

# 泰达宏利睿选稳健灵活配置混合型证券投资 基金 2017 年年度报告摘要

2017 年 12 月 31 日

基金管理人：泰达宏利基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2018 年 3 月 29 日

## § 1 重要提示

基金管理人泰达宏利基金管理有限公司的董事会及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责任。本年度报告已经全体独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人招商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，普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2017 年 1 月 23 日（基金合同生效日）起至 2017 年 12 月 31 日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	泰达睿选稳健混合
基金主代码	004000
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 1 月 23 日
基金管理人	泰达宏利基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	81,418,563.24 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	通过现代风险模型技术进行基金风险预算，在严控本基金下行风险的前提下，灵活运用多种投资策略，力争实现基金资产的长期稳健增值
投资策略	本基金将采取目标风险的投资策略，也就是通过优化投资过程，限制预期波动率，将风险维持在固定的低风险水平，从而实现风险约束下投资组合 alpha 的最大化，以便获得尽可能高回报。从长期来看，目标风险策略能够达到市场平均收益，在风控控制方面效果显著，从而提高风险调整后收益
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×35%+中证综合债券指数收益率×65%
风险收益特征	本基金为混合型基金，具有较高预期风险、较高预期收益的特征，其预期风险和预期收益低于股票型基金、高于债券型基金和货币市场基金

### 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		泰达宏利基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	袁静	张燕
	联系电话	010-66577513	0755-83199084
	电子邮箱	irm@mfteda.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		400-698-8888	95555
传真		010-66577666	0755-83195201

## 2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http:// www.mfcteda.com
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

## § 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 1 月 23 日(基金合同生效日)-2017 年 12 月 31 日
本期已实现收益	11,639,839.66
本期利润	12,235,355.27
加权平均基金份额本期利润	0.0418
本期基金份额净值增长率	2.39%
3.1.2 期末数据和指标	2017 年末
期末可供分配基金份额利润	0.0130
期末基金资产净值	83,368,508.82
期末基金份额净值	1.0239

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基金份额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；

3. 期末可供分配利润等于期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-2.08%	0.55%	1.48%	0.29%	-3.56%	0.26%
过去六个月	2.71%	0.51%	3.55%	0.25%	-0.84%	0.26%
自基金合同生效起至今	2.39%	0.47%	6.94%	0.23%	-4.55%	0.24%

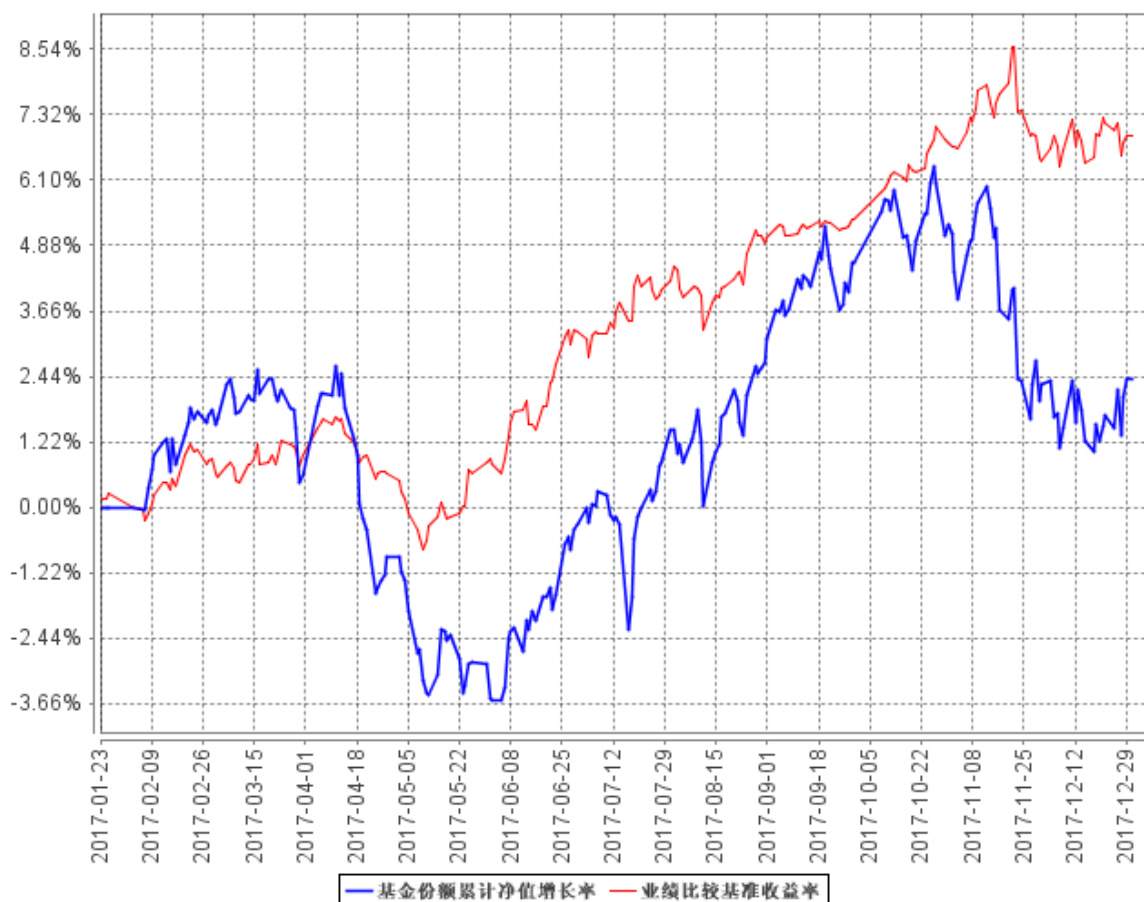
注：本基金业绩比较基准：沪深 300 指数收益率×35%+中证综合债券指数收益率×65%。

本基金选择市场认同度较高、行业分类标准和指数编制方法较为科学的沪深 300 指数作为本

基金股票组合的业绩比较基准。沪深 300 指数由中证指数有限公司编制，是由沪深 A 股中规模大、流通股中规模大、流动性好的最具代表 300 只股票组成，可以综合反映沪深 A 股市场整体表现，适合作为本基金股票部分的业绩比较基准。中证综合债券指数是综合反映银行间和交易所市场国债、金融债、企业债、央票及短融整体走势的跨市场债券指数，其选样是在中证全债指数样本的基础上，增加了央行票据、短期融资券以及一年期以下的国债、金融债和企业债，旨在全面地反映我国债券市场的整体价格变动趋势。该指数具有广泛的市场代表性，能够反映债券市场总体走势。本基金管理人认为，以沪深 300 指数收益率×35%+中证综合债券指数收益率×65%作为本基金的业绩比较基准，能够使本基金持有人理性判断本基金产品的风险收益特征。

### 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

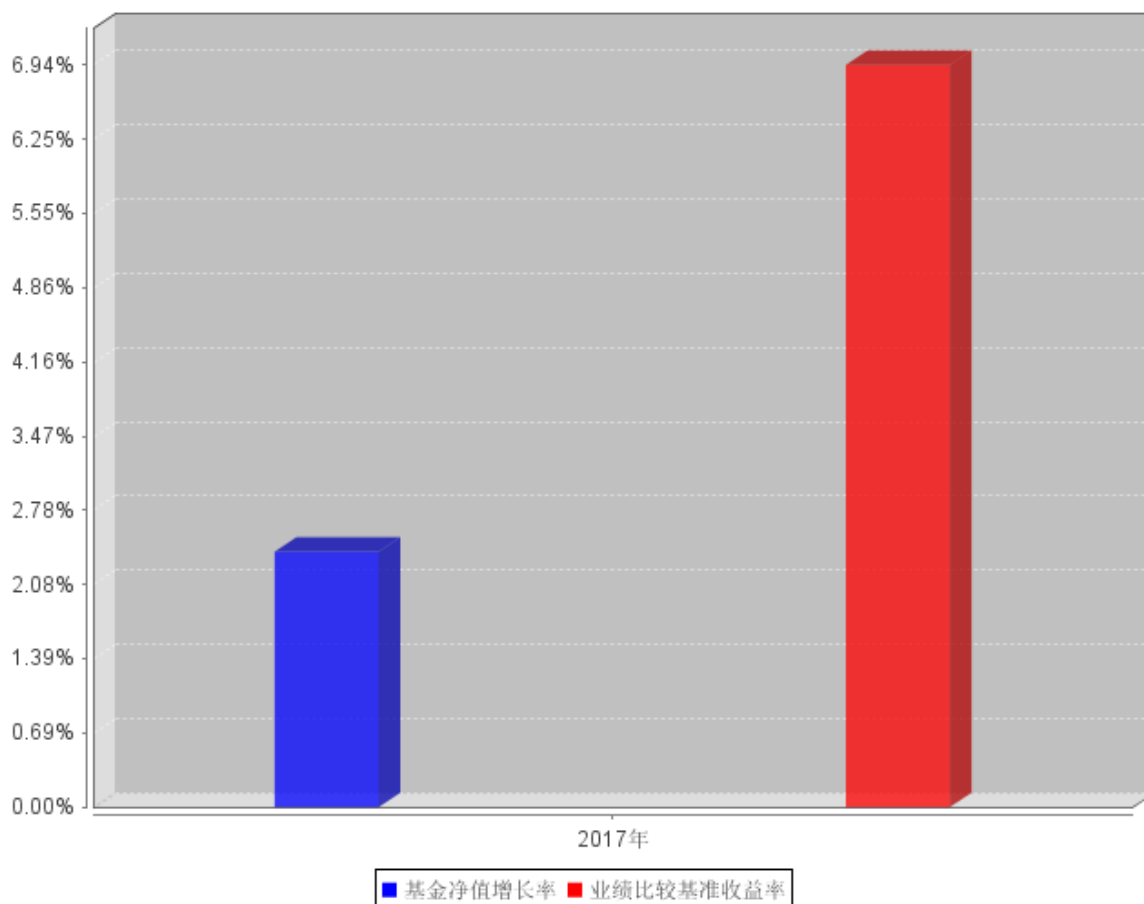
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金成立于 2017 年 1 月 23 日，截止报告期末本基金成立不满一年。按基金合同规定，自基金合同生效日起六个月内为建仓期。本基金在建仓期结束时及截止报告期末各项投资比例已达到基金合同规定的比例要求。

### 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



本基金合同生效日为 2017 年 1 月 23 日，2017 年度净值增长率的计算期间为 2017 年 1 月 23 日至 2017 年 12 月 31 日。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金基金合同于 2017 年 1 月 23 日生效。根据本基金合同及基金实际运作的情况，本基金自成立以来到本报告期末未进行利润分配。目前无其他收益分配安排。

## § 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

泰达宏利基金管理有限公司原名湘财合丰基金管理有限公司、湘财荷银基金管理有限公司、泰达荷银基金管理有限公司，成立于 2002 年 6 月，是中国首批合资基金管理公司之一。截至报告期末本公司股东及持股比例分别为：北方国际信托股份有限公司：51%；宏利资产管理（香港）有

限公司：49%。

目前公司管理着包括泰达宏利价值优化型系列基金、泰达宏利行业精选混合型证券投资基金、泰达宏利风险预算混合型证券投资基金、泰达宏利货币市场基金、泰达宏利效率优选混合型证券投资基金(LOF)、泰达宏利首选企业股票型证券投资基金、泰达宏利市值优选混合型证券投资基金、泰达宏利集利债券型证券投资基金、泰达宏利品质生活灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利红利先锋混合型证券投资基金、泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金、泰达宏利领先中小盘混合型证券投资基金、泰达宏利聚利债券型证券投资基金(LOF)、泰达宏利中证 500 指数分级证券投资基金、泰达宏利逆向策略混合型证券投资基金、泰达宏利信用合利定期开放债券型证券投资基金、泰达宏利瑞利分级债券型证券投资基金、泰达宏利养老收益混合型证券投资基金、泰达宏利淘利债券型证券投资基金、泰达宏利转型机遇股票型证券投资基金、泰达宏利改革动力量化策略灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利创盈灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利复兴伟业灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利新起点灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利蓝筹价值混合型证券投资基金、泰达宏利新思路灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利创益灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利活期友货币市场基金、泰达宏利绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金、泰达宏利同顺大数据量化优选灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利多元回报债券型证券投资基金、泰达宏利增利灵活配置定期开放混合型证券投资基金、泰达宏利汇利债券型证券投资基金、泰达宏利量化增强股票型证券投资基金、泰达宏利启智灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利定宏混合型证券投资基金、泰达宏利创金灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利亚洲债券型证券投资基金、泰达宏利睿智稳健灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利纯利债券型证券投资基金、泰达宏利京元宝货币市场基金、泰达宏利溢利债券型证券投资基金、泰达宏利恒利债券型证券投资基金、泰达宏利睿选稳健灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利启迪灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利启惠灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利启明灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利启泽灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利京天宝货币市场基金、泰达宏利启富灵活配置混合型证券投资基金、泰达宏利港股通优选股票型证券投资基金、泰达宏利业绩驱动量化股票型证券投资基金、泰达宏利全能优选混合型基金中基金(FOF)、泰达宏利交利 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金在内的五十多只证券投资基金。

本公司采用团队投资方式，即通过整个投资团队全体人员的共同努力，力求实现基金财产的持续增值。

#### 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		
刘欣	本基金基金经理； 金融工程部总经理	2017 年 1 月 23 日	-	10	清华大学理学硕士；2007 年 7 月至 2008 年 12 月就职于工银瑞信基金管理有限公司；2008 年 12 月至 2011 年 7 月就职于嘉实基金管理有限公司；2011 年 7 月加盟泰达宏利基金管理有限公司，曾担任产品与金融工程部高级研究员、金融工程部副总经理，现担任金融工程部总经理兼基金经理；具备 10 年基金从业经验，10 年证券投资管理经验，具有基金从业资格。
王靖	本基金基金经理助理，固定收益部副总经理	2017 年 3 月 3 日	-	10	澳大利亚国立大学财务管理硕士；2007 年 11 月至 2010 年 3 月，任职于华夏基金管理有限公司基金运作部，担任基金会计；2010 年 3 月至 2012 年 3 月，任职于华融证券股份有限公司资产管理部，担任投资经理；2012 年 3 月至 2014 年 4 月，任职于国盛证券有限责任公司资产管理总部，担任投资经理；2014 年 5 月至 2016 年 6 月，任职于北信瑞丰基金管理有限公司，担任固定收益部总监兼基金经理；2016 年 6 月至 2016 年 10 月，任职安邦基金管理有限公司（筹），担任固定收益投资部副总经理；2016 年 11 月加入泰达宏利基金管理有限公司，现任固定收益部副



					总经理兼基金经理；具备 10 年证券从业经验，具有基金从业资格。
刘洋	本基金基金经理助理	2017 年 4 月 21 日	-	2	北京大学理学硕士；2015 年 1 月至 2015 年 5 月就职于九坤投资（北京）有限公司，2015 年 5 月加盟泰达宏利基金管理有限公司，曾担任金融工程部助理研究员、研究员，现担任基金经理助理。具备 2 年基金从业经验，具有基金从业资格。

注：证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。表中的任职日期和离任日期均指公司相关公告中披露的日期。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守相关法律法规以及基金合同的约定，本基金运作整体合法合规，没有出现损害基金份额持有人利益的行为。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人建立了公平交易制度和内部控制流程，严格执行相关制度规定。在投资管理活动中，公平对待不同投资组合，确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和投资决策方面享有平等机会；在交易环节实行集中交易制度，交易部运用交易系统内的公平交易功能并按照时间优先、价格优先的原则严格执行所有指令，确保公平交易可操作、可评估、可稽核、可持续；对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以基金管理人名义进行的交易，交易部按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配，确保各投资组合享有公平的投资机会。

基金管理人的风险管理部定期对基金管理人管理的不同投资组合的收益率差异进行分析，对连续四个季度期间内、不同时间窗口下（日内、3 日内、5 日内）基金管理人管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析，并向管理层报告。基金管理人的监察稽核部定期对公平交易制度的执行和控制工作进行稽核。

### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

基金管理人的风险管理部事后从交易指令的公平性、同日反向交易、不同时间窗口下的同向

交易溢价率和风格相似的基金的业绩等方面，对报告期内的公平交易执行情况进行统计分析。本报告期内，交易指令多为指令下达人管理的多只资产组合同时下发，无明显的非公平交易指令；基金管理人严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易；场外交易的交易价格与市场价格一致，场内交易的溢价率在剔除交易时间差异、交易数量悬殊、市场波动剧烈等因素后，处于正常范围之内；基金管理人管理的各投资组合的业绩由于投资策略、管理风格、业绩基准等方面的因素而有所不同。

本报告期内，本基金管理人管理的各投资组合之间未发现利益输送或不公平对待不同组合的情况。

### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金管理人建立了异常交易的监控与报告制度，对异常交易行为进行事前、事中和事后的监控，风险管理部定期对各投资组合的交易行为进行分析评估，向风险控制委员会提交公募基金和特定客户资产组合的交易行为分析报告。监察稽核部定期对异常交易制度的执行和控制工作进行稽核。

本报告期内，除指数基金以外的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况共出现了 7 次，未发现异常。在本报告期内也未发生因异常交易而受到监管机构处罚的情况。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2017 年全年，A 股市场呈现出较强的结构性行情。一方面，数量不足全市场股票 30% 的绩优蓝筹股出现明显上涨，其中以家电、白酒、保险为代表的业绩稳定类行业公司涨幅近翻倍；而另一方面，占市场 70% 的中小股票出现大面积普跌，全市场股票（剔除新股）涨幅中位数为下跌 20%。观察其背后原因，我们看到几方面因素共振。从长期因素看，监管政策从过去数年的较宽松监管模式转向较严格的监管，尤其体现在再融资新规、减持新规等方面，压制了早些年被炒作的小股票壳价值，并且通过严厉打击内幕交易，抑制游资利用资金优势炒作扰乱市场的行为；另一方面，积极引入海外和机构资金，增强专业机构对市场定价的纠偏。从中期因素看，在脱虚向实与金融去杠杆的大背景下，市场利率上升，优质企业融资成本可控，而小型信用等级较低的企业在融资上更加艰难。从表观看，短期大面积中小盘股票估值出现压缩，但是从长远看，整治金融乱象对投资者保护起到了切实作用，规范了市场行为从融资转向投资，对于长期牛市存在较好的支持基础。

本基金在操作中，采用目标波动率策略，控制产品整体波动风险。选股层面，投资风格兼顾成长确定、估值合理、景气度较高的成长性公司，和估值低、基本面稳健、存在改善预期的蓝筹股。从结构上分散由于市场风格大幅波动造成的风险。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止报告期末，本基金份额净值为 1.0239 元，本报告期份额净值增长率为 2.39%，同期业绩比较基准增长率为 6.94%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从大类资产角度看，我们依然维持以往的观点：债市受国内外加息周期和国内资管新规的影响，房地产受到政策严厉的管制，在资金流出受限的背景下，股票市场依然具有较强的吸引力，且财富效应正在形成，趋势投资者开始逐渐进入市场；另一方面看，重组式投资逻辑的破裂将驱使资金重回价值投资，优质白马股的长期投资价值被点燃。与此同时，我们认为 A 股大小盘估值差异的压缩结果要像美国等成熟市场一样到达几乎一致的估值水平需要较长的时间，其原因是尽管严厉的监管政策对小盘重组形成打击，但是 A 股市场资金主要来自上市公司大股东与个人投资者，金融机构资金占比相对较低的这一根本情况并没有快速改变，目前局部的改变来自香港市场和其他海外市场流入资金，但数量有限。未来这一状况的改变有赖于长期机构资金的进入，例如养老金，而目前这一领域最大的突破点在于税务递延式养老保险或基金产品的出现以及相关制度的建立、成熟与完善以及企业年金制度在企业中的普及。从中短期看，市场可能继续维持偏高的利率，这对高盈利风格股票相对有利，而趋势投资者可能进一步推升蓝筹股估值至出现局部泡沫。

基于此观点，我们的配置偏向于具有真实业绩成长且估值合理的股票，并采用目标波动率策略对产品整体风险波动进行控制。本基金在持仓上相对分散，以平衡组合风险。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照相关法律法规规定，设有估值委员会，并制定了相关制度及流程。估值委员会主要负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允与合理。报告期内相关基金估值政策由托管银行进行复核。公司估值委员会主任由主管基金运营的副总经理担任，成员包括但不限于督察长、主管投研的副总经理或投资总监、基金投资部、研究部、金融工程部、固定收益部、合规风控部门、基金运营部的主要负责人；委员会秘书由基金运营部负责人担任。所有人员均具有丰富的专业工作经历，具备良好的专业经验和专业胜任能力。

基金经理参与估值委员会对相关停牌品种估值的讨论，发表相关意见和建议，但涉及停牌品种的基金经理不参与最终的投票表决。

本报告期内，本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突，一切以投资者利益最大化为最高准则。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议，由其按约定提供银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

#### **4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

根据本基金合同及基金实际运作的情况，本基金本报告期内未进行利润分配。目前无其他利润分配安排。

#### **4.8 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**

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

## **§ 5 托管人报告**

### **5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明**

托管人声明，在本报告期内，基金托管人——招商银行股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同，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**

本报告期内基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》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**

本年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 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	普华永道中天审字(2018)第 21247 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	泰达宏利睿选稳健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>(一)我们审计的内容</p> <p>我们审计了泰达宏利睿选稳健灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“泰达宏利睿选稳健混合基金”）的财务报表，包括 2017 年 12 月 31 日的资产负债表，2017 年 1 月 23 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日止期间的利润表和所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二)我们的意见</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在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了泰达宏利睿选稳健混合基金 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年 1 月 23 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日止期间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。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> <p>按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于泰达宏利睿选稳健混合基金，并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	-
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>泰达宏利睿选稳健混合基金的基金管理人泰达宏利基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，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</p>

	<p>报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估泰达宏利睿选稳健混合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，除非基金管理人管理层计划清算泰达宏利睿选稳健混合基金、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泰达宏利睿选稳健混合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>(一) 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>(二) 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>(三) 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>(四) 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，就可能导致对泰达宏利睿选稳健混合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</p>

	<p>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泰达宏利睿选稳健混合基金不能持续经营。</p> <p>(五) 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>
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	单峰   庞伊君
会计师事务所的地址	上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场二座普华永道中心 11 楼
审计报告日期	2018 年 3 月 29 日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体: 泰达宏利睿选稳健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	本期末 2017 年 12 月 31 日
<b>资产:</b>	
银行存款	992, 955. 24
结算备付金	288, 585. 07
存出保证金	62, 652. 92
交易性金融资产	80, 018, 250. 78
其中: 股票投资	69, 518, 615. 08
基金投资	-
债券投资	10, 499, 635. 70
资产支持证券投资	-
贵金属投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	2, 400, 000. 00
应收证券清算款	-
应收利息	290, 261. 15
应收股利	-
应收申购款	2, 579. 53

递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	84,055,284.69
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 2017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	-
卖出回购金融资产款	-
应付证券清算款	-
应付赎回款	20,150.43
应付管理人报酬	108,189.25
应付托管费	18,031.55
应付销售服务费	-
应付交易费用	315,389.51
应交税费	-
应付利息	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	225,015.13
负债合计	686,775.87
<b>所有者权益:</b>	
实收基金	81,418,563.24
未分配利润	1,949,945.58
所有者权益合计	83,368,508.82
负债和所有者权益总计	84,055,284.69

注：1. 报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0239 元，基金份额总额 81,418,563.24 份；

2. 本财务报表的实际编制期间为 2017 年 1 月 23 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日。

## 7.2 利润表

会计主体：泰达宏利睿选稳健灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 23 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期
	2017年1月23日(基金合同生效日)至2017年12月31日
一、收入	20,601,736.20
1. 利息收入	3,422,822.62



其中：存款利息收入	336,327.42
债券利息收入	1,643,409.54
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	1,443,085.66
其他利息收入	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	16,019,845.69
其中：股票投资收益	13,435,435.56
基金投资收益	-
债券投资收益	54,758.33
资产支持证券投资收益	-
贵金属投资收益	-
衍生工具收益	-
股利收益	2,529,651.80
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	595,515.61
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	563,552.28
<b>减：二、费用</b>	<b>8,366,380.93</b>
1. 管理人报酬	4,197,173.78
2. 托管费	699,528.95
3. 销售服务费	-
4. 交易费用	3,213,540.47
5. 利息支出	-
其中：卖出回购金融资产支出	-
6. 其他费用	256,137.73
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>12,235,355.27</b>
减：所得税费用	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>12,235,355.27</b>

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：泰达宏利睿选稳健灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 23 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 23 日(基金合同生效日)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	441,053,393.59	-	441,053,393.59

金净值)			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	12,235,355.27	12,235,355.27
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)	-359,634,830.35	-10,285,409.69	-369,920,240.04
其中: 1. 基金申购款	7,102,713.70	149,194.38	7,251,908.08
2. 基金赎回款	-366,737,544.05	-10,434,604.07	-377,172,148.12
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)	81,418,563.24	1,949,945.58	83,368,508.82

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>刘建</u>	<u>傅国庆</u>	<u>王泉</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

泰达宏利睿选稳健灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)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[2016]2077号《关于准予泰达宏利睿选稳健灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》核准,由泰达宏利基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰达宏利睿选稳健灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币440,988,814.99元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2017)第020号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《泰达宏利睿选稳健灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2017年1月23日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为441,053,393.59份基金份额,其中认购资金利息折合64,578.60份基金份额。本基金的基金管理人为泰达宏利基金管理有限公司,基金托管人为招商银行股份有限公司(以下简称“招商银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰达宏利睿选稳健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,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票),债券(包括国债、央行票

据、金融债、地方政府债、企业债、公司债、短期融资券、中期票据、公开发行的次级债券、可交换债券、可转债及分离交易可转债)、债券回购、资产支持证券、货币市场工具、权证、股指期货、同业存单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的相关规定)。基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的比例为 0%-95%;本基金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,应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券,股指期货的投资比例遵循国家相关法律法规。本基金的业绩比较基准为沪深 300 指数收益率×35%+中证综合债券指数收益率×65%。

本财务报表由本基金的基金管理人泰达宏利基金管理有限公司于 2018 年 3 月 29 日批准报出。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《泰达宏利睿选稳健灵活配置混合型证券投资基金 基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2017 年 1 月 23 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日止期间的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 1 月 23 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2017 年 1 月 23 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。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。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

#### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债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。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，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；对于支付的价款中包含的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。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。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于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。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金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；或者(3) 该金融资产已转移，虽然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，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和债券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其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近

交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，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) 当金融工具不存在活跃市场，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。采用估值技术时，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，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### **7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销**

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### **7.4.4.7 实收基金**

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### **7.4.4.8 损益平准金**

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### **7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量**

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1)该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2)本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3)本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

- (1) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不

活跃)等情况,本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》,根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2)于2017年12月5日前,对于在锁定期内的非公开发行股票,根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》,若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本,按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值;若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本,按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。自2017年12月5日起,对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时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流通受限股票,根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”),按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种,根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外),按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中央国债登记结算有限责任公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

## 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》,对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期

的股票等流通受限股票，本基金自 2017 年 12 月 5 日起改为按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。该估值技术变更对本基金无影响。

### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。



### 7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
泰达宏利基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人、基金代销机构
北方国际信托股份有限公司	基金管理人的股东
宏利资产管理(香港)有限公司	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

### 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.8.1.1 股票交易

本基金本报告期未通过关联交易单元进行股票交易。

##### 7.4.8.1.2 债券交易

本基金本报告期未通过关联交易单元进行债券交易。

##### 7.4.8.1.3 债券回购交易

本基金本报告期未通过关联交易单元进行债券回购交易。

##### 7.4.8.1.4 权证交易

本基金本报告期未通过关联交易单元进行权证交易。

##### 7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内无应支付关联方的佣金。

#### 7.4.8.2 关联方报酬

##### 7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 1 月 23 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	4,197,173.78
其中：支付销售机构的客户维护费	873,856.35

注：支付基金管理人泰达宏利基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50% 的费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 1.50% / 当年天数。上述相关费用包含实际支付金额和税金。

### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 1 月 23 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	699,528.95

注：支付基金托管人招商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

### 7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内无与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）的交易。

### 7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

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

本基金的管理人在本报告期内未运用固有资金投资本基金。

#### 7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金除基金管理人之外的其他关联方在本报告期末未持有本基金。

### 7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期	
	2017 年 1 月 23 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入
招商银行	992,955.24	287,353.02

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按约定利率计息。

### 7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

### 7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

## 7.4.9 期末（2017 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

### 7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.9.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注

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	-
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	-
600057	象屿股份	2017年12月28日	2018年1月8日	配股流通受限	6.10	8.09	20,900	127,490.00	169,081.00	-

### 7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600309	万华化学	2017年12月5日	重大事项	37.94	-	-	38,400	983,619.57	1,456,896.00	-
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	122,400	1,050,610.00	1,205,640.00	-
601216	君正集团	2017年12月15日	重大事项	4.71	-	-	187,400	896,201.00	882,654.00	-
600525	长园集团	2017年12月25日	重大事项	15.79	2018年1月10日	17.30	49,800	798,983.00	786,342.00	-
300362	天翔环境	2017年12月28日	重大事项	12.92	2018年1月5日	13.50	40,600	591,788.44	524,552.00	-
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	-

注：本基金截至 2017 年 12 月 31 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌

的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

### 7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购余额。

#### 7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购余额。

### 7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

#### (1) 公允价值

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

###### (i) 各层次金融工具公允价值

于 2017 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 64,562,573.62 元，属于第二层次的余额为 15,455,677.16 元，无属于第三层次的余额。

###### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

###### (iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

##### (c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

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

##### (d) 不以公允价值计量的金融工具

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

(2) 增值税

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

根据财政部、国家税务总局于 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

此外，财政部、国家税务总局于 2017 年 12 月 25 日颁布的财税[2017]90 号《关于租入固定资产进行税额抵扣等增值税政策的通知》对资管产品管理人自 2018 年 1 月 1 日起运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务的销售额确定做出规定。

上述税收政策对本基金截至 2017 年 12 月 31 日止的财务状况和经营成果无影响。

(3) 除公允价值和增值税外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	69,518,615.08	82.71
	其中：股票	69,518,615.08	82.71
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	10,499,635.70	12.49
	其中：债券	10,499,635.70	12.49
	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	2,400,000.00	2.86
	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	1,281,540.31	1.52

8	其他各项资产	355,493.60	0.42
9	合计	84,055,284.69	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	113,599.00	0.14
B	采矿业	5,321,378.00	6.38
C	制造业	34,797,139.93	41.74
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,143.20	0.02
E	建筑业	2,750,920.00	3.30
F	批发和零售业	6,316,383.40	7.58
G	交通运输、仓储和邮政业	3,461,192.00	4.15
H	住宿和餐饮业	130,074.00	0.16
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,805,476.55	2.17
J	金融业	7,536,125.00	9.04
K	房地产业	4,134,715.00	4.96
L	租赁和商务服务业	1,978,455.00	2.37
M	科学研究和技术服务业	959,158.00	1.15
N	水利、环境和公共设施管理业	197,856.00	0.24
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	69,518,615.08	83.39

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601899	紫金矿业	430,400	1,975,536.00	2.37
2	600511	国药股份	65,583	1,823,207.40	2.19
3	600028	中国石化	294,800	1,807,124.00	2.17
4	600031	三一重工	198,800	1,803,116.00	2.16
5	600755	厦门国贸	177,500	1,792,750.00	2.15
6	600612	老凤祥	43,100	1,773,996.00	2.13
7	601006	大秦铁路	194,600	1,765,022.00	2.12
8	600519	贵州茅台	2,500	1,743,725.00	2.09
9	601166	兴业银行	100,900	1,714,291.00	2.06
10	600406	国电南瑞	93,100	1,701,868.00	2.04

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于管理人网站的年度报告正文。

### 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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	600516	方大炭素	6,919,293.46	8.30
2	300338	开元股份	5,870,046.81	7.04
3	601899	紫金矿业	5,678,554.00	6.81
4	002589	瑞康医药	5,574,022.90	6.69
5	600019	宝钢股份	5,477,207.45	6.57
6	600971	恒源煤电	5,354,776.36	6.42
7	600325	华发股份	5,277,354.16	6.33
8	000550	江铃汽车	5,198,124.32	6.24
9	000959	首钢股份	5,161,604.33	6.19
10	601288	农业银行	4,989,722.20	5.99
11	002508	老板电器	4,901,952.99	5.88
12	002016	世荣兆业	4,876,937.98	5.85
13	600340	华夏幸福	4,851,707.00	5.82
14	002010	传化智联	4,844,576.24	5.81

15	000725	京东方 A	4,790,259.20	5.75
16	600900	长江电力	4,721,508.00	5.66
17	601898	中煤能源	4,684,767.00	5.62
18	000333	美的集团	4,608,215.02	5.53
19	300138	晨光生物	4,389,863.22	5.27
20	601398	工商银行	4,375,298.00	5.25
21	600389	江山股份	4,220,357.50	5.06
22	601225	陕西煤业	4,179,422.65	5.01
23	600887	伊利股份	4,146,811.08	4.97
24	300116	坚瑞沃能	4,114,385.48	4.94
25	600606	绿地控股	4,100,208.00	4.92
26	002142	宁波银行	4,006,574.42	4.81
27	600519	贵州茅台	3,956,366.50	4.75
28	000415	渤海金控	3,912,431.31	4.69
29	002601	龙鳞佰利	3,909,273.87	4.69
30	601857	中国石油	3,809,748.00	4.57
31	601012	隆基股份	3,746,133.79	4.49
32	002195	二三四五	3,688,469.00	4.42
33	600415	小商品城	3,684,007.90	4.42
34	000898	鞍钢股份	3,647,219.90	4.37
35	600875	东方电气	3,613,403.23	4.33
36	002202	金风科技	3,611,217.45	4.33
37	600395	盘江股份	3,604,649.51	4.32
38	000039	中集集团	3,591,145.93	4.31
39	300316	晶盛机电	3,520,194.84	4.22
40	600166	福田汽车	3,502,272.22	4.20
41	300070	碧水源	3,502,040.00	4.20
42	002311	海大集团	3,500,971.95	4.20
43	601866	中远海发	3,488,087.00	4.18
44	601628	中国人寿	3,469,286.55	4.16
45	600703	三安光电	3,467,810.60	4.16
46	600883	博闻科技	3,434,803.00	4.12
47	601166	兴业银行	3,434,241.05	4.12
48	300054	鼎龙股份	3,424,595.00	4.11
49	600600	青岛啤酒	3,416,216.05	4.10
50	300164	通源石油	3,401,091.03	4.08



51	000930	中粮生化	3,385,260.00	4.06
52	600348	阳泉煤业	3,344,207.67	4.01
53	300306	远方信息	3,332,891.45	4.00
54	000895	双汇发展	3,308,171.63	3.97
55	002026	山东威达	3,280,787.57	3.94
56	601339	百隆东方	3,260,206.12	3.91
57	000046	泛海控股	3,256,690.43	3.91
58	002120	韵达股份	3,253,027.80	3.90
59	300064	豫金刚石	3,237,967.96	3.88
60	601633	长城汽车	3,224,009.00	3.87
61	000800	一汽轿车	3,221,722.99	3.86
62	300230	永利股份	3,217,568.88	3.86
63	601678	滨化股份	3,209,997.00	3.85
64	300258	精锻科技	3,188,051.73	3.82
65	600702	沱牌舍得	3,184,820.46	3.82
66	002463	沪电股份	3,184,536.00	3.82
67	300131	英唐智控	3,178,978.00	3.81
68	600235	民丰特纸	3,172,815.32	3.81
69	000631	顺发恒业	3,169,734.16	3.80
70	002442	龙星化工	3,169,673.00	3.80
71	600808	马钢股份	3,165,932.00	3.80
72	000036	华联控股	3,163,779.97	3.79
73	300259	新天科技	3,162,279.42	3.79
74	600640	号百控股	3,161,325.10	3.79
75	603566	普莱柯	3,148,179.19	3.78
76	600067	冠城大通	3,147,954.00	3.78
77	601518	吉林高速	3,144,602.00	3.77
78	600261	阳光照明	3,141,809.00	3.77
79	600853	龙建股份	3,141,526.60	3.77
80	600367	红星发展	3,141,105.14	3.77
81	002480	新筑股份	3,133,152.24	3.76
82	002705	新宝股份	3,132,578.14	3.76
83	002742	三圣股份	3,132,389.85	3.76
84	600628	新世界	3,127,653.00	3.75
85	600683	京投发展	3,123,416.56	3.75
86	002223	鱼跃医疗	3,118,096.00	3.74

87	603968	醋化股份	3,113,942.67	3.74
88	000630	铜陵有色	3,111,839.00	3.73
89	300200	高盟新材	3,110,787.13	3.73
90	600063	皖维高新	3,109,700.00	3.73
91	600213	亚星客车	3,107,212.80	3.73
92	603002	宏昌电子	3,106,966.24	3.73
93	600378	天科股份	3,106,106.55	3.73
94	002609	捷顺科技	3,105,584.43	3.73
95	600510	黑牡丹	3,102,462.91	3.72
96	600188	兖州煤业	3,102,122.00	3.72
97	600882	广泽股份	3,100,790.17	3.72
98	601888	中国国旅	3,100,623.80	3.72
99	002144	宏达高科	3,100,619.54	3.72
100	002205	国统股份	3,100,065.00	3.72
101	600771	广誉远	3,098,465.58	3.72
102	600661	新南洋	3,098,428.00	3.72
103	600740	山西焦化	3,095,686.51	3.71
104	600127	金健米业	3,095,339.51	3.71
105	601001	大同煤业	3,095,169.98	3.71
106	600657	信达地产	3,095,125.30	3.71
107	002529	海源机械	3,093,528.21	3.71
108	002580	圣阳股份	3,092,368.53	3.71
109	600743	华远地产	3,091,754.00	3.71
110	600624	复旦复华	3,091,571.07	3.71
111	002392	北京利尔	3,091,131.60	3.71
112	603268	松发股份	3,090,651.42	3.71
113	600586	金晶科技	3,090,504.58	3.71
114	000890	法尔胜	3,089,157.74	3.71
115	600889	南京化纤	3,088,508.02	3.70
116	600363	联创光电	3,087,885.20	3.70
117	000625	长安汽车	3,087,851.00	3.70
118	600997	开滦股份	3,086,046.00	3.70
119	600094	大名城	3,085,985.00	3.70
120	300401	花园生物	3,085,554.00	3.70
121	002108	沧州明珠	3,081,033.66	3.70
122	002457	青龙管业	3,077,495.00	3.69

123	000820	神雾节能	3,070,629.00	3.68
124	002242	九阳股份	3,027,183.91	3.63
125	002043	兔宝宝	3,020,939.00	3.62
126	000651	格力电器	2,999,299.69	3.60
127	600066	宇通客车	2,990,812.97	3.59
128	002032	苏泊尔	2,924,019.14	3.51
129	300293	蓝英装备	2,915,543.27	3.50
130	603518	维格娜丝	2,914,741.36	3.50
131	000060	中金岭南	2,895,963.00	3.47
132	600287	江苏舜天	2,848,101.35	3.42
133	000421	南京公用	2,839,971.69	3.41
134	601098	中南传媒	2,810,507.09	3.37
135	601006	大秦铁路	2,750,392.00	3.30
136	600690	青岛海尔	2,736,508.46	3.28
137	600028	中国石化	2,699,180.00	3.24
138	600612	老凤祥	2,675,364.00	3.21
139	002221	东华能源	2,668,108.99	3.20
140	000525	红太阳	2,655,512.78	3.19
141	600153	建发股份	2,637,521.00	3.16
142	600502	安徽水利	2,613,234.88	3.13
143	600018	上港集团	2,608,692.00	3.13
144	600779	水井坊	2,605,653.65	3.13
145	002152	广电运通	2,602,826.72	3.12
146	600978	宜华生活	2,576,306.00	3.09
147	600856	中天能源	2,566,518.05	3.08
148	300284	苏交科	2,554,208.98	3.06
149	600684	珠江实业	2,538,284.32	3.04
150	000568	泸州老窖	2,526,369.80	3.03
151	002470	金正大	2,508,370.25	3.01
152	600708	光明地产	2,468,374.99	2.96
153	600398	海澜之家	2,448,888.00	2.94
154	002503	搜于特	2,412,333.90	2.89
155	300072	三聚环保	2,411,706.00	2.89
156	603611	诺力股份	2,404,432.42	2.88
157	600893	航发动力	2,395,047.00	2.87
158	300184	力源信息	2,390,502.78	2.87

159	600377	宁沪高速	2,386,004.80	2.86
160	600998	九州通	2,377,717.20	2.85
161	600031	三一重工	2,370,317.00	2.84
162	600070	浙江富润	2,319,002.10	2.78
163	002217	合力泰	2,315,973.00	2.78
164	600511	国药股份	2,313,979.80	2.78
165	600623	华谊集团	2,306,126.89	2.77
166	600220	江苏阳光	2,301,575.65	2.76
167	002216	三全食品	2,301,251.46	2.76
168	300365	恒华科技	2,273,284.07	2.73
169	002131	利欧股份	2,272,483.00	2.73
170	600104	上汽集团	2,270,774.32	2.72
171	002091	江苏国泰	2,264,557.00	2.72
172	002160	常铝股份	2,264,360.95	2.72
173	002304	洋河股份	2,258,532.84	2.71
174	600535	天士力	2,252,033.51	2.70
175	002682	龙洲股份	2,250,869.00	2.70
176	601668	中国建筑	2,250,246.00	2.70
177	002515	金字火腿	2,249,606.56	2.70
178	600522	中天科技	2,248,219.00	2.70
179	002615	哈尔斯	2,199,557.82	2.64
180	600280	中央商场	2,199,360.00	2.64
181	000567	海德股份	2,195,454.00	2.63
182	600362	江西铜业	2,173,421.46	2.61
183	600160	巨化股份	2,153,088.09	2.58
184	000960	锡业股份	2,152,262.00	2.58
185	002329	皇氏集团	2,151,698.01	2.58
186	600010	包钢股份	2,150,480.00	2.58
187	000997	新大陆	2,149,738.28	2.58
188	002587	奥拓电子	2,149,417.50	2.58
189	300061	康旗股份	2,135,155.93	2.56
190	300083	劲胜智能	2,134,531.19	2.56
191	600309	万华化学	2,133,988.40	2.56
192	600240	华业资本	2,120,668.00	2.54
193	000639	西王食品	2,101,560.00	2.52
194	300007	汉威科技	2,099,919.00	2.52

195	603766	隆鑫通用	2,099,158.08	2.52
196	300170	汉得信息	2,089,601.62	2.51
197	002674	兴业科技	2,089,333.95	2.51
198	601939	建设银行	2,084,135.00	2.50
199	000881	中广核技	2,075,650.00	2.49
200	002080	中材科技	2,069,099.40	2.48
201	600585	海螺水泥	2,051,310.00	2.46
202	600383	金地集团	2,038,100.82	2.44
203	601601	中国太保	2,037,928.00	2.44
204	002008	大族激光	2,035,303.00	2.44
205	002706	良信电器	2,034,813.31	2.44
206	300197	铁汉生态	2,017,752.00	2.42
207	000524	岭南控股	2,005,129.89	2.41
208	002717	岭南园林	2,004,096.00	2.40
209	002573	清新环境	2,001,440.01	2.40
210	300144	宋城演艺	2,001,335.29	2.40
211	000980	众泰汽车	1,994,581.00	2.39
212	300324	旋极信息	1,992,141.08	2.39
213	600410	华胜天成	1,983,805.00	2.38
214	300217	东方电热	1,976,656.95	2.37
215	600282	南钢股份	1,974,910.00	2.37
216	000990	诚志股份	1,960,170.00	2.35
217	600577	精达股份	1,942,158.87	2.33
218	000151	中成股份	1,941,876.00	2.33
219	000528	柳 工	1,941,123.50	2.33
220	000707	双环科技	1,941,017.38	2.33
221	300232	洲明科技	1,940,300.10	2.33
222	600755	厦门国贸	1,936,402.00	2.32
223	603600	永艺股份	1,936,186.10	2.32
224	600090	同济堂	1,932,321.00	2.32
225	600429	三元股份	1,925,956.31	2.31
226	300178	腾邦国际	1,922,470.00	2.31
227	000759	中百集团	1,916,447.24	2.30
228	300340	科恒股份	1,910,415.00	2.29
229	603338	浙江鼎力	1,908,995.00	2.29
230	300183	东软载波	1,904,961.00	2.28

231	002270	华明装备	1,904,847.97	2.28
232	002135	东南网架	1,904,071.00	2.28
233	600051	宁波联合	1,903,926.58	2.28
234	600231	凌钢股份	1,903,603.00	2.28
235	600482	中国动力	1,899,626.00	2.28
236	601877	正泰电器	1,894,028.26	2.27
237	300472	新元科技	1,892,467.88	2.27
238	300394	天孚通信	1,892,247.69	2.27
239	600479	千金药业	1,892,224.71	2.27
240	300093	金刚玻璃	1,892,007.00	2.27
241	002084	海鸥卫浴	1,891,697.62	2.27
242	600338	西藏珠峰	1,891,463.84	2.27
243	603306	华懋科技	1,888,463.82	2.27
244	600183	生益科技	1,885,250.00	2.26
245	600816	安信信托	1,883,508.00	2.26
246	300094	国联水产	1,881,744.60	2.26
247	002146	荣盛发展	1,881,168.00	2.26
248	002244	滨江集团	1,881,027.00	2.26
249	600665	天地源	1,880,249.72	2.26
250	601390	中国中铁	1,867,771.00	2.24
251	002337	赛象科技	1,867,680.83	2.24
252	300378	鼎捷软件	1,865,963.00	2.24
253	600960	渤海活塞	1,860,544.00	2.23
254	600271	航天信息	1,860,031.67	2.23
255	002653	海思科	1,856,601.00	2.23
256	600297	广汇汽车	1,843,478.32	2.21
257	000070	特发信息	1,840,999.54	2.21
258	300430	诚益通	1,823,788.60	2.19
259	600663	陆家嘴	1,822,385.23	2.19
260	300274	阳光电源	1,803,612.03	2.16
261	600778	友好集团	1,803,278.05	2.16
262	600739	辽宁成大	1,799,639.00	2.16
263	300260	新莱应材	1,787,306.11	2.14
264	603288	海天味业	1,784,387.32	2.14
265	002236	大华股份	1,783,861.00	2.14
266	000802	北京文化	1,783,330.00	2.14

267	601258	庞大集团	1,782,529.00	2.14
268	002443	金洲管道	1,781,775.00	2.14
269	600458	时代新材	1,781,590.98	2.14
270	002380	科远股份	1,780,325.20	2.14
271	603899	晨光文具	1,780,159.00	2.14
272	601058	赛轮金宇	1,778,928.00	2.13
273	000016	深康佳A	1,778,522.00	2.13
274	000008	神州高铁	1,778,065.03	2.13
275	600406	国电南瑞	1,778,036.00	2.13
276	600697	欧亚集团	1,775,431.98	2.13
277	300444	双杰电气	1,774,904.95	2.13
278	600507	方大特钢	1,774,005.00	2.13
279	600393	粤泰股份	1,773,929.00	2.13
280	600530	交大昂立	1,772,403.30	2.13
281	002686	亿利达	1,770,360.76	2.12
282	002369	卓翼科技	1,770,267.00	2.12
283	600201	生物股份	1,768,656.18	2.12
284	300082	奥克股份	1,765,007.30	2.12
285	002058	威尔泰	1,764,394.96	2.12
286	002540	亚太科技	1,763,456.00	2.12
287	300150	世纪瑞尔	1,763,083.00	2.11
288	002564	天沃科技	1,762,543.82	2.11
289	601179	中国西电	1,757,795.00	2.11
290	000729	燕京啤酒	1,757,025.35	2.11
291	600157	永泰能源	1,756,939.00	2.11
292	601009	南京银行	1,756,537.00	2.11
293	002180	纳思达	1,755,540.63	2.11
294	601515	东风股份	1,755,340.54	2.11
295	000418	小天鹅A	1,754,911.66	2.11
296	600653	申华控股	1,753,853.00	2.10
297	002666	德联集团	1,752,415.18	2.10
298	002498	汉缆股份	1,752,037.00	2.10
299	300267	尔康制药	1,751,694.23	2.10
300	603077	和邦生物	1,748,178.00	2.10
301	600811	东方集团	1,747,992.29	2.10
302	601808	中海油服	1,746,949.99	2.10

303	600705	中航资本	1,746,647.00	2.10
304	600648	外高桥	1,746,335.44	2.09
305	600637	东方明珠	1,746,322.37	2.09
306	002493	荣盛石化	1,745,346.40	2.09
307	600438	通威股份	1,743,066.00	2.09
308	600850	华东电脑	1,741,198.21	2.09
309	000560	昆百大A	1,741,030.49	2.09
310	002677	浙江美大	1,735,100.00	2.08
311	002563	森马服饰	1,729,333.45	2.07
312	002416	爱施德	1,727,903.59	2.07
313	000627	天茂集团	1,725,295.00	2.07
314	002635	安洁科技	1,724,373.00	2.07
315	002024	苏宁云商	1,722,131.05	2.07
316	000100	TCL 集团	1,721,658.00	2.07
317	300092	科新机电	1,716,202.44	2.06
318	601231	环旭电子	1,709,637.57	2.05
319	300139	晓程科技	1,704,347.19	2.04
320	002147	新光圆成	1,703,939.00	2.04
321	002081	金螳螂	1,698,080.20	2.04
322	603005	晶方科技	1,695,316.28	2.03
323	300433	蓝思科技	1,693,539.00	2.03
324	600068	葛洲坝	1,692,090.00	2.03
325	601988	中国银行	1,691,698.00	2.03
326	600566	济川药业	1,684,675.00	2.02
327	600126	杭钢股份	1,680,048.89	2.02
328	601567	三星医疗	1,679,887.53	2.02
329	300389	艾比森	1,679,384.64	2.01
330	002541	鸿路钢构	1,677,363.33	2.01
331	601088	中国神华	1,677,339.00	2.01
332	600058	五矿发展	1,674,290.59	2.01
333	300158	振东制药	1,672,501.69	2.01
334	600864	哈投股份	1,672,477.62	2.01

注：“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“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。

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	600971	恒源煤电	6,587,268.17	7.90
2	300338	开元股份	5,970,923.86	7.16
3	600019	宝钢股份	5,914,210.66	7.09
4	002589	瑞康医药	5,881,871.24	7.06
5	000725	京东方 A	5,416,017.00	6.50
6	600516	方大炭素	5,299,216.98	6.36
7	000959	首钢股份	5,264,746.74	6.32
8	600325	华发股份	5,178,739.60	6.21
9	000550	江铃汽车	5,173,153.96	6.21
10	002508	老板电器	5,053,967.67	6.06
11	002016	世荣兆业	4,991,624.76	5.99
12	600900	长江电力	4,835,609.89	5.80
13	601225	陕西煤业	4,727,911.00	5.67
14	601898	中煤能源	4,713,419.54	5.65
15	002010	传化智联	4,567,673.92	5.48
16	601398	工商银行	4,551,455.00	5.46
17	601899	紫金矿业	4,491,768.89	5.39
18	300116	坚瑞沃能	4,369,797.02	5.24
19	300138	晨光生物	4,361,859.87	5.23
20	601012	隆基股份	4,258,768.70	5.11
21	601288	农业银行	4,246,527.96	5.09
22	002202	金风科技	4,185,113.65	5.02
23	000898	鞍钢股份	4,167,436.13	5.00
24	002142	宁波银行	4,149,334.80	4.98
25	000820	神雾节能	4,054,505.66	4.86
26	000333	美的集团	4,034,584.30	4.84
27	600389	江山股份	4,000,631.67	4.80
28	600606	绿地控股	3,992,429.00	4.79
29	601888	中国国旅	3,875,643.39	4.65
30	002742	三圣股份	3,765,832.00	4.52
31	000415	渤海金控	3,751,604.10	4.50
32	000039	中集集团	3,741,185.40	4.49
33	002601	龙麟佰利	3,740,182.00	4.49
34	002195	二三四五	3,736,152.82	4.48
35	600702	沱牌舍得	3,710,817.00	4.45

36	300316	晶盛机电	3,687,852.06	4.42
37	600883	博闻科技	3,655,107.56	4.38
38	002311	海大集团	3,641,839.00	4.37
39	600348	阳泉煤业	3,599,906.69	4.32
40	600415	小商品城	3,599,819.00	4.32
41	000930	中粮生化	3,575,360.00	4.29
42	600395	盘江股份	3,523,467.69	4.23
43	601866	中远海发	3,517,674.57	4.22
44	600600	青岛啤酒	3,517,074.48	4.22
45	600779	水井坊	3,516,923.71	4.22
46	600363	联创光电	3,508,022.00	4.21
47	600771	广誉远	3,440,324.64	4.13
48	600887	伊利股份	3,437,751.00	4.12
49	002457	青龙管业	3,406,048.69	4.09
50	002205	国统股份	3,390,630.00	4.07
51	000800	一汽轿车	3,386,319.37	4.06
52	300258	精锻科技	3,378,108.64	4.05
53	600127	金健米业	3,377,580.90	4.05
54	300070	碧水源	3,372,311.41	4.05
55	600808	马钢股份	3,369,887.75	4.04
56	600166	福田汽车	3,351,556.00	4.02
57	002120	韵达股份	3,351,202.38	4.02
58	600586	金晶科技	3,336,636.00	4.00
59	600063	皖维高新	3,324,056.66	3.99
60	000631	顺发恒业	3,323,217.20	3.99
61	002705	新宝股份	3,302,703.10	3.96
62	600853	龙建股份	3,297,389.99	3.96
63	600743	华远地产	3,270,146.16	3.92
64	300306	远方信息	3,265,569.47	3.92
65	600624	复旦复华	3,262,659.10	3.91
66	002026	山东威达	3,259,077.66	3.91
67	300259	新天科技	3,259,028.52	3.91
68	600213	亚星客车	3,239,389.93	3.89
69	601339	百隆东方	3,236,287.00	3.88
70	603566	普莱柯	3,236,203.20	3.88
71	600340	华夏幸福	3,233,269.00	3.88
72	600188	兖州煤业	3,229,563.49	3.87
73	600367	红星发展	3,220,615.00	3.86

74	300054	鼎龙股份	3,220,198.80	3.86
75	002392	北京利尔	3,199,219.90	3.84
76	601001	大同煤业	3,198,944.23	3.84
77	600683	京投发展	3,184,021.82	3.82
78	002223	鱼跃医疗	3,183,912.01	3.82
79	600657	信达地产	3,182,654.14	3.82
80	603002	宏昌电子	3,175,624.23	3.81
81	000525	红太阳	3,170,517.05	3.80
82	603968	醋化股份	3,161,174.89	3.79
83	000895	双汇发展	3,156,574.65	3.79
84	601633	长城汽车	3,155,451.00	3.78
85	002463	沪电股份	3,152,167.97	3.78
86	000625	长安汽车	3,128,236.00	3.75
87	600889	南京化纤	3,128,196.87	3.75
88	002108	沧州明珠	3,116,668.72	3.74
89	000036	华联控股	3,115,519.22	3.74
90	000651	格力电器	3,105,913.00	3.73
91	300131	英唐智控	3,103,145.92	3.72
92	601678	滨化股份	3,101,107.31	3.72
93	002144	宏达高科	3,100,277.60	3.72
94	300064	豫金刚石	3,097,305.00	3.72
95	000046	泛海控股	3,095,380.68	3.71
96	002032	苏泊尔	3,070,132.60	3.68
97	601518	吉林高速	3,065,539.64	3.68
98	600067	冠城大通	3,043,315.43	3.65
99	002609	捷顺科技	3,043,060.77	3.65
100	600510	黑牡丹	3,042,795.89	3.65
101	600661	新南洋	3,041,511.67	3.65
102	002242	九阳股份	3,027,402.96	3.63
103	000890	法尔胜	3,023,433.43	3.63
104	600094	大名城	3,018,129.33	3.62
105	600997	开滦股份	3,001,511.00	3.60
106	000630	铜陵有色	3,001,317.00	3.60
107	002442	龙星化工	2,996,454.67	3.59
108	600261	阳光照明	2,993,530.32	3.59
109	002580	圣阳股份	2,992,172.98	3.59
110	600740	山西焦化	2,984,957.65	3.58
111	300164	通源石油	2,981,724.60	3.58

112	300401	花园生物	2,975,228.03	3.57
113	002529	海源机械	2,942,151.74	3.53
114	600378	天科股份	2,936,330.00	3.52
115	600519	贵州茅台	2,936,304.36	3.52
116	300200	高盟新材	2,927,935.97	3.51
117	002221	东华能源	2,902,354.70	3.48
118	600235	民丰特纸	2,892,029.97	3.47
119	600882	广泽股份	2,887,140.88	3.46
120	601098	中南传媒	2,817,580.87	3.38
121	600628	新世界	2,794,095.04	3.35
122	002160	常铝股份	2,788,010.61	3.34
123	002043	兔宝宝	2,744,379.28	3.29
124	002008	大族激光	2,729,921.00	3.27
125	000568	泸州老窖	2,726,030.00	3.27
126	002480	新筑股份	2,724,559.18	3.27
127	600856	中天能源	2,722,210.00	3.27
128	002470	金正大	2,706,761.00	3.25
129	600018	上港集团	2,688,964.48	3.23
130	002217	合力泰	2,660,135.93	3.19
131	000421	南京公用	2,659,800.77	3.19
132	600362	江西铜业	2,658,507.99	3.19
133	600708	光明地产	2,640,175.90	3.17
134	300230	永利股份	2,626,995.60	3.15
135	600287	江苏舜天	2,620,341.34	3.14
136	000567	海德股份	2,591,369.00	3.11
137	000060	中金岭南	2,579,118.98	3.09
138	002503	搜于特	2,571,927.00	3.09
139	002152	广电运通	2,500,163.17	3.00
140	600684	珠江实业	2,484,038.50	2.98
141	600280	中央商场	2,447,319.00	2.94
142	603518	维格娜丝	2,430,803.00	2.92
143	002329	皇氏集团	2,407,811.26	2.89
144	002304	洋河股份	2,405,242.00	2.89
145	603766	隆鑫通用	2,397,759.00	2.88
146	300072	三聚环保	2,379,607.00	2.85
147	600998	九州通	2,369,031.78	2.84
148	600398	海澜之家	2,360,671.00	2.83
149	300007	汉威科技	2,358,638.00	2.83

150	000980	众泰汽车	2,356,522.00	2.83
151	300340	科恒股份	2,351,732.20	2.82
152	002216	三全食品	2,346,854.28	2.82
153	000997	新大陆	2,334,316.15	2.80
154	002080	中材科技	2,328,885.33	2.79
155	603611	诺力股份	2,324,782.31	2.79
156	601939	建设银行	2,294,956.31	2.75
157	600104	上汽集团	2,292,834.01	2.75
158	601668	中国建筑	2,290,060.00	2.75
159	300184	力源信息	2,289,933.00	2.75
160	601857	中国石油	2,227,738.00	2.67
161	002285	世联行	2,206,399.94	2.65
162	002573	清新环境	2,204,955.00	2.64
163	600623	华谊集团	2,199,165.80	2.64
164	600978	宜华生活	2,176,510.68	2.61
165	300365	恒华科技	2,168,007.33	2.60
166	002587	奥拓电子	2,166,906.50	2.60
167	000759	中百集团	2,165,163.00	2.60
168	600522	中天科技	2,164,128.00	2.60
169	002706	良信电器	2,155,132.46	2.59
170	000960	锡业股份	2,140,103.26	2.57
171	002091	江苏国泰	2,130,545.55	2.56
172	601601	中国太保	2,128,071.00	2.55
173	600220	江苏阳光	2,087,288.45	2.50
174	600066	宇通客车	2,085,129.95	2.50
175	600410	华胜天成	2,080,589.00	2.50
176	600703	三安光电	2,079,656.00	2.49
177	601628	中国人寿	2,070,805.40	2.48
178	600338	西藏珠峰	2,068,866.00	2.48
179	002515	金字火腿	2,062,775.20	2.47
180	601877	正泰电器	2,059,041.00	2.47
181	300430	诚益通	2,058,227.55	2.47
182	601231	环旭电子	2,053,411.00	2.46
183	603268	松发股份	2,048,368.26	2.46
184	603338	浙江鼎力	2,042,046.49	2.45
185	002131	利欧股份	2,035,484.00	2.44
186	000881	中广核技	2,030,347.00	2.44
187	600383	金地集团	2,025,725.00	2.43

188	600875	东方电气	2,017,377.00	2.42
189	300083	劲胜智能	2,007,770.00	2.41
190	600201	生物股份	2,006,845.60	2.41
191	000639	西王食品	1,996,243.00	2.39
192	600183	生益科技	1,990,207.70	2.39
193	002682	龙洲股份	1,979,082.86	2.37
194	000540	中天金融	1,976,422.00	2.37
195	601258	庞大集团	1,974,127.00	2.37
196	600816	安信信托	1,968,490.00	2.36
197	600240	华业资本	1,961,915.00	2.35
198	600482	中国动力	1,955,804.92	2.35
199	601390	中国中铁	1,947,944.73	2.34
200	002615	哈尔斯	1,947,283.15	2.34
201	603306	华懋科技	1,938,353.00	2.33
202	000990	诚志股份	1,928,791.00	2.31
203	002369	卓翼科技	1,926,841.00	2.31
204	002717	岭南园林	1,924,074.89	2.31
205	300232	洲明科技	1,922,572.18	2.31
206	600231	凌钢股份	1,918,981.98	2.30
207	000707	双环科技	1,905,145.00	2.29
208	002078	太阳纸业	1,903,306.00	2.28
209	600458	时代新材	1,895,347.00	2.27
210	600663	陆家嘴	1,885,961.00	2.26
211	600507	方大特钢	1,884,011.24	2.26
212	002135	东南网架	1,883,020.00	2.26
213	600479	千金药业	1,877,934.58	2.25
214	002244	滨江集团	1,876,638.57	2.25
215	600297	广汇汽车	1,870,294.15	2.24
216	000401	冀东水泥	1,869,519.00	2.24
217	002236	大华股份	1,869,433.00	2.24
218	603288	海天味业	1,864,340.00	2.24
219	300433	蓝思科技	1,859,045.50	2.23
220	300183	东软载波	1,834,950.00	2.20
221	300170	汉得信息	1,823,165.00	2.19
222	601088	中国神华	1,814,490.00	2.18
223	000938	紫光股份	1,808,232.12	2.17
224	601988	中国银行	1,807,503.00	2.17
225	000070	特发信息	1,807,333.17	2.17

226	000016	深康佳 A	1,805,711.21	2.17
227	300144	宋城演艺	1,805,595.00	2.17
228	600429	三元股份	1,801,448.54	2.16
229	000418	小天鹅 A	1,799,800.66	2.16
230	002674	兴业科技	1,793,932.84	2.15
231	000100	TCL 集团	1,793,871.00	2.15
232	300061	康旗股份	1,775,570.77	2.13
233	002081	金螳螂	1,771,501.97	2.12
234	002262	恩华药业	1,768,637.06	2.12
235	601058	赛轮金宇	1,765,356.00	2.12
236	300094	国联水产	1,763,168.20	2.11
237	600566	济川药业	1,762,273.00	2.11
238	600409	三友化工	1,760,909.00	2.11
239	300274	阳光电源	1,760,115.52	2.11
240	300124	汇川技术	1,757,117.82	2.11
241	002024	苏宁云商	1,742,794.68	2.09
242	601636	旗滨集团	1,741,618.00	2.09
243	300122	智飞生物	1,739,602.00	2.09
244	300178	腾邦国际	1,739,262.00	2.09
245	002337	赛象科技	1,738,745.30	2.09
246	300444	双杰电气	1,736,367.90	2.08
247	600282	南钢股份	1,731,561.16	2.08
248	002443	金洲管道	1,728,428.00	2.07
249	600309	万华化学	1,722,491.36	2.07
250	601166	兴业银行	1,718,476.00	2.06
251	601992	金隅股份	1,718,176.00	2.06
252	600690	青岛海尔	1,713,173.00	2.05
253	000963	华东医药	1,704,678.00	2.04
254	600811	东方集团	1,704,062.00	2.04
255	300217	东方电热	1,701,973.80	2.04
256	300394	天孚通信	1,701,362.42	2.04
257	300293	蓝英装备	1,701,080.87	2.04
258	002058	威尔泰	1,699,068.45	2.04
259	600068	葛洲坝	1,697,714.12	2.04
260	002147	新光圆成	1,697,293.00	2.04
261	002215	诺普信	1,695,528.00	2.03
262	000528	柳工	1,694,538.00	2.03
263	601179	中国西电	1,693,902.63	2.03

264	002677	浙江美大	1,693,875.00	2.03
265	600665	天地源	1,692,995.00	2.03
266	600697	欧亚集团	1,692,249.06	2.03
267	600648	外高桥	1,692,166.37	2.03
268	600567	山鹰纸业	1,691,068.00	2.03
269	600640	号百控股	1,690,544.00	2.03
270	300203	聚光科技	1,688,512.65	2.03
271	000627	天茂集团	1,683,381.00	2.02
272	000524	岭南控股	1,680,795.00	2.02
273	601328	交通银行	1,680,509.00	2.02
274	300378	鼎捷软件	1,678,623.10	2.01
275	002084	海鸥卫浴	1,678,237.45	2.01
276	000008	神州高铁	1,677,185.84	2.01

注：“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“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。

### 8.4.3 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	1,094,772,599.12
卖出股票收入（成交）总额	1,039,219,529.51

注：“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“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	9,992,000.00	11.99
	其中：政策性金融债	9,992,000.00	11.99
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）	507,635.70	0.61
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	10,499,635.70	12.59



## 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	170301	17 进出 01	100,000	9,992,000.00	11.99
2	113013	国君转债	4,530	475,151.70	0.57
3	110040	生益转债	300	32,484.00	0.04

注：以上为本基金本报告期末持有的全部债券投资。

## 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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

本基金本报告期末无股指期货持仓和损益明细。

### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

在报告期内，本基金未投资于股指期货。该策略符合基金合同的规定。

## 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

在报告期内，本基金未投资于国债期货。该策略符合基金合同的规定。

### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货持仓和损益明细。

### 8.11.3 本期国债期货投资评价

本报告期本基金未投资国债期货。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体未出现被监管部门立案调查的情况，在报告编制

日前一年内未受到公开谴责、处罚。

### 8.12.2

基金投资的前十名股票均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	62,652.92
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	290,261.15
5	应收申购款	2,579.53
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	355,493.60

### 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未存在流通受限的情况。

### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
1,259	64,669.23	9,999,000.00	12.28%	71,419,563.24	87.72%

### 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	483.13	0.0006%

### 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、基金投资和相关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（2017年1月23日）基金份额总额	441,053,393.59
本报告期期初基金份额总额	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	7,102,713.70
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	366,737,544.05
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	81,418,563.24

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金没有召开份额持有人大会。

### 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

本报告期内基金管理人、托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 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

本报告期内本基金无投资策略的变化。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本年度本基金未更换会计师事务所，本年度支付给普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计费用为人民币 60,000 元，该审计机构对本基金提供审计服务的连续年限为 1 年。

### 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、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

### 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	
国泰君安	2	1,461,678,533.35	68.66%	1,361,270.82	68.66%	-
天风证券	2	534,108,571.68	25.09%	497,414.44	25.09%	-
新时代	1	133,033,469.68	6.25%	123,895.74	6.25%	-

注：(一)2017 年本基金新增国泰君安证券、天风证券、新时代证券交易单元。

(二) 交易单元选择的标准和程序

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，使用其席位作为基金的专用交易单元，选择的标准是：

- (1) 经营规范，有较完备的内控制度；
- (2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合证券交易的需要
- (3) 能为基金管理人提供高质量的研究咨询服务。

#### 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	成交金额	占当期权证成交总额的比例

				的比例		
国泰君安	682,607.50	100.00%	4,380,000,000.00	98.13%	-	-
天风证券	-	-	83,500,000.00	1.87%	-	-
新时代	-	-	-	-	-	-

## § 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	20170321-20171119	0.00	69,999,000.00	69,999,000.00	0.00	0.00%
	2	20170307-20171120	0.00	80,009,800.00	80,009,800.00	0.00	0.00%
产品特有风险							
报告期内，本基金存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金总份额 20%的情况，易发生巨额赎回的情况，存在基金资产无法以合理价格及时变现以支付投资者赎回款的风险，以及基金份额净值出现大幅波动的风险。							

注：报告期内，申购份额含红利再投资份额。

泰达宏利基金管理有限公司  
2018 年 3 月 29 日