927,852.88    |
| 本期利润           | 10,846,995.41    | 642,363.17      | 11,489,358.58    |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 845,822,043.64   | 5,922,082.81    | 851,744,126.45   |
| 其中：基金申购款       | 1,175,442,064.30 | 154,775,821.11  | 1,330,217,885.41 |
| 基金赎回款          | -329,620,020.66  | -148,853,738.30 | -478,473,758.96  |

|         |                 |              |                 |
|---------|-----------------|--------------|-----------------|
| 本期已分配利润 | -864,961,005.30 | -            | -864,961,005.30 |
| 本期末     | 7,741,248.41    | 4,459,084.20 | 12,200,332.61   |

#### 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  | 348,442.66            | 222,525.49            |
| 定期存款利息收入  | -                     | 372,847.37            |
| 其他存款利息收入  | -                     | -                     |
| 结算备付金利息收入 | 16,077.88             | 157,272.75            |
| 其他        | 16,175.17             | 2,566.69              |
| 合计        | 380,695.71            | 755,212.30            |

注：其他包括结算保证金利息收入人民币 1,436.28 元和申购款利息收入人民币 14,738.89 元。上年度可比期间，其他包括结算保证金利息收入人民币 2,166.59 元和申购款利息收入人民币 400.10 元

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 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   | 539,876,046.23        | 526,401,487.26        |
| 减：卖出股票成本总额 | 540,454,810.19        | 536,429,179.99        |
| 买卖股票差价收入   | -578,763.96           | -10,027,692.73        |

#### 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                    | 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 |

|                               |        |               |
|-------------------------------|--------|---------------|
| 债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入 | -14.00 | -3,445,313.58 |
| 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                            | -14.00 | -3,445,313.58 |

#### 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<br>2017年1月1日至2017<br>年12月31日 | 上年度可比期间<br>2016年1月1日至2016年<br>12月31日 |
|-------------------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额   | 406,340.51                      | 414,099,370.81                       |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 399,360.00                      | 411,846,516.28                       |
| 减：应收利息总额                | 6,994.51                        | 5,698,168.11                         |
| 买卖债券差价收入                | -14.00                          | -3,445,313.58                        |

#### 7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

-

#### 7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

-

#### 7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

##### 7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

##### 7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

##### 7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

-

##### 7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

-

### 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

本基金本报告期及上年度可比期间无衍生工具投资收益。

#### 7.4.7.15.2 衍生工具收益 ——其他投资收益

-

### 7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

| 项目          | 本期<br>2017年1月1日至2017年12月31日 | 上年度可比期间<br>2016年1月1日至2016年12月31日 |
|-------------|-----------------------------|----------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 100,718.47                  | 293,650.78                       |
| 基金投资产生的股利收益 | -                           | -                                |
| 合计          | 100,718.47                  | 293,650.78                       |

### 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称       | 本期<br>2017年1月1日至2017年12月31日 | 上年度可比期间<br>2016年1月1日至2016年12月31日 |
|------------|-----------------------------|----------------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | 642,363.17                  | -81,865.42                       |
| ——股票投资     | 642,401.97                  | -133,963.50                      |
| ——债券投资     | -38.80                      | 52,098.08                        |
| ——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         | 642,363.17                  | -81,865.42                       |

### 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

| 项目       | 本期<br>2017年1月1日至2017年12月31日 | 上年度可比期间<br>2016年1月1日至2016年12月31日 |
|----------|-----------------------------|----------------------------------|
| 基金赎回费收入  | 13,500,070.52               | 572,040.15                       |
| 其他收入_转换费 | 1,385.56                    | 4,193.12                         |

|    |               |            |
|----|---------------|------------|
| 合计 | 13,501,456.08 | 576,233.27 |
|----|---------------|------------|

#### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2017年1月1日至2017年12月31日 | 上年度可比期间<br>2016年1月1日至2016年12月31日 |
|-----------|-----------------------------|----------------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 1,675,605.72                | 1,584,992.28                     |
| 银行间市场交易费用 | -                           | 5,045.00                         |
| 合计        | 1,675,605.72                | 1,590,037.28                     |

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2017年1月1日至2017年12月31日 | 上年度可比期间<br>2016年1月1日至2016年12月31日 |
|---------|-----------------------------|----------------------------------|
| 审计费用    | 50,000.00                   | 50,000.00                        |
| 信息披露费   | 150,000.00                  | 300,000.00                       |
| 银行汇划费   | 7,644.85                    | 20,829.41                        |
| 账户维护费   | 36,100.00                   | 54,000.00                        |
| 其他费用_其他 | 1,400.00                    | 300.00                           |
| 合计      | 245,144.85                  | 425,129.41                       |

#### 7.4.7.21 分部报告

-

#### 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，本基金无需要披露的或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，除在 7.4.6 税项中披露的事项外，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 |
|-------|---------|
|-------|---------|

|                        |              |
|------------------------|--------------|
| 华润元大基金管理有限公司           | 基金管理人、基金销售机构 |
| 中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”） | 基金托管人、基金销售机构 |
| 华润深国投信托有限公司            | 基金管理人的股东     |
| 元大证券投资信托股份有限公司         | 基金管理人的股东     |
| 深圳华润元大资产管理有限公司         | 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

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行交易。

##### 7.4.10.1 关联方报酬

###### 7.4.10.1.1 基金管理费

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 |
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 914,830.89            | 5,562,127.12          |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 152,606.24            | 80,324.76             |

注：(1) 基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.40% 的年费率计提，按月支付。日管理费=前一日基金资产净值×1.40%÷当年天数。

(2) 根据《开放式证券投资基金销售费用管理规定》，基金管理人依据销售机构销售基金的保有量提取一定比例的客户维护费，用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，客户维护费从基金管理费中列支。

###### 7.4.10.1.2 基金托管费

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 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 130,690.12            | 794,589.66            |

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.20% 的年费率计提，按月支付。日托管费=前一日基金资产净值×0.20%÷当年天数。

###### 7.4.10.2 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）交易。

### 7.4.10.3 各关联方投资本基金的情况

#### 7.4.10.3.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

#### 7.4.10.3.2 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

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未持有本基金。

#### 7.4.10.4 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<br>2017年1月1日至2017年12月31日 |            | 上年度可比期间<br>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     |
| 中国农业银行 | 890,358.44                  | 348,442.66 | 2,835,428.15                     | 222,525.49 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按银行同业利率计息。

#### 7.4.10.5 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 7.4.10.6 其他关联交易事项的说明

无。

### 7.4.11 利润分配情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 权益登记日     | 除息日 |           | 每10份<br>基金份额分红<br>数 | 现金形式<br>发放总额   | 再投资形式<br>发放总额 | 本期利润分配<br>合计   | 备注 |
|----|-----------|-----|-----------|---------------------|----------------|---------------|----------------|----|
|    |           | 场内  | 场外        |                     |                |               |                |    |
| 1  | 2017年9月8日 | -   | 2017年9月8日 | 7.2200              | 862,633,113.92 | 2,327,891.38  | 864,961,005.30 |    |
| 合计 | -         | -   |           | 7.2200              | 862,633,113.92 | 2,327,891.38  | 864,961,005.30 |    |

### 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                   | 证券 | 成功 | 可流 | 流通受 | 认购 | 期末估 | 数量 | 期末 | 期末估值 | 备注 |
|                      |    |    |    |     |    |     |    |    |      |    |

| 代码     | 名称   | 认购日         | 通日        | 限类型    | 价格    | 值单价   | (单位:股) | 成本总额      | 总额        |   |
|--------|------|-------------|-----------|--------|-------|-------|--------|-----------|-----------|---|
| 603080 | 新疆火炬 | 2017年12月26日 | 2018年1月3日 | 新股流通受限 | 13.60 | 13.60 | 1,000  | 13,600.00 | 13,600.00 | - |

#### 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 |
|--------|------|------------|----------|--------|------------|--------|---------|--------------|--------------|----|
| 601600 | 中国铝业 | 2017年9月12日 | 重大资产重组停牌 | 6.67   | 2018年2月26日 | 7.28   | 160,000 | 1,212,820.00 | 1,067,200.00 | -  |

#### 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

截至本报告期末，本基金未持有从事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

截至本报告期末，本基金未持有从事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。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了由董事会、监事会、董事会下设风险控制委员会，督察长、管理层下设风险管理委员会，监察合规部和各业务部门构成的四级风险管理架构体系。

##### 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。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国农业银行股份有限公司，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。于 2017 年 12 月 31 日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券资产（2016 年 12 月 31 日：无）。

#### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2017 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2016 年 12 月 31 日 |
|--------|-------------------------|--------------------------|
| A-1    | -                       | -                        |
| A-1 以下 | -                       | -                        |
| 未评级    | 1,303,126.80            | -                        |
| 合计     | 1,303,126.80            | -                        |

注：1、未评级债券包括没有信用评级的国债、政策性金融债、央票等。

2、上述评级均由经中国证监会核准从事证券市场资信评级业务的评级机构做出。

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指在履行以交付现金或其他金融资产的方式结算的义务时发生资金短缺的风险。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。本基金所投资证券均在证券交易所或银行间市场交易，除在附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让外，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可回购交易的债券资产的公允价值。本基金所持有的金融负债以及可赎回基金份额净值(所有者权益)的合同约定到期日均为一年以内且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

##### 7.4.13.3.1 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每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基

金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。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。

#### 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。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、债券投资及买入返售金融资产等。本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。

下表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合同约定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2017年12月31日 | 6个月以内        | 6个月-1年 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息            | 合计            |
|--------------------|--------------|--------|------|------|----------------|---------------|
| 资产                 |              |        |      |      |                |               |
| 银行存款               | 890,358.44   | -      | -    | -    | -              | 890,358.44    |
| 结算备付金              | 463,265.56   | -      | -    | -    | -              | 463,265.56    |
| 存出保证金              | 325,661.85   | -      | -    | -    | -              | 325,661.85    |
| 交易性金融资产            | 1,303,126.80 | -      | -    | -    | -33,754,556.00 | 35,057,682.80 |
| 应收利息               | -            | -      | -    | -    | 32,347.73      | 32,347.73     |
| 应收申购款              | -            | -      | -    | -    | 1,186,454.07   | 1,186,454.07  |
| 资产总计               | 2,982,412.65 | -      | -    | -    | -34,973,357.80 | 37,955,770.45 |
| 负债                 |              |        |      |      |                |               |
| 应付证券清算款            | -            | -      | -    | -    | 266,349.62     | 266,349.62    |
| 应付赎回款              | -            | -      | -    | -    | 15,862.61      | 15,862.61     |
| 应付管理人报酬            | -            | -      | -    | -    | 42,425.67      | 42,425.67     |
| 应付托管费              | -            | -      | -    | -    | 6,060.82       | 6,060.82      |
| 应付交易费用             | -            | -      | -    | -    | 158,416.13     | 158,416.13    |
| 其他负债               | -            | -      | -    | -    | 300,016.85     | 300,016.85    |
| 负债总计               | -            | -      | -    | -    | 789,131.70     | 789,131.70    |
| 利率敏感度缺口            | 2,982,412.65 | -      | -    | -    | -              | -             |
| 上年度末               | 6个月以内        | 6个月-1年 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息            | 合计            |

| 2016 年 12 月 31 日 |               | 年 |   |   |              |               |
|------------------|---------------|---|---|---|--------------|---------------|
| 资产               |               |   |   |   |              |               |
| 银行存款             | 2,835,428.15  | - | - | - | -            | 2,835,428.15  |
| 结算备付金            | 850,000.00    | - | - | - | -            | 850,000.00    |
| 存出保证金            | 102,888.20    | - | - | - | -            | 102,888.20    |
| 买入返售金融资产         | 27,000,000.00 | - | - | - | -            | 27,000,000.00 |
| 应收证券清算款          | -             | - | - | - | 1,009,693.06 | 1,009,693.06  |
| 应收利息             | -             | - | - | - | 13,446.02    | 13,446.02     |
| 应收申购款            | -             | - | - | - | 2,964.43     | 2,964.43      |
| 资产总计             | 30,788,316.35 | - | - | - | 1,026,103.51 | 31,814,419.86 |
| 负债               |               |   |   |   |              |               |
| 应付赎回款            | -             | - | - | - | 203.63       | 203.63        |
| 应付管理人报酬          | -             | - | - | - | 37,317.66    | 37,317.66     |
| 应付托管费            | -             | - | - | - | 5,331.12     | 5,331.12      |
| 应付交易费用           | -             | - | - | - | 4,825.68     | 4,825.68      |
| 其他负债             | -             | - | - | - | 350,000.76   | 350,000.76    |
| 负债总计             | -             | - | - | - | 397,678.85   | 397,678.85    |
| 利率敏感度缺口          | 30,788,316.35 | - | - | - | -            | -             |

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| 假设 | 除市场利率以外的其他市场变量保持不变 |                                 |                   |
|----|--------------------|---------------------------------|-------------------|
| 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<br>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） |
|    | 市场利率增加 25 个<br>基准点 | -951.89                         | -                 |
|    | 市场利率减少 25 个<br>基准点 | 953.28                          | -                 |

#### 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，所面临的最大其他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其他价格风险，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。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行交易的股票、债券、货币市场工具、权证、股指期货、银行存款、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会相关规定。

#### 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<br>2017 年 12 月 31 日 |                          | 上年度末<br>2016 年 12 月 31 日 |                       |
|---------------|-------------------------|--------------------------|--------------------------|-----------------------|
|               | 公允价值                    | 占基金<br>资产净<br>值比例<br>(%) | 公允价值                     | 占基金资<br>产净值比<br>例 (%) |
| 交易性金融资产-股票投资  | 33,754,556.00           | 90.82                    | -                        | -                     |
| 交易性金融资产-基金投资  | -                       | -                        | -                        | -                     |
| 交易性金融资产-债券投资  | 1,303,126.80            | 3.51                     | -                        | -                     |
| 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            | 35,057,682.80           | 94.33                    | -                        | -                     |

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 假设             | 除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变 |                             |                        |
|----------------|-------------------------|-----------------------------|------------------------|
| 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） |
|                | 沪深 300 指数上升 5%          | 2,037,772.42                | -                      |
| 沪深 300 指数下降 5% | -2,037,772.42           | -                           |                        |

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 1. 公允价值

##### (1) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值接近于公允价值。

##### (2) 以公允价值计量的金融工具

①金融工具公允价值计量的方法

本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债根据对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值确定公允价值计量层级。公允价值计量层级参见附注 7.4.4.5。

②各层级金融工具公允价值

于 2017 年 12 月 31 日：本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为 32,673,756.00 元，属于第二层级的余额为 2,383,926.80 元，无属于第三层次的余额（于 2016 年 12 月 31 日，本基金未持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产）。

③公允价值所属层级间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券，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将相关股票和债券的公允价值列入第二层级或第三层级，上述事项解除时将相关股票和债券的公允价值列入第一层级；除证券交易所上市的可转换债券外，其他固定收益品种采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值，相关固定收益品种的公允价值层次归入第二层级。

2. 截至资产负债表日，本基金的资产净值为人民币 37,166,638.75 元，已连续超过 60 个工作日基金资产净值低于人民币 5,000 万元。

3. 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目                | 金额            | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|---------------|---------------|
| 1  | 权益投资              | 33,754,556.00 | 88.93         |
|    | 其中：股票             | 33,754,556.00 | 88.93         |
| 2  | 基金投资              | -             | -             |
| 3  | 固定收益投资            | 1,303,126.80  | 3.43          |
|    | 其中：债券             | 1,303,126.80  | 3.43          |
|    | 资产支持证券            | -             | -             |
| 4  | 贵金属投资             | -             | -             |
| 5  | 金融衍生品投资           | -             | -             |
| 6  | 买入返售金融资产          | -             | -             |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -             | -             |
| 7  | 银行存款和结算备付金合计      | 1,353,624.00  | 3.57          |
| 8  | 其他各项资产            | 1,544,463.65  | 4.07          |
| 9  | 合计                | 37,955,770.45 | 100.00        |

### 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         | -             | -             |
| B  | 采矿业              | -             | -             |
| C  | 制造业              | 20,366,152.00 | 54.80         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 13,600.00     | 0.04          |
| E  | 建筑业              | -             | -             |
| F  | 批发和零售业           | -             | -             |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | -             | -             |
| H  | 住宿和餐饮业           | -             | -             |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 1,510,110.00  | 4.06          |
| J  | 金融业              | 11,864,694.00 | 31.92         |
| K  | 房地产业             | -             | -             |
| L  | 租赁和商务服务业         | -             | -             |
| M  | 科学研究和技术服务业       | -             | -             |

|   |               |               |       |
|---|---------------|---------------|-------|
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | -             | -     |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | -             | -     |
| P | 教育            | -             | -     |
| Q | 卫生和社会工作       | -             | -     |
| R | 文化、体育和娱乐业     | -             | -     |
| S | 综合            | -             | -     |
|   | 合计            | 33,754,556.00 | 90.82 |

### 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  | 600519 | 贵州茅台 | 4,600   | 3,208,454.00 | 8.63         |
| 2  | 601939 | 建设银行 | 381,300 | 2,928,384.00 | 7.88         |
| 3  | 601398 | 工商银行 | 430,000 | 2,666,000.00 | 7.17         |
| 4  | 601336 | 新华保险 | 34,300  | 2,407,860.00 | 6.48         |
| 5  | 000063 | 中兴通讯 | 64,200  | 2,334,312.00 | 6.28         |
| 6  | 002008 | 大族激光 | 43,100  | 2,129,140.00 | 5.73         |
| 7  | 000858 | 五粮液  | 26,600  | 2,124,808.00 | 5.72         |
| 8  | 002475 | 立讯精密 | 89,500  | 2,097,880.00 | 5.64         |
| 9  | 300136 | 信维通信 | 40,500  | 2,053,350.00 | 5.52         |
| 10 | 600030 | 中信证券 | 112,800 | 2,041,680.00 | 5.49         |
| 11 | 002415 | 海康威视 | 52,300  | 2,039,700.00 | 5.49         |
| 12 | 600809 | 山西汾酒 | 32,700  | 1,863,573.00 | 5.01         |
| 13 | 000001 | 平安银行 | 136,900 | 1,820,770.00 | 4.90         |
| 14 | 300170 | 汉得信息 | 126,900 | 1,510,110.00 | 4.06         |
| 15 | 000568 | 泸州老窖 | 21,800  | 1,438,800.00 | 3.87         |
| 16 | 601600 | 中国铝业 | 160,000 | 1,067,200.00 | 2.87         |
| 17 | 603080 | 新疆火炬 | 1,000   | 13,600.00    | 0.04         |
| 18 | 002922 | 伊戈尔  | 500     | 8,935.00     | 0.02         |

### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 本期累计买入金额      | 占期初基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|---------------|----------------|
| 1  | 601398 | 工商银行 | 26,073,205.00 | 82.99          |

|    |        |      |               |       |
|----|--------|------|---------------|-------|
| 2  | 600809 | 山西汾酒 | 18,132,632.08 | 57.72 |
| 3  | 601688 | 华泰证券 | 18,062,925.25 | 57.49 |
| 4  | 600519 | 贵州茅台 | 17,174,931.86 | 54.67 |
| 5  | 601939 | 建设银行 | 17,149,716.00 | 54.59 |
| 6  | 000001 | 平安银行 | 16,378,868.00 | 52.13 |
| 7  | 002236 | 大华股份 | 15,031,658.60 | 47.85 |
| 8  | 600036 | 招商银行 | 14,459,701.00 | 46.03 |
| 9  | 601668 | 中国建筑 | 13,915,273.00 | 44.29 |
| 10 | 601318 | 中国平安 | 13,616,225.00 | 43.34 |
| 11 | 600703 | 三安光电 | 13,570,415.00 | 43.19 |
| 12 | 600702 | 沱牌舍得 | 12,966,836.00 | 41.27 |
| 13 | 600068 | 葛洲坝  | 12,914,245.00 | 41.11 |
| 14 | 002456 | 欧菲科技 | 12,802,600.84 | 40.75 |
| 15 | 002241 | 歌尔股份 | 12,800,177.57 | 40.74 |
| 16 | 002142 | 宁波银行 | 12,706,646.76 | 40.45 |
| 17 | 000002 | 万科A  | 12,668,069.00 | 40.32 |
| 18 | 601377 | 兴业证券 | 12,643,414.60 | 40.24 |
| 19 | 000333 | 美的集团 | 12,536,499.00 | 39.90 |
| 20 | 600585 | 海螺水泥 | 12,516,815.00 | 39.84 |
| 21 | 600104 | 上汽集团 | 12,398,453.22 | 39.46 |
| 22 | 000063 | 中兴通讯 | 12,311,311.00 | 39.19 |
| 23 | 601155 | 新城控股 | 10,914,357.47 | 34.74 |
| 24 | 300115 | 长盈精密 | 10,641,375.14 | 33.87 |
| 25 | 002466 | 天齐锂业 | 10,551,791.94 | 33.59 |
| 26 | 600718 | 东软集团 | 10,490,908.00 | 33.39 |
| 27 | 600487 | 亨通光电 | 10,049,619.00 | 31.99 |
| 28 | 002074 | 国轩高科 | 9,924,136.15  | 31.59 |
| 29 | 002460 | 赣锋锂业 | 9,690,476.00  | 30.84 |
| 30 | 603799 | 华友钴业 | 9,684,097.20  | 30.82 |
| 31 | 002008 | 大族激光 | 9,260,418.00  | 29.48 |
| 32 | 000807 | 云铝股份 | 7,852,005.50  | 24.99 |
| 33 | 002410 | 广联达  | 7,274,074.00  | 23.15 |
| 34 | 002027 | 分众传媒 | 7,049,512.80  | 22.44 |
| 35 | 002497 | 雅化集团 | 6,728,720.00  | 21.42 |
| 36 | 300097 | 智云股份 | 6,722,914.00  | 21.40 |
| 37 | 601336 | 新华保险 | 6,169,098.42  | 19.64 |

|    |        |      |              |       |
|----|--------|------|--------------|-------|
| 38 | 000568 | 泸州老窖 | 5,255,498.00 | 16.73 |
| 39 | 601388 | 怡球资源 | 4,828,977.00 | 15.37 |
| 40 | 600030 | 中信证券 | 4,795,627.00 | 15.26 |
| 41 | 000651 | 格力电器 | 3,993,850.00 | 12.71 |
| 42 | 300618 | 寒锐钴业 | 3,562,338.00 | 11.34 |
| 43 | 000725 | 京东方A | 3,399,396.00 | 10.82 |
| 44 | 000858 | 五粮液  | 3,123,651.00 | 9.94  |
| 45 | 603993 | 洛阳钼业 | 2,652,510.00 | 8.44  |
| 46 | 601211 | 国泰君安 | 2,259,249.00 | 7.19  |
| 47 | 002415 | 海康威视 | 2,211,814.00 | 7.04  |
| 48 | 000800 | 一汽轿车 | 2,207,510.00 | 7.03  |
| 49 | 002475 | 立讯精密 | 2,203,931.00 | 7.02  |
| 50 | 300136 | 信维通信 | 2,146,616.40 | 6.83  |
| 51 | 000537 | 广宇发展 | 1,694,340.00 | 5.39  |
| 52 | 600999 | 招商证券 | 1,675,721.00 | 5.33  |
| 53 | 300433 | 蓝思科技 | 1,631,837.00 | 5.19  |
| 54 | 601600 | 中国铝业 | 1,586,686.00 | 5.05  |
| 55 | 600015 | 华夏银行 | 1,562,637.00 | 4.97  |
| 56 | 600298 | 安琪酵母 | 1,547,032.00 | 4.92  |
| 57 | 300170 | 汉得信息 | 1,515,424.00 | 4.82  |
| 58 | 603612 | 索通发展 | 1,384,877.00 | 4.41  |
| 59 | 300251 | 光线传媒 | 1,358,146.00 | 4.32  |
| 60 | 601699 | 潞安环能 | 1,326,122.00 | 4.22  |
| 61 | 000997 | 新大陆  | 1,301,091.00 | 4.14  |
| 62 | 002386 | 天原集团 | 1,291,671.00 | 4.11  |
| 63 | 000776 | 广发证券 | 1,266,628.00 | 4.03  |
| 64 | 600056 | 中国医药 | 1,247,661.00 | 3.97  |
| 65 | 603515 | 欧普照明 | 1,213,762.00 | 3.86  |
| 66 | 600720 | 祁连山  | 1,205,163.00 | 3.84  |
| 67 | 600887 | 伊利股份 | 1,181,487.00 | 3.76  |
| 68 | 601088 | 中国神华 | 1,107,706.10 | 3.53  |
| 69 | 300271 | 华宇软件 | 1,106,050.26 | 3.52  |
| 70 | 601009 | 南京银行 | 1,071,815.00 | 3.41  |
| 71 | 002709 | 天赐材料 | 1,071,575.00 | 3.41  |
| 72 | 000933 | 神火股份 | 1,024,076.00 | 3.26  |
| 73 | 000789 | 万年青  | 1,014,719.00 | 3.23  |

|    |        |      |            |      |
|----|--------|------|------------|------|
| 74 | 600362 | 江西铜业 | 960,211.00 | 3.06 |
| 75 | 000401 | 冀东水泥 | 945,808.00 | 3.01 |
| 76 | 300320 | 海达股份 | 936,498.00 | 2.98 |
| 77 | 002396 | 星网锐捷 | 920,469.00 | 2.93 |
| 78 | 300070 | 碧水源  | 905,026.00 | 2.88 |
| 79 | 300188 | 美亚柏科 | 865,470.00 | 2.75 |
| 80 | 600549 | 厦门钨业 | 837,069.00 | 2.66 |
| 81 | 002304 | 洋河股份 | 782,627.00 | 2.49 |
| 82 | 300078 | 思创医惠 | 779,111.40 | 2.48 |
| 83 | 300083 | 劲胜智能 | 771,557.00 | 2.46 |
| 84 | 600884 | 杉杉股份 | 768,667.00 | 2.45 |
| 85 | 300133 | 华策影视 | 735,303.00 | 2.34 |
| 86 | 002368 | 太极股份 | 725,844.00 | 2.31 |
| 87 | 002812 | 创新股份 | 715,394.00 | 2.28 |
| 88 | 600977 | 中国电影 | 707,581.00 | 2.25 |
| 89 | 000728 | 国元证券 | 700,672.00 | 2.23 |
| 90 | 000709 | 河钢股份 | 695,713.00 | 2.21 |
| 91 | 600958 | 东方证券 | 681,203.00 | 2.17 |
| 92 | 601375 | 中原证券 | 670,192.00 | 2.13 |
| 93 | 600338 | 西藏珠峰 | 663,274.00 | 2.11 |
| 94 | 002668 | 奥马电器 | 657,990.00 | 2.09 |
| 95 | 000825 | 太钢不锈 | 654,805.00 | 2.08 |
| 96 | 600392 | 盛和资源 | 650,720.74 | 2.07 |
| 97 | 002343 | 慈文传媒 | 644,513.00 | 2.05 |
| 98 | 002365 | 永安药业 | 631,686.76 | 2.01 |

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  | 601398 | 工商银行 | 23,975,992.00 | 76.32          |
| 2  | 601688 | 华泰证券 | 17,479,920.79 | 55.64          |
| 3  | 600809 | 山西汾酒 | 16,744,324.84 | 53.30          |
| 4  | 600036 | 招商银行 | 14,583,669.93 | 46.42          |
| 5  | 000001 | 平安银行 | 14,536,413.19 | 46.27          |
| 6  | 600519 | 贵州茅台 | 14,490,135.61 | 46.12          |

|    |        |      |               |       |
|----|--------|------|---------------|-------|
| 7  | 601939 | 建设银行 | 14,333,360.52 | 45.62 |
| 8  | 601318 | 中国平安 | 14,285,253.96 | 45.47 |
| 9  | 002236 | 大华股份 | 14,242,061.60 | 45.33 |
| 10 | 601668 | 中国建筑 | 13,603,980.00 | 43.30 |
| 11 | 600703 | 三安光电 | 13,164,637.00 | 41.90 |
| 12 | 002142 | 宁波银行 | 12,896,189.00 | 41.05 |
| 13 | 600702 | 沱牌舍得 | 12,894,575.38 | 41.04 |
| 14 | 000333 | 美的集团 | 12,789,575.00 | 40.71 |
| 15 | 601377 | 兴业证券 | 12,590,157.70 | 40.07 |
| 16 | 000002 | 万科A  | 12,580,168.54 | 40.04 |
| 17 | 002241 | 歌尔股份 | 12,571,425.10 | 40.02 |
| 18 | 600585 | 海螺水泥 | 12,539,992.00 | 39.91 |
| 19 | 002456 | 欧菲科技 | 12,426,929.65 | 39.56 |
| 20 | 600068 | 葛洲坝  | 12,409,311.54 | 39.50 |
| 21 | 600104 | 上汽集团 | 12,384,086.89 | 39.42 |
| 22 | 000063 | 中兴通讯 | 11,312,320.60 | 36.01 |
| 23 | 601155 | 新城控股 | 10,618,802.49 | 33.80 |
| 24 | 002466 | 天齐锂业 | 10,449,205.00 | 33.26 |
| 25 | 600718 | 东软集团 | 10,382,459.00 | 33.05 |
| 26 | 300115 | 长盈精密 | 10,289,548.00 | 32.75 |
| 27 | 002074 | 国轩高科 | 10,142,519.05 | 32.28 |
| 28 | 600487 | 亨通光电 | 9,886,453.00  | 31.47 |
| 29 | 002460 | 赣锋锂业 | 9,736,324.00  | 30.99 |
| 30 | 603799 | 华友钴业 | 9,659,103.60  | 30.75 |
| 31 | 000807 | 云铝股份 | 8,149,678.00  | 25.94 |
| 32 | 002008 | 大族激光 | 7,326,565.60  | 23.32 |
| 33 | 002027 | 分众传媒 | 7,145,910.00  | 22.75 |
| 34 | 002410 | 广联达  | 7,067,383.00  | 22.50 |
| 35 | 300097 | 智云股份 | 6,707,075.25  | 21.35 |
| 36 | 002497 | 雅化集团 | 6,671,571.00  | 21.24 |
| 37 | 601388 | 怡球资源 | 4,968,557.40  | 15.81 |
| 38 | 601336 | 新华保险 | 4,082,476.00  | 12.99 |
| 39 | 000651 | 格力电器 | 4,027,945.00  | 12.82 |
| 40 | 000568 | 泸州老窖 | 3,740,293.00  | 11.91 |
| 41 | 000725 | 京东方A | 3,567,783.00  | 11.36 |
| 42 | 300618 | 寒锐钴业 | 3,496,663.00  | 11.13 |
| 43 | 600030 | 中信证券 | 2,657,785.00  | 8.46  |
| 44 | 603993 | 洛阳钼业 | 2,509,036.00  | 7.99  |

|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 45 | 000800 | 一汽轿车 | 2,252,235.00 | 7.17 |
| 46 | 601211 | 国泰君安 | 2,187,761.72 | 6.96 |
| 47 | 000537 | 广宇发展 | 1,732,603.00 | 5.51 |
| 48 | 600999 | 招商证券 | 1,681,030.00 | 5.35 |
| 49 | 300433 | 蓝思科技 | 1,679,776.80 | 5.35 |
| 50 | 600298 | 安琪酵母 | 1,604,353.00 | 5.11 |
| 51 | 600015 | 华夏银行 | 1,590,349.60 | 5.06 |
| 52 | 603612 | 索通发展 | 1,397,296.00 | 4.45 |
| 53 | 300251 | 光线传媒 | 1,392,693.00 | 4.43 |
| 54 | 000997 | 新大陆  | 1,358,020.04 | 4.32 |
| 55 | 601699 | 潞安环能 | 1,294,483.00 | 4.12 |
| 56 | 000776 | 广发证券 | 1,265,081.00 | 4.03 |
| 57 | 600056 | 中国医药 | 1,257,390.00 | 4.00 |
| 58 | 600887 | 伊利股份 | 1,235,545.00 | 3.93 |
| 59 | 603515 | 欧普照明 | 1,230,867.00 | 3.92 |
| 60 | 002386 | 天原集团 | 1,207,937.00 | 3.84 |
| 61 | 600720 | 祁连山  | 1,132,358.00 | 3.60 |
| 62 | 300271 | 华宇软件 | 1,105,203.10 | 3.52 |
| 63 | 002709 | 天赐材料 | 1,093,321.00 | 3.48 |
| 64 | 601009 | 南京银行 | 1,078,020.00 | 3.43 |
| 65 | 601088 | 中国神华 | 1,056,238.00 | 3.36 |
| 66 | 000789 | 万年青  | 1,023,056.00 | 3.26 |
| 67 | 000933 | 神火股份 | 998,913.00   | 3.18 |
| 68 | 600362 | 江西铜业 | 980,182.00   | 3.12 |
| 69 | 000401 | 冀东水泥 | 978,589.00   | 3.11 |
| 70 | 000858 | 五粮液  | 977,174.00   | 3.11 |
| 71 | 300320 | 海达股份 | 919,562.00   | 2.93 |
| 72 | 002396 | 星网锐捷 | 880,931.00   | 2.80 |
| 73 | 300070 | 碧水源  | 852,989.00   | 2.72 |
| 74 | 600549 | 厦门钨业 | 850,928.00   | 2.71 |
| 75 | 002304 | 洋河股份 | 835,904.00   | 2.66 |
| 76 | 300188 | 美亚柏科 | 831,226.00   | 2.65 |
| 77 | 600884 | 杉杉股份 | 801,752.00   | 2.55 |
| 78 | 300078 | 思创医惠 | 790,091.00   | 2.51 |
| 79 | 300083 | 劲胜智能 | 761,006.00   | 2.42 |
| 80 | 300133 | 华策影视 | 730,352.00   | 2.32 |
| 81 | 002368 | 太极股份 | 704,451.00   | 2.24 |
| 82 | 600958 | 东方证券 | 682,538.00   | 2.17 |

|    |        |      |            |      |
|----|--------|------|------------|------|
| 83 | 002812 | 创新股份 | 681,292.00 | 2.17 |
| 84 | 000728 | 国元证券 | 676,287.00 | 2.15 |
| 85 | 600392 | 盛和资源 | 672,487.44 | 2.14 |
| 86 | 601375 | 中原证券 | 671,779.00 | 2.14 |
| 87 | 002343 | 慈文传媒 | 663,840.00 | 2.11 |
| 88 | 600338 | 西藏珠峰 | 660,794.00 | 2.10 |
| 89 | 000709 | 河钢股份 | 648,108.00 | 2.06 |
| 90 | 002365 | 永安药业 | 643,925.40 | 2.05 |
| 91 | 600977 | 中国电影 | 643,282.00 | 2.05 |
| 92 | 000825 | 太钢不锈 | 634,185.00 | 2.02 |

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 | 573,566,964.22 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 539,876,046.23 |

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      | 1,303,126.80 | 3.51         |
|    | 其中：政策性金融债 | 1,303,126.80 | 3.51         |
| 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） | -            | -            |
| 8  | 同业存单      | -            | -            |
| 9  | 其他        | -            | -            |
| 10 | 合计        | 1,303,126.80 | 3.51         |

### 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  | 108601 | 国开 1703 | 13,060 | 1,303,126.80 | 3.51         |

注：本基金本报告期末仅持有 1 只债券。

### 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

本基金本报告期末投资股指期货。

#### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末持有股指期货。

### 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

本基金本报告期末持有国债期货。

#### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末投资国债期货。

#### 8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末持有国债期货。

### 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未被监管部门立案调查，且在本报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

#### 8.12.2

本基金所投资的前十名股票没有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   | 325,661.85 |
| 2  | 应收证券清算款 | -          |

|   |       |              |
|---|-------|--------------|
| 3 | 应收股利  | -            |
| 4 | 应收利息  | 32,347.73    |
| 5 | 应收申购款 | 1,186,454.07 |
| 6 | 其他应收款 | -            |
| 7 | 待摊费用  | -            |
| 8 | 其他    | -            |
| 9 | 合计    | 1,544,463.65 |

#### 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，投资组合报告中数字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<br>(户) | 户均持有的<br>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<br>额比例 | 持有份额          | 占总份<br>额比例 |
| 1,492        | 16,733.45     | 700,787.82 | 2.81%      | 24,265,518.32 | 97.19%     |

### 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<br>持有本基金 | 0.00       | 0.0000%  |

注：截至本报告期末，本基金管理人从业人员投资、持有本基金符合相关法律法规、中国证监会规定及相关管理制度的规定。

### 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<br>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（ 2014 年 9 月 18 日 ）基金份额总额 | 65,878,168.77    |
| 本报告期期初基金份额总额                     | 17,488,888.13    |
| 本报告期基金总申购份额                      | 1,232,324,525.61 |
| 减:本报告期基金总赎回份额                    | 1,224,847,107.60 |
| 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                     | 24,966,306.14    |

注：本基金总申购份额含红利再投、转换入份额，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

2017 年 2 月 13 日，根据华润元大基金管理有限公司第二届董事会第十三次临时会议审议通过，公司总经理由林瑞源先生变更为孙晔伟先生；2017 年 7 月 5 日，根据华润元大基金管理有限公司第二届董事会第十九次临时会议审议通过，公司聘任李仆先生为副总经理、李东育先生为总经理助理；2017 年 8 月 2 日，根据华润元大基金管理有限公司第二届董事会第二十一次临时会议审议通过，公司督察长由何特先生变更为刘豫皓先生。

上述变更已按照规定报相关监管机构备案，并进行公告。

本报告期内，本基金托管人于 2016 年 8 月 29 日任命史静欣女士为中国农业银行股份有限公司托管业务部/养老金管理中心副总经理，负责管理证券投资基金托管业务。因工作需要，余晓晨先生于 2017 年 3 月 8 日不再担任中国农业银行股份有限公司托管业务部/养老金管理中心副总经理职务。

### 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

本报告期内，本基金管理人的基金投资策略遵循本基金《基金合同》中规定的投资策略，未发生显著改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

基金管理人于 2017 年 9 月 22 日发布《华润元大基金管理有限公司改聘会计师事务所公告》，将会计师事务所由安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）改聘为德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）。

报告期内应支付德勤会计师事务所（特殊普通合伙）审计费用 50,000.00 元，该审计机构自 2017 年 9 月 22 日起为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，本基金管理人、托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

### 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<br>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<br>成交总额的比<br>例 | 佣金         | 占当期佣金<br>总量的比例 |    |
| 国泰君安 | 1          | 287,067,243.35 | 25.78%               | 267,345.40 | 25.78%         | -  |
| 招商证券 | 1          | 270,372,214.56 | 24.28%               | 251,796.09 | 24.28%         | -  |
| 华泰证券 | 1          | 227,595,939.60 | 20.44%               | 211,960.32 | 20.44%         | -  |
| 银河证券 | 1          | 213,356,108.43 | 19.16%               | 198,698.64 | 19.16%         | -  |
| 中信建投 | 1          | 36,144,517.05  | 3.25%                | 33,661.42  | 3.25%          | -  |
| 安信证券 | 2          | 33,260,621.26  | 2.99%                | 30,975.83  | 2.99%          | -  |
| 国信证券 | 2          | 29,774,226.70  | 2.67%                | 27,728.77  | 2.67%          | -  |
| 中信证券 | 2          | 15,837,864.50  | 1.42%                | 14,749.74  | 1.42%          | -  |
| 海通证券 | 1          | -              | -                    | -          | -              | -  |
| 中金公司 | 1          | -              | -                    | -          | -              | -  |
| 民生证券 | 1          | -              | -                    | -          | -              | -  |
| 中银国际 | 2          | -              | -                    | -          | -              | -  |

注：基金专用交易单元的选择标准和程序如下：

1、基金管理人负责选择代理本基金证券买卖的证券经营机构，使用其交易单元作为基金的专用交易单元，选择的标准是：

- (1) 实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 5 亿元人民币；
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (3) 经营行为规范，最近二年未发生因重大违规行为而受到中国证监会处罚；

- (4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- (5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要，并能为本基金提供全面的信息服务；
- (6) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务。

2、选择交易单元的程序：

我公司根据上述标准，选定符合条件的证券公司作为租用交易单元的对象。我公司投研部门定期对所选定证券公司的服务进行综合评比，评比内容包括：提供研究报告质量、数量、及时性及提供研究服务主动性和质量等情况，并依据评比结果确定交易单元交易的具体情况。我公司在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，向券商租用交易单元作为基金专用交易单元。本基金本报告期内租用的基金专用交易单元未发生变化。

**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 |
| 国泰君安 | -            | -            | 50,000,000.00 | 31.51%         | -    | -            |
| 招商证券 | -            | -            | 12,200,000.00 | 7.69%          | -    | -            |
| 华泰证券 | 2,101,871.60 | 100.00%      | -             | -              | -    | -            |
| 银河证券 | -            | -            | -             | -              | -    | -            |
| 中信建投 | -            | -            | -             | -              | -    | -            |
| 安信证券 | -            | -            | -             | -              | -    | -            |
| 国信证券 | -            | -            | 96,500,000.00 | 60.81%         | -    | -            |
| 中信证券 | -            | -            | -             | -              | -    | -            |
| 海通证券 | -            | -            | -             | -              | -    | -            |
| 中金公司 | -            | -            | -             | -              | -    | -            |
| 民生证券 | -            | -            | -             | -              | -    | -            |

|      |   |   |   |   |   |   |
|------|---|---|---|---|---|---|
| 中银国际 | - | - | - | - | - | - |
|------|---|---|---|---|---|---|

### 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  | 华润元大基金管理有限公司旗下开放式基金净值公告   | 中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站 | 2017 年 1 月 3 日  |
| 2  | 华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金 2016 年第 4 季度报告                              | 中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站 | 2017 年 1 月 19 日 |
| 3  | 华润元大基金管理有限公司总经理变更公告   | 中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站 | 2017 年 2 月 14 日 |
| 4  | 华润元大基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加蚂蚁（杭州）基金销售有限公司转换费率优惠活动的公告              | 中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站 | 2017 年 2 月 25 日 |
| 5  | 华润元大基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加泰诚财富基金销售（大连）有限公司为代销机构、开通定期定额投资和转换业务的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站 | 2017 年 3 月 4 日  |
| 6  | 华润元大基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加南京苏宁基金销售有限公司为代销机构、开通转换业务并参加其费率优惠活动的公告  | 中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站 | 2017 年 3 月 8 日  |
| 7  | 华润元大基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金在北京肯特                                    | 中国证券报、上海证券报、证券时报、基       | 2017 年 3 月 15 日 |

|    |  |                          |                 |
|----|--|--------------------------|-----------------|
|    | 瑞财富投资管理有限公司开通定期定额投资业务的公告   | 金管理人网站                   |                 |
| 8  | 华润元大基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加厦门市鑫鼎盛控股有限公司为代销机构、开通定期定额投资和转换业务并参加其费率优惠活动的公告    | 中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站 | 2017 年 3 月 17 日 |
| 9  | 华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金 2016 年年度报告   | 基金管理人网站                  | 2017 年 3 月 29 日 |
| 10 | 华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金 2016 年年度报告摘要   | 中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站 | 2017 年 3 月 29 日 |
| 11 | 华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金 2017 年第 1 季度报告                                       | 中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站 | 2017 年 4 月 24 日 |
| 12 | 华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）<br>（2017 年第 1 号）                            | 基金管理人网站                  | 2017 年 4 月 28 日 |
| 13 | 华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）<br>摘要（2017 年第 1 号）                          | 中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站 | 2017 年 4 月 28 日 |
| 14 | 华润元大基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加深圳前海凯恩斯基金销售有限公司为代销机构、开通定期定额投资和转换业务并参加其费率优惠活动的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站 | 2017 年 4 月 28 日 |
| 15 | 华润元大基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加申万宏   | 中国证券报、上海证券报、证券时报、基       | 2017 年 6 月 14 日 |

|    |   |                          |                 |
|----|---|--------------------------|-----------------|
|    | 源证券有限公司为代销机构、开通定期定额投资和转换业务并参加其费率优惠活动的公告                               | 金管理人网站                   |                 |
| 16 | 华润元大基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加申万宏源西部证券有限公司为代销机构、开通定期定额投资和转换业务并参加其费率优惠活动的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站 | 2017 年 6 月 24 日 |
| 17 | 华润元大基金管理有限公司旗下开放式基金净值公告   | 中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站 | 2017 年 7 月 1 日  |
| 18 | 华润元大基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加上海华夏财富投资管理有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告             | 中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站 | 2017 年 7 月 5 日  |
| 19 | 华润元大基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加上海通华财富资产管理有限公司为代销机构、开通转换业务并参加其费率优惠活动的公告      | 中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站 | 2017 年 7 月 6 日  |
| 20 | 华润元大基金管理有限公司副总经理任职公告  | 中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站 | 2017 年 7 月 6 日  |
| 21 | 华润元大基金管理有限公司总经理助理任职公告   | 中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站 | 2017 年 7 月 6 日  |
| 22 | 华润元大基金管理有限公司关于调整直销中心柜台个人投资者最  | 中国证券报、上海证券报、证券时报、基       | 2017 年 7 月 17 日 |

|    |   |                          |                 |
|----|---|--------------------------|-----------------|
|    | 低认申购金额限制的公告   | 金管理人网站                   |                 |
| 23 | 华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金 2017 年第 2 季度报告                                  | 中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站 | 2017 年 7 月 20 日 |
| 24 | 华润元大基金管理有限公司督察长变更公告   | 中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站 | 2017 年 8 月 3 日  |
| 25 | 华润元大基金管理有限公司董事长变更公告   | 中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站 | 2017 年 8 月 24 日 |
| 26 | 华润元大基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加招商证券股份有限公司为代销机构、开通定期定额投资和转换业务并参加其费率优惠活动的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站 | 2017 年 8 月 25 日 |
| 27 | 华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金 2017 年半年度报告                                     | 基金管理人网站                  | 2017 年 8 月 26 日 |
| 28 | 华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金 2017 年半年度报告摘要                                   | 中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站 | 2017 年 8 月 26 日 |
| 29 | 华润元大基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加天津万家财富资产管理有限公司为代销机构并开通转换业务的公告              | 中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站 | 2017 年 9 月 6 日  |
| 30 | 华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金分红公告   | 中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站 | 2017 年 9 月 7 日  |
| 31 | 华润元大基金管理有限公司关于旗下部分基金调整停牌股票估值  | 中国证券报、上海证券报、证券时报、基       | 2017 年 9 月 16 日 |

|    | 方法的公告  | 金管理人网站                   |                  |
|----|--|--------------------------|------------------|
| 32 | 华润元大基金管理有限公司改聘会计师事务所公告   | 中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站 | 2017 年 9 月 22 日  |
| 33 | 华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金 2017 年第 3 季度报告                                       | 中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站 | 2017 年 10 月 25 日 |
| 34 | 华润元大基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加喜鹊财富基金销售有限公司为代销机构、开通定期定额投资和转换业务并参加其费率优惠活动的公告    | 中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站 | 2017 年 10 月 27 日 |
| 35 | 华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）<br>（2017 年第 2 号）                            | 基金管理人网站                  | 2017 年 11 月 1 日  |
| 36 | 华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）<br>摘要（2017 年第 2 号）                          | 中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站 | 2017 年 11 月 1 日  |
| 37 | 华润元大基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加天津市凤凰财富基金销售有限公司为代销机构、开通定期定额投资和转换业务并参加其费率优惠活动的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站 | 2017 年 11 月 13 日 |
| 38 | 华润元大基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加上海云湾投资管理有限公司为代销机构、开通定期定额投资和转换业务并参加其费率优惠活动的公告    | 中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站 | 2017 年 11 月 24 日 |

|    |   |                          |                  |
|----|---|--------------------------|------------------|
| 39 | 华润元大基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加中证金牛（北京）投资咨询有限公司为代销机构、开通定期定额投资和转换业务并参加其费率优惠活动的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站 | 2017 年 11 月 24 日 |
| 40 | 华润元大基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加贵州省贵文文化基金销售有限公司为代销机构、开通定期定额投资和转换业务并参加其费率优惠活动的公告  | 中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站 | 2017 年 12 月 1 日  |
| 41 | 华润元大基金关于调整网上直销建行直连渠道基金交易费率优惠的公告   | 中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站 | 2017 年 12 月 11 日 |
| 42 | 华润元大基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加国融证券股份有限公司为代销机构、开通定期定额投资和转换业务并参加其费率优惠活动的公告       | 中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站 | 2017 年 12 月 14 日 |
| 43 | 华润元大基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加武汉市伯嘉基金销售有限公司为代销机构、开通定期定额投资和转换业务并参加其费率优惠活动的公告    | 中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站 | 2017 年 12 月 25 日 |
| 44 | 华润元大基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加泰诚财富基金销售（大连）有限公司为代销机构、开通定期定额投资和转换业务并参加其费率优惠活动    | 中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站 | 2017 年 12 月 27 日 |

|    | 的公告   |                          |                  |
|----|---|--------------------------|------------------|
| 45 | 华润元大基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加东吴证券股份有限公司为代销机构、开通定期定额投资和转换业务并参加其费率优惠活动的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站 | 2017 年 12 月 27 日 |
| 46 | 华润元大基金管理有限公司关于旗下证券投资基金缴纳增值税的公告                                      | 中国证券报、上海证券报、证券时报、基金管理人网站 | 2017 年 12 月 30 日 |

## § 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

| 投资者类别  | 报告期内持有基金份额变化情况 |                                  |                |               |                | 报告期末持有基金情况 |       |
|--------|----------------|----------------------------------|----------------|---------------|----------------|------------|-------|
|        | 序号             | 持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间          | 期初份额           | 申购份额          | 赎回份额           | 持有份额       | 份额占比  |
| 机构     | 1              | 2017 年 9 月 4 日至 2017 年 9 月 6 日   | 0.00           | 6,679,806.27  | 6,679,806.27   | 0.00       | 0.00% |
|        | 2              | 2017 年 9 月 5 日至 2017 年 9 月 6 日   | 0.00           | 38,829,484.98 | 38,829,484.98  | 0.00       | 0.00% |
|        | 3              | 2017 年 9 月 14 日至 2017 年 9 月 20 日 | 139,302,646.19 | 0.00          | 139,302,646.19 | 0.00       | 0.00% |
|        | 4              | 2017 年 9 月 14 日至 2017 年 9 月 20 日 | 95,237,619.05  | 0.00          | 95,237,619.05  | 0.00       | 0.00% |
|        | 5              | 2017 年 9 月 20 日至 2017 年 9 月 21 日 | 33,332,857.14  | 0.00          | 33,332,857.14  | 0.00       | 0.00% |
| 个人     | -              | -                                | -              | -             | -              | -          | -     |
| -      | -              | -                                | -              | -             | -              | -          | -     |
| 产品特有风险 |                |                                  |                |               |                |            |       |

本基金于本报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情形，本基金管理人已经采取措施，审慎确认大额申购与大额赎回，防控产品流动性风险并公平对待投资者。本基金管理人提请投资者注意因单一投资者持有基金份额集中导致的产品流动性风险、大额赎回风险以及净值波动风险等特有风险。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会关于核准本基金募集的批复；
- 2、本基金基金合同；
- 3、本基金托管协议；
- 4、本报告期内在指定报刊上披露的各项公告。

### 13.2 存放地点

以上备查文件存放于基金管理人和基金托管人的办公场所。

### 13.3 查阅方式

基金持有人可在办公时间到基金管理人和基金托管人的办公场所或网站免费查阅。

华润元大基金管理有限公司

2018年3月28日