

富国低碳新经济混合型证券投资基金

二〇一七年年度报告

(摘要)

2017年12月31日

基金管理人：富国基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2018年03月31日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

富国基金管理有限公司的董事会、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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 3 月 29 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。

富国基金管理有限公司承诺以诚实信用、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。

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

1.2

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	富国低碳新经济混合
基金主代码	001985
交易代码	001985
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年12月18日
基金管理人	富国基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	411,603,571.91份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于低碳新经济主题相关股票，通过精选个股和严格风险控制，力求为基金份额持有人获取超过业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金采取“自上而下”的方式进行大类资产配置，根据对宏观经济、市场面、政策面等因素进行定量与定性相结合的分析研究，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。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为：中证800指数收益率×60%+中债综合全价指数收益率×40%。
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金，属于中高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		富国基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵瑛	田青
	联系电话	021-20361818	010-67595096
	电子邮箱	public@fullgoal.com.cn	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		95105686、4008880688	010-67595096
传真		021-20361616	010-66275853

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.fullgoal.com.cn
---------------------	---------------------

基金年度报告备置地点	富国基金管理有限公司 上海市浦东新区世纪大道8号 上海国金中心二期16-17层 中国建设银行股份有限公司 北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
------------	--

§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12月18日 (基金合同生效日) 至2015年12月31日
本期已实现收益	85,306,922.27	64,859,287.96	-956,477.03
本期利润	97,394,215.67	95,370,613.04	4,056,744.13
加权平均基金份额本期利润	0.2316	0.1242	0.0038
本期基金份额净值增长率	23.79%	13.05%	0.40%
3.1.2 期末数据和指标	2017年12月31日	2016年12月31日	2015年12月31日
期末可供分配基金份额利润	0.3597	0.1351	-0.0009
期末基金资产净值	578,206,780.77	542,539,547.44	1,081,386,767.19
期末基金份额净值	1.405	1.135	1.004

注：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（例如，开放式基金的申购赎回费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。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。

3.2 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	4.46%	1.32%	0.84%	0.46%	3.62%	0.86%
过去六个月	25.33%	1.22%	4.07%	0.41%	21.26%	0.81%
过去一年	23.79%	1.11%	7.48%	0.39%	16.31%	0.72%
自基金合同生效日起至今	40.50%	1.23%	-1.49%	0.71%	41.99%	0.52%

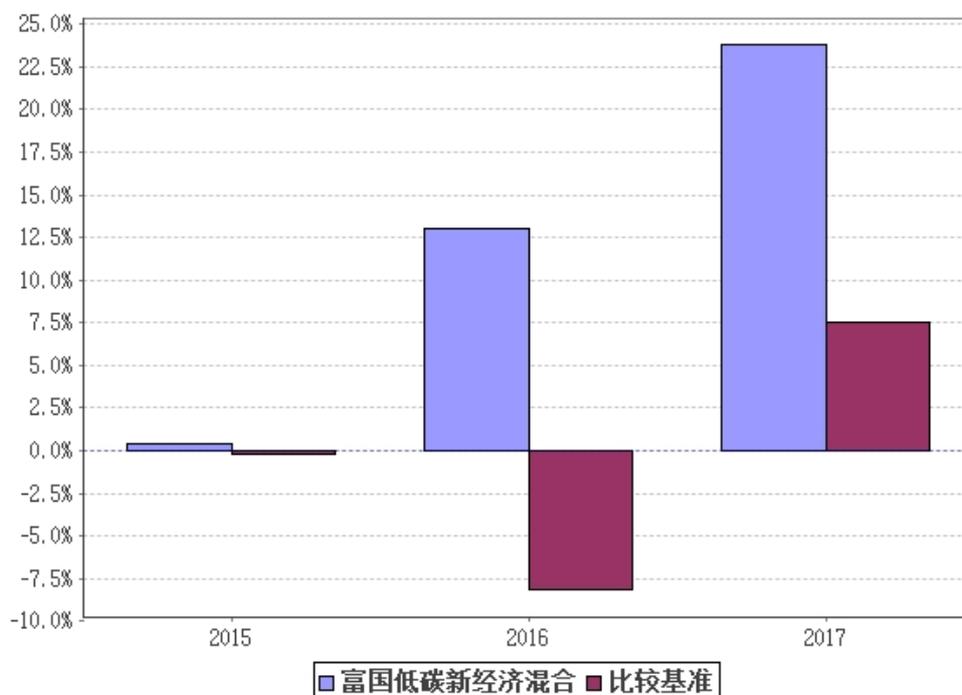
注：本基金业绩比较基准：中证 800 指数收益率×60%+中债综合全价指数收益率×40%。中证 800 指数是由中证指数有限公司编制的综合反映沪深证券市场内大中小市值公司的整体状况的指数。中证 800 指数的成份股由中证 500 指数和沪深 300 指数成份股一起构成。本基金每个交易日对业绩比较基准进行再平衡处理，1 日收益率 (benchmark_t) 按下列公式计算： $benchmark_t = [中证 800 指数_t / (中证 800 指数_{t-1}) - 1] * 60\% + [中债综合指数_t / (中债综合指数_{t-1}) - 1] * 40\%$ ；其中， $t = t=1, 2, 3, \dots, T$, T 表示时间截至日；期间 T 日收益率 (benchmark_T) 按下列公式计算： $benchmark_T = [\prod_{t=1}^T (1 + benchmark_t)] - 1$ 其中， $T=2, 3, 4, \dots$ ； $\prod_{t=1}^T (1 + benchmark_t)$ 表示 t 日至 T 日的 $(1 + benchmark_t)$ 数学连乘。

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：1、截止日期为 2017 年 12 月 31 日。
2、本基金于 2015 年 12 月 18 日成立，建仓期 6 个月，从 2015 年 12 月 18 日起至 2016 年 6 月 17 日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

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：2015 年按实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金 2015 年 12 月 18 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日未进行利润分配

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

富国基金管理有限公司于 1999 年 4 月 13 日获国家工商行政管理局登记注册成立，是经中国证监会批准设立的首批十家基金管理公司之一，公司于 2001 年 3 月从北京迁址上海。2003 年 9 月加拿大蒙特利尔银行（BMO）参股富国基金管理有限公司的工商变更登记办理完毕，富国基金管理有限公司成为国内首批成立的十家基金公司中，第一家中外合资的基金管理公司。截至 2017 年 12 月 31 日，本基金管理人共管理富国天盛灵活配置混合型证券投资基金、富国消费主题混合型证券投资基金、富国天源沪港深平衡混合型证券投资基金、富国天利增长债券投资基金、富国天益价值混合型证券投资基金、富国天瑞强势地区精选混合型证券投资基金、富国天惠精选成长混合型证券投资基金（LOF）、富国天时货币市场基金、富国天合稳健优选混合型证券投资基金、富国天博创新主题混合型证券

投资基金、富国天成红利灵活配置混合型证券投资基金、富国天丰强化收益债券型证券投资基金（LOF）、富国中证红利指数增强型证券投资基金、富国优化增强债券型证券投资基金、富国沪深 300 增强证券投资基金、富国通胀通缩主题轮动混合型证券投资基金、富国汇利回报两年定期开放债券型证券投资基金、富国全球债券证券投资基金、富国可转换债券证券投资基金、上证综指交易型开放式指数证券投资基金、富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金、富国天盈债券型证券投资基金（LOF）、富国全球顶级消费品混合型证券投资基金、富国低碳环保混合型证券投资基金、富国中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）、富国产业债债券型证券投资基金、富国新天锋定期开放债券型证券投资基金、富国高新技术产业混合型证券投资基金、富国中国中小盘（香港上市）混合型证券投资基金、富国纯债债券型发起式证券投资基金、富国强回报定期开放债券型证券投资基金、富国宏观策略灵活配置混合型证券投资基金、富国稳健增强债券型证券投资基金、富国信用债债券型证券投资基金、富国目标收益一年期纯债债券型证券投资基金、富国医疗保健行业混合型证券投资基金、富国创业板指数分级证券投资基金、富国目标收益两年期纯债债券型证券投资基金、富国国有企业债债券型证券投资基金、富国城镇发展股票型证券投资基金、富国高端制造行业股票型证券投资基金、富国收益增强债券型证券投资基金、富国新回报灵活配置混合型证券投资基金、富国研究精选灵活配置混合型证券投资基金、富国中证军工指数分级证券投资基金、富国中证移动互联网指数分级证券投资基金、富国中证国有企业改革指数分级证券投资基金、富国目标齐利一年期纯债债券型证券投资基金、富国富钱包货币市场基金、富国安益货币市场基金、富国中小盘精选混合型证券投资基金、富国新兴产业股票型证券投资基金、富国中证新能源汽车指数分级证券投资基金、富国中证全指证券公司指数分级证券投资基金、富国中证银行指数分级证券投资基金、富国文体健康股票型证券投资基金、富国国家安全主题混合型证券投资基金、富国改革动力混合型证券投资基金、富国新收益灵活配置混合型证券投资基金、富国中证工业 4.0 指数分级证券投资基金、富国沪港深价值精选灵活配置混合型证券投资基金、富国中证煤炭指数分级证券投资基金、富国中证体育产业指数分级证券投资基金、富国绝对收益多策略定期开放混合型发起式证券投资基金、富国新动力灵活配置混合型证券投资基金、富国收益宝交易型货币市场基金、富国低碳新经济混合型证券投资基金、富国中证智能汽车指数证券投资基金（LOF）、富国研究优选沪港深灵活配置混合型证券投资基金、富国价值优势混合型证券投资基金、富国泰利定期开放债券型发起式证券投资基金、富国祥利定期开放债券型发起式证券投资基金、富国美丽中国混合型证券投资基金、富国创新科技混合型证券投资基金、富国睿利定期开放混合型发起式证券投资基金、富国中证医药主题指数增强型证券投资基金（LOF）、富国两年期理财债券型证券投资基金、富国久利稳健配置混合型证券投资基金、富国富利稳健配置混合型证券投资基金、富国中证娱乐主题指数增强型证券投资基金（LOF）、富国中证高端制造指数增强型证券投资基金（LOF）、富国新活力灵活配置混合型发起式证券投资基金、富国产业升级混合型证券投资基金、富国鼎利纯债债券型发起式证券投资基金、富国新兴成长量化精选混合型证券投资基金（LOF）、富国泓利纯债债券型发起式证券投资基金、富国新优享灵活配置混合型证券投资基金、富国聚利纯债定期开放债券型发起式证券投资基金、富国祥利一年期定期开放债券型证券投资基金、富国丰利增强债券型发起式证券投资基金、富国兴利增强债券型发起式证券投资基金、富国嘉利稳健配置定

期开放混合型证券投资基金、富国景利纯债债券型发起式证券投资基金、富国新机遇灵活配置混合型发起式证券投资基金、富国精准医疗灵活配置混合型证券投资基金、富国研究量化精选混合型证券投资基金、富国沪港深行业精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、富国金利定期开放混合型证券投资基金等九十八只证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
杨栋	本基金经理兼任富国天合稳健优选混合型证券投资基金基金经理	2015-12-18	—	7	硕士，自2011年5月至2015年8月在富国基金管理有限公司任助理行业研究员、行业研究员；自2015年8月起任富国天合稳健优选混合型证券投资基金基金经理；自2015年12月起任富国低碳新经济混合型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。

注：1、上述任职日期为根据公司确定的聘任日期，离任日期为根据公司确定的解聘日期；首任基金经理任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的涵义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期，富国基金管理有限公司作为富国低碳新经济混合型证券投资基金的管理人严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券法》、《富国低碳新经济混合型证券投资基金基金合同》以及其它有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，以为投资者减少和分散风险，确保基金资产的安全并谋求基金长期稳定收益为目标，管理和运用基金资产，基金投资组合符合有关法规及基金合同的规定。

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

本基金管理人根据相关法规要求，结合实际情况，制定了内部的《公平交易管理办法》，对证券的一级市场申购、二级市场交易相关的研究分析、投资决策、授权、交易执行、业绩评估等投资管理环节，实行事前控制、事中监控、事后评估及反馈的流程化管理。在制度、操作层面确保各组合享有同等信息知情权、均等交易机会，并保持各组合的独立投资决策权。

事前控制主要包括：1、一级市场，通过标准化的办公流程，对关联方审核、价格公允性判断及证券公平分配等相关环节进行控制；2、二级市场，通过交易系统的投资备选库、交易对手库及授权管理，对投资标的、交易对手和操作权限进行自动化控制。

事中监控主要包括组合间相同投资标的的交易方向、市场冲击的控制，银行间市场交易价格的公允性评估等。1、将主动投资组合的同日反向交易列为限制行为，非经特别控制流程审核同意，不得进行；对于同日同向交易，通过交易系统对组合间的交易公平性进行自动化处理。2、同一基金经理管理的不同组合，

对同一投资标的采用相同投资策略的，必须通过交易系统采取同时、同价下达投资指令，确保公平对待其所管理的组合。

事后评估及反馈主要包括组合间同一投资标的的临近交易日的同向交易和反向交易的合理性分析评估，以及不同时间窗口下（1日、3日、5日）的季度公平性交易分析评估等。1、通过公平性交易的事后分析评估系统，对涉及公平性交易的投资行为进行分析评估，分析对象涵盖公募、年金、社保及专户产品，并重点分析同类组合（股票型、混合型、债券型）间、不同产品间以及同一基金经理管理不同组合间的交易行为，若发现异常交易行为，风险管理部视情况要求相关当事人做出合理性解释，并按法规要求上报辖区监管机构。2、季度公平性交易分析报告按规定经基金经理或投资经理签字，并经督察长、总经理审阅签字后，归档保存，以备后查。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期，在同向交易价差分析方面，公司采集连续四个季度，不同时间窗口（1日内、3日内、5日内）的同向交易样本，在假设同向交易价差为零及95%的置信水平下，对同向交易价差进行t分布假设检验并对检验结果进行跟踪分析。分析结果显示本投资组合与公司管理的其他投资组合在同向交易价差方面未出现异常。

本报告期内公司旗下基金严格遵守公司的相关公平交易制度，未出现违反公平交易制度的情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现异常交易行为。

公司旗下管理的各投资组合在交易所公开竞价同日反向交易的控制方面，报告期内本组合与其他投资组合之间，因组合流动性管理或投资策略调整需要，出现3次同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2017年，本基金收益率23.79%，跑赢基准17个百分点。本基金坚持均衡配置，精选个股。重点在新能源、新材料、先进制造，以及处于行业拐点的具备显著竞争优势的公司。

在二季度末，市场对经济增长存在重大分歧，本基金重点配置基本面良好的资源类股票。三四季度，重点配置以光伏为代表的新能源类公司。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2017年12月31日，本基金份额净值为1.405元；份额累计净值为1.405元；本报告期，本基金份额净值增长率为23.79%，同期业绩比较基准收益率为7.48%

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2018年，中国经济继续向高质量发展转型，本基金将继续坚持寻找行业拐点，在底部挖掘优秀公司。以光伏、风电为代表的新能源产业，有望在3年内迎来平价上网。以煤炭为代表的周期性行业，在供给侧改革的背景下，优秀公司的盈利有望维持高位，各类品牌消费、生物医药、电子产品也受益于消费升级。

本基金将继续坚持在趋势向好的行业中精选个股的配置策略。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、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》等法律法规、估值指引的相关规定，以及基金合同对估值程序的相关约定，对基金所持有的投资品种进行估值。日常估值的账务处理、基金份额净值的计算由基金管理人独立完成，并与基金托管人进行账务核对，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规、本基金《基金合同》的约定以及基金的实际运作情况，本报告期内本基金未进行收益分配。本基金将严格按照法律法规及基金合同约定进行收益分配。

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

本基金本报告期无需要说明的相关情形。

§ 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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

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

本托管人复核审查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。

§ 6 审计报告

本基金审计的注册会计师出具的是无保留意见的审计报告。
投资者可通过本基金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：富国低碳新经济混合型证券投资基金

报告截止日：2017年12月31日

单位：人民币元

资 产	本期末 (2017年12月31日)	上年度末 (2016年12月31日)
资 产：		
银行存款	40,074,479.64	55,283,981.66
结算备付金	4,498,095.78	4,430,272.68
存出保证金	309,101.53	600,148.55
交易性金融资产	540,531,236.65	503,786,767.03
其中：股票投资	540,104,736.65	503,786,767.03
基金投资	—	—
债券投资	426,500.00	—
资产支持证券投资	—	—
贵金属投资	—	—
衍生金融资产	—	—
买入返售金融资产	—	—
应收证券清算款	—	4,372,024.91
应收利息	11,596.38	14,208.92
应收股利	—	—
应收申购款	3,697,012.76	2,365,801.72
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	—
资产总计	589,121,522.74	570,853,205.47
负债和所有者权益	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	—	—
卖出回购金融资产款	—	—
应付证券清算款	5,702,977.16	21,281,723.22
应付赎回款	2,436,970.44	4,194,393.99
应付管理人报酬	727,890.99	692,297.36
应付托管费	121,315.18	115,382.89
应付销售服务费	—	—
应付交易费用	1,642,973.05	1,820,731.30

应交税费	—	—
应付利息	—	—
应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	282,615.15	209,129.27
负债合计	10,914,741.97	28,313,658.03
所有者权益：		
实收基金	411,603,571.91	477,953,169.88
未分配利润	166,603,208.86	64,586,377.56
所有者权益合计	578,206,780.77	542,539,547.44
负债和所有者权益总计	589,121,522.74	570,853,205.47

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.405 元，基金份额总额 411,603,571.91 份。

7.2 利润表

会计主体：富国低碳新经济混合型证券投资基金

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 (2017 年 01 月 01 日至 2017 年 12 月 31 日)	上年度可比期间 (2016 年 01 月 01 日至 2016 年 12 月 31 日)
一、收入	118,931,173.90	131,379,416.03
1. 利息收入	350,848.16	2,015,830.71
其中：存款利息收入	344,072.77	1,155,120.27
债券利息收入	210.54	1,885.86
资产支持证券利息收入	—	—
买入返售金融资产收入	6,564.85	858,824.58
其他利息收入	—	—
2. 投资收益（损失以“-”填列）	105,186,203.59	96,980,331.78
其中：股票投资收益	101,657,476.14	93,707,272.78
基金投资收益	—	—
债券投资收益	80,467.47	593,987.13
资产支持证券投资收益	—	—
贵金属投资收益	—	—
衍生工具投资收益	—	—
股利收益	3,448,259.98	2,679,071.87
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	12,087,293.40	30,511,325.08
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	—	—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	1,306,828.75	1,871,928.46
减：二、费用	21,536,958.23	36,008,802.99
1. 管理人报酬	7,585,626.27	11,665,552.13

2. 托管费	1,264,271.08	1,944,258.61
3. 销售服务费	—	—
4. 交易费用	12,374,829.28	22,067,244.94
5. 利息支出	—	—
其中：卖出回购金融资产支出	—	—
6. 其他费用	312,231.60	331,747.31
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	97,394,215.67	95,370,613.04
减：所得税费用	—	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	97,394,215.67	95,370,613.04

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：富国低碳新经济混合型证券投资基金

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 (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）	477,953,169.88	64,586,377.56	542,539,547.44
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	97,394,215.67	97,394,215.67
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-66,349,597.97	4,622,615.63	-61,726,982.34
其中：1. 基金申购款	358,929,053.10	94,814,786.21	453,743,839.31
2. 基金赎回款	-425,278,651.07	-90,192,170.58	-515,470,821.65
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）	411,603,571.91	166,603,208.86	578,206,780.77
项目	上年度可比期间 (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）	1,077,330,023.06	4,056,744.13	1,081,386,767.19
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	95,370,613.04	95,370,613.04
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）	-599,376,853.18	-34,840,979.61	-634,217,832.79
其中：1. 基金申购款	297,381,548.34	25,120,502.73	322,502,051.07
2. 基金赎回款	-896,758,401.52	-59,961,482.34	-956,719,883.86

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）	477,953,169.88	64,586,377.56	542,539,547.44

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；

陈 戈	林志松	徐 慧
-----	-----	-----
基金管理公司负责人	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 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的说明

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

7.4.2 会计差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.3 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
富国基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
海通证券股份有限公司（“海通证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构
申万宏源证券有限公司（“申万宏源”）	基金管理人的股东、基金代销机构
中国建设银行股份有限公司（“建设银行”）	基金托管人、基金代销机构
山东省国际信托股份有限公司	基金管理人的股东
蒙特利尔银行	基金管理人的股东

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.4.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期(2017年01月01日至2017年12月31日)		上年度可比期间(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(%)

海通证券	621,532,310.36	7.58	439,685,674.32	3.00
申万宏源	141,745,665.33	1.73	793,269,067.13	5.41

7.4.4.1.2 权证交易

注：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。

7.4.4.1.3 债券交易

注：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。

7.4.4.1.4 回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（2017年01月01日至2017年12月31日）		上年度可比期间（2016年01月01日至2016年12月31日）	
	成交金额	占当期回购成交总额的比例（%）	成交金额	占当期回购成交总额的比例（%）
海通证券	—	—	750,000,000.00	34.58
申万宏源	—	—	200,000,000.00	9.22

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行回购交易。

7.4.4.1.5 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01月01日至2017年12月31日）			
	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（%）
海通证券	571,447.40	7.62	177,222.35	10.79
申万宏源	132,007.66	1.76	0.00	0.00
关联方名称	上年度可比期间（2016年01月01日至2016年12月31日）			
	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（%）
申万宏源	738,773.18	5.51	12,442.68	0.68
海通证券	402,917.12	3.00	64,276.60	3.53

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。

7.4.4.2 关联方报酬

7.4.4.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期（2017年01月01日至 2017年12月31日）	上年度可比期间（2016年01月 01日至2016年12月31日）
当期发生的基金应支付的管理费	7,585,626.27	11,665,552.13
其中：支付销售机构的客户维护费	2,936,885.01	7,038,873.13

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.50%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

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。

7.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期（2017年01月01日至 2017年12月31日）	上年度可比期间（2016年01 月01日至2016年12月31日）
当期发生的基金应支付的 托管费	1,264,271.08	1,944,258.61

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

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。

7.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方通过银行间同业市场进行债券（含回购）交易。

7.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本报告期内及上年度可比期间内本基金的基金管理人均未运用固有资金投资本基金。

7.4.4.4.2 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

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方本报告期末及上年度末均未投资本基金。

7.4.4.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期（2017年01月01日至2017年12月31日）		上年度可比期间（2016年01月01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
中国建设银行股份有限公司	40,074,479.64	284,097.23	55,283,981.66	1,016,234.78

7.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：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。

7.4.4.7 其他关联交易事项的说明

7.4.4.7.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间均无其他关联方交易事项。

7.4.5 期末（2017年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

7.4.5.1.1 受限证券类别：股票

金额单位：人民币元

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002001	新和成	2017-12-20	2019-12-23	非公开发行	28.00	33.16	71,428	1,999,984.00	2,368,552.48	—
002001	新和成	2017-12-20	2018-12-24	非公开发行	28.00	35.00	71,429	2,000,012.00	2,500,015.00	—
002027	分众传媒	2017-09-13	2018-03-13	大宗交易	8.86	13.47	500,000	4,430,000.00	6,735,000.00	—
002923	润都股份	2017-12-28	2018-01-05	新股认购	17.01	17.01	954	16,227.54	16,227.54	—
300558	贝达药业	2017-11-20	2018-05-21	大宗交易	58.00	59.84	100,000	5,800,000.00	5,984,000.00	—
300664	鹏鹞环保	2017-12-28	2018-01-05	新股认购	8.88	8.88	3,640	32,323.20	32,323.20	—

601233	桐昆股份	2017-12-12	2018-06-12	大宗交易	19.05	20.81	210,000	4,000,500.00	4,370,100.00	—
601233	桐昆股份	2017-12-22	2018-06-22	大宗交易	20.33	20.75	250,000	5,082,500.00	5,187,500.00	—

7.4.5.1.2 受限证券类别：债券

金额单位：人民币元

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
123003	蓝思转债	2017-12-08	2018-01-17	认购新发证券	100.00	100.00	2,906	290,600.00	290,600.00	
123006	东财转债	2017-12-20	2018-01-29	认购新发证券	100.00	100.00	1,359	135,900.00	135,900.00	

注：002001 新和成“可流通日”是根据上市公司公告估算的流通日期，最终日期以上市公司公告为准。

7.4.5.2 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 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002919	名臣健康	2017-12-28	股票交易异常波动	35.26	2018-01-02	38.79	821	10,311.76	28,948.46	—
603986	兆易创新	2017-11-01	重大事项停牌	153.72	2018-03-02	150.00	11,200	1,387,224.00	1,721,664.00	—

7.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

注：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证券款余额。

7.4.5.3.2 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证券款余额。

7.4.6 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1 公允价值

7.4.14.1.1 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。

7.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

7.4.14.1.2.1 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 511,160,405.97 元，属于第二层次的余额为人民币 2,225,663.20 元，属于第三层次余额为人民币 27,145,167.48 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 468,803,455.67 元，属于第二层次的余额为人民币 34,983,311.36 元，属于第三层次余额为人民币 0.00 元）。

7.4.14.1.2.2 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。

7.4.14.1.2.3 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变动情况如下：

上年度末余额 0.00 元，2017 年度转入第三层次 4,430,000.00 元，转出第三层次 0.00 元，当期计入损益的利得或损失总额 3,832,171.48 元，购买 18,882,996.00 元，卖出 0.00 元，本期末 27,145,167.48 元，本期末持有的资产计入损益的当期未实现利得或损失的变动 3,832,171.48 元。

7.4.14.2 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。

7.4.14.3 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。

§ 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	540,104,736.65	91.68
	其中：股票	540,104,736.65	91.68
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	426,500.00	0.07
	其中：债券	426,500.00	0.07
	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	44,572,575.42	7.57
8	其他各项资产	4,017,710.67	0.68
9	合计	589,121,522.74	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

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	—	—
B	采矿业	60,962,068.38	10.54
C	制造业	322,605,373.16	55.79
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,848,970.00	2.91
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	14,307,863.96	2.47
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,509,779.00	1.13
J	金融业	3,111,966.00	0.54
K	房地产业	59,681,317.79	10.32
L	租赁和商务服务业	29,172,443.60	5.05
M	科学研究和技术服务业	26,863,067.80	4.65
N	水利、环境和公共设施管理业	41,886.96	0.01
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	540,104,736.65	93.41

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	300274	阳光电源	2,950,541	55,381,654.57	9.58
2	300130	新国都	1,532,562	36,566,929.32	6.32
3	002202	金风科技	1,786,102	33,668,022.70	5.82
4	603938	三孚股份	802,268	32,852,874.60	5.68
5	600338	西藏珠峰	782,290	32,582,378.50	5.64
6	300487	蓝晓科技	1,904,950	32,422,249.00	5.61
7	002027	分众传媒	2,092,420	29,156,273.60	5.04
8	603959	百利科技	867,110	26,863,067.80	4.65
9	000537	广宇发展	1,839,130	23,485,690.10	4.06
10	002768	国恩股份	706,467	20,113,115.49	3.48

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于富国基金管理有限公司网站的年度报告正文

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 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	600338	西藏珠峰	73,086,059.88	13.47
2	603938	三孚股份	58,754,379.57	10.83
3	300274	阳光电源	56,091,968.97	10.34
4	300401	花园生物	56,068,225.67	10.33
5	002202	金风科技	44,163,909.85	8.14
6	603377	东方时尚	44,147,931.09	8.14
7	600438	通威股份	42,783,012.32	7.89
8	300335	迪森股份	41,407,823.21	7.63
9	600406	国电南瑞	39,034,900.37	7.19
10	601225	陕西煤业	38,718,752.04	7.14
11	300130	新国都	37,579,852.55	6.93
12	300444	双杰电气	36,744,265.47	6.77
13	002008	大族激光	36,672,372.61	6.76
14	600703	三安光电	36,277,099.13	6.69
15	300487	蓝晓科技	35,849,491.54	6.61
16	002036	联创电子	35,402,654.21	6.53
17	300522	世名科技	35,260,731.56	6.50
18	002596	海南瑞泽	33,703,292.72	6.21
19	002027	分众传媒	32,883,614.77	6.06
20	002466	天齐锂业	31,894,543.07	5.88
21	603959	百利科技	31,073,135.56	5.73
22	300097	智云股份	30,081,140.57	5.54
23	300476	胜宏科技	30,043,195.59	5.54
24	000537	广宇发展	29,953,185.08	5.52
25	002562	兄弟科技	28,645,793.59	5.28
26	300393	中来股份	28,142,674.43	5.19
27	002050	三花智控	28,033,477.70	5.17
28	300068	南都电源	27,216,601.23	5.02
29	601233	桐昆股份	26,969,219.81	4.97
30	601668	中国建筑	26,290,120.00	4.85
31	300038	梅泰诺	25,775,160.00	4.75
32	600089	特变电工	25,443,496.80	4.69
33	601688	华泰证券	24,952,786.98	4.60

34	000858	五粮液	24,144,087.24	4.45
35	300255	常山药业	23,990,561.00	4.42
36	000725	京东方 A	23,721,111.00	4.37
37	600110	诺德股份	23,505,477.90	4.33
38	000807	云铝股份	23,503,792.45	4.33
39	600309	万华化学	23,070,267.04	4.25
40	600208	新潮中宝	21,555,693.14	3.97
41	000050	深天马 A	21,543,468.90	3.97
42	002564	天沃科技	21,388,033.13	3.94
43	000400	许继电气	21,107,796.36	3.89
44	300323	华灿光电	19,875,226.86	3.66
45	002273	水晶光电	19,858,694.80	3.66
46	601318	中国平安	19,789,242.00	3.65
47	603223	恒通股份	19,544,355.86	3.60
48	600104	上汽集团	19,331,541.92	3.56
49	600546	山煤国际	19,130,556.54	3.53
50	300059	东方财富	18,683,280.70	3.44
51	600622	光大嘉宝	18,637,483.02	3.44
52	601117	中国化学	18,468,594.00	3.40
53	300477	合纵科技	18,356,640.50	3.38
54	600030	中信证券	17,919,682.00	3.30
55	600337	美克家居	17,869,898.20	3.29
56	002205	国统股份	17,835,915.99	3.29
57	600581	八一钢铁	17,656,961.56	3.25
58	300471	厚普股份	17,460,793.90	3.22
59	603127	昭衍新药	17,430,226.14	3.21
60	600188	兖州煤业	17,418,245.14	3.21
61	600060	海信电器	17,389,713.88	3.21
62	000538	云南白药	17,180,949.90	3.17
63	300346	南大光电	17,132,029.00	3.16
64	002831	裕同科技	17,105,823.68	3.15
65	600886	国投电力	17,009,176.90	3.14
66	600416	湘电股份	16,694,463.03	3.08
67	300601	康泰生物	16,558,223.21	3.05
68	002768	国恩股份	16,381,021.30	3.02
69	300320	海达股份	16,308,027.40	3.01
70	603799	华友钴业	16,274,663.36	3.00
71	600563	法拉电子	16,171,156.46	2.98
72	300013	新宁物流	15,797,207.66	2.91
73	600884	杉杉股份	15,664,075.00	2.89
74	600066	宇通客车	15,567,536.36	2.87

75	002384	东山精密	15,375,146.63	2.83
76	002756	永兴特钢	15,241,727.42	2.81
77	600528	中铁工业	15,137,472.00	2.79
78	600021	上海电力	14,842,184.00	2.74
79	600521	华海药业	14,703,770.85	2.71
80	300567	精测电子	14,680,395.28	2.71
81	300413	快乐购	14,551,647.00	2.68
82	601211	国泰君安	14,095,790.30	2.60
83	000408	藏格控股	14,093,763.00	2.60
84	600764	中电广通	14,079,841.00	2.60
85	300121	阳谷华泰	14,054,352.32	2.59
86	600048	保利地产	14,002,166.68	2.58
87	600019	宝钢股份	13,981,200.68	2.58
88	300433	蓝思科技	13,668,993.65	2.52
89	603006	联明股份	13,655,322.20	2.52
90	600782	新钢股份	13,552,733.84	2.50
91	600614	鹏起科技	13,335,061.96	2.46
92	601766	中国中车	13,322,191.00	2.46
93	300435	中泰股份	13,128,026.00	2.42
94	600596	新安股份	13,084,457.00	2.41
95	600499	科达洁能	13,006,940.00	2.40
96	601699	潞安环能	12,779,967.70	2.36
97	600409	三友化工	12,732,777.02	2.35
98	002640	跨境通	12,731,632.18	2.35
99	601012	隆基股份	12,700,281.00	2.34
100	300064	豫金刚石	12,645,508.48	2.33
101	002497	雅化集团	12,585,092.00	2.32
102	600595	中孚实业	12,510,823.10	2.31
103	601988	中国银行	12,502,625.27	2.30
104	600602	云赛智联	12,496,105.94	2.30
105	002427	尤夫股份	12,129,920.74	2.24
106	601179	中国西电	12,089,232.00	2.23
107	002127	南极电商	11,984,650.75	2.21
108	603896	寿仙谷	11,908,274.20	2.19
109	600141	兴发集团	11,839,718.00	2.18
110	000639	西王食品	11,764,351.00	2.17
111	601166	兴业银行	11,674,537.00	2.15
112	603993	洛阳钼业	11,656,721.00	2.15
113	002686	亿利达	11,622,735.45	2.14
114	002001	新和成	11,568,430.00	2.13
115	002024	苏宁云商	11,557,256.28	2.13

116	601933	永辉超市	11,518,478.69	2.12
117	600466	蓝光发展	11,383,249.08	2.10
118	600031	三一重工	11,246,966.98	2.07
119	002044	美年健康	11,169,012.00	2.06
120	600702	沱牌舍得	10,887,937.90	2.01
—	—	—	—	—

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300401	花园生物	92,662,956.57	17.08
2	600338	西藏珠峰	69,556,221.10	12.82
3	002564	天沃科技	59,664,699.03	11.00
4	002202	金风科技	43,079,492.30	7.94
5	600703	三安光电	42,610,300.43	7.85
6	300169	天晟新材	42,427,450.46	7.82
7	002008	大族激光	42,351,958.63	7.81
8	603377	东方时尚	41,737,626.88	7.69
9	300335	迪森股份	40,501,850.70	7.47
10	600406	国电南瑞	39,878,642.48	7.35
11	600093	易见股份	38,308,835.78	7.06
12	300444	双杰电气	37,960,065.04	7.00
13	002036	联创电子	35,869,076.35	6.61
14	600438	通威股份	34,334,178.92	6.33
15	300522	世名科技	33,969,062.12	6.26
16	002596	海南瑞泽	33,623,806.16	6.20
17	002466	天齐锂业	33,407,575.60	6.16
18	002050	三花智控	32,880,956.32	6.06
19	300476	胜宏科技	31,173,412.50	5.75
20	002562	兄弟科技	30,322,458.20	5.59
21	000608	阳光股份	29,714,925.97	5.48
22	603938	三孚股份	29,400,152.57	5.42
23	600309	万华化学	28,759,255.19	5.30
24	300393	中来股份	28,748,583.43	5.30
25	000858	五粮液	28,743,776.81	5.30
26	002511	中顺洁柔	28,470,262.83	5.25
27	000018	神州长城	28,095,028.78	5.18
28	300097	智云股份	27,587,778.26	5.08
29	000725	京东方 A	26,558,196.00	4.90
30	300038	梅泰诺	26,233,256.28	4.84
31	300068	南都电源	25,952,709.50	4.78
32	000807	云铝股份	25,729,180.61	4.74

33	601117	中国化学	25,619,109.10	4.72
34	600089	特变电工	25,363,801.62	4.68
35	601668	中国建筑	25,351,995.98	4.67
36	601688	华泰证券	24,884,320.59	4.59
37	601225	陕西煤业	24,582,068.33	4.53
38	300323	华灿光电	24,275,320.11	4.47
39	000921	海信科龙	23,063,126.89	4.25
40	600110	诺德股份	22,710,469.65	4.19
41	000050	深天马 A	22,600,710.61	4.17
42	000630	铜陵有色	22,161,140.02	4.08
43	600546	山煤国际	22,157,628.48	4.08
44	600581	八一钢铁	22,127,054.00	4.08
45	300255	常山药业	22,057,880.65	4.07
46	601318	中国平安	21,676,283.77	4.00
47	000400	许继电气	21,209,904.16	3.91
48	600104	上汽集团	20,147,692.71	3.71
49	300471	厚普股份	20,125,559.82	3.71
50	300274	阳光电源	18,990,456.04	3.50
51	600884	杉杉股份	18,959,003.74	3.49
52	300059	东方财富	18,865,981.59	3.48
53	600337	美克家居	18,573,458.18	3.42
54	002831	裕同科技	18,067,311.56	3.33
55	002180	纳思达	18,062,232.31	3.33
56	002273	水晶光电	17,991,396.24	3.32
57	000538	云南白药	17,951,056.79	3.31
58	600030	中信证券	17,793,819.00	3.28
59	603223	恒通股份	17,602,615.10	3.24
60	000928	中钢国际	17,314,626.53	3.19
61	002384	东山精密	17,270,769.85	3.18
62	600060	海信电器	16,710,743.15	3.08
63	002205	国统股份	16,680,763.80	3.07
64	603896	寿仙谷	16,211,748.91	2.99
65	002559	亚威股份	16,188,796.66	2.98
66	600563	法拉电子	16,039,249.49	2.96
67	002024	苏宁云商	15,962,156.41	2.94
68	300567	精测电子	15,907,537.92	2.93
69	300320	海达股份	15,855,480.00	2.92
70	600416	湘电股份	15,431,883.31	2.84
71	300477	合纵科技	15,414,990.00	2.84
72	600409	三友化工	15,253,636.68	2.81
73	300346	南大光电	15,227,565.63	2.81

74	600066	宇通客车	15,137,424.19	2.79
75	000560	昆百大 A	15,107,703.24	2.78
76	600021	上海电力	14,941,614.40	2.75
77	600528	中铁工业	14,927,394.87	2.75
78	603127	昭衍新药	14,909,902.44	2.75
79	600782	新钢股份	14,881,200.33	2.74
80	300121	阳谷华泰	14,703,499.68	2.71
81	603799	华友钴业	14,496,394.25	2.67
82	600487	亨通光电	14,281,710.66	2.63
83	601211	国泰君安	14,241,841.70	2.63
84	600019	宝钢股份	14,241,695.43	2.63
85	000408	藏格控股	14,181,886.30	2.61
86	600614	鹏起科技	14,065,682.91	2.59
87	002756	永兴特钢	13,951,472.51	2.57
88	300013	新宁物流	13,816,532.48	2.55
89	002414	高德红外	13,781,844.45	2.54
90	600048	保利地产	13,728,031.21	2.53
91	600527	江南高纤	13,573,148.21	2.50
92	600595	中孚实业	13,542,320.18	2.50
93	603006	联明股份	13,508,427.76	2.49
94	600596	新安股份	13,280,019.99	2.45
95	601766	中国中车	13,144,764.25	2.42
96	002427	尤夫股份	13,102,729.30	2.42
97	002640	跨境通	13,084,453.42	2.41
98	600764	中电广通	13,039,245.36	2.40
99	601933	永辉超市	12,953,931.51	2.39
100	601988	中国银行	12,947,070.02	2.39
101	300433	蓝思科技	12,842,513.00	2.37
102	600029	南方航空	12,762,487.32	2.35
103	002497	雅化集团	12,537,017.24	2.31
104	300223	北京君正	12,284,577.95	2.26
105	601699	潞安环能	12,214,843.53	2.25
106	300429	强力新材	12,169,280.64	2.24
107	603993	洛阳钼业	12,056,267.92	2.22
108	002686	亿利达	12,004,281.52	2.21
109	300064	豫金刚石	11,954,609.27	2.20
110	000059	华锦股份	11,923,346.51	2.20
111	002493	荣盛石化	11,723,514.49	2.16
112	601166	兴业银行	11,709,852.35	2.16
113	600622	光大嘉宝	11,674,083.16	2.15
114	601179	中国西电	11,673,798.85	2.15

115	603688	石英股份	11,640,516.83	2.15
116	600602	云赛智联	11,517,628.85	2.12
117	002281	光迅科技	11,512,829.06	2.12
118	300435	中泰股份	11,509,560.03	2.12
119	002127	南极电商	11,237,314.75	2.07
120	600141	兴发集团	11,205,624.77	2.07
121	002044	美年健康	11,062,650.94	2.04
122	000639	西王食品	10,986,825.40	2.03
123	600055	万东医疗	10,887,786.06	2.01

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	4,067,091,629.68
卖出股票收入（成交）总额	4,144,518,429.60

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	—	—
2	央行票据	—	—
3	金融债券	—	—
	其中：政策性金融债	—	—
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	可转债（可交换债）	426,500.00	0.07
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	426,500.00	0.07

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	123003	蓝思转债	2,906	290,600.00	0.05
2	123006	东财转债	1,359	135,900.00	0.02

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注：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

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：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

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

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本。

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

本基金根据基金合同的约定，不允许投资国债期货。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

公允价值变动总额合计（元）	—
国债期货投资本期收益（元）	—
国债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

本基金本报告期末未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 申明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现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。

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体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 申明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在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	309,101.53
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	11,596.38
5	应收申购款	3,697,012.76
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	4,017,710.67

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：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(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002027	分众传媒	6,735,000.00	1.16	大宗交易限售股票

注：本基金本报告期末持有分众传媒（股票代码 002027）公允价值为 29,156,273.60 元，其中大宗交易限售股票部分公允价值为 6,735,000.00 元，剩余部分为正常流通股。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分。

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例

			(%)		(%)
16,550	24,870.31	38,071,375.65	9.25	373,532,196.26	90.75

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（%）
基金管理公司所有从业人员持有本基金	401,281.61	0.0975

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	0~10
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(2015年12月18日)基金份额总额	1,077,330,023.06
报告期期初基金份额总额	477,953,169.88
本报告期基金总申购份额	358,929,053.10
减：本报告期基金总赎回份额	425,278,651.07
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	411,603,571.91

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金没有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

本报告期内本基金托管人于2017年9月1日发布公告，聘任纪伟为中国建设银行资产托管业务部总经理。

本报告期本基金管理人于2017年4月20日在中国证券报、上海证券报、证券时报及公司网站上做公告，范伟隽先生不再担任本公司督察长，由赵瑛女士出任公司督察长。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金资产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略无改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内基金管理人没有改聘为其审计的会计师事务所。本基金本年度支付给审计机构安永华明会计师事务所的报酬为8万元人民币，其已提供审计服务的连续年限为15年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

11.7 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		债券交易		债券回购交易		权证交易		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 (%)	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 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
安信证券	2	309,085,435.71	3.77	—	—	—	—	—	—	284,203.06	3.79	
渤海证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
长城证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
长江证券	2	1,498,719,373.81	18.27	806,625.00	100.00	10,500,000.00	39.33	—	—	1,365,783.08	18.20	
东北证券	2	55,514,073.83	0.68	—	—	6,200,000.00	23.22	—	—	50,590.32	0.67	
东财证券	2	647,444,955.72	7.89	—	—	—	—	—	—	590,016.32	7.86	
高华证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
光大证券	2	324,020,267.79	3.95	—	—	—	—	—	—	295,280.23	3.94	
广发证券	2	254,342,712.26	3.10	—	—	—	—	—	—	231,782.54	3.09	
国海证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
国泰君安	2	362,944,347.18	4.43	—	—	—	—	—	—	334,974.04	4.46	
国信证券	1	500,252,994.26	6.10	—	—	—	—	—	—	455,882.89	6.08	
海通证券	2	621,532,310.36	7.58	—	—	—	—	—	—	571,447.40	7.62	
华泰证券	1	288,772,242.55	3.52	—	—	—	—	—	—	263,158.54	3.51	
华信证券	2	1,436,239,172.31	17.51	—	—	—	—	—	—	1,308,844.08	17.44	

平安证券	2	139,778,588.60	1.70	—	—	—	—	—	—	127,380.36	1.70
瑞银证券	2	44,482,453.42	0.54	—	—	—	—	—	—	40,536.83	0.54
上海证券	1	52,934,627.28	0.65	—	—	—	—	—	—	49,298.17	0.66
申万宏源	1	141,745,665.33	1.73	—	—	—	—	—	—	132,007.66	1.76
太平洋证券	2	19,121,388.45	0.23	—	—	5,200,000.00	19.48	—	—	17,425.29	0.23
天风证券	2	476,371,580.80	5.81	—	—	4,800,000.00	17.98	—	—	434,114.00	5.79
西南证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
湘财证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
信达证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
兴业证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
招商证券	1	262,751,985.29	3.20	—	—	—	—	—	—	239,446.30	3.19
中金公司	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
中泰证券	2	120,705,139.90	1.47	—	—	—	—	—	—	110,000.16	1.47
中信建投	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
中信山东	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
中信证券	1	645,227,753.72	7.87	—	—	—	—	—	—	600,900.98	8.01
中银国际	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—

注：我对基金交易单元的选择是综合考虑券商的研究能力及其它相关因素后决定的。本报告期本基金退租券商交易单元：中投证券（22347），德邦证券（24228）。本报告期本基金新增券商交易单元：天风证券（003793、38652），瑞银证券（38166、004183），平安证券（002294、38173）。其余租用券商交易单元未发生变动。

§ 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

注：本基金本报告期无单一投资者持有基金份额达到或超过 20%的情况。