

融通中国风 1 号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：融通基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2018 年 3 月 29 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据融通中国风1号灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）基金合同规定，于2017年3月26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

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	8
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	11
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
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.....	12
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
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.....	13
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.....	13
§ 6 审计报告	13
§ 7 年度财务报表	15
7.1 资产负债表.....	15
7.2 利润表.....	16
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17
7.4 报表附注.....	18
§ 8 投资组合报告	39
8.1 期末基金资产组合情况.....	39
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	40
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.....	41
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	41
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	48
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.....	48
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.....	48
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.....	48
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.....	48

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	49
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	49
8.12 投资组合报告附注	49
§ 9 基金份额持有人信息	50
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	50
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	50
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	50
§ 10 开放式基金份额变动	50
§ 11 重大事件揭示	50
11.1 基金份额持有人大会决议	50
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	50
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	51
11.4 基金投资策略的改变	51
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	51
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	51
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	51
11.8 其他重大事件	54
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	56
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	56
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	56
§ 13 备查文件目录	57
13.1 备查文件目录	57
13.2 存放地点	57
13.3 查阅方式	57

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	融通中国风1号灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	融通中国风1号灵活配置混合
基金主代码	001852
前端交易代码	001852
后端交易代码	001853
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年2月3日
基金管理人	融通基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	39,967,199.26份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金精选优质上市公司进行投资，分享相关行业、上市公司发展过程中的投资机会，在保证本金安全的前提下，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金的资产配置策略主要是通过对宏观经济周期运行规律的研究，基于定量与定性相结合的宏观及市场分析，确定组合中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例，规避系统性风险。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×50%+中债综合全价（总值）指数收益率×50%。
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和货币市场基金，但低于股票型基金，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		融通基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	涂卫东	郭明
	联系电话	(0755) 26948666	(010) 66105799
	电子邮箱	service@mail.rtfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-883-8088、(0755) 26948088	95588
传真		(0755) 26935005	(010) 66105798
注册地址		深圳市南山区华侨城汉唐大厦13、14层	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址		深圳市南山区华侨城汉唐大厦13、14层	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码		518053	100140
法定代表人		高峰	易会满

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.rtfund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
注册登记机构	融通基金管理有限公司	深圳市南山区华侨城汉唐大厦13、14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2月3日(基金合同生效日)-2016年12月31日
本期已实现收益	4,513,938.90	7,177,373.20
本期利润	7,712,827.97	7,791,572.20
加权平均基金份额本期利润	0.1955	0.0890
本期加权平均净值利润率	17.10%	8.70%
本期基金份额净值增长率	19.28%	8.32%
3.1.2 期末数据和指标	2017年末	2016年末
期末可供分配利润	7,898,177.76	2,134,106.54
期末可供分配基金份额利润	0.1976	0.0534
期末基金资产净值	50,212,475.14	42,130,554.44
期末基金份额净值	1.256	1.053
3.1.3 累计期末指标	2017年末	2016年末
基金份额累计净值增长率	29.21%	8.32%

注：1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3、期末可供分配基金份额利润=期末可供分配利润÷期末基金份额总额。其中期末可供分配利润：如果期末未分配利润的未实现部分为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分，如果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（已实现部分扣除未实现部分）。

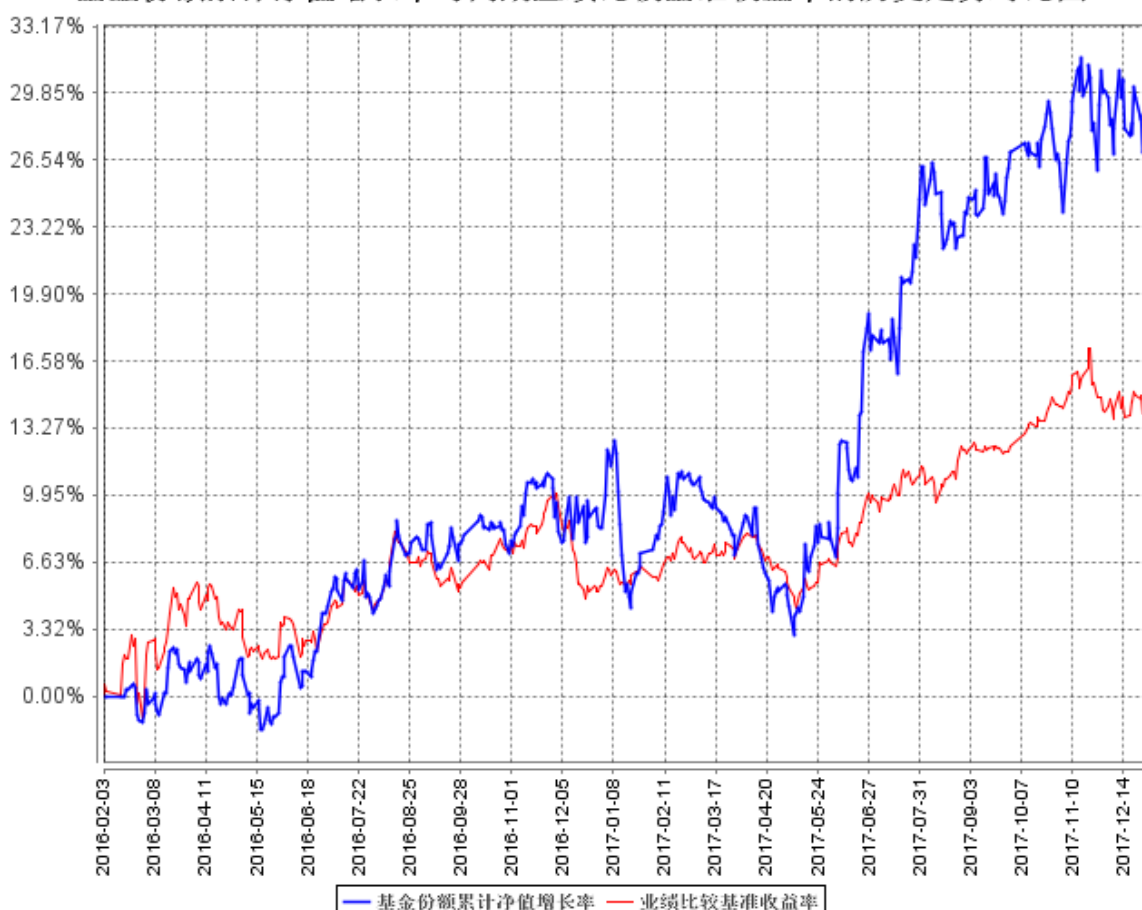
3.2 基金净值表现

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	1.78%	0.99%	1.96%	0.40%	-0.18%	0.59%
过去六个月	9.60%	0.90%	4.25%	0.35%	5.35%	0.55%
过去一年	19.28%	0.87%	8.60%	0.32%	10.68%	0.55%
自基金合同生效起至今	29.21%	0.75%	14.55%	0.44%	14.66%	0.31%

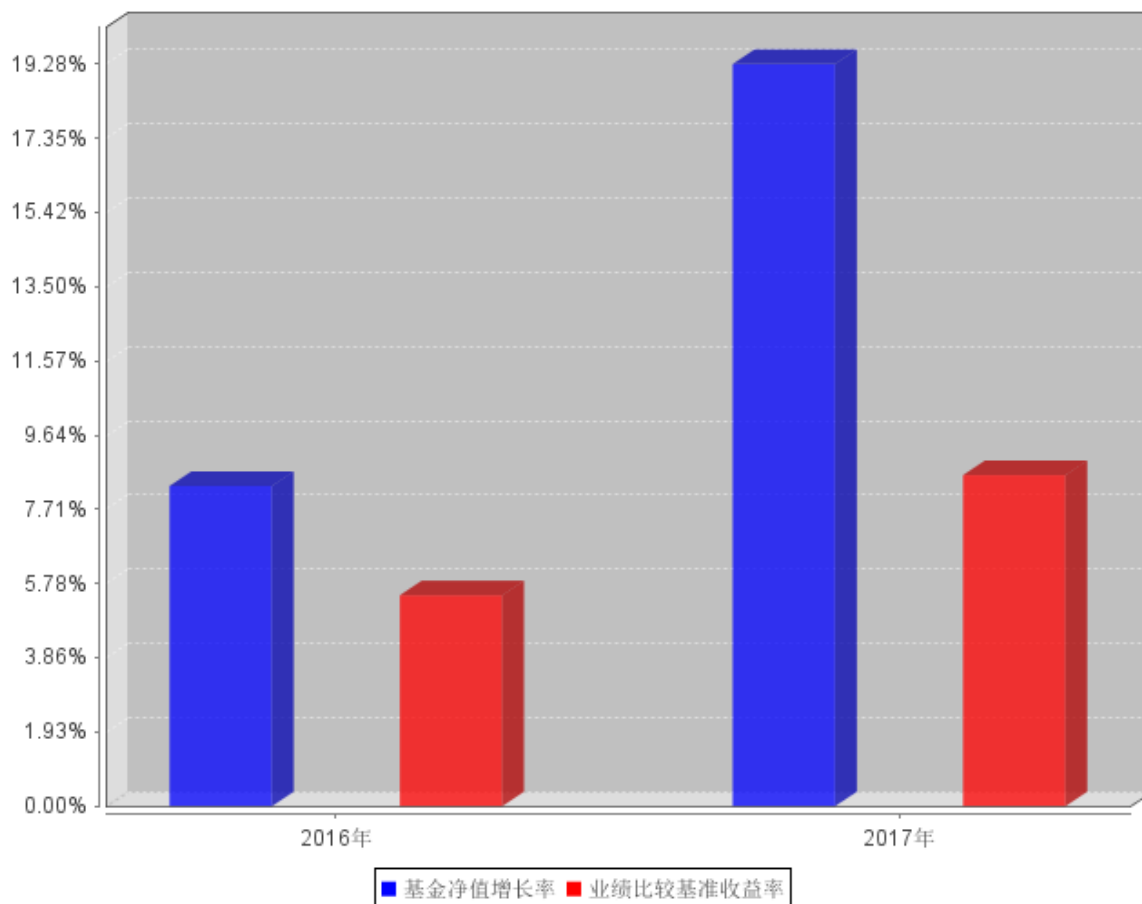
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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



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：本基金合同生效日为2016年2月3日，合同生效当年按实际存续期计算，未按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额 分红数	现金形式发放 总额	再投资形式发 放总额	年度利润分配合 计	备注
2017	-	-	-	-	-
2016	0.3000	1,059,342.42	444,232.88	1,503,575.30	-
合计	0.3000	1,059,342.42	444,232.88	1,503,575.30	-

注：本基金合同生效日为2016年2月3日。

§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

融通基金管理有限公司（以下简称“本公司”）经中国证监会证监基字[2001]8号文批准，于2001年5月22日成立，公司注册资本12500万元人民币。本公司的股东及其出资比例为：新时

代证券股份有限公司60%、日兴资产管理有限公司（Nikko Asset Management Co., Ltd.）40%。

截至2017年12月31日，公司共管理六十五只开放式基金：即融通新蓝筹混合基金、融通债券基金、融通深证100指数基金、融通蓝筹成长混合基金、融通行业景气混合基金、融通巨潮100指数基金（LOF）、融通易支付货币基金、融通动力先锋混合基金、融通领先成长混合基金（LOF）、融通内需驱动混合基金、融通深证成份指数基金、融通四季添利债券基金、融通创业板指数基金、融通医疗保健混合基金、融通岁岁添利定期开放债券基金、融通丰利四分法（QDII-FOF）基金、融通汇财宝货币市场基金、融通可转债债券基金、融通通泰保本混合基金、融通通福债券基金（LOF）、融通通源短融债券基金、融通通瑞债券基金、融通月月添利基金、融通健康产业混合基金、融通转型三动力混合基金、融通互联网传媒混合基金、融通新区域新经济混合基金、融通通鑫混合基金、融通新能源混合基金、融通军工分级指数基金、融通证券分级指数基金、融通中证大农业指数基金（LOF）、融通跨界成长混合基金、融通新机遇混合基金、融通成长30混合基金、融通中国风1号混合基金、融通通盈保本混合基金、融通增利债券基金、融通增裕债券基金、融通增鑫债券基金、融通增益债券基金、融通增祥债券基金、融通新消费混合基金、融通增丰债券基金、融通通安债券基金、融通通优债券基金、融通通乾研究精选混合基金、融通新趋势混合基金、融通国企改革新机遇混合基金、融通通尚混合基金、融通通裕债券基金、融通通和债券基金、融通沪港深智慧生活混合基金、融通现金宝货币市场基金、融通通祺债券基金、融通稳利债券基金、融通通宸债券基金、融通通玺债券基金、融通通穗债券基金、融通通润债券基金、融通通颐定期开放债券基金、融通人工智能指数基金（LOF）、融通新动力灵活配置混合、融通收益增强债券基金和融通中国概念债券基金（QDII）。其中，融通债券基金、融通深证100指数基金和融通蓝筹成长混合基金同属融通通利系列证券投资基金。此外，公司还开展了特定客户资产管理业务。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
范琨	本基金的基金经理	2016年2月5日	-	5	范琨女士，复旦大学金融学硕士、湖南大学化学工程学士，5年证券投资从业经历，具有基金从业资格。2012年7月加入融通基金管理有限公司，历任化工行业研究员、周期组组长。2016年2月5日起至今任“融通中国风1号灵活配置混合型证券投资基金”基金经理。
彭炜	本基金的基金经理	2017年8月5日	-	5	彭炜先生，上海交通大学管理学硕士、工学学士，5年证券投资从业经历，具有基金从业资格。2012年4月加入融通基金，历任建筑建材、房地产、钢铁煤炭行业研究员，周期行业组长。现任融通中国

					风1号灵活配置混合、融通国企改革新机遇灵活配置混合基金的基金经理。
商小虎	本基金的基金经理、投资总监。	2016年2月3日	2017年10月21日	16	商小虎先生，上海社会科学院经济学博士、澳门大学及上海社会科学院经济学硕士、复旦大学经济学学士，美国特许金融分析师（CFA），16年证券投资从业经历，具有基金从业资格，曾任融通基金管理有限公司投资总监。历任日本东京三菱银行旗下和昇证券公司行业分析师、上海国际集团（原上海国有资产经营有限公司）投资经理、上海国际集团香港子公司副总经理、中银国际证券公司资产管理部副总经理。2015年1月加入融通基金管理有限公司，曾任融通跨界成长灵活配置混合、融通中国风1号灵活配置混合、融通新消费灵活配置混合、融通国企改革新机遇灵活配置混合、融通沪港深智慧生活灵活配置混合基金的基金经理。

注：任免日期根据基金管理人对外披露的任免日期填写；证券从业年限以从事证券业务相关工作的时间为计算标准。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规和本基金合同的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益，无损害基金持有人利益的行为，本基金投资组合符合有关法律法规的规定及基金合同的约定。

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

为了保证旗下的不同投资组合得到公平对待，本基金管理人制定了《融通基金管理有限公司公平交易制度》，公平交易制度所规范的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等所有投资管理活动，并涵盖授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

本基金管理人通过建立科学的投资决策体系，加强交易执行环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段来保证公平交易原则的实现。同时，本基金管理人通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一直坚持公平对待旗下所有投资组合的原则，在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等各个环节保证公平交易制度的严格执行。

本基金管理人对报告期内不同时间窗下（日内、3日内、5日内）公司管理的不同投资组合同

向交易的交易价差进行了分析，各投资组合的同向交易价差均处于合理范围之内。

报告期内，本基金管理人严格执行了公平交易的原则和制度。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金报告期内未发生异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2017年A股市场呈现了明显分化的结构表现，其中上证综指上涨6.56%、沪深300指数上涨21.78%、上证50指数上涨25.08%；而创业板指则是下跌了10.67%。行业结构层面则是以金融、白酒、家电、电子，以及各细分行业龙头白马股走出了强者恒强的趋势。

本基金在一季度延续周期回暖趋势的思路积极布局三四线地产以及部分中游周期制造业，而在二季度前后及时捕捉到市场风格的变化后，整体配置思路转向各个细分行业的龙头白马股，在这一阶段获取了明显的超额收益。三四季度随着市场对宏观经济韧性的逐步认识，本基金重新调整结构，增配了供给侧改革和环保限产的中游周期品板块，以及部分兼具周期消费和消费升级/普及属性的板块。另外，在先进制造业领域和部分优质成长股，业已开始逐步有所布局。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为1.256元；本报告期基金份额净值增长率为19.28%，业绩比较基准收益率为8.60%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2018年，我们认为，当前的经济结构对整体宏观经济的韧性依然有较好的支撑。伴随“十九大”的召开，明确了新时代的发展方向，路径更加清晰，将有效提升市场的整体风险偏好。“去产能、去库存、去杠杆”作为过去两年在传统周期行业层面的改革主线依然不会放松，而“降成本、补短板”也将在未来在先进高端制造业等领域逐步发力。房地产长效机制即将建立，立足于增加供给，对经济起到了更加稳定的作用；同时，消费不仅已逐步成为经济增长的主动力，也熨平了经济的波动性，从而拉长了牛市的行情。但市场层面可能潜在的风险我们也须时刻关注，一个是金融去杠杆带来对市场的阶段性冲击；另一个是海外加息叠加国内通胀水平的不确定带来对流动性政策的变化。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

基金管理人坚持一切从保护基金持有人利益出发，继续致力于内控制度与机制的完善，加强合规控制与风险防范，确保基金运作符合法律法规和基金合同的要求。公司监察稽核部门通过合规审核、实时监控及专项检查等方法，对基金运作和公司管理进行独立的监察稽核，及时发现风

险隐患，提出整改建议，并督促跟踪业务部门进行整改。

在专项稽核方面，公司监察稽核部门针对不同业务环节的风险特点，制定年度检查计划，并结合对各风险点风险程度的实时判断和评估，按照不同的检查频率，对投资决策、研究支持、交易执行、基金销售、后台运营、信息披露及员工职业操守管理等方面的重点业务环节进行专项检查，检查有关业务执行的合规性和风险控制措施的有效性，检查项目覆盖了相关业务的主要风险点。本报告期内，加大了对投资管理人员管控措施、投资决策流程及决策依据、交易执行及后台运作风险等敏感、重点项目的关注，确保基金运作的稳健合规。本基金管理人全年未发生合规及风险事故。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金的估值业务严格按照《融通基金管理有限公司证券投资基金估值业务原则和程序》进行，公司设立由研究部、风险管理部、登记清算部、固定收益部、国际业务部和监察稽核部共同组成的估值委员会，通过参考行业协会估值意见、参考独立第三方估值服务机构的估值数据等一种或多种方式的有效结合，减少或避免估值偏差的发生。估值委员会的相关成员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经历，估值委员会成员不包含本基金基金经理。

估值委员会定期对经济环境是否发生重大变化、证券发行机构是否发生影响证券价格的重大事件以及估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性及其适用性的情况后及时修订估值方法，以保证其持续适用。估值政策和程序的修订须经公司总经理办公会议审批后方可实施。基金在采用新投资策略或投资新品种时，应评价现有估值政策和程序的适用性。其中研究部负责定期对经济环境是否发生重大变化、证券发行机构是否发生影响证券价格的重大事件以及估值政策和程序进行评价，金融工程小组负责估值方法的研究、价格的计算及复核，登记清算部进行具体的估值核算并与基金托管人核对，同时负责对外进行信息披露。监察稽核部负责基金估值业务的事前、事中及事后的审核工作。本基金基金经理不参与估值决定，参与估值流程各方之间亦不存在任何重大利益冲突。

截至本报告期末，本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司、中证指数有限公司签订服务协议，由其提供相关债券品种和流通受限股票的估值参考数据。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

从2016年12月15日至2017年3月14日，本基金存在连续二十个工作日以上基金资产净值低于五千万的情形。

从2017年3月24日至2017年6月14日，本基金存在连续二十个工作日以上基金资产净值低于五千万的情形。

从2017年6月23日至2017年8月22日，本基金存在连续二十个工作日以上基金资产净值低于五千万的情形。

本基金本报告期内未发生连续二十个工作日出现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

本报告期内，本基金托管人在对融通中国风1号灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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，融通中国风1号灵活配置混合型证券投资基金的管理人——融通基金管理有限公司在融通中国风1号灵活配置混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、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，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，融通中国风1号灵活配置混合型证券投资基金未进行利润分配。

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

本托管人依法对融通基金管理有限公司编制和披露的融通中国风1号灵活配置混合型证券投资基金2017年年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§6 审计报告

普华永道中天审字(2018)第22316号

融通中国风1号灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人：

一、审计意见

(一) 我们审计的内容

我们审计了融通中国风1号灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“融通中国风1号灵活配置混合基金”)的财务报表，包括2017年12月31日的资产负债表，2017年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

(二) 我们的意见

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,公允反映了融通中国风1号灵活配置混合基金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。

二、形成审计意见的基础

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。

按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于融通中国风1号灵活配置混合基金,并履行了职业道德方面的其他责任。

三、管理层和治理层对财务报表的责任

融通中国风1号灵活配置混合基金的基金管理人融通基金管理有限公司(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报。

在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估融通中国风1号灵活配置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融通中国风1号灵活配置混合基金、终止运营或别无其他现实的选择。

基金管理人治理层负责监督融通中国风1号灵活配置混合基金的财务报告过程。

四、注册会计师对财务报表审计的责任

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。

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:

(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。

(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。

(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。

(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,就可能导致对融通中国风1号灵活配置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融通中国风1号灵活配置混合基金不能持续经营。

(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。

我们与基金管理人就计划的审计范围、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。

普华永道中天	注册会计师
会计师事务所(特殊普通合伙)	薛 竞
中国·上海市	注册会计师
2018年3月26日	俞 伟 敏

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:融通中国风1号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 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
资产:			
银行存款	7.4.7.1	4,552,349.73	9,420,695.16
结算备付金		74,634.56	224,717.66
存出保证金		91,584.15	57,885.20
交易性金融资产	7.4.7.2	45,735,551.00	28,426,003.04
其中:股票投资		45,735,551.00	28,426,003.04
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-

衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	4,234,341.84
应收利息	7.4.7.5	896.91	2,438.09
应收股利		-	-
应收申购款		2,110.52	5,233.14
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		50,457,126.87	42,371,314.13
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
负债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		78,627.23	11,604.00
应付管理人报酬		62,909.48	55,627.90
应付托管费		10,484.94	9,271.31
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	42,480.19	114,213.15
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	50,149.89	50,043.33
负债合计		244,651.73	240,759.69
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	39,967,199.26	39,996,447.90
未分配利润	7.4.7.10	10,245,275.88	2,134,106.54
所有者权益合计		50,212,475.14	42,130,554.44
负债和所有者权益总计		50,457,126.87	42,371,314.13

注:1、报告截止日2017年12月31日,基金份额净值为1.256,基金份额总额为39,967,199.26份。

7.2 利润表

会计主体: 融通中国风1号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 2017年1月1日至	上年度可比期间 2016年2月3日(基金
----	-----	------------------	-------------------------

		2017年12月31日	合同生效日)至2016年12月31日
一、收入		9,633,384.41	10,404,988.10
1. 利息收入		114,325.44	451,133.41
其中：存款利息收入	7.4.7.11	87,734.59	451,133.41
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		26,590.85	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益		5,994,500.83	7,918,032.29
其中：股票投资收益	7.4.7.12	5,776,941.31	7,811,494.26
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
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	217,559.52	106,538.03
3. 公允价值变动收益	7.4.7.17	3,198,889.07	614,199.00
4. 汇兑收益		-	-
5. 其他收入	7.4.7.18	325,669.07	1,421,623.40
减：二、费用		1,920,556.44	2,613,415.90
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	674,860.65	1,249,549.29
2. 托管费	7.4.10.2.2	112,476.81	208,258.23
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	1,014,800.98	995,940.38
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	118,418.00	159,668.00
三、利润总额		7,712,827.97	7,791,572.20
减：所得税费用		-	-
四、净利润		7,712,827.97	7,791,572.20

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：融通中国风1号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 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	39,996,447.90	2,134,106.54	42,130,554.44

金净值)			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	7,712,827.97	7,712,827.97
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-29,248.64	398,341.37	369,092.73
其中:1.基金申购款	65,370,783.79	9,850,044.01	75,220,827.80
2.基金赎回款	-65,400,032.43	-9,451,702.64	-74,851,735.07
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	39,967,199.26	10,245,275.88	50,212,475.14
项目	上年度可比期间 2016年2月3日(基金合同生效日)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)	265,553,528.17	-	265,553,528.17
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	7,791,572.20	7,791,572.20
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-225,557,080.27	-4,153,890.36	-229,710,970.63
其中:1.基金申购款	24,320,730.76	831,022.24	25,151,753.00
2.基金赎回款	-249,877,811.03	-4,984,912.60	-254,862,723.63
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-1,503,575.30	-1,503,575.30
五、期末所有者权益(基金净值)	39,996,447.90	2,134,106.54	42,130,554.44

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:

张帆

颜锡廉

刘美丽

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

融通中国风1号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[2015]2049号《关于融通中国风1号灵活配置混合型证

券投资基金注册的批复》核准，由融通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《融通中国风1号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265,522,074.84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(2016)第161号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《融通中国风1号灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2016年2月3日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为265,553,528.17份基金份额，其中认购资金利息折合31,453.33份基金份额。本基金的基金管理人为融通基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《融通中国风1号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、创业板以及其他经中国证监会批准发行上市的股票)、固定收益类资产(国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、中小企业私募债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券(含超短期融资券)、资产支持证券、质押及买断式债券回购、银行存款及现金等)、衍生工具(权证、股指期货等)以及经中国证监会批准允许基金投资的其它金融工具(但需符合中国证监会的相关规定)。本基金投资组合中，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投资比例合计不低于基金资产净值的5%。本基金业绩比较基准为：50% X 沪深300指数收益率+50% X 中债综合全价(总值)指数收益率。

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》、《融通中国风1号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1日至2017年12月31日止期间财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2017年12月31日的财务状况以及2017年度的经营成果和基金净值变

动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

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。比较财务报表的实际编制期间为2016年2月3日(基金合同生效日)至2016年12月31日止期间。

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、债券投资和资产支持证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卖出回购金融资产款和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或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，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、债券投资和资产支持证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。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；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和债券，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、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

（2）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

本基金本报告期未发生会计估计变更。

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 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
活期存款	4,552,349.73	9,420,695.16
定期存款	-	-
其中：存款期限1-3个月	-	-
其他存款	-	-

合计:	4,552,349.73	9,420,695.16
-----	--------------	--------------

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2017年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		41,922,462.93	45,735,551.00	3,813,088.07
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		41,922,462.93	45,735,551.00	3,813,088.07
项目		上年度末 2016年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		27,811,804.04	28,426,003.04	614,199.00
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		27,811,804.04	28,426,003.04	614,199.00

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/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

本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

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无买断式逆回购交易中所取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
应收活期存款利息	822.11	2,310.99
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	33.60	101.10
应收债券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	41.20	26.00
合计	896.91	2,438.09

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
交易所市场应付交易费用	42,480.19	114,213.15
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	42,480.19	114,213.15

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
应付赎回费	149.89	43.33
预提费用	50,000.00	50,000.00
合计	50,149.89	50,043.33

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	39,996,447.90	39,996,447.90
本期申购	65,370,783.79	65,370,783.79
本期赎回	-65,400,032.43	-65,400,032.43

本期末	39,967,199.26	39,967,199.26
-----	---------------	---------------

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

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	2,369,278.20	-235,171.66	2,134,106.54
本期利润	4,513,938.90	3,198,889.07	7,712,827.97
本期基金份额交易产生的变动数	1,014,960.66	-616,619.29	398,341.37
其中：基金申购款	9,796,261.86	53,782.15	9,850,044.01
基金赎回款	-8,781,301.20	-670,401.44	-9,451,702.64
本期已分配利润	-	-	-
本期末	7,898,177.76	2,347,098.12	10,245,275.88

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年2月3日(基金合同生效日)至2016年12月31日
活期存款利息收入	81,586.92	438,884.33
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	4,949.20	4,395.53
其他	1,198.47	7,853.55
合计	87,734.59	451,133.41

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 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年2月3日(基金合同生效日)至2016年12月31日
卖出股票成交总额	334,291,778.41	324,257,440.84
减：卖出股票成本总额	328,514,837.10	316,445,946.58
买卖股票差价收入	5,776,941.31	7,811,494.26

7.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间无债券投资收益/损失。

7.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间无贵金属投资收益/损失。

7.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期及上年度可比期间无衍生工具收益/损失。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年2月3日(基金合同生效日)至2016年12月31日
股票投资产生的股利收益	217,559.52	106,538.03
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	217,559.52	106,538.03

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年2月3日(基金合同生效日)至2016年12月31日
1. 交易性金融资产	3,198,889.07	614,199.00
——股票投资	3,198,889.07	614,199.00
——债券投资	-	-
——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	3,198,889.07	614,199.00

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年2月3日(基金合同生效日)至2016年12月31日
基金赎回费收入	304,615.58	1,412,346.19
基金转换费收入	21,053.49	9,277.21
合计	325,669.07	1,421,623.40

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的25%归入基金资产。

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其不低于转出基金赎回费的25%归入转出基金的基金资产。

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年2月3日(基金合同生效日)至2016年12月31日
交易所市场交易费用	1,014,800.98	995,940.38
银行间市场交易费用	-	-
合计	1,014,800.98	995,940.38

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年2月3日(基金合同生效日)至2016年12月31日
审计费用	50,000.00	50,000.00
信息披露费	50,000.00	100,000.00
银行费用	418.00	268.00
帐户维护费	18,000.00	9,000.00
其他	-	400.00
合计	118,418.00	159,668.00

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，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作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
融通基金管理有限公司(“融通基金”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	基金托管人、基金销售机构
新时代证券股份有限公司(“新时代证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
日兴资产管理有限公司	基金管理人的股东
深圳市融通资本管理股份有限公司	基金管理人的子公司
融通国际资产管理有限公司	基金管理人的子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年12月31日		上年度可比期间 2016年2月3日(基金合同生效日)至2016年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
新时代证券	13,652,501.28	2.02%	10,265,820.62	1.54%

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
新时代证券	12,714.65	2.05%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2016年2月3日(基金合同生效日)至2016年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
新时代证券	9,560.65	1.56%	-	-

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年2月3日(基金合同生效日)至2016年12月31日
当期发生的基金应支付	674,860.65	1,249,549.29

的管理费		
其中：支付销售机构的客户维护费	242,850.63	664,276.50

注：1、支付基金管理人融通基金的管理人报酬按前一日基金资产净值1.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.50%/当年天数。

2、客户维护费是基金管理人与基金销售机构约定的依据销售机构销售基金的保有量提取一定比例的费用，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，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

7.4.10.2.2 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2月3日(基金合同生效日)至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	112,476.81	208,258.23

注：支付基金托管人中国工商银行的基金托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

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2月3日(基金合同生效日)至2016年12月31日
基金合同生效日持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	7,929,605.48	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	7,929,605.48	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	19.84%	-

注：基金管理人融通基金在本年度申购本基金的交易通过融通基金网上直销汇款交易方式办

理，适用费率为零。

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人以外的其他关联方未投资本基金。

7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2017年1月1日至2017年12月31日		2016年2月3日(基金合同生效日)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
中国工商银行	4,552,349.73	81,586.92	9,420,695.16	438,884.33

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内无利润分配。

7.4.12 期末（2017年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

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
601003	柳钢股份	2017-10-17	重大资产重组	7.98	2018-01-18	7.50	153,100	1,133,300.80	1,221,738.00	-

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。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有因从事银行间市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有因从事交易所市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

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

本基金是混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于中等预期收益和预期风险水平的投资品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的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建设全面风险管理体系、风控优先的政策，在董事会下设立风险控制与审计委员会，负责检查公司合规运作的状况及合规控制的有效性，并对公司的合规控制提出相关要求；在管理层层面设立风险控制委员会，负责建立健全公司的风险管理制度并组织实施，审定公司的业务风险管理政策，审定公司内控管理组织实施方案，审定公司的业务授权方案，审定基金资产组合的风险状况评价分析报告，审定公司各项风险与内控状况评价报告，审定业务风险损失责任人的责任，审定重大业务可行性风险论证，协调突发性重大风险事件的处理；各业务部门在执行业务事项时需遵守相关法律法规，遵守公司业务管理制度，具有根据业务特点控制业务风险的职责。业务人员是风险控制环节的第一责任人，部门负责人是控制业务风险管理的第一责任人，对部门风险控制措施的实施情况进行管理；风险管理小组由投资经理、金融工程人员和研究员组成，负责制定相关业务风险的识别和度量方法，指导业务部门实施风险的管理和控制，并定期出具投资组合风险报告，进行投资风险分析与绩效评估；督察长和监察稽核部负责监察公司各业务部门在相关法律法规、规章制度和业务流程执行方面的情况，确保既定的风险控制措施得到有效的贯彻执行，发现内控缺失和管理漏洞，提出改进要求和建议，并报告法规和制度的执行情况。

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

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

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。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行中国工商银行，因而与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，本基金无债券投资(2016年12月31日：同)。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。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或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，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。

于2017年12月31日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，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在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自2017年10月1日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的15%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制），本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的30%。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过7个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

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

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的

久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	4,552,349.73	-	-	-	4,552,349.73
结算备付金	74,634.56	-	-	-	74,634.56
存出保证金	91,584.15	-	-	-	91,584.15
交易性金融资产	-	-	-	45,735,551.00	45,735,551.00
应收利息	-	-	-	896.91	896.91
应收申购款	-	-	-	2,110.52	2,110.52
资产总计	4,718,568.44	-	-	45,738,558.43	50,457,126.87
负债					
应付赎回款	-	-	-	78,627.23	78,627.23
应付管理人报酬	-	-	-	62,909.48	62,909.48
应付托管费	-	-	-	10,484.94	10,484.94
应付交易费用	-	-	-	42,480.19	42,480.19
其他负债	-	-	-	50,149.89	50,149.89
负债总计	-	-	-	244,651.73	244,651.73
利率敏感度缺口	4,718,568.44	-	-	45,493,906.70	50,212,475.14
上年度末 2016年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	9,420,695.16	-	-	-	9,420,695.16
结算备付金	224,717.66	-	-	-	224,717.66
存出保证金	57,885.20	-	-	-	57,885.20
交易性金融资产	-	-	-	28,426,003.04	28,426,003.04
应收证券清算款	-	-	-	4,234,341.84	4,234,341.84
应收利息	-	-	-	2,438.09	2,438.09
应收申购款	-	-	-	5,233.14	5,233.14
资产总计	9,703,298.02	-	-	32,668,016.11	42,371,314.13
负债					
应付赎回款	-	-	-	11,604.00	11,604.00
应付管理人报酬	-	-	-	55,627.90	55,627.90
应付托管费	-	-	-	9,271.31	9,271.31
应付交易费用	-	-	-	114,213.15	114,213.15

其他负债	-	-	-	50,043.33	50,043.33
负债总计	-	-	-	240,759.69	240,759.69
利率敏感度缺口	9,703,298.02	-	-	32,427,256.42	42,130,554.44

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2017年12月31日，本基金未持有交易性债券投资(2016年12月31日：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2016年12月31日：同)。

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，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的股票，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中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投资比例合计不低于基金资产净值的5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
----	--------------------	---------------------

	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	45,735,551.00	91.08	28,426,003.04	67.47
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
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	45,735,551.00	91.08	28,426,003.04	67.47

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深300指数收益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指数收益率上升5%	2,237,686.71	-
	沪深300指数收益率下降5%	-2,237,686.71	-

注:于2016年12月31日,本基金合同生效尚未满一年,无足够历史经验数据计算其他价格风险对基金资产净值的影响。

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

(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44,513,813.00元,属于第二层次的余额为1,221,738.00元,无属于第三层次的余额(2016年12月31日:第一层次26,913,274.21元,第二层次1,512,728.83元,无第三层次)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票，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，确定相关股票公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2017年12月31日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2016年12月31日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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

(2) 增值税

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

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

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

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	45,735,551.00	90.64
	其中：股票	45,735,551.00	90.64
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	4,626,984.29	9.17
8	其他各项资产	94,591.58	0.19
9	合计	50,457,126.87	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	469,836.32	0.94
C	制造业	34,175,702.35	68.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	2,007,090.00	4.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	1,739,882.07	3.47
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,224,760.00	2.44
J	金融业	2,253,166.18	4.49
K	房地产业	2,784,703.08	5.55
L	租赁和商务服务业	1,080,411.00	2.15
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	45,735,551.00	91.08

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	600801	华新水泥	233,600	3,300,768.00	6.57
2	600887	伊利股份	95,271	3,066,773.49	6.11
3	600622	光大嘉宝	154,964	2,784,703.08	5.55
4	300630	普利制药	30,800	2,358,048.00	4.70
5	600176	中国巨石	130,500	2,125,845.00	4.23
6	002294	信立泰	43,800	1,979,322.00	3.94
7	600782	新钢股份	289,200	1,902,936.00	3.79
8	600754	锦江股份	53,883	1,739,882.07	3.47
9	000789	万年青	161,700	1,699,467.00	3.38
10	600809	山西汾酒	28,500	1,624,215.00	3.23
11	000932	华菱钢铁	197,200	1,599,292.00	3.19
12	000063	中兴通讯	39,900	1,450,764.00	2.89
13	601799	星宇股份	29,000	1,435,500.00	2.86
14	002110	三钢闽光	74,100	1,433,094.00	2.85
15	000568	泸州老窖	20,100	1,326,600.00	2.64
16	600742	一汽富维	78,600	1,297,686.00	2.58
17	002798	帝王洁具	23,100	1,273,041.00	2.54
18	600030	中信证券	67,800	1,227,180.00	2.44
19	600406	国电南瑞	67,000	1,224,760.00	2.44
20	601003	柳钢股份	153,100	1,221,738.00	2.43
21	603883	老百姓	17,400	1,096,026.00	2.18
22	601888	中国国旅	24,900	1,080,411.00	2.15
23	600521	华海药业	34,900	1,051,188.00	2.09
24	601688	华泰证券	59,443	1,025,986.18	2.04
25	002640	跨境通	47,600	911,064.00	1.81
26	603688	石英股份	54,646	855,756.36	1.70
27	002043	兔宝宝	66,600	816,516.00	1.63
28	000100	TCL 集团	205,600	801,840.00	1.60
29	000786	北新建材	34,771	782,347.50	1.56
30	000725	京东方A	133,500	772,965.00	1.54
31	002128	露天煤业	42,404	469,836.32	0.94

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	002234	民和股份	16,075,672.04	38.16
2	002458	益生股份	16,000,753.85	37.98
3	600104	上汽集团	10,243,933.42	24.31
4	002029	七匹狼	9,990,522.93	23.71
5	002299	圣农发展	9,140,957.00	21.70
6	000063	中兴通讯	8,604,177.00	20.42
7	000333	美的集团	7,172,186.54	17.02
8	600036	招商银行	7,001,598.17	16.62
9	002746	仙坛股份	6,538,901.00	15.52
10	600276	恒瑞医药	6,446,867.03	15.30
11	002041	登海种业	6,306,466.00	14.97
12	000020	深华发A	4,615,326.20	10.95
13	600660	福耀玻璃	4,573,524.00	10.86
14	600066	宇通客车	4,549,328.34	10.80
15	000651	格力电器	4,545,395.85	10.79
16	600519	贵州茅台	4,536,990.00	10.77
17	000538	云南白药	4,533,838.00	10.76
18	600009	上海机场	4,471,997.19	10.61
19	002251	步步高	4,273,188.07	10.14
20	600801	华新水泥	4,240,753.89	10.07
21	601225	陕西煤业	3,909,641.00	9.28
22	601288	农业银行	3,903,919.00	9.27
23	000422	湖北宜化	3,903,088.00	9.26
24	002415	海康威视	3,857,399.00	9.16
25	601939	建设银行	3,850,245.00	9.14
26	600691	阳煤化工	3,842,830.00	9.12
27	601318	中国平安	3,737,815.24	8.87
28	600754	锦江股份	3,690,851.00	8.76
29	002570	贝因美	3,557,122.00	8.44
30	600600	青岛啤酒	3,446,194.00	8.18
31	600258	首旅酒店	3,203,045.28	7.60
32	002563	森马服饰	3,200,796.74	7.60
33	601919	中远海控	3,169,911.00	7.52
34	000895	双汇发展	3,148,509.50	7.47

35	600585	海螺水泥	3,126,268.53	7.42
36	002690	美亚光电	3,118,312.00	7.40
37	000729	燕京啤酒	3,001,406.00	7.12
38	300481	濮阳惠成	2,970,010.00	7.05
39	000983	西山煤电	2,836,725.00	6.73
40	601699	潞安环能	2,826,763.00	6.71
41	600782	新钢股份	2,790,805.00	6.62
42	300568	星源材质	2,780,179.00	6.60
43	600622	光大嘉宝	2,776,504.90	6.59
44	002146	荣盛发展	2,575,367.00	6.11
45	600887	伊利股份	2,541,715.00	6.03
46	300285	国瓷材料	2,391,638.10	5.68
47	600282	南钢股份	2,341,496.00	5.56
48	002850	科达利	2,269,794.00	5.39
49	600708	光明地产	2,052,346.00	4.87
50	601988	中国银行	2,052,162.00	4.87
51	600340	华夏幸福	2,044,035.01	4.85
52	600325	华发股份	2,043,992.00	4.85
53	600188	兖州煤业	1,981,356.00	4.70
54	002477	雏鹰农牧	1,954,459.00	4.64
55	600741	华域汽车	1,953,614.00	4.64
56	002157	正邦科技	1,945,806.00	4.62
57	300498	温氏股份	1,941,704.00	4.61
58	000423	东阿阿胶	1,927,446.21	4.57
59	002008	大族激光	1,893,580.00	4.49
60	300630	普利制药	1,873,345.00	4.45
61	002241	歌尔股份	1,870,595.88	4.44
62	601628	中国人寿	1,834,460.00	4.35
63	000786	北新建材	1,830,098.00	4.34
64	601688	华泰证券	1,772,999.00	4.21
65	600742	一汽富维	1,747,788.00	4.15
66	600362	江西铜业	1,725,728.58	4.10
67	603626	科森科技	1,723,111.84	4.09
68	600999	招商证券	1,705,979.00	4.05
69	600809	山西汾酒	1,657,104.00	3.93
70	002110	三钢闽光	1,561,264.00	3.71

71	000789	万年青	1,557,136.00	3.70
72	000932	华菱钢铁	1,459,280.00	3.46
73	002322	理工环科	1,447,105.00	3.43
74	000553	沙隆达A	1,422,412.00	3.38
75	601168	西部矿业	1,422,244.00	3.38
76	002294	信立泰	1,383,895.00	3.28
77	600176	中国巨石	1,366,050.76	3.24
78	603160	汇顶科技	1,334,825.00	3.17
79	601799	星宇股份	1,302,421.00	3.09
80	600030	中信证券	1,300,887.90	3.09
81	600115	东方航空	1,293,560.00	3.07
82	002430	杭氧股份	1,285,518.00	3.05
83	002798	帝王洁具	1,281,458.00	3.04
84	000568	泸州老窖	1,274,825.00	3.03
85	600489	中金黄金	1,262,820.00	3.00
86	600547	山东黄金	1,261,690.00	2.99
87	603008	喜临门	1,251,407.44	2.97
88	300236	上海新阳	1,250,947.00	2.97
89	300429	强力新材	1,249,004.20	2.96
90	601339	百隆东方	1,242,972.00	2.95
91	600111	北方稀土	1,233,569.00	2.93
92	600392	盛和资源	1,233,210.00	2.93
93	600406	国电南瑞	1,227,874.00	2.91
94	600835	上海机电	1,222,933.50	2.90
95	002367	康力电梯	1,222,499.00	2.90
96	600894	广日股份	1,222,160.00	2.90
97	300232	洲明科技	1,215,830.00	2.89
98	600759	洲际油气	1,204,560.00	2.86
99	002419	天虹商场	1,202,050.00	2.85
100	002185	华天科技	1,188,721.00	2.82
101	600123	兰花科创	1,188,090.00	2.82
102	002083	孚日股份	1,187,450.20	2.82
103	002557	洽洽食品	1,185,694.00	2.81
104	600004	白云机场	1,179,469.00	2.80
105	000709	河钢股份	1,172,550.00	2.78
106	000898	鞍钢股份	1,164,320.00	2.76

107	002027	分众传媒	1,159,011.00	2.75
108	300327	中颖电子	1,137,346.00	2.70
109	002508	老板电器	1,137,073.91	2.70
110	002643	万润股份	1,136,201.05	2.70
111	601933	永辉超市	1,135,141.00	2.69
112	601003	柳钢股份	1,133,300.80	2.69
113	002640	跨境通	1,119,265.00	2.66
114	002127	南极电商	1,112,026.00	2.64
115	600420	现代制药	1,111,901.00	2.64
116	002262	恩华药业	1,106,904.40	2.63
117	002128	露天煤业	1,103,962.00	2.62
118	600521	华海药业	1,005,789.00	2.39
119	603883	老百姓	1,000,891.00	2.38
120	600808	马钢股份	949,727.00	2.25
121	000100	TCL 集团	940,664.00	2.23
122	601888	中国国旅	940,664.00	2.00

注：“买入金额”是指买入股票成交金额，即成交单价乘以成交数量，相关交易费用不考虑。

8.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值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	002234	民和股份	16,081,371.05	38.17
2	002458	益生股份	16,050,438.68	38.10
3	600104	上汽集团	10,497,950.40	24.92
4	002029	七匹狼	9,698,593.75	23.02
5	002299	圣农发展	9,265,241.68	21.99
6	000063	中兴通讯	8,493,938.86	20.16
7	600036	招商银行	7,994,929.40	18.98
8	000333	美的集团	7,848,037.22	18.63
9	002746	仙坛股份	6,633,486.00	15.75
10	600276	恒瑞医药	6,511,940.05	15.46
11	002570	贝因美	6,427,441.82	15.26
12	000422	湖北宣化	6,245,967.34	14.83
13	002041	登海种业	6,117,182.32	14.52
14	600691	阳煤化工	6,026,230.30	14.30
15	002251	步步高	5,256,810.39	12.48
16	000651	格力电器	4,953,427.00	11.76

17	600660	福耀玻璃	4,876,980.87	11.58
18	600519	贵州茅台	4,812,418.29	11.42
19	600009	上海机场	4,760,101.78	11.30
20	000538	云南白药	4,697,886.39	11.15
21	600066	宇通客车	4,531,004.20	10.75
22	601318	中国平安	4,350,845.34	10.33
23	000020	深华发A	4,124,682.92	9.79
24	601225	陕西煤业	4,120,402.19	9.78
25	601939	建设银行	3,998,520.85	9.49
26	002415	海康威视	3,997,054.01	9.49
27	601288	农业银行	3,887,437.00	9.23
28	600600	青岛啤酒	3,797,554.55	9.01
29	000830	鲁西化工	3,591,254.99	8.52
30	600426	华鲁恒升	3,497,507.12	8.30
31	601919	中远海控	3,428,499.00	8.14
32	600258	首旅酒店	3,406,999.05	8.09
33	000895	双汇发展	3,198,253.80	7.59
34	600585	海螺水泥	3,188,409.95	7.57
35	002690	美亚光电	3,144,268.75	7.46
36	002563	森马服饰	3,143,726.02	7.46
37	000729	燕京啤酒	3,108,527.00	7.38
38	300481	濮阳惠成	3,013,045.00	7.15
39	000731	四川美丰	2,824,976.00	6.71
40	000983	西山煤电	2,807,433.64	6.66
41	601699	潞安环能	2,727,712.88	6.47
42	600409	三友化工	2,582,438.98	6.13
43	002146	荣盛发展	2,484,860.06	5.90
44	600282	南钢股份	2,453,398.00	5.82
45	300568	星源材质	2,392,755.00	5.68
46	002068	黑猫股份	2,279,357.70	5.41
47	600754	锦江股份	2,230,875.74	5.30
48	601988	中国银行	2,197,795.00	5.22
49	300285	国瓷材料	2,184,959.00	5.19
50	002850	科达利	2,145,384.00	5.09
51	600188	兖州煤业	2,051,704.00	4.87
52	600325	华发股份	2,023,926.47	4.80
53	600708	光明地产	2,018,829.00	4.79
54	002470	金正大	1,987,356.00	4.72

55	600340	华夏幸福	1,978,243.00	4.70
56	000423	东阿阿胶	1,970,343.00	4.68
57	002157	正邦科技	1,951,128.24	4.63
58	600741	华域汽车	1,937,210.00	4.60
59	002477	雏鹰农牧	1,885,290.00	4.47
60	601628	中国人寿	1,877,201.00	4.46
61	002008	大族激光	1,867,186.00	4.43
62	300498	温氏股份	1,857,831.60	4.41
63	002241	歌尔股份	1,850,940.00	4.39
64	600362	江西铜业	1,763,797.00	4.19
65	000786	北新建材	1,656,106.24	3.93
66	603626	科森科技	1,543,605.30	3.66
67	000501	鄂武商A	1,500,074.00	3.56
68	300088	长信科技	1,498,372.00	3.56
69	600999	招商证券	1,475,854.42	3.50
70	603160	汇顶科技	1,450,790.86	3.44
71	600392	盛和资源	1,410,768.00	3.35
72	000553	沙隆达A	1,408,477.46	3.34
73	601168	西部矿业	1,393,999.00	3.31
74	600782	新钢股份	1,359,910.00	3.23
75	600111	北方稀土	1,343,756.00	3.19
76	300236	上海新阳	1,331,967.00	3.16
77	002430	杭氧股份	1,284,429.00	3.05
78	002027	分众传媒	1,281,571.62	3.04
79	601933	永辉超市	1,247,616.00	2.96
80	002419	天虹商场	1,242,479.00	2.95
81	600835	上海机电	1,233,284.80	2.93
82	000709	河钢股份	1,231,100.00	2.92
83	002322	理工环科	1,227,292.65	2.91
84	002262	恩华药业	1,225,835.00	2.91
85	002557	洽洽食品	1,221,828.40	2.90
86	300429	强力新材	1,218,186.38	2.89
87	600894	广日股份	1,214,759.00	2.88
88	600115	东方航空	1,210,276.00	2.87
89	601339	百隆东方	1,206,414.00	2.86
90	600801	华新水泥	1,204,401.00	2.86
91	002367	康力电梯	1,204,106.00	2.86
92	600004	白云机场	1,196,352.00	2.84

93	300327	中颖电子	1,195,407.00	2.84
94	000898	鞍钢股份	1,193,045.00	2.83
95	000759	中百集团	1,184,364.00	2.81
96	600547	山东黄金	1,177,977.64	2.80
97	600123	兰花科创	1,176,065.00	2.79
98	002185	华天科技	1,170,197.00	2.78
99	600489	中金黄金	1,168,962.00	2.77
100	002643	万润股份	1,164,968.30	2.77
101	603008	喜临门	1,163,996.03	2.76
102	002083	孚日股份	1,144,032.52	2.72
103	300232	洲明科技	1,141,829.00	2.71
104	002508	老板电器	1,109,835.50	2.63
105	600808	马钢股份	1,052,312.84	2.50
106	600420	现代制药	1,016,493.00	2.41
107	600759	洲际油气	1,006,185.00	2.39
108	002127	南极电商	957,473.19	2.27

注：卖出金额”是指卖出股票成交金额，即成交单价乘以成交数量，相关交易费用不考虑。

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	342,625,495.99
卖出股票收入（成交）总额	334,291,778.41

注：表中“买入股票成本（成交）总额”及“卖出股票收入（成交）总额”均指成交金额，即成交单价乘以成交数量，相关交易费用不考虑。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。

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

本基金本报告期末未持有国债期货。

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报告期内没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.12.2 本基金投资的前十名股票未超出本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	91,584.15
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	896.91
5	应收申购款	2,110.52
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	94,591.58

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。

§ 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
771	51,838.13	13,929,133.25	34.85%	26,038,066.01	65.15%

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	17,113.58	0.0428%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2016年2月3日)基金份额总额	265,553,528.17
本报告期期初基金份额总额	39,996,447.90
本报告期基金总申购份额	65,370,783.79
减:本报告期基金总赎回份额	65,400,032.43
本报告期期末基金份额总额	39,967,199.26

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期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

11.2.1 基金管理人重大人事变动

(1) 2017年3月4日,本基金管理人发布了《融通基金管理有限公司关于高级管理人员变更公告》,经本基金管理人第五届董事会第十七次临时会议审议并通过,同意孟朝霞女士辞去公司总经理职务,并决定由公司董事长高峰先生代为履行公司总经理职务。

(2) 2017年6月3日,本基金管理人发布了《融通基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》,经本基金管理人第五届董事会第十八次临时会议决议审议并通过,决定由张帆先生担任公司总经理职务,公司董事长高峰先生不再代为履行公司总经理职务。

11.2.2 基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

在本报告期内没有涉及基金管理人、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

本报告期内基金的投资策略未发生变更。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘请的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙），该事务所自基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今，本年度应支付的审计费用为 50,000.00 元。

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、托管人及其高级管理人员无受监管部门稽查或处罚的情形。

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	
中泰证券	3	174,223,660.58	25.74%	158,770.93	25.59%	-
长江证券	1	87,365,463.43	12.91%	79,616.45	12.83%	-
天风证券	2	74,224,464.58	10.97%	67,641.07	10.90%	-
中信建投	1	69,727,427.77	10.30%	64,936.45	10.47%	-
东北证券	1	58,711,725.75	8.67%	53,504.55	8.62%	-
恒泰证券	1	42,293,434.34	6.25%	39,387.94	6.35%	-
申万宏源	2	36,018,466.53	5.32%	33,544.07	5.41%	-
中信证券	1	30,262,686.52	4.47%	27,578.24	4.44%	-
海通证券	1	29,537,941.29	4.36%	26,917.75	4.34%	-
华泰证券	1	17,516,262.24	2.59%	15,962.67	2.57%	-
安信证券	2	17,437,837.85	2.58%	16,239.46	2.62%	-

新时代证券	1	13,652,501.28	2.02%	12,714.65	2.05%	-
光大证券	1	13,591,968.50	2.01%	12,386.27	2.00%	-
浙商证券	2	12,353,433.74	1.82%	11,257.71	1.81%	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
广州证券	2	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
华鑫证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
西藏东方财富	1	-	-	-	-	-

注：1、本基金选择代理本公司所管理的基金进行证券买卖业务的证券经营机构的标准包括以下六个方面：

- (1) 资质雄厚，信誉良好，注册资本不少于3亿元人民币；
- (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，最近两年未因重大违规行为而受到中国证监会和中国人民银行处罚；
- (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研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告及其他专门报告，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告。

2、选择代理本公司所管理的基金进行证券买卖业务的证券经营机构的程序包括以下四个步骤：

- (1) 券商服务评价；

- (2) 拟定租用对象。由研究部根据以上评价结果拟定备选的券商；
- (3) 上报批准。研究部将拟定租用对象上报分管副总经理批准；
- (4) 签约。在获得批准后，按公司签约程序代表公司与确定券商签约。

3、交易单元变更情况

本报告期内基金新增天风证券上海席位和深圳席位各一个，东北证券上海席位一个，东兴证券深圳席位一个，华安证券深圳席位一个，西藏东方财富深圳席位一个。本报告期内基金终止中山证券上海席位和深圳席位各一个。

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
中信建投	-	-	37,600,000.00	89.95%	-	-
东北证券	-	-	4,200,000.00	10.05%	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-

国联证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
西藏东方财富	-	-	-	-	-	-

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	融通基金管理有限公司关于新增天津国美基金销售有限公司为代销机构并参加其申购费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、管理人网站	2017-01-06
2	融通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加北京肯特瑞财富投资管理有限公司申购费率优惠的公告	中国证券报、证券时报、管理人网站	2017-02-20
3	关于融通基金管理有限公司旗下部分开放式基金参加交通银行股份有限公司申购及定期定额投资业务费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、管理人网站	2017-02-23
4	融通基金管理有限公司关于高级管理人员变更公告	证券时报、管理人网站	2017-03-04
5	融通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加上海万得投资顾问有限公司申购费率优惠的公告	中国证券报、证券时报、管理人网站	2017-03-30
6	关于融通基金管理有限公司旗下开放式基金参加中国工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、管理人网站	2017-03-31
7	融通基金管理有限公司关于新增北京乐融多源投资咨询有限公司为代销机构并参加其申购费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、管理人网站	2017-04-06
8	融通基金管理有限公司关于新增华瑞保险销售有限公司为代销机构的公告	中国证券报、证券时报、管理人网站	2017-04-06
9	关于融通基金管理有限公司旗下部分开放式基金参加交通银行股份有限公司申购及定期定额投资业务费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、管理人网站	2017-04-22

10	融通基金管理有限公司关于高级管理人员变更公告	证券时报、管理人网站	2017-06-03
11	融通基金管理有限公司关于新增上海通华财富资产管理有限公司为代销机构的公告	中国证券报、证券时报、管理人网站	2017-06-14
12	关于融通基金管理有限公司旗下部分开放式基金参加交通银行股份有限公司网上银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、管理人网站	2017-07-01
13	关于融通旗下部分开放式基金参加交通银行手机银行申购及定期定额投资业务费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、管理人网站	2017-07-01
14	融通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加华西证券股份有限公司申购及定期定额投资业务费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、管理人网站	2017-07-28
15	融通中国风1号灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告	中国证券报、证券时报、管理人网站	2017-08-05
16	融通基金管理有限公司关于融通中国风1号灵活配置混合型证券投资基金参加浙江同花顺基金销售有限公司申购费率优惠活动	中国证券报、证券时报、管理人网站	2017-08-14
17	融通基金关于参加天津国美基金销售有限公司申购费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、管理人网站	2017-09-20
18	关于新增深圳市锦安基金销售有限公司为代销机构的公告	中国证券报、证券时报、管理人网站	2017-09-21
19	融通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金在工商银行开通基金定投业务并参加工行定投优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、管理人网站	2017-09-27
20	关于中泰证券股份有限公司代销的融通基金管理有限公司旗下部分开放式基金新增开通定期定额投资业务的公告	中国证券报、证券时报、管理人网站	2017-09-29
21	融通基金管理有限公司关于调整旗下部分开放式基金最低赎回、转换和保有份额限制的公告	中国证券报、证券时报、管理人网站	2017-09-29
22	融通基金管理有限公司关于新增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和参加其申购费率优惠的公告	中国证券报、证券时报、管理人网站	2017-10-19
23	融通中国风1号灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告	中国证券报、证券时报、管理人网站	2017-10-21
24	融通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加中泰证券股份有限公司申购及定期定额投资业务费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、管理人网站	2017-10-27
25	融通基金管理有限公司关于新增北京植信基金销售有限公司为代销机构的公告	中国证券报、证券时报、管理人网站	2017-11-17
26	融通基金关于新增大河财富基金销售有限公司为代销机构并开通定期定额投资业务、转换业务及参加其申购费率优惠的公告	中国证券报、证券时报、管理人网站	2017-12-14
27	关于融通旗下部分开放式基金参加新时代证券	中国证券报、证券	2017-12-15

	申购费率优惠活动的公告	时报、管理人网站	
28	关于新增上海联泰资产管理有限公司为代销机构并开通转换业务及参加其申购费率优惠的公告	中国证券报、证券时报、管理人网站	2017-12-22
29	关于融通基金管理有限公司旗下部分开放式基金参加中国国际金融股份有限公司基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、管理人网站	2017-12-27
30	关于融通基金管理有限公司旗下部分开放式基金参加苏州银行股份有限公司基金申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、管理人网站	2017-12-29
31	关于融通基金管理有限公司旗下部分开放式基金参加交通银行股份有限公司申购及定期定额投资业务费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、管理人网站	2017-12-29
32	关于融通旗下部分开放式基金参加中国工商银行股份有限公司“2018倾心回馈”基金定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、管理人网站	2017-12-29
33	融通基金关于新增上海华夏财富投资管理有限公司为代销机构并开通转换业务及参加其申购费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、管理人网站	2017-12-29

§ 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	2017-01-01~2017-06-1, 2017-06-16~2017-11-21	9,999,527.77	-	4,000,000.00	5,999,527.77	15.01%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
当基金份额持有人占比过于集中时,可能存在因某单一基金份额持有人大额赎回而引起基金单位份额净值剧烈波动的风险及流动性风险。							

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》的要求,本基金管理人经与基金托管人协商一致,对本基金合同进行了修订和更新。本次修订和更新仅涉及与《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》相关的条款,包括前言、释义、基金份额的申购与赎回、基金的投资、基金资产估值、基金的信息披露等,具体内容详见2018年3月22日基金管理人网站

披露的相关公告和修订更新后的法律文件。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会批准融通中国风1号灵活配置混合型证券投资基金设立的文件
- (二) 《融通中国风1号灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- (三) 《融通中国风1号灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- (四) 《融通中国风1号灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》及其更新
- (五) 融通基金管理有限公司业务资格批件和营业执照
- (六) 报告期内在指定报刊上披露的各项公告

13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

13.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件，或登陆本基金管理人网站 <http://www.rtfund.com> 查阅。