

**永赢量化灵活配置混合型发起式证券投资基金**  
**2017 年年度报告摘要**

2017 年 12 月 31 日

基金管理人:永赢基金管理有限公司

基金托管人:华泰证券股份有限公司

送出日期:2018 年 03 月 30 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。

基金托管人华泰证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 3 月 28 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。

本报告中财务资料经审计。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 2017 年 12 月 31 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                      |
|------------|----------------------|
| 基金名称       | 永赢量化灵活配置混合型发起式证券投资基金 |
| 基金简称       | 永赢量化灵活配置混合发起式        |
| 基金主代码      | 001754               |
| 基金运作方式     | 契约型开放式               |
| 基金合同生效日    | 2015年09月01日          |
| 基金管理人      | 永赢基金管理有限公司           |
| 基金托管人      | 华泰证券股份有限公司           |
| 报告期末基金份额总额 | 56,492,789.33份       |
| 基金合同存续期    | 不定期                  |

### 2.2 基金产品说明

|      |   |
|------|---|
| 投资目标 | <p>本基金通过灵活应用多种量化策略，在充分控制基金财产风险和保证基金财产流动性的基础上，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金财产的长期稳健增值。</p>   |
| 投资策略 | <p>本基金采用多因子选股策略为主，辅以事件驱动以及宏观择时等其他量化策略，力争实现稳定的绝对回报。</p> <p>1、多因子选股策略</p> <p>该策略以对中国股票市场较长期的回测研究为基础，运用量化多因子模型框架，结合定性指标和定量指标，综合考虑上市公司基本经营状况和市场对股票的反应两大因素，通过计算市场上所有股票的管理质量、价值、成长变化、市场情绪以及行业特殊因素等量化因子，将计算结果组合成alpha模型，同时结合风险模型构建股票现货组合。基金经理根据市场状况及变化对各类信息的重要性做出具有一定前瞻性的判断，适时调整各因子类别的具体组成及权重。</p> <p>(1) 基本面因子</p> <p>管理质量：利用计算横截面多种比率来判断上市</p> |

公司的报表质量以及管理能力，例如衡量报表质量的应收应付因子，衡量管理能力的周转率、偿债能力、ROA和ROE等因子；

成长变化：通过计算时间序列上各种比率的变化来衡量公司基本面的成长性；

价值：判断公司的股票价格相对于它的内在价值是否合理。由于内在价值无法直接计算，我们通过计算全市场所有公司的利润、销售量、总资产等多种指标来综合间接反映公司的内在价值。

## （2）市场因子

市场情绪：从技术面的动量、反转、枢轴突破等指标来衡量投资者情绪；

分析师预测：通过扫描市场上分析师观点的变化来预测市场反应。

## 2、事件驱动策略

该策略通过对某些公司事件和市场事件的研究，分析事件对股价造成波动的方向，以赚取超额收益。此外，该策略还利用市场上存在的金融产品定价非有效性，实现套利收益。

## 3、宏观择时策略

该策略通过计算和跟踪多种宏观经济变量和市场变量，运用计量经济学方法对未来大盘走势进行预测。

## 4、其他投资策略

### （1）债券投资策略

出于对流动性、有效利用基金财产的考虑，本基金适时对债券进行投资。通过深入分析宏观经济数据、货币政策和利率变化趋势等因素，制定久期控制下的投资策略，构造能够提供稳定收益的债券和货币市场工具组合。

### （2）金融衍生工具投资策略

在法律法规允许的范围内，本基金可基于谨慎原则运用权证、股票指数期货等相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理，以控制投资组合风险、提高投资效率，从而更好地实现本基金的投资目标。

|        |  |
|--------|--|
| 业绩比较基准 | 95%*沪深300指数收益率+5%*银行活期存款利率<br>(税后)               |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型证券投资基金，预期风险和预期收益水平高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金。 |

### 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      | 永赢基金管理有限公司   | 华泰证券股份有限公司             |
| 信息披露负责人 | 姓名           | 毛慧                     |
|         | 联系电话         | 021-51690145           |
|         | 电子邮箱         | maoh@maxwealthfund.com |
| 客户服务电话  | 021-51690111 | 95597                  |
| 传真      | 021-51690177 | 025-83387215           |

### 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 | www.maxwealthfund.com |
| 基金年度报告备置地点          | 基金管理人、基金托管人处          |

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 2017年        | 2016年         | 2015年9月1日（基金合同生效日）-2015年12月31日 |
|---------------|--------------|---------------|--------------------------------|
| 本期已实现收益       | 5,256,218.87 | -8,678,657.67 | 14,593,008.03                  |
| 本期利润          | 6,195,038.97 | -9,655,379.85 | 14,346,110.20                  |

|                      |               |               |                |
|----------------------|---------------|---------------|----------------|
| 加权平均基金份额本期利润         | 0.1073        | -0.1022       | 0.0539         |
| 本期加权平均净值利润率          | 10.14%        | -10.86%       | 5.35%          |
| 本期基金份额净值增长率          | 6.59%         | -4.87%        | 6.80%          |
| <b>3.1.2 期末数据和指标</b> | 2017年末        | 2016年末        | 2015年末         |
| 期末可供分配利润             | 4,712,496.02  | 964,885.43    | 8,371,341.21   |
| 期末可供分配基金份额利润         | 0.0834        | 0.0163        | 0.0679         |
| 期末基金资产净值             | 61,205,285.35 | 60,002,958.63 | 131,585,086.93 |
| 期末基金份额净值             | 1.083         | 1.016         | 1.068          |
| <b>3.1.3 累计期末指标</b>  | 2017年末        | 2016年末        | 2015年末         |
| 基金份额累计净值增长率          | 8.30%         | 1.60%         | 6.80%          |

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

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

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③     | ②-④   |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|---------|-------|
| 过去三个月      | -5.58%   | 0.81%       | 4.82%      | 0.76%         | -10.40% | 0.05% |
| 过去六个月      | 5.56%    | 0.85%       | 9.44%      | 0.66%         | -3.88%  | 0.19% |
| 过去一年       | 6.59%    | 0.83%       | 20.63%     | 0.60%         | -14.04% | 0.23% |
| 自基金合同生效起至今 | 8.30%    | 1.19%       | 18.95%     | 1.15%         | -10.65% | 0.04% |

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

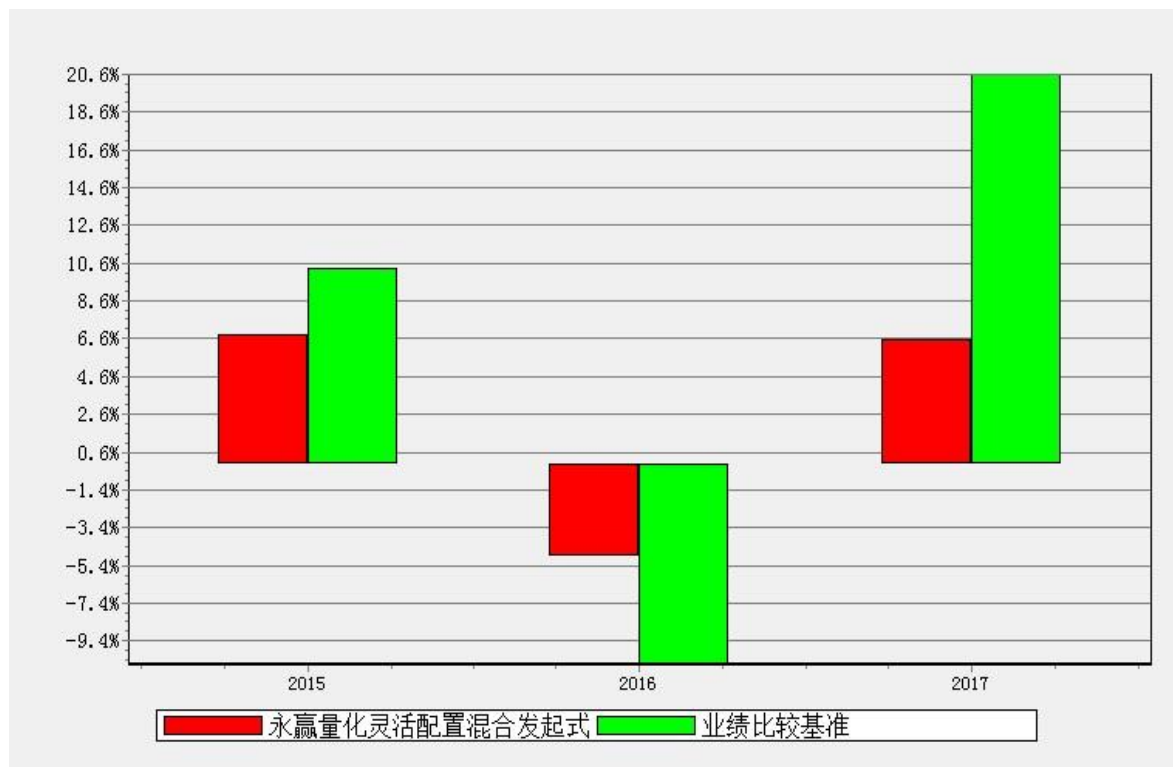
2、本基金业绩比较基准为95%\*沪深300指数收益率+5%\*银行活期存款利率（税后）。

### 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



注：本基金在六个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同约定。

### 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



注：图中列示的2015年度基金净值增长率按该年度本基金实际存续期9月1日（基金合同生效日）起至12月31日止计算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金的合同生效日为2015年9月1日，截至2017年12月31日，本基金未进行过利润分配。

## § 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

永赢基金管理有限公司（以下简称“公司”）于2013年10月8日取得了中国证监会《关于核准设立永赢基金管理有限公司的批复》（证监许可[2013]1280号），随后，公司于2013年10月11日取得商务部《中华人民共和国外商投资企业批准证书》（商外资资审字[2013]008号），并于2013年11月7日在国家工商行政管理总局注册成立，此后，于2013年11月12日取得中国证监会核发的《基金管理资格证书》（编号A087），并于2017年3月14日获得中国证监会颁发的信用代码为913302007178854322的《中华人民共和国经营证券期货业务许可证》。2014年8月18日，公司完成工商变更登记，注册资本由人民币壹点伍亿元增至人民币贰亿元；2018年1月25日，公司完成增资，注册资本由人民币贰



亿元增至人民币玖亿元。目前，公司的股权结构为宁波银行股份有限公司持股71.49%，利安资金管理公司持股28.51%。

截止2017年12月31日，本基金管理人共管理10只开放式证券投资基金，即永赢货币市场基金、永赢天天利货币市场基金、永赢量化混合型发起式证券投资基金、永赢量化灵活配置混合型发起式证券投资基金、永赢稳益债券型证券投资基金、永赢双利债券型证券投资基金、永赢丰益债券型证券投资基金、永赢添益债券型证券投资基金、永赢瑞益债券型证券投资基金、永赢永益债券型证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名  | 职务   | 任本基金的基金经理（助理）期限 |      | 证券从业年限 | 说明   |
|-----|------|-----------------|------|--------|--|
|     |      | 任职日期            | 离任日期 |        |  |
| 张大木 | 基金经理 | 2015-09-01      | -    | 17     | 张大木先生，硕士，17年金融行业投资研究经验，其中10年证券相关从业经验，曾任美国沃顿商学院高级数据分析师；巴克莱全球投资公司（BGI）投资分析员；博时基金管理有限公司投资经理兼量化分析师。现任永赢基金管理有限公司总经理助理兼量化投资总监。 |

注：1、任职时间和离任日期一般情况下指公司做出决定之日；若该基金经理自基金合同生效日起即任职，则任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

在本报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《永赢量化灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，并本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作合法合规，无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

为了公平对待投资人，保护投资人利益，避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为，本基金管理人根据《证券投资基金法》、《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司特定客户资产管理业务试点办法》等法律法规和内部制度，制定和修订了《公平交易制度》。

通过组织结构的设置、工作制度、流程和技术手段全面落实公平交易原则在具体业务（包括研究分析、投资决策、交易执行等）环节中的实现，在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时，确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。同时，通过对投资交易行为的日常监控和事后分析评估来加强对公平交易过程和结果的监督。

在研究分析方面，本基金管理人建立了规范、完善的研究管理平台，规范了研究人员投资建议、研究报告的发布流程，使各投资组合经理在获取投资建议的及时性、准确性及深度等方面得到公平对待。

在投资决策方面，首先，本基金管理人建立健全投资授权制度，明确投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体的职责和权限。投资决策委员会和投资总监等管理机构和人员不得对投资经理在授权范围内的投资活动进行干预。投资经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作必须经过严格的审批程序；其次，本基金管理人建立投资组合投资信息的管理及保密制度，除分管投资副总及投资总监等因业务管理的需要外，不同投资经理之间的持仓和交易等重大非公开投资信息相互隔离；另外，本基金管理人还建立机制要求公募投资经理与特定客户资产投资经理互相隔离，且不能互相授权投资事宜。

在交易执行方面，本基金管理人设立了独立于投资管理职能的交易部，通过实行集中交易制度和公平的交易分配制度，确保各投资组合享有公平的交易执行机会；此外，本基金管理人对于可能导致涉嫌不公平交易和利益输送的反向交易行为也制定并落实了严格的管理：（1）对于交易所公开竞价的同向交易，交易部按照“时间优先、价格优先”的原则，采取“未委托数量比例法”，通过系统的公平交易模块实现公平交易；（2）对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以本基金管理人名义进行的交易，各投资经理在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量，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；（3）对于银行间市场的现券交易，交易部在银行间市场开展独立、公平的询价，并由监察稽核部对交易价格的公允性（根据市场公认的第三方信息）、交易对手和交易方式进行事后审核，确保交易得到公平和公允的执行。对于由于特殊原因不能参与以上提到的公平交易程序的交易指令，投资经理须提出申请并阐明具体原因，交由交易总监及监察稽核总监进行严格的公平性审核；（4）严格禁止同一投资组合或不同投资组合之间在同一交易日内进行反向交易（除完全按照有关指数的构成比例进行投资的组合或严格依据量化模型进行投资的组合外）。确因投资组合的投资策略或流动性等需要而发生的不同投资组合之间的同日反向交易，相关投资经理

须向风险管理委员会提供决策依据并留存记录备查。

在日常监控和事后分析评估方面，监察稽核部开展日内和定期的工作对公平交易执行情况作整体监控和效果评估。其中日常监控包括了日内不定点对交易系统的抽查监控；对非公开发行业股票申购、以本基金管理人名义进行的债券一级市场申购的申购方案和分配过程进行审核和监控；以及对银行间交易过程中投资组合与交易对手之间议价交易的交易方式和交易价格的公允性进行审查。事后分析评估上，监察稽核部在每个季度的《公平交易报告》中，对不同组合间同一投资标的、临近交易日的同向交易和反向交易的合理性开展分析评估。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本基金管理人主要通过建立有纪律、规范化的投资研究和决策流程、交易流程，以及强化事后监控分析来确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。本基金管理人规定了严格的投资权限管理制度、投资备选库管理制度和集中交易制度等，并重视交易执行环节的公平交易措施，以“时间优先、价格优先”作为执行指令的基本原则，通过投资交易系统内的公平交易模块，以尽可能确保公平对待各投资组合。

本基金管理人交易部和监察稽核部进行日常投资交易行为监控，监察稽核部负责对各账户公平交易进行事后分析，于每季度分别对所管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异以及不同时间窗口同向交易的交易价差进行分析，通过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。

报告期内本基金管理人严格执行公平交易制度，公平对待旗下各投资组合，未发现任何违反公平交易的行为。本报告期内，公平交易制度执行情况良好。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

### 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股市场走势分化严重，与过去十年市场整体风格偏好出现明显偏离，以沪深300为代表的大盘蓝筹强势上涨，其余个股则出现较为明显的调整。在本报告期内，本基金遵循稳健原则，利用量化模型灵活配置基金资产，由于受历史回测框架体系限制，本基金主要采用的量化多因子模型在2017年行情中表现一般，超额收益水平处于历史均值下限区域。

未来，我们将继续保持谨慎，灵活配置基金资产，在进一步有效控制产品风险的前提下，力争本产品的平衡运行。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末永赢量化灵活配置混合发起式基金份额净值为1.083元;本报告期内,基金份额净值增长率为6.59%,同期业绩比较基准收益率为20.63%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2017年,A股市场走势分化严重,与过去十年市场整体风格偏好出现明显偏离,以沪深300为代表的大盘蓝筹强势上涨,其余个股则出现较为明显的调整。在本报告期内,本基金遵循稳健原则,利用量化模型灵活配置基金资产,由于受历史回溯框架体系限制,本基金主要采用的量化多因子模型在2017年行情中表现一般,超额收益水平处于历史均值下限区域。

未来,我们将继续保持谨慎,灵活配置基金资产,在进一步有效控制产品风险的前提下,力争本产品的平衡运行。

#### 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。本基金管理人估值委员会由分管运营的总经理助理负责,成员包括总经理、督察长、分管投资的总经理助理、分管运营的总经理助理、基金运营部负责人、监察稽核部负责人。以上成员均具有丰富的行业分析、会计核算等证券投资基金行业从业经验及专业能力。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况,可向估值委员会报告并提出相关意见和建议,但不参与最终估值决策。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。

报告期内,本基金依据签署的《中债收益率曲线和中债估值最终用户服务协议》从中央国债登记结算有限责任公司取得中债估值服务;本基金与中证指数有限公司根据《中证债券估值数据服务协议》而取得中证数据估值服务。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配,符合相关法规及基金合同的规定。

#### 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

本报告期内本基金管理人无应说明的预警信息。

### § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在本报告期内（2017年01月01日至2017年12月31日），永赢量化灵活配置混合型发起式证券投资基金基金托管人-华泰证券股份有限公司按时进行了基金的投资交易清算，及时完成了基金名下的资金划拨，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，并严格遵守了基金合同和各项法律法规的相关规定，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，本托管人依基金合同约定对基金管理人的投资运作行为进行了监督，对本基金资产净值计算、费用开支方面进行了复核，未发现基金管理人存在损害本基金份额持有人利益的行为。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核了本基金2017年年度报告中的有关财务数据、净值表现、收益分配、投资组合报告等内容，相关内容真实、准确和完整。

## § 6 审计报告

本基金2017年年度财务会计报告经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师签字出具了无保留意见的审计报告。投资者可通过登载于本管理人网站的年度报告正文查看审计报告全文。

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：永赢量化灵活配置混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2017年12月31日

单位：人民币元

| 资产         | 附注号     | 本期末<br>2017年12月31日 | 上年度末<br>2016年12月31日 |
|------------|---------|--------------------|---------------------|
| <b>资产：</b> |         |                    |                     |
| 银行存款       | 7.4.7.1 | 5,067,180.55       | 5,241,162.13        |
| 结算备付金      |         | 1,940,887.61       | 1,150,832.88        |
| 存出保证金      |         | 81,202.88          | 456,607.87          |
| 交易性金融资产    | 7.4.7.2 | 54,831,334.87      | 55,212,057.79       |

|                 |            |                            |                             |
|-----------------|------------|----------------------------|-----------------------------|
| 其中：股票投资         |            | 54,831,334.87              | 55,212,057.79               |
| 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         |            | -                          | -                           |
| 应收利息            | 7.4.7.5    | 3,332.79                   | 2,540.84                    |
| 应收股利            |            | -                          | -                           |
| 应收申购款           |            | -                          | 30,053.59                   |
| 递延所得税资产         |            | -                          | -                           |
| 其他资产            | 7.4.7.6    | -                          | -                           |
| 资产总计            |            | 61,923,938.70              | 62,093,255.10               |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2017年12月31日</b> | <b>上年度末<br/>2016年12月31日</b> |
| <b>负 债：</b>     |            |                            |                             |
| 短期借款            |            | -                          | -                           |
| 交易性金融负债         |            | -                          | -                           |
| 衍生金融负债          | 7.4.7.3    | -                          | -                           |
| 卖出回购金融资产款       |            | -                          | -                           |
| 应付证券清算款         |            | -                          | -                           |
| 应付赎回款           |            | 4,034.37                   | 1,405,451.26                |
| 应付管理人报酬         |            | 78,080.50                  | 79,998.58                   |
| 应付托管费           |            | 10,410.75                  | 10,666.46                   |
| 应付销售服务费         |            | -                          | -                           |
| 应付交易费用          | 7.4.7.7    | 246,127.73                 | 314,165.84                  |
| 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      | 380,000.00    | 280,014.33    |
| 负债合计          |              | 718,653.35    | 2,090,296.47  |
| <b>所有者权益：</b> |              |               |               |
| 实收基金          | 7.4.7.9      | 56,492,789.33 | 59,038,073.20 |
| 未分配利润         | 7.4.7.1<br>0 | 4,712,496.02  | 964,885.43    |
| 所有者权益合计       |              | 61,205,285.35 | 60,002,958.63 |
| 负债和所有者权益总计    |              | 61,923,938.70 | 62,093,255.10 |

注：报告截止日2017年12月31日，基金份额净值1.083元，基金份额总额56,492,789.33份。

## 7.2 利润表

会计主体：永赢量化灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期：2017年01月01日至2017年12月31日

单位：人民币元

| 项目                | 附注号          | 本期2017年01月01日至2017年12月31日 | 上年度可比期间<br>2016年01月01日至2016年12月31日 |
|-------------------|--------------|---------------------------|------------------------------------|
| <b>一、收入</b>       |              | 9,801,279.82              | -4,383,991.26                      |
| 1. 利息收入           |              | 103,279.72                | 283,430.18                         |
| 其中：存款利息收入         | 7.4.7.1<br>1 | 103,279.72                | 240,563.98                         |
| 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        |              | -                         | 42,866.20                          |
| 其他利息收入            |              | -                         | -                                  |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） |              | 8,752,587.59              | -3,789,766.46                      |
| 其中：股票投资收益         | 7.4.7.1<br>2 | 7,850,061.08              | -4,804,623.87                      |

|                            |                |              |               |
|----------------------------|----------------|--------------|---------------|
| 基金投资收益                     | 7.4.7.1<br>3   | -            | -12,126.75    |
| 债券投资收益                     | 7.4.7.1<br>4   | -            | -             |
| 资产支持证券投资收<br>益             | 7.4.7.1<br>4.2 | -            | -             |
| 贵金属投资收益                    | 7.4.7.1<br>5   | -            | -             |
| 衍生工具收益                     | 7.4.7.1<br>6   | 9,480.00     | 473,020.00    |
| 股利收益                       | 7.4.7.1<br>7   | 893,046.51   | 553,964.16    |
| 3. 公允价值变动收益(损失以<br>“-”号填列) | 7.4.7.1<br>8   | 938,820.10   | -976,722.18   |
| 4. 汇兑收益(损失以“-”号<br>填列)     |                | -            | -             |
| 5. 其他收入(损失以“-”号<br>填列)     | 7.4.7.1<br>9   | 6,592.41     | 99,067.20     |
| <b>减：二、费用</b>              |                | 3,606,240.85 | 5,271,388.59  |
| 1. 管理人报酬                   | 7.4.10.<br>2.1 | 915,112.04   | 1,339,726.70  |
| 2. 托管费                     | 7.4.10.<br>2.2 | 122,014.98   | 178,630.24    |
| 3. 销售服务费                   | 7.4.10.<br>2.3 | -            | -             |
| 4. 交易费用                    | 7.4.7.2<br>0   | 2,239,113.83 | 3,448,031.49  |
| 5. 利息支出                    |                | -            | -             |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |                | -            | -             |
| 6. 其他费用                    | 7.4.7.2<br>1   | 330,000.00   | 305,000.16    |
| <b>三、利润总额(亏损总额以“-”</b>     |                | 6,195,038.97 | -9,655,379.85 |



|                   |  |              |               |
|-------------------|--|--------------|---------------|
| 号填列)              |  |              |               |
| 减：所得税费用           |  | -            | -             |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列) |  | 6,195,038.97 | -9,655,379.85 |

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：永赢量化灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期：2017年01月01日至2017年12月31日

单位：人民币元

| 项 目                                    | 本期<br>2017年01月01日至2017年12月31日      |               |                |
|--|------------------------------------|---------------|----------------|
|  | 实收基金                               | 未分配利润         | 所有者权益合计        |
| 一、期初所有者权益(基金净值)                        | 59,038,073.20                      | 964,885.43    | 60,002,958.63  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)               | -                                  | 6,195,038.97  | 6,195,038.97   |
| 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)      | -2,545,283.87                      | -2,447,428.38 | -4,992,712.25  |
| 其中：1. 基金申购款                            | 30,404,392.94                      | -295,065.15   | 30,109,327.79  |
| 2. 基金赎回款                               | -32,949,676.81                     | -2,152,363.23 | -35,102,040.04 |
| 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)                        | 56,492,789.33                      | 4,712,496.02  | 61,205,285.35  |
| 项 目                                    | 上年度可比期间<br>2016年01月01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)                        | 123,213,745.72                     | 8,371,341.21  | 131,585,086.93 |

|  |                |               |                |
|--|----------------|---------------|----------------|
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)               | -              | -9,655,379.85 | -9,655,379.85  |
| 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)      | -64,175,672.52 | 2,248,924.07  | -61,926,748.45 |
| 其中：1. 基金申购款                            | 11,367,556.07  | -1,006,067.47 | 10,361,488.60  |
| 2. 基金赎回款                               | -75,543,228.59 | 3,254,991.54  | -72,288,237.05 |
| 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)                        | 59,038,073.20  | 964,885.43    | 60,002,958.63  |

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：

芦特尔

高利民

虞俏依

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

永赢量化灵活配置混合型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2015]1700号文《关于准予永赢量化灵活配置混合型发起式证券投资基金注册的批复》的核准，由基金管理人永赢基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于2015年9月1日正式生效，首次设立募集规模为302,140,249.57份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人及注册登记机构为永赢基金管理有限公司，基金托管人为华泰证券股份有限公司。

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（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（国债、金融债、企业/公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、股指期货、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

本基金股票资产的投资比例占基金资产的0-95%；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，现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%。本基金参与股指期货交易后，应符合法律法规规定和基金合同约定的投资限制并遵守相关期货交易所的业务规则。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的业绩比较基准为： $95% \times \text{沪深300指数收益率} + 5% \times \text{银行活期存款利率（税后）}$ 。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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于2017年12月31日的财务状况以及2017年度的经营成果和净值变动情况。

#### 7.4.4 本报告期内所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 7.4.6 税项

##### 7.4.6.1 印花税

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

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

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

而发生的股权转让，暂免征收印花税。

#### 7.4.6.2 增值税

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

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自2018年1月1日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

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

价计算销售额。

#### 7.4.6.3 企业所得税

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

#### 7.4.6.4 个人所得税

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

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

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自2013年1月1日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂减按25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税；

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

#### 7.4.7 关联方关系

| 关联方名称           | 与本基金的关系                |
|-----------------|------------------------|
| 永赢基金管理有限公司(“永赢基 | 基金管理人、基金发起人、基金注册登记机构、基 |

|                    |                 |
|--------------------|-----------------|
| 金”)                | 金销售机构           |
| 华泰证券股份有限公司(“华泰证券”) | 基金托管人、基金代销机构    |
| 宁波银行股份有限公司(“宁波银行”) | 基金管理人的股东、基金代销机构 |
| 利安资金管理公司           | 基金管理人的股东        |
| 员工股东               | 基金管理人的股东        |
| 华泰期货有限公司           | 基金托管人的子公司       |
| 永赢资产管理有限公司(“永赢资产”) | 基金管理人的子公司       |

注：1、以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

2、根据中国证券监督管理委员会2017年12月27日证监许可（2017）2415号《关于核准永赢基金管理有限公司变更股权的批复》，永赢基金管理有限公司原自然人股东将其所持18.51%转让给利安资金管理公司，并于2018年1月10日完成工商变更登记。

#### 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

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2017年01月01日至2017年12月31日 |              | 上年度可比期间<br>2016年01月01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 |
| 华泰证券  | 352,796,018.64                | 17.30%       | 2,116,520,127.24                   | 89.46%       |

##### 7.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

##### 7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名 | 本期 |
|------|----|
|      |    |

| 称     | 2017年01月01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 |
| 华泰证券  | 324,463.61                         | 31.40%     | -          | -            |
| 关联方名称 | 上年度可比期间<br>2016年01月01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 |
| 华泰证券  | 1,951,471.06                       | 96.05%     | 233,824.10 | 74.43%       |

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。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。

#### 7.4.8.1.4 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

#### 7.4.8.1.5 债券回购交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2017年01月01日至2017年12月31日 |                | 上年度可比期间<br>2016年01月01日至2016年12月31日 |                |
|-------|-------------------------------|----------------|------------------------------------|----------------|
|       | 成交金额                          | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额                               | 占当期债券回购成交总额的比例 |
| 华泰证券  | -                             | -              | 665,200,000.00                     | 100.00%        |

#### 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<br>2017年01月01日至201 | 上年度可比期间<br>2016年01月01日至201 |
|----|-----------------------|----------------------------|
|    |                       |                            |

|                 | 7年12月31日     | 6年12月31日        |
|-----------------|--------------|-----------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 915, 112. 04 | 1, 339, 726. 70 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 258, 639. 61 | 555, 406. 32    |

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

$H = E \times \text{基金管理费率} / \text{当年天数}$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。

#### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2017年01月01日至2017<br>年12月31日 | 上年度可比期间<br>2016年01月01日至2016<br>年12月31日 |
|----------------|-----------------------------------|--|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 122, 014. 98                      | 178, 630. 24                           |

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的0.20%的年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times \text{基金托管费率} / \text{当年天数}$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。

#### 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

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

份额单位：份

| 项目 | 本期<br>2017年01月01<br>日至2017年12<br>月31日 | 上年度可比期<br>间<br>2016年01月01<br>日至2016年12<br>月31日 |
|----|---------------------------------------|--|
|    |                                       |  |



|                             |               |               |
|-----------------------------|---------------|---------------|
| 基金合同生效日（2015年09月01日）持有的基金份额 | -             | -             |
| 报告期初持有的基金份额                 | 10,004,850.00 | 10,004,850.00 |
| 报告期间申购/买入总份额                | 21,073,761.85 | -             |
| 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                 | 31,078,611.85 | 10,004,850.00 |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例         | 55.01%        | 16.95%        |

注：期间申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 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

份额单位：份

| 关联方名称 | 本期末<br>2017年12月31日 |                  | 上年度末<br>2016年12月31日 |                  |
|-------|--------------------|------------------|---------------------|------------------|
|       | 持有的基金份额            | 持有的基金份额占基金总份额的比例 | 持有的基金份额             | 持有的基金份额占基金总份额的比例 |
| 员工股东  | 69,997.82          | 0.12%            | 988.73              | 0.00%            |

#### 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

本基金本报告期末及上年度末均无由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入。

#### 7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

#### 7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期末存放于华泰期货的结算备付金金额为人民币474,953.29元。本基金本报告期通过华泰期货买卖股指期货成交额为人民币4,045,080.00元，当期发生的基金应支付给华泰期货的交易费用为人民币124.36元，本报告期末无应付华泰期货的交易费用余额。

本基金上年度末存放于华泰期货的结算备付金金额为人民币465,597.65元。本基金上年度可比期间通过华泰期货买卖股指期货成交额为人民币238,839,740.00元，当期发

生的基金应支付给华泰期货的交易费用为人民币7,422.35元,上年度末无应付华泰期货的交易费用余额。

#### 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

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 7.4.9.2 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 | 2017-12-05 | 重大事项停牌 | 37.94  | -          | -      | 29,300 | 1,073.45   | 1,111.64   | -  |
| 600686 | 金龙汽车 | 2017-12-28 | 重大事项停牌 | 13.03  | 2018-01-10 | 13.03  | 19,600 | 244,124.67 | 255,388.00 | -  |

##### 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

截至本报告期末2017年12月31日止,本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

###### 7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2017年12月31日止,本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

#### 7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 7.4.10.1 公允价值

###### 7.4.10.1.1 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括贷款和应收款项以及其他金融负债,

其因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

#### 7.4.10.1.2 以公允价值计量的金融工具

##### 7.4.10.1.2.1 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人民币53,464,304.87元，属于第二层次的余额为人民币1,367,030.00元，属于第三层次余额为人民币0.00元（于2016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人民币52,707,112.49元，属于第二层次的余额为人民币2,504,945.30元，属于第三层次余额为人民币0.00元）。

##### 7.4.10.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关股票和可转换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，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。

##### 7.4.10.1.2.3 第三层次公允价值余额和本期变动金额

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工具第三层次公允价值本期未发生变动。

#### 7.4.10.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

#### 7.4.10.3 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

#### 7.4.10.4 财务报表的批准

本财务报表已于2018年3月26日经本基金的基金管理人批准。

## § 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              | 54,831,334.87 | 88.55         |
|    | 其中：股票             | 54,831,334.87 | 88.55         |
| 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      | 7,008,068.16  | 11.32         |
| 8  | 其他各项资产            | 84,535.67     | 0.14          |
| 9  | 合计                | 61,923,938.70 | 100.00        |

## 8.2 报告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

| 代码 | 行业类别             | 公允价值（元）       | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------------------|---------------|---------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | 200,991.00    | 0.33          |
| B  | 采矿业              | 2,630,556.00  | 4.30          |
| C  | 制造业              | 33,962,408.40 | 55.49         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 2,179,739.00  | 3.56          |
| E  | 建筑业              | 398,080.00    | 0.65          |
| F  | 批发和零售业           | 4,920,224.47  | 8.04          |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 2,725,820.00  | 4.45          |
| H  | 住宿和餐饮业           | -             | -             |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 2,034,858.00  | 3.32          |
| J  | 金融业              | 688,080.00    | 1.12          |

|   |               |               |       |
|---|---------------|---------------|-------|
| K | 房地产业          | 4,030,171.00  | 6.58  |
| L | 租赁和商务服务业      | -             | -     |
| M | 科学研究和技术服务业    | 424,349.00    | 0.69  |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 496,386.00    | 0.81  |
| 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     | 139,672.00    | 0.23  |
| S | 综合            | -             | -     |
|   | 合计            | 54,831,334.87 | 89.59 |

### 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  | 600398 | 海澜之家 | 118,900 | 1,153,330.00 | 1.88         |
| 2  | 603288 | 海天味业 | 21,200  | 1,140,560.00 | 1.86         |
| 3  | 600566 | 济川药业 | 29,800  | 1,136,870.00 | 1.86         |
| 4  | 600309 | 万华化学 | 29,300  | 1,111,642.00 | 1.82         |
| 5  | 601238 | 广汽集团 | 44,700  | 1,102,302.00 | 1.80         |
| 6  | 600665 | 天地源  | 251,200 | 1,072,624.00 | 1.75         |
| 7  | 600688 | 上海石化 | 169,000 | 1,069,770.00 | 1.75         |
| 8  | 600377 | 宁沪高速 | 107,700 | 1,060,845.00 | 1.73         |
| 9  | 600297 | 广汇汽车 | 129,300 | 1,036,986.00 | 1.69         |

|    |        |      |        |              |      |
|----|--------|------|--------|--------------|------|
|    |        |      |        | 0            |      |
| 10 | 600618 | 氯碱化工 | 95,400 | 1,033,182.00 | 1.69 |

#### 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  | 600585 | 海螺水泥 | 13,638,526.89 | 22.73           |
| 2  | 601179 | 中国西电 | 13,151,220.42 | 21.92           |
| 3  | 600713 | 南京医药 | 12,975,097.11 | 21.62           |
| 4  | 600688 | 上海石化 | 11,781,725.23 | 19.64           |
| 5  | 600808 | 马钢股份 | 10,188,617.01 | 16.98           |
| 6  | 600600 | 青岛啤酒 | 9,890,610.50  | 16.48           |
| 7  | 600708 | 光明地产 | 9,151,107.67  | 15.25           |
| 8  | 600271 | 航天信息 | 8,805,139.72  | 14.67           |
| 9  | 600188 | 兖州煤业 | 8,674,424.08  | 14.46           |
| 10 | 603100 | 川仪股份 | 8,457,804.46  | 14.10           |
| 11 | 600875 | 东方电气 | 8,073,261.98  | 13.45           |
| 12 | 600466 | 蓝光发展 | 8,022,529.00  | 13.37           |
| 13 | 600823 | 世茂股份 | 8,006,041.40  | 13.34           |
| 14 | 600606 | 绿地控股 | 7,887,118.00  | 13.14           |
| 15 | 600297 | 广汇汽车 | 7,850,728.76  | 13.08           |
| 16 | 600398 | 海澜之家 | 7,650,916.71  | 12.75           |
| 17 | 600548 | 深高速  | 7,422,851.69  | 12.37           |

|    |        |      |              |       |
|----|--------|------|--------------|-------|
| 18 | 603288 | 海天味业 | 7,421,000.72 | 12.37 |
| 19 | 600998 | 九州通  | 7,259,106.25 | 12.10 |
| 20 | 603868 | 飞科电器 | 7,201,156.00 | 12.00 |
| 21 | 600894 | 广日股份 | 7,010,957.93 | 11.68 |
| 22 | 600261 | 阳光照明 | 6,853,589.80 | 11.42 |
| 23 | 600483 | 福能股份 | 6,743,411.84 | 11.24 |
| 24 | 603228 | 景旺电子 | 6,648,298.00 | 11.08 |
| 25 | 601218 | 吉鑫科技 | 6,575,634.82 | 10.96 |
| 26 | 600361 | 华联综超 | 6,538,903.93 | 10.90 |
| 27 | 600694 | 大商股份 | 6,410,169.44 | 10.68 |
| 28 | 600835 | 上海机电 | 6,252,889.60 | 10.42 |
| 29 | 600390 | 五矿资本 | 6,040,979.48 | 10.07 |
| 30 | 600096 | 云天化  | 6,019,020.00 | 10.03 |
| 31 | 601908 | 京运通  | 5,993,757.54 | 9.99  |
| 32 | 601607 | 上海医药 | 5,925,221.00 | 9.87  |
| 33 | 600019 | 宝钢股份 | 5,854,468.78 | 9.76  |
| 34 | 600299 | 安迪苏  | 5,833,131.99 | 9.72  |
| 35 | 600295 | 鄂尔多斯 | 5,807,387.01 | 9.68  |
| 36 | 600573 | 惠泉啤酒 | 5,793,513.22 | 9.66  |
| 37 | 603198 | 迎驾贡酒 | 5,684,686.06 | 9.47  |
| 38 | 601231 | 环旭电子 | 5,659,367.66 | 9.43  |
| 39 | 600362 | 江西铜业 | 5,321,774.00 | 8.87  |
| 40 | 600612 | 老凤祥  | 5,125,470.20 | 8.54  |
| 41 | 600537 | 亿晶光电 | 5,074,790.10 | 8.46  |
| 42 | 600309 | 万华化学 | 5,048,180.00 | 8.41  |
| 43 | 600757 | 长江传媒 | 4,976,038.33 | 8.29  |
| 44 | 601238 | 广汽集团 | 4,974,904.00 | 8.29  |
| 45 | 600697 | 欧亚集团 | 4,971,308.88 | 8.29  |
| 46 | 600642 | 申能股份 | 4,970,539.83 | 8.28  |
| 47 | 600418 | 江淮汽车 | 4,941,207.20 | 8.23  |
| 48 | 600691 | 阳煤化工 | 4,892,545.00 | 8.15  |

|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 49 | 600618 | 氯碱化工 | 4,802,072.87 | 8.00 |
| 50 | 603018 | 中设集团 | 4,689,558.24 | 7.82 |
| 51 | 600213 | 亚星客车 | 4,659,007.78 | 7.76 |
| 52 | 000338 | 潍柴动力 | 4,619,359.48 | 7.70 |
| 53 | 600312 | 平高电气 | 4,595,809.00 | 7.66 |
| 54 | 603188 | 亚邦股份 | 4,560,897.88 | 7.60 |
| 55 | 603025 | 大豪科技 | 4,512,666.66 | 7.52 |
| 56 | 600327 | 大东方  | 4,506,908.84 | 7.51 |
| 57 | 601579 | 会稽山  | 4,381,081.27 | 7.30 |
| 58 | 600611 | 大众交通 | 4,380,803.05 | 7.30 |
| 59 | 600566 | 济川药业 | 4,361,854.00 | 7.27 |
| 60 | 600850 | 华东电脑 | 4,338,824.49 | 7.23 |
| 61 | 600582 | 天地科技 | 4,317,158.50 | 7.19 |
| 62 | 600569 | 安阳钢铁 | 4,230,052.00 | 7.05 |
| 63 | 600183 | 生益科技 | 4,195,484.70 | 6.99 |
| 64 | 600273 | 嘉化能源 | 4,193,409.50 | 6.99 |
| 65 | 600444 | 国机通用 | 4,172,852.34 | 6.95 |
| 66 | 600675 | 中华企业 | 4,133,120.48 | 6.89 |
| 67 | 600308 | 华泰股份 | 4,098,519.41 | 6.83 |
| 68 | 000625 | 长安汽车 | 4,085,629.12 | 6.81 |
| 69 | 600845 | 宝信软件 | 4,064,847.47 | 6.77 |
| 70 | 600513 | 联环药业 | 4,064,070.04 | 6.77 |
| 71 | 600282 | 南钢股份 | 4,043,094.00 | 6.74 |
| 72 | 600746 | 江苏索普 | 4,033,514.10 | 6.72 |
| 73 | 600377 | 宁沪高速 | 3,987,193.00 | 6.64 |
| 74 | 600216 | 浙江医药 | 3,956,970.59 | 6.59 |
| 75 | 600775 | 南京熊猫 | 3,909,034.00 | 6.51 |
| 76 | 603806 | 福斯特  | 3,884,260.43 | 6.47 |
| 77 | 600268 | 国电南自 | 3,836,260.00 | 6.39 |
| 78 | 600615 | 丰华股份 | 3,818,112.56 | 6.36 |
| 79 | 600350 | 山东高速 | 3,761,840.10 | 6.27 |



|     |        |      |              |      |
|-----|--------|------|--------------|------|
| 80  | 600623 | 华谊集团 | 3,755,115.00 | 6.26 |
| 81  | 600359 | 新农开发 | 3,676,384.22 | 6.13 |
| 82  | 600218 | 全柴动力 | 3,660,768.87 | 6.10 |
| 83  | 601339 | 百隆东方 | 3,635,421.34 | 6.06 |
| 84  | 600721 | 百花村  | 3,632,507.00 | 6.05 |
| 85  | 600839 | 四川长虹 | 3,585,301.88 | 5.98 |
| 86  | 600475 | 华光股份 | 3,567,942.35 | 5.95 |
| 87  | 600801 | 华新水泥 | 3,464,689.36 | 5.77 |
| 88  | 600419 | 天润乳业 | 3,441,314.35 | 5.74 |
| 89  | 601877 | 正泰电器 | 3,415,605.00 | 5.69 |
| 90  | 600723 | 首商股份 | 3,410,598.39 | 5.68 |
| 91  | 600664 | 哈药股份 | 3,376,430.00 | 5.63 |
| 92  | 600983 | 惠而浦  | 3,297,044.82 | 5.49 |
| 93  | 000422 | 湖北宜化 | 3,295,669.00 | 5.49 |
| 94  | 600422 | 昆药集团 | 3,284,894.84 | 5.47 |
| 95  | 600567 | 山鹰纸业 | 3,262,970.00 | 5.44 |
| 96  | 000869 | 张裕A  | 3,221,697.34 | 5.37 |
| 97  | 600602 | 云赛智联 | 3,140,134.26 | 5.23 |
| 98  | 600978 | 宜华生活 | 3,125,889.06 | 5.21 |
| 99  | 600805 | 悦达投资 | 3,109,296.74 | 5.18 |
| 100 | 600667 | 太极实业 | 3,069,482.00 | 5.12 |
| 101 | 603858 | 步长制药 | 3,067,252.00 | 5.11 |
| 102 | 600026 | 中远海能 | 3,047,404.00 | 5.08 |
| 103 | 600961 | 株冶集团 | 3,034,100.91 | 5.06 |
| 104 | 603828 | 柯利达  | 3,030,692.60 | 5.05 |
| 105 | 600651 | 飞乐音响 | 3,023,845.00 | 5.04 |
| 106 | 600665 | 天地源  | 3,015,437.00 | 5.03 |
| 107 | 600356 | 恒丰纸业 | 2,997,005.56 | 4.99 |
| 108 | 603556 | 海兴电力 | 2,992,043.00 | 4.99 |
| 109 | 600819 | 耀皮玻璃 | 2,951,348.47 | 4.92 |
| 110 | 603989 | 艾华集团 | 2,939,140.00 | 4.90 |

|     |                      |                 |              |      |
|-----|----------------------|-----------------|--------------|------|
| 111 | 601313 (现代码: 601360) | 江南嘉捷 (现名称: 三六零) | 2,932,349.82 | 4.89 |
| 112 | 601636               | 旗滨集团            | 2,888,510.00 | 4.81 |
| 113 | 603677               | 奇精机械            | 2,872,024.00 | 4.79 |
| 114 | 002083               | 孚日股份            | 2,802,111.00 | 4.67 |
| 115 | 600409               | 三友化工            | 2,792,149.00 | 4.65 |
| 116 | 600561               | 江西长运            | 2,779,531.48 | 4.63 |
| 117 | 600827               | 百联股份            | 2,751,062.57 | 4.58 |
| 118 | 600889               | 南京化纤            | 2,739,470.00 | 4.57 |
| 119 | 600067               | 冠城大通            | 2,730,781.00 | 4.55 |
| 120 | 600580               | 卧龙电气            | 2,723,852.34 | 4.54 |
| 121 | 601919               | 中远海控            | 2,683,960.16 | 4.47 |
| 122 | 603015               | 弘讯科技            | 2,671,976.10 | 4.45 |
| 123 | 600060               | 海信电器            | 2,669,291.90 | 4.45 |
| 124 | 300305               | 裕兴股份            | 2,660,617.67 | 4.43 |
| 125 | 600339               | 中油工程            | 2,646,878.99 | 4.41 |
| 126 | 600073               | 上海梅林            | 2,630,730.12 | 4.38 |
| 127 | 601677               | 明泰铝业            | 2,584,150.00 | 4.31 |
| 128 | 600408               | 安泰集团            | 2,580,729.00 | 4.30 |
| 129 | 000902               | 新洋丰             | 2,571,385.52 | 4.29 |
| 130 | 600804               | 鹏博士             | 2,542,023.44 | 4.24 |
| 131 | 603421               | 鼎信通讯            | 2,514,856.00 | 4.19 |
| 132 | 600210               | 紫江企业            | 2,506,108.00 | 4.18 |
| 133 | 000031               | 中粮地产            | 2,502,621.00 | 4.17 |
| 134 | 002666               | 德联集团            | 2,466,683.92 | 4.11 |
| 135 | 600704               | 物产中大            | 2,464,606.05 | 4.11 |
| 136 | 603979               | 金诚信             | 2,452,551.00 | 4.09 |
| 137 | 000039               | 中集集团            | 2,448,704.00 | 4.08 |
| 138 | 600681               | 百川能源            | 2,423,628.81 | 4.04 |
| 139 | 000666               | 经纬纺机            | 2,411,799.00 | 4.02 |
| 140 | 600810               | 神马股份            | 2,408,734.64 | 4.01 |

|     |        |      |              |      |
|-----|--------|------|--------------|------|
| 141 | 300171 | 东富龙  | 2,362,477.00 | 3.94 |
| 142 | 601225 | 陕西煤业 | 2,356,641.82 | 3.93 |
| 143 | 601233 | 桐昆股份 | 2,354,676.80 | 3.92 |
| 144 | 000521 | 美菱电器 | 2,277,288.21 | 3.80 |
| 145 | 600973 | 宝胜股份 | 2,262,291.46 | 3.77 |
| 146 | 600166 | 福田汽车 | 2,210,459.00 | 3.68 |
| 147 | 603600 | 永艺股份 | 2,200,897.50 | 3.67 |
| 148 | 002309 | 中利集团 | 2,197,668.48 | 3.66 |
| 149 | 600376 | 首开股份 | 2,196,218.96 | 3.66 |
| 150 | 300214 | 日科化学 | 2,191,202.00 | 3.65 |
| 151 | 000404 | 华意压缩 | 2,179,432.26 | 3.63 |
| 152 | 000729 | 燕京啤酒 | 2,177,742.00 | 3.63 |
| 153 | 600129 | 太极集团 | 2,175,967.70 | 3.63 |
| 154 | 601038 | 一拖股份 | 2,129,730.00 | 3.55 |
| 155 | 002420 | 毅昌股份 | 2,126,885.00 | 3.54 |
| 156 | 600420 | 现代制药 | 2,119,970.00 | 3.53 |
| 157 | 600320 | 振华重工 | 2,106,942.00 | 3.51 |
| 158 | 600597 | 光明乳业 | 2,092,757.00 | 3.49 |
| 159 | 600563 | 法拉电子 | 2,092,208.96 | 3.49 |
| 160 | 600587 | 新华医疗 | 2,088,063.00 | 3.48 |
| 161 | 601567 | 三星医疗 | 2,080,590.00 | 3.47 |
| 162 | 601628 | 中国人寿 | 2,063,503.00 | 3.44 |
| 163 | 600269 | 赣粤高速 | 2,046,409.80 | 3.41 |
| 164 | 600761 | 安徽合力 | 2,015,040.66 | 3.36 |
| 165 | 000488 | 晨鸣纸业 | 2,013,613.00 | 3.36 |
| 166 | 600782 | 新钢股份 | 1,978,127.00 | 3.30 |
| 167 | 601137 | 博威合金 | 1,961,270.00 | 3.27 |
| 168 | 002004 | 华邦健康 | 1,941,686.70 | 3.24 |
| 169 | 300146 | 汤臣倍健 | 1,929,655.00 | 3.22 |
| 170 | 000708 | 大冶特钢 | 1,927,284.75 | 3.21 |
| 171 | 601616 | 广电电气 | 1,924,161.00 | 3.21 |

|     |        |      |              |      |
|-----|--------|------|--------------|------|
| 172 | 603167 | 渤海轮渡 | 1,922,788.00 | 3.20 |
| 173 | 002394 | 联发股份 | 1,910,639.00 | 3.18 |
| 174 | 002540 | 亚太科技 | 1,903,614.80 | 3.17 |
| 175 | 002398 | 建研集团 | 1,895,554.28 | 3.16 |
| 176 | 002009 | 天奇股份 | 1,892,086.13 | 3.15 |
| 177 | 600676 | 交运股份 | 1,877,888.68 | 3.13 |
| 178 | 600335 | 国机汽车 | 1,877,888.20 | 3.13 |
| 179 | 000701 | 厦门信达 | 1,873,623.53 | 3.12 |
| 180 | 000550 | 江铃汽车 | 1,872,737.00 | 3.12 |
| 181 | 603020 | 爱普股份 | 1,857,976.03 | 3.10 |
| 182 | 601258 | 庞大集团 | 1,835,965.00 | 3.06 |
| 183 | 601899 | 紫金矿业 | 1,832,370.00 | 3.05 |
| 184 | 600586 | 金晶科技 | 1,832,228.00 | 3.05 |
| 185 | 603369 | 今世缘  | 1,827,390.84 | 3.05 |
| 186 | 002458 | 益生股份 | 1,817,479.00 | 3.03 |
| 187 | 600333 | 长春燃气 | 1,773,775.17 | 2.96 |
| 188 | 600707 | 彩虹股份 | 1,770,175.86 | 2.95 |
| 189 | 603328 | 依顿电子 | 1,730,498.46 | 2.88 |
| 190 | 601211 | 国泰君安 | 1,684,734.00 | 2.81 |
| 191 | 600082 | 海泰发展 | 1,683,766.69 | 2.81 |
| 192 | 600090 | 同济堂  | 1,681,731.00 | 2.80 |
| 193 | 600601 | 方正科技 | 1,673,460.42 | 2.79 |
| 194 | 603599 | 广信股份 | 1,670,183.00 | 2.78 |
| 195 | 600151 | 航天机电 | 1,657,710.00 | 2.76 |
| 196 | 600517 | 置信电气 | 1,647,974.00 | 2.75 |
| 197 | 603899 | 晨光文具 | 1,643,274.54 | 2.74 |
| 198 | 000570 | 苏常柴A | 1,635,650.00 | 2.73 |
| 199 | 000543 | 皖能电力 | 1,613,652.00 | 2.69 |
| 200 | 600238 | 海南椰岛 | 1,607,136.00 | 2.68 |
| 201 | 601208 | 东材科技 | 1,594,041.50 | 2.66 |
| 202 | 603658 | 安图生物 | 1,580,913.47 | 2.63 |

|     |        |       |              |      |
|-----|--------|-------|--------------|------|
| 203 | 603160 | 汇顶科技  | 1,578,779.00 | 2.63 |
| 204 | 600506 | 香梨股份  | 1,575,758.00 | 2.63 |
| 205 | 600519 | 贵州茅台  | 1,567,259.00 | 2.61 |
| 206 | 600751 | 天海投资  | 1,558,717.00 | 2.60 |
| 207 | 601727 | 上海电气  | 1,550,561.00 | 2.58 |
| 208 | 601898 | 中煤能源  | 1,528,648.00 | 2.55 |
| 209 | 603031 | 安德利   | 1,524,143.00 | 2.54 |
| 210 | 603993 | 洛阳钼业  | 1,518,362.00 | 2.53 |
| 211 | 000055 | 方大集团  | 1,514,914.00 | 2.52 |
| 212 | 002026 | 山东威达  | 1,512,802.05 | 2.52 |
| 213 | 000665 | 湖北广电  | 1,502,462.40 | 2.50 |
| 214 | 002104 | 恒宝股份  | 1,492,175.00 | 2.49 |
| 215 | 000429 | 粤高速 A | 1,486,662.40 | 2.48 |
| 216 | 603738 | 泰晶科技  | 1,477,332.70 | 2.46 |
| 217 | 000876 | 新希望   | 1,475,572.00 | 2.46 |
| 218 | 600768 | 宁波富邦  | 1,469,430.00 | 2.45 |
| 219 | 002541 | 鸿路钢构  | 1,458,594.02 | 2.43 |
| 220 | 002152 | 广电运通  | 1,447,222.00 | 2.41 |
| 221 | 601010 | 文峰股份  | 1,446,614.00 | 2.41 |
| 222 | 600755 | 厦门国贸  | 1,444,126.00 | 2.41 |
| 223 | 000023 | 深天地 A | 1,437,874.00 | 2.40 |
| 224 | 600796 | 钱江生化  | 1,436,668.00 | 2.39 |
| 225 | 600997 | 开滦股份  | 1,430,583.86 | 2.38 |
| 226 | 600237 | 铜峰电子  | 1,426,178.00 | 2.38 |
| 227 | 000726 | 鲁泰 A  | 1,419,950.00 | 2.37 |
| 228 | 600438 | 通威股份  | 1,405,575.60 | 2.34 |
| 229 | 600089 | 特变电工  | 1,405,461.39 | 2.34 |
| 230 | 000036 | 华联控股  | 1,403,706.03 | 2.34 |
| 231 | 600470 | 六国化工  | 1,398,841.00 | 2.33 |
| 232 | 000908 | 景峰医药  | 1,382,858.82 | 2.30 |
| 233 | 300195 | 长荣股份  | 1,371,236.00 | 2.29 |

|     |        |      |              |      |
|-----|--------|------|--------------|------|
| 234 | 601318 | 中国平安 | 1,361,731.00 | 2.27 |
| 235 | 300154 | 瑞凌股份 | 1,361,676.77 | 2.27 |
| 236 | 600306 | 商业城  | 1,356,565.66 | 2.26 |
| 237 | 000957 | 中通客车 | 1,348,104.00 | 2.25 |
| 238 | 601186 | 中国铁建 | 1,326,925.99 | 2.21 |
| 239 | 600742 | 一汽富维 | 1,324,551.00 | 2.21 |
| 240 | 600068 | 葛洲坝  | 1,310,728.52 | 2.18 |
| 241 | 600516 | 方大炭素 | 1,308,303.59 | 2.18 |
| 242 | 300157 | 恒泰艾普 | 1,303,207.00 | 2.17 |
| 243 | 002416 | 爱施德  | 1,299,098.50 | 2.17 |
| 244 | 000835 | 长城动漫 | 1,295,299.14 | 2.16 |
| 245 | 601800 | 中国交建 | 1,290,073.00 | 2.15 |
| 246 | 600057 | 象屿股份 | 1,283,247.00 | 2.14 |
| 247 | 002005 | 德豪润达 | 1,266,518.00 | 2.11 |
| 248 | 600340 | 华夏幸福 | 1,265,706.00 | 2.11 |
| 249 | 600741 | 华域汽车 | 1,262,342.42 | 2.10 |
| 250 | 600776 | 东方通信 | 1,260,244.00 | 2.10 |
| 251 | 000919 | 金陵药业 | 1,250,286.00 | 2.08 |
| 252 | 601222 | 林洋能源 | 1,242,392.00 | 2.07 |
| 253 | 600487 | 亨通光电 | 1,233,992.00 | 2.06 |
| 254 | 600686 | 金龙汽车 | 1,225,044.00 | 2.04 |
| 255 | 002234 | 民和股份 | 1,220,636.00 | 2.03 |
| 256 | 000761 | 本钢板材 | 1,216,440.83 | 2.03 |
| 257 | 002727 | 一心堂  | 1,215,484.00 | 2.03 |
| 258 | 600132 | 重庆啤酒 | 1,214,706.00 | 2.02 |
| 259 | 600527 | 江南高纤 | 1,202,228.00 | 2.00 |

注：买入金额按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计卖出 | 占期初基金资 |
|----|------|------|--------|--------|
|----|------|------|--------|--------|

|    |        |      | 金额            | 产净值比例<br>(%) |
|----|--------|------|---------------|--------------|
| 1  | 600585 | 海螺水泥 | 14,056,742.03 | 23.43        |
| 2  | 600713 | 南京医药 | 13,245,396.28 | 22.07        |
| 3  | 601179 | 中国西电 | 12,365,601.17 | 20.61        |
| 4  | 600688 | 上海石化 | 10,857,134.54 | 18.09        |
| 5  | 600600 | 青岛啤酒 | 10,528,508.79 | 17.55        |
| 6  | 600808 | 马钢股份 | 9,259,916.90  | 15.43        |
| 7  | 600708 | 光明地产 | 8,844,040.95  | 14.74        |
| 8  | 600271 | 航天信息 | 8,799,369.60  | 14.66        |
| 9  | 600875 | 东方电气 | 8,343,224.98  | 13.90        |
| 10 | 600823 | 世茂股份 | 8,296,751.78  | 13.83        |
| 11 | 600466 | 蓝光发展 | 8,148,229.58  | 13.58        |
| 12 | 600188 | 兖州煤业 | 7,977,565.97  | 13.30        |
| 13 | 603100 | 川仪股份 | 7,958,567.64  | 13.26        |
| 14 | 600295 | 鄂尔多斯 | 7,717,935.98  | 12.86        |
| 15 | 600297 | 广汇汽车 | 7,410,034.30  | 12.35        |
| 16 | 600894 | 广日股份 | 7,403,473.89  | 12.34        |
| 17 | 600548 | 深高速  | 7,211,686.16  | 12.02        |
| 18 | 600835 | 上海机电 | 7,186,497.37  | 11.98        |
| 19 | 600694 | 大商股份 | 7,173,399.28  | 11.96        |
| 20 | 600606 | 绿地控股 | 7,171,188.00  | 11.95        |
| 21 | 600261 | 阳光照明 | 7,089,635.17  | 11.82        |
| 22 | 600998 | 九州通  | 6,999,233.74  | 11.66        |
| 23 | 600483 | 福能股份 | 6,973,970.16  | 11.62        |
| 24 | 601607 | 上海医药 | 6,653,754.76  | 11.09        |

|    |        |      |              |       |
|----|--------|------|--------------|-------|
| 25 | 603868 | 飞科电器 | 6,614,315.26 | 11.02 |
| 26 | 600361 | 华联综超 | 6,583,167.96 | 10.97 |
| 27 | 601218 | 吉鑫科技 | 6,555,075.22 | 10.92 |
| 28 | 600398 | 海澜之家 | 6,442,910.00 | 10.74 |
| 29 | 603288 | 海天味业 | 6,440,306.00 | 10.73 |
| 30 | 601908 | 京运通  | 6,272,500.20 | 10.45 |
| 31 | 603228 | 景旺电子 | 6,033,900.00 | 10.06 |
| 32 | 600096 | 云天化  | 6,010,884.84 | 10.02 |
| 33 | 600390 | 五矿资本 | 5,852,227.60 | 9.75  |
| 34 | 603198 | 迎驾贡酒 | 5,751,525.02 | 9.59  |
| 35 | 600299 | 安迪苏  | 5,745,614.90 | 9.58  |
| 36 | 601231 | 环旭电子 | 5,742,482.00 | 9.57  |
| 37 | 600019 | 宝钢股份 | 5,702,028.40 | 9.50  |
| 38 | 600362 | 江西铜业 | 5,486,742.00 | 9.14  |
| 39 | 600697 | 欧亚集团 | 5,421,052.22 | 9.03  |
| 40 | 600537 | 亿晶光电 | 5,331,137.00 | 8.88  |
| 41 | 603188 | 亚邦股份 | 5,290,415.89 | 8.82  |
| 42 | 600418 | 江淮汽车 | 5,289,257.89 | 8.81  |
| 43 | 000338 | 潍柴动力 | 5,226,734.20 | 8.71  |
| 44 | 600573 | 惠泉啤酒 | 5,221,221.65 | 8.70  |
| 45 | 600691 | 阳煤化工 | 5,177,396.03 | 8.63  |
| 46 | 600757 | 长江传媒 | 5,124,816.80 | 8.54  |
| 47 | 600327 | 大东方  | 5,031,534.86 | 8.39  |
| 48 | 600642 | 申能股份 | 5,030,243.31 | 8.38  |
| 49 | 600612 | 老凤祥  | 5,020,337.85 | 8.37  |
| 50 | 603018 | 中设集团 | 4,716,505.51 | 7.86  |
| 51 | 600213 | 亚星客车 | 4,644,945.44 | 7.74  |
| 52 | 600569 | 安阳钢铁 | 4,629,589.00 | 7.72  |
| 53 | 600850 | 华东电脑 | 4,587,951.60 | 7.65  |
| 54 | 600273 | 嘉化能源 | 4,555,529.36 | 7.59  |
| 55 | 600308 | 华泰股份 | 4,488,363.72 | 7.48  |



|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 56 | 600312 | 平高电气 | 4,441,862.00 | 7.40 |
| 57 | 600183 | 生益科技 | 4,399,946.42 | 7.33 |
| 58 | 601579 | 会稽山  | 4,370,202.45 | 7.28 |
| 59 | 600444 | 国机通用 | 4,356,948.38 | 7.26 |
| 60 | 600746 | 江苏索普 | 4,349,445.89 | 7.25 |
| 61 | 600582 | 天地科技 | 4,330,541.00 | 7.22 |
| 62 | 600611 | 大众交通 | 4,232,917.50 | 7.05 |
| 63 | 600309 | 万华化学 | 4,208,683.00 | 7.01 |
| 64 | 600845 | 宝信软件 | 4,196,284.48 | 6.99 |
| 65 | 600801 | 华新水泥 | 4,102,111.20 | 6.84 |
| 66 | 600216 | 浙江医药 | 4,082,200.85 | 6.80 |
| 67 | 600675 | 中华企业 | 4,053,954.80 | 6.76 |
| 68 | 600218 | 全柴动力 | 4,027,903.60 | 6.71 |
| 69 | 600723 | 首商股份 | 4,025,829.26 | 6.71 |
| 70 | 603025 | 大豪科技 | 3,969,946.00 | 6.62 |
| 71 | 601339 | 百隆东方 | 3,955,788.06 | 6.59 |
| 72 | 000625 | 长安汽车 | 3,911,970.98 | 6.52 |
| 73 | 600268 | 国电南自 | 3,862,564.68 | 6.44 |
| 74 | 600623 | 华谊集团 | 3,843,498.00 | 6.41 |
| 75 | 601238 | 广汽集团 | 3,823,941.00 | 6.37 |
| 76 | 603806 | 福斯特  | 3,817,609.86 | 6.36 |
| 77 | 600350 | 山东高速 | 3,796,947.80 | 6.33 |
| 78 | 600359 | 新农开发 | 3,778,959.00 | 6.30 |
| 79 | 600618 | 氯碱化工 | 3,768,782.51 | 6.28 |
| 80 | 600026 | 中远海能 | 3,737,001.84 | 6.23 |
| 81 | 601877 | 正泰电器 | 3,688,568.84 | 6.15 |
| 82 | 600615 | 丰华股份 | 3,660,770.00 | 6.10 |
| 83 | 600805 | 悦达投资 | 3,656,486.85 | 6.09 |
| 84 | 600721 | 百花村  | 3,627,202.05 | 6.05 |
| 85 | 600839 | 四川长虹 | 3,624,213.00 | 6.04 |
| 86 | 600475 | 华光股份 | 3,618,690.08 | 6.03 |

|     |                      |                 |              |      |
|-----|----------------------|-----------------|--------------|------|
| 87  | 600513               | 联环药业            | 3,584,896.20 | 5.97 |
| 88  | 600664               | 哈药股份            | 3,471,268.26 | 5.79 |
| 89  | 601313 (现代码: 601360) | 江南嘉捷 (现名称: 三六零) | 3,460,057.94 | 5.77 |
| 90  | 600775               | 南京熊猫            | 3,447,672.00 | 5.75 |
| 91  | 600419               | 天润乳业            | 3,400,580.09 | 5.67 |
| 92  | 600282               | 南钢股份            | 3,307,226.58 | 5.51 |
| 93  | 600602               | 云赛智联            | 3,295,872.59 | 5.49 |
| 94  | 600422               | 昆药集团            | 3,281,523.70 | 5.47 |
| 95  | 600067               | 冠城大通            | 3,277,264.00 | 5.46 |
| 96  | 000869               | 张裕A             | 3,261,305.47 | 5.44 |
| 97  | 600983               | 惠而浦             | 3,249,712.97 | 5.42 |
| 98  | 601677               | 明泰铝业            | 3,236,667.00 | 5.39 |
| 99  | 600651               | 飞乐音响            | 3,215,901.00 | 5.36 |
| 100 | 600667               | 太极实业            | 3,209,547.00 | 5.35 |
| 101 | 601636               | 旗滨集团            | 3,203,807.37 | 5.34 |
| 102 | 600566               | 济川药业            | 3,121,026.28 | 5.20 |
| 103 | 002083               | 孚日股份            | 3,111,915.68 | 5.19 |
| 104 | 600356               | 恒丰纸业            | 3,104,338.14 | 5.17 |
| 105 | 000422               | 湖北宜化            | 3,091,809.00 | 5.15 |
| 106 | 600978               | 宜华生活            | 3,068,772.29 | 5.11 |
| 107 | 600567               | 山鹰纸业            | 3,061,772.00 | 5.10 |
| 108 | 603828               | 柯利达             | 3,035,041.50 | 5.06 |
| 109 | 600210               | 紫江企业            | 3,024,946.00 | 5.04 |
| 110 | 603989               | 艾华集团            | 2,999,789.00 | 5.00 |
| 111 | 000666               | 经纬纺机            | 2,984,517.53 | 4.97 |
| 112 | 600961               | 株冶集团            | 2,960,524.00 | 4.93 |
| 113 | 600377               | 宁沪高速            | 2,930,894.00 | 4.88 |
| 114 | 600060               | 海信电器            | 2,914,896.16 | 4.86 |
| 115 | 000521               | 美菱电器            | 2,876,119.52 | 4.79 |
| 116 | 603677               | 奇精机械            | 2,782,292.56 | 4.64 |

|     |        |      |              |      |
|-----|--------|------|--------------|------|
| 117 | 600580 | 卧龙电气 | 2,779,388.38 | 4.63 |
| 118 | 600889 | 南京化纤 | 2,730,610.02 | 4.55 |
| 119 | 000404 | 华意压缩 | 2,723,540.84 | 4.54 |
| 120 | 600804 | 鹏博士  | 2,718,010.00 | 4.53 |
| 121 | 600129 | 太极集团 | 2,708,896.00 | 4.51 |
| 122 | 600073 | 上海梅林 | 2,695,731.36 | 4.49 |
| 123 | 603858 | 步长制药 | 2,692,150.00 | 4.49 |
| 124 | 002666 | 德联集团 | 2,690,141.47 | 4.48 |
| 125 | 002309 | 中利集团 | 2,677,518.56 | 4.46 |
| 126 | 600561 | 江西长运 | 2,641,102.66 | 4.40 |
| 127 | 300171 | 东富龙  | 2,640,842.07 | 4.40 |
| 128 | 300305 | 裕兴股份 | 2,622,764.06 | 4.37 |
| 129 | 000031 | 中粮地产 | 2,568,793.00 | 4.28 |
| 130 | 600335 | 国机汽车 | 2,553,633.01 | 4.26 |
| 131 | 603979 | 金诚信  | 2,545,772.50 | 4.24 |
| 132 | 000902 | 新洋丰  | 2,545,546.00 | 4.24 |
| 133 | 600761 | 安徽合力 | 2,521,836.45 | 4.20 |
| 134 | 600973 | 宝胜股份 | 2,511,226.92 | 4.19 |
| 135 | 600810 | 神马股份 | 2,492,207.00 | 4.15 |
| 136 | 600819 | 耀皮玻璃 | 2,467,499.00 | 4.11 |
| 137 | 600408 | 安泰集团 | 2,454,884.98 | 4.09 |
| 138 | 000039 | 中集集团 | 2,454,529.00 | 4.09 |
| 139 | 601233 | 桐昆股份 | 2,406,331.12 | 4.01 |
| 140 | 601919 | 中远海控 | 2,402,555.00 | 4.00 |
| 141 | 600827 | 百联股份 | 2,361,813.00 | 3.94 |
| 142 | 300214 | 日科化学 | 2,353,748.74 | 3.92 |
| 143 | 603167 | 渤海轮渡 | 2,348,441.00 | 3.91 |
| 144 | 000550 | 江铃汽车 | 2,283,977.00 | 3.81 |
| 145 | 600704 | 物产中大 | 2,229,341.90 | 3.72 |
| 146 | 600166 | 福田汽车 | 2,219,641.00 | 3.70 |
| 147 | 603015 | 弘讯科技 | 2,205,622.00 | 3.68 |

|     |        |      |              |      |
|-----|--------|------|--------------|------|
| 148 | 000708 | 大冶特钢 | 2,201,190.18 | 3.67 |
| 149 | 600587 | 新华医疗 | 2,194,282.00 | 3.66 |
| 150 | 603556 | 海兴电力 | 2,183,919.00 | 3.64 |
| 151 | 603020 | 爱普股份 | 2,183,179.00 | 3.64 |
| 152 | 002394 | 联发股份 | 2,182,973.11 | 3.64 |
| 153 | 000729 | 燕京啤酒 | 2,178,234.00 | 3.63 |
| 154 | 601038 | 一拖股份 | 2,171,424.25 | 3.62 |
| 155 | 600320 | 振华重工 | 2,153,836.00 | 3.59 |
| 156 | 300146 | 汤臣倍健 | 2,150,747.04 | 3.58 |
| 157 | 603600 | 永艺股份 | 2,137,857.18 | 3.56 |
| 158 | 002009 | 天奇股份 | 2,133,126.00 | 3.56 |
| 159 | 002420 | 毅昌股份 | 2,103,075.00 | 3.50 |
| 160 | 600563 | 法拉电子 | 2,086,589.00 | 3.48 |
| 161 | 600269 | 赣粤高速 | 2,078,174.64 | 3.46 |
| 162 | 002458 | 益生股份 | 2,074,793.60 | 3.46 |
| 163 | 600597 | 光明乳业 | 2,074,634.29 | 3.46 |
| 164 | 601567 | 三星医疗 | 2,053,970.00 | 3.42 |
| 165 | 603599 | 广信股份 | 2,032,635.12 | 3.39 |
| 166 | 000726 | 鲁泰A  | 2,024,094.80 | 3.37 |
| 167 | 601137 | 博威合金 | 2,010,566.16 | 3.35 |
| 168 | 600782 | 新钢股份 | 1,983,071.00 | 3.30 |
| 169 | 000488 | 晨鸣纸业 | 1,978,184.00 | 3.30 |
| 170 | 600741 | 华域汽车 | 1,957,577.65 | 3.26 |
| 171 | 002104 | 恒宝股份 | 1,955,993.05 | 3.26 |
| 172 | 002398 | 建研集团 | 1,951,627.00 | 3.25 |
| 173 | 601616 | 广电电气 | 1,946,082.00 | 3.24 |
| 174 | 002004 | 华邦健康 | 1,944,925.47 | 3.24 |
| 175 | 600665 | 天地源  | 1,941,521.56 | 3.24 |
| 176 | 002540 | 亚太科技 | 1,928,052.20 | 3.21 |
| 177 | 600420 | 现代制药 | 1,913,217.80 | 3.19 |
| 178 | 603369 | 今世缘  | 1,909,990.86 | 3.18 |

|     |        |      |              |      |
|-----|--------|------|--------------|------|
| 179 | 600376 | 首开股份 | 1,907,150.25 | 3.18 |
| 180 | 600409 | 三友化工 | 1,894,989.25 | 3.16 |
| 181 | 601258 | 庞大集团 | 1,892,365.00 | 3.15 |
| 182 | 601628 | 中国人寿 | 1,875,965.00 | 3.13 |
| 183 | 600676 | 交运股份 | 1,865,393.00 | 3.11 |
| 184 | 601208 | 东材科技 | 1,864,972.99 | 3.11 |
| 185 | 600755 | 厦门国贸 | 1,859,464.00 | 3.10 |
| 186 | 000701 | 厦门信达 | 1,858,483.92 | 3.10 |
| 187 | 601899 | 紫金矿业 | 1,833,235.00 | 3.06 |
| 188 | 000665 | 湖北广电 | 1,801,802.60 | 3.00 |
| 189 | 600586 | 金晶科技 | 1,791,580.00 | 2.99 |
| 190 | 600333 | 长春燃气 | 1,776,570.00 | 2.96 |
| 191 | 600339 | 中油工程 | 1,759,862.07 | 2.93 |
| 192 | 000908 | 景峰医药 | 1,741,709.68 | 2.90 |
| 193 | 600997 | 开滦股份 | 1,731,574.46 | 2.89 |
| 194 | 600681 | 百川能源 | 1,705,314.20 | 2.84 |
| 195 | 000036 | 华联控股 | 1,696,645.37 | 2.83 |
| 196 | 603993 | 洛阳钼业 | 1,691,192.00 | 2.82 |
| 197 | 002026 | 山东威达 | 1,683,183.68 | 2.81 |
| 198 | 601211 | 国泰君安 | 1,681,862.00 | 2.80 |
| 199 | 600601 | 方正科技 | 1,680,276.00 | 2.80 |
| 200 | 600707 | 彩虹股份 | 1,680,219.00 | 2.80 |
| 201 | 600151 | 航天机电 | 1,671,320.91 | 2.79 |
| 202 | 600090 | 同济堂  | 1,669,699.00 | 2.78 |
| 203 | 600082 | 海泰发展 | 1,653,689.65 | 2.76 |
| 204 | 600238 | 海南椰岛 | 1,634,516.00 | 2.72 |
| 205 | 603899 | 晨光文具 | 1,616,103.06 | 2.69 |
| 206 | 600519 | 贵州茅台 | 1,610,263.00 | 2.68 |
| 207 | 601225 | 陕西煤业 | 1,599,536.00 | 2.67 |
| 208 | 000570 | 苏常柴A | 1,598,099.30 | 2.66 |
| 209 | 603658 | 安图生物 | 1,590,885.53 | 2.65 |

|     |        |       |              |      |
|-----|--------|-------|--------------|------|
| 210 | 000543 | 皖能电力  | 1,590,233.00 | 2.65 |
| 211 | 603160 | 汇顶科技  | 1,585,666.00 | 2.64 |
| 212 | 000429 | 粤高速 A | 1,572,306.62 | 2.62 |
| 213 | 600517 | 置信电气  | 1,559,446.00 | 2.60 |
| 214 | 000600 | 建投能源  | 1,553,817.00 | 2.59 |
| 215 | 603328 | 依顿电子  | 1,549,813.65 | 2.58 |
| 216 | 600751 | 天海投资  | 1,536,382.00 | 2.56 |
| 217 | 002641 | 永高股份  | 1,534,479.66 | 2.56 |
| 218 | 600506 | 香梨股份  | 1,505,794.38 | 2.51 |
| 219 | 000876 | 新希望   | 1,488,701.47 | 2.48 |
| 220 | 601898 | 中煤能源  | 1,485,043.00 | 2.47 |
| 221 | 002541 | 鸿路钢构  | 1,480,412.09 | 2.47 |
| 222 | 000650 | 仁和药业  | 1,477,932.00 | 2.46 |
| 223 | 601010 | 文峰股份  | 1,472,472.00 | 2.45 |
| 224 | 002727 | 一心堂   | 1,460,734.00 | 2.43 |
| 225 | 002152 | 广电运通  | 1,456,534.80 | 2.43 |
| 226 | 600796 | 钱江生化  | 1,449,852.00 | 2.42 |
| 227 | 000957 | 中通客车  | 1,428,708.00 | 2.38 |
| 228 | 300195 | 长荣股份  | 1,419,018.00 | 2.36 |
| 229 | 600438 | 通威股份  | 1,403,008.22 | 2.34 |
| 230 | 600487 | 亨通光电  | 1,390,266.00 | 2.32 |
| 231 | 600089 | 特变电工  | 1,389,726.00 | 2.32 |
| 232 | 601318 | 中国平安  | 1,379,489.00 | 2.30 |
| 233 | 002234 | 民和股份  | 1,366,713.12 | 2.28 |
| 234 | 603421 | 鼎信通讯  | 1,355,542.00 | 2.26 |
| 235 | 000023 | 深天地 A | 1,338,954.00 | 2.23 |
| 236 | 601186 | 中国铁建  | 1,325,425.00 | 2.21 |
| 237 | 000055 | 方大集团  | 1,322,338.96 | 2.20 |
| 238 | 600068 | 葛洲坝   | 1,321,034.00 | 2.20 |
| 239 | 300154 | 瑞凌股份  | 1,320,288.74 | 2.20 |
| 240 | 300157 | 恒泰艾普  | 1,309,925.74 | 2.18 |

|     |        |        |              |      |
|-----|--------|--------|--------------|------|
| 241 | 000835 | 长城动漫   | 1,303,103.76 | 2.17 |
| 242 | 601222 | 林洋能源   | 1,298,955.50 | 2.16 |
| 243 | 600237 | 铜峰电子   | 1,291,145.00 | 2.15 |
| 244 | 600776 | 东方通信   | 1,286,229.13 | 2.14 |
| 245 | 002005 | 德豪润达   | 1,273,447.00 | 2.12 |
| 246 | 002416 | 爱施德    | 1,271,174.74 | 2.12 |
| 247 | 601727 | 上海电气   | 1,265,845.00 | 2.11 |
| 248 | 600340 | 华夏幸福   | 1,260,521.00 | 2.10 |
| 249 | 600966 | 博汇纸业   | 1,260,180.00 | 2.10 |
| 250 | 600742 | 一汽富维   | 1,258,968.00 | 2.10 |
| 251 | 000921 | 海信科龙   | 1,251,259.00 | 2.09 |
| 252 | 600132 | 重庆啤酒   | 1,241,805.00 | 2.07 |
| 253 | 000919 | 金陵药业   | 1,237,221.00 | 2.06 |
| 254 | 600683 | 京投发展   | 1,227,207.00 | 2.05 |
| 255 | 600100 | 同方股份   | 1,226,329.00 | 2.04 |
| 256 | 002006 | 精功科技   | 1,220,507.00 | 2.03 |
| 257 | 000100 | TCL 集团 | 1,211,902.00 | 2.02 |

注：卖出金额按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

|              |                  |
|--------------|------------------|
| 买入股票成本（成交）总额 | 1,015,533,046.92 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 1,024,702,651.02 |

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

#### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

**8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细**  
本基金本报告期末未持有资产支持证券。

**8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细**  
本基金本报告期末未持有贵金属。

**8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细**  
本基金本报告期末未持有权证。

**8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**

**8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

| 代码                | 名称 | 持仓量(买/卖) | 合约市值 | 公允价值变动 | 风险说明 |
|-------------------|----|----------|------|--------|------|
| -                 | -  | -        | -    | -      | -    |
| 公允价值变动总额合计(元)     |    |          |      |        | -    |
| 股指期货投资本期收益(元)     |    |          |      |        | -    |
| 股指期货投资本期公允价值变动(元) |    |          |      |        | -    |

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

**8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策**

本基金采用灵活配置策略，可利用股指期货调节系统性风险。

在报告期内，本基金管理人密切关注市场动态，针对当前股指期货基差贴水状态进行现货替代操作，优化资金利用效率，合理管理产品系统性风险，符合既定的投资政策和投资目标。

**8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

本基金本报告期内未投资国债期货。

**8.12 投资组合报告附注**

**8.12.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责、处罚。**



8.12.2 基金投资的前十名股票中，不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

### 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   | 81,202.88 |
| 2  | 应收证券清算款 | -         |
| 3  | 应收股利    | -         |
| 4  | 应收利息    | 3,332.79  |
| 5  | 应收申购款   | -         |
| 6  | 其他应收款   | -         |
| 7  | 待摊费用    | -         |
| 8  | 其他      | -         |
| 9  | 合计      | 84,535.67 |

### 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值  | 占基金资产净值比例(%) | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|--------------|--------------|----------|
| 1  | 600309 | 万华化学 | 1,111,642.00 | 1.82         | 重大资产重组   |

## § 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 | 户均持有的基 | 持有人结构 |
|-------|--------|-------|
|-------|--------|-------|

| (户) | 金份额       | 机构投资者         |            | 个人投资者         |            |
|-----|-----------|---------------|------------|---------------|------------|
|     |           | 持有份额          | 占总份<br>额比例 | 持有份额          | 占总份<br>额比例 |
| 627 | 90,100.14 | 31,078,611.85 | 55.01%     | 25,414,177.48 | 44.99%     |

## 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 | 107,413.34 | 0.19%    |

## 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情况

| 项目                                 | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|------------------------------------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研<br>究部门负责人持有本开放式基金 | 0~10              |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                    | 0                 |

## 9.4 发起式基金发起资金持有份额情况

| 项目          | 持有份<br>额总数 | 持有份<br>额占基<br>金总份<br>额比例<br>(%) | 发起份<br>额总数 | 发起份<br>额占基<br>金总份<br>额比例<br>(%) | 发起份额承<br>诺持有期限 |
|-------------|------------|---------------------------------|------------|---------------------------------|----------------|
| 基金管理人固有资金   | -          | -                               | -          | -                               | -              |
| 基金管理人高级管理人员 | -          | -                               | -          | -                               | -              |
| 基金经理等人员     | -          | -                               | -          | -                               | -              |
| 基金管理人股东     | -          | -                               | -          | -                               | -              |
| 其他          | -          | -                               | -          | -                               | -              |
| 合计          | -          | -                               | -          | -                               | -              |

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

|                            |                |
|----------------------------|----------------|
| 基金合同生效日(2015年09月01日)基金份额总额 | 302,140,249.57 |
| 本报告期期初基金份额总额               | 59,038,073.20  |

|               |               |
|---------------|---------------|
| 本报告期基金总申购份额   | 30,404,392.94 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 32,949,676.81 |
| 本报告期基金拆分变动份额  | -             |
| 本报告期期末基金份额总额  | 56,492,789.33 |

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

经永赢基金管理有限公司第二届董事会2017年书面决议审议通过，赵楠先生、田中甲先生不再担任永赢基金副总经理职务。本基金管理人已于2017年7月1日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报以及公司网站登载了《永赢基金管理有限公司高级管理人员变更公告》。上述变更事项已按有关规定向中国证券监督管理委员会和上海证监局报备。

本报告期内，本基金托管人的托管部门没有发生重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及本基金管理人、基金财产及基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金管理人的基金投资策略严格遵循本基金《基金合同》及《招募说明书》中披露的基本投资策略，未发生显著的改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自合同生效日起聘请安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金提供审计服务。报告期内本基金未改聘会计师事务所。报告期内应支付给聘任会计师事务所的报酬为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

本报告期内未发生基金管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚的情况。

## 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 |    |
| 信达证券   | 2      | 661,830,355.02 | 32.45%       | 216,496.36 | 20.95%     | -  |
| 华泰证券   | 2      | 352,796,018.64 | 17.30%       | 324,463.61 | 31.40%     | -  |
| 申万宏源证券 | 2      | 382,163,084.70 | 18.74%       | 279,476.50 | 27.05%     | 新增 |
| 海通证券   | 2      | 384,545,320.50 | 18.85%       | 127,399.56 | 12.33%     | 新增 |
| 华福证券   | 2      | 258,161,646.31 | 12.66%       | 85,527.81  | 8.28%      | 新增 |

注：根据中国证监会的有关规定，我司在综合考量证券经营机构的财务状况、经营状况、研究能力的基础上，选择基金专用交易席位，并由本基金管理人董事会授权管理层批准。

## 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 |              | 基金交易 |              |
|--------|------|--------------|--------|----------------|------|--------------|------|--------------|
|        | 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 | 成交金额 | 占当期基金成交总额的比例 |
| 信达证券   | -    | -            | -      | -              | -    | -            | -    | -            |
| 华泰证券   | -    | -            | -      | -              | -    | -            | -    | -            |
| 申万宏源证券 | -    | -            | -      | -              | -    | -            | -    | -            |
| 海通证券   | -    | -            | -      | -              | -    | -            | -    | -            |
| 华福证券   | -    | -            | -      | -              | -    | -            | -    | -            |

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

## 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

| 投资者类别   | 报告期内持有基金份额变化情况 |                          |               |               |      | 报告期末持有基金情况    |        |
|---|----------------|--------------------------|---------------|---------------|------|---------------|--------|
|   | 序号             | 持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间   | 期初份额          | 申购份额          | 赎回份额 | 持有份额          | 份额占比   |
| 机构  | 1              | 2017年11月1日 - 2017年12月31日 | 10,004,850.00 | 21,073,761.85 | 0.00 | 31,078,611.85 | 55.01% |
| 产品特有风险  |                |                          |               |               |      |               |        |
| 本基金在本报告期内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，存在可能因投资者的大额申购或赎回造成基金份额波动的风险。 |                |                          |               |               |      |               |        |

永赢基金管理有限公司  
二〇一八年三月三十日