

富国宏观策略灵活配置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	富国宏观策略灵活配置混合
基金主代码	000029
交易代码	前端交易代码：000029 后端交易代码：000161
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年04月12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	178,566,189.95份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金力争通过灵活合理的大类资产配置与专业的个券选择，实现基金资产较高的长期回报。
投资策略	本基金将采用“自上而下”与“自下而上”相结合的主动投资管理策略，将定性分析与定量分析贯穿于资产配置、行业细分、公司价值评估以及组合风险管理全过程中。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×65%+中债综合指数收益率×35%
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楼

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
本期已实现收益	48,965,471.54	-17,715,272.77	168,446,191.58
本期利润	64,903,073.68	-25,583,802.57	147,861,915.10
加权平均基金份额本期利润	0.4130	-0.1743	0.5954
本期基金份额净值增长率	30.78%	-10.36%	38.21%
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	0.7594	0.3452	0.6057
期末基金资产净值	314,178,278.84	186,782,410.95	247,576,154.07
期末基金份额净值	1.759	1.345	1.606

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	13.63%	0.96%	3.16%	0.52%	10.47%	0.44%
过去六个月	26.64%	0.91%	6.56%	0.45%	20.08%	0.46%
过去一年	30.78%	0.89%	13.89%	0.42%	16.89%	0.47%
过去三年	62.02%	1.59%	15.53%	1.09%	46.49%	0.50%
自基金合同生效日起至今	103.48%	1.44%	50.56%	1.01%	52.92%	0.43%

注：根据基金合同中投资策略及投资限制的有关规定，本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率×65%+中债综合指数收益率×35%。

沪深300指数是由上海证券交易所和深圳证券交易所授权，由中证指数有限公司开发的中国A股市场指数，其成份股票为中国A股市场中代表性强、流动性高、

流通市值大的主流股票，能够反映 A 股市场总体价格走势。中债综合指数是由中央国债登记结算有限公司编制的具有代表性的债券市场指数。根据本基金的投资范围和投资比例，选用上述业绩比较基准能够客观、合理地反映本基金的风险收益特征。

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：

$$\text{benchmark}_t = 65\% * [\text{沪深 300 指数}_t / (\text{沪深 300 指数}_{t-1}) - 1] + 35\% * [\text{中债综合指数}_t / (\text{中债综合指数}_{t-1}) - 1];$$

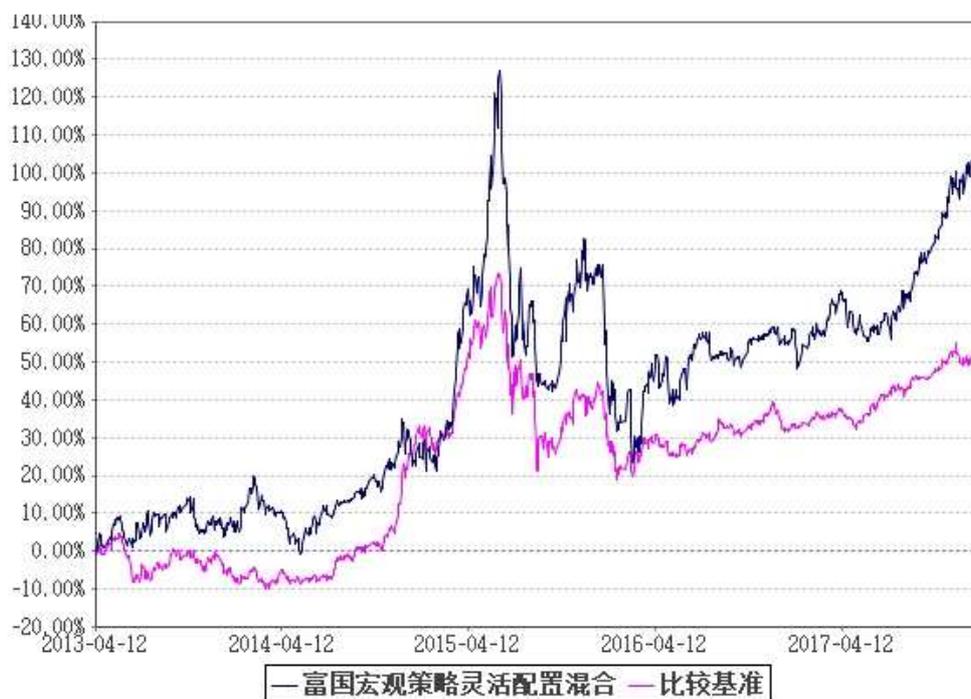
其中，t=1, 2, 3, ..., T, T 表示时间截至日；

期间 T 日收益率（benchmark_T）按下列公式计算：

$$\text{benchmark}_T = [\prod_{t=1}^T (1 + \text{benchmark}_t)] - 1$$

其中，T=2, 3, 4, ...； $\prod_{t=1}^T (1 + \text{benchmark}_t)$ 表示 t 日至 T 日的 (1+benchmark_t) 数学连乘。

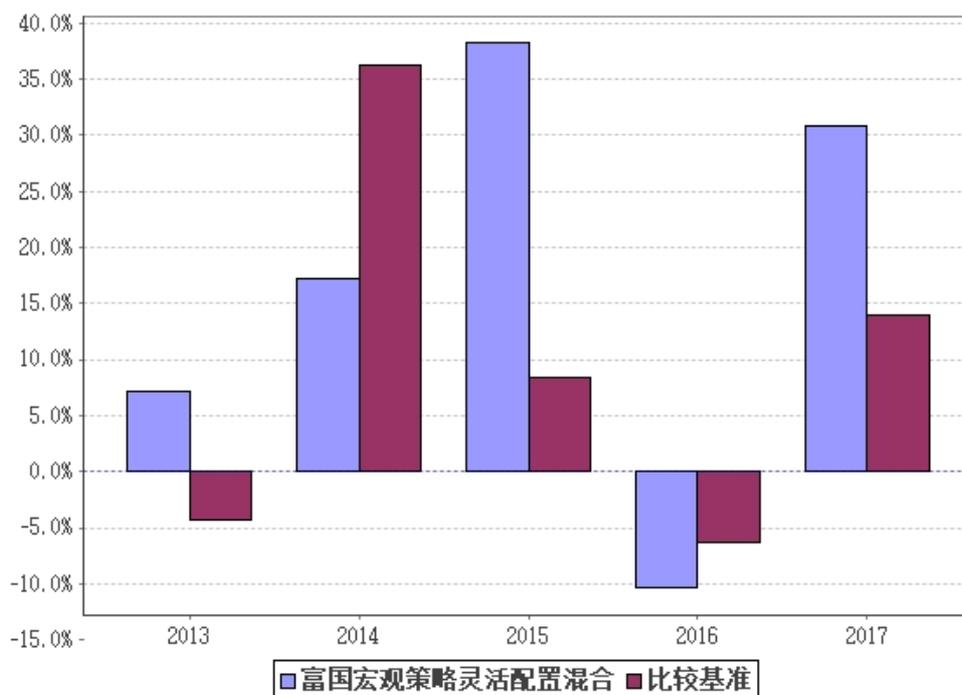
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、截止日期为 2017 年 12 月 31 日。

2、本基金于 2013 年 4 月 12 日成立，建仓期 6 个月，从 2013 年 4 月 12 日起至 2013 年 10 月 11 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：2013 年按实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2017年	—	—	—	—	—
2016年	0.950	11,203,057.45	1,735,327.45	12,938,384.90	1次分红
2015年	—	—	—	—	—
合计	0.950	11,203,057.45	1,735,327.45	12,938,384.90	—

§ 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		
袁宜	本基金基金经理兼任权益投资副总监、富国天盛灵活配置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基金经理	2013-04-12	—	11	博士，曾任申银万国证券研究所有限公司宏观分析师、高级宏观分析师、高级策略分析师、首席策略分析师；2011年3月加入富国基金管理有限公司，任首席经济学家兼基金经理助理；2012年10月至2014年4月29日任汉盛证券投资基金基金经理，2013年4月起任富国宏观策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2014年4月30日起任富国天盛灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2016年9月起任富国睿利定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理；兼任权益投资副总监。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遵规守信情况的说明

本报告期，富国基金管理有限公司作为富国宏观策略灵活配置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》、《富国宏观策略灵活配置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，以尽可能减少和分散投资风险，确保基金资产的安全并谋求基金资产长期稳定的增长为目标，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1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，中国经济在外需和库存回补的拉动下，增长稳健，同时受益于供给侧结构性改革，企业利润大幅增长。沪深主板指数全年呈现震荡上行态势，仅在4月和11月因受到金融监管的影响而出现一定的调整。同时，全年的风格差异极为显著。在机构投资者，特别是海外资金的引领下，白马蓝筹表现优异，享受了估值和业绩的双重收益，而中小创则表现低迷。本基金主要以偏白马的配置为底仓，在一到四季度分别阶段性地参与了一带一路、新能源车、周期品、5G和民营炼化等主题，取得了一定的超额收益。

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1.759元；份额累计净值为1.954元；本报告期，本基金份额净值增长率为30.78%，同期业绩比较基准收益率为13.89%

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2018年，从全球来看，海外主要经济体有望呈现同步复苏的态势，这将为中国经济和股市提供良好的外部环境。从国内来看，在去杠杆和强监管的政策影响下，可能会对经济和股市造成阶段性的冲击。预计2018年A股市场的整体表现将同步于上市公司的业绩增速，同时，波动性会高于2017年。此外，在改革开放40周年和下半年将召开十九届三中全会的预期下，改革主题有望活跃。

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：富国宏观策略灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2017年12月31日

单位：人民币元

资产	本期末 (2017年12月31日)	上年度末 (2016年12月31日)
资产：		
银行存款	22,991,465.34	20,491,208.46
结算备付金	1,884,583.96	1,459,879.99
存出保证金	201,942.22	252,358.69
交易性金融资产	208,885,844.79	161,869,841.89
其中：股票投资	198,892,844.79	151,879,841.89
基金投资	—	—
债券投资	9,993,000.00	9,990,000.00
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	60,000,000.00	—
应收证券清算款	27,100,551.53	4,754,795.43
应收利息	360,484.05	194,074.01
应收股利	—	—
应收申购款	1,799,446.14	243,407.79
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	—
资产总计	323,224,318.03	189,265,566.26
负债和所有者权益	本期末	上年度末
	(2017年12月31日)	(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	6,892,367.86	1,204,387.21
应付赎回款	763,031.19	228,469.39
应付管理人报酬	388,561.13	238,690.18
应付托管费	64,760.18	39,781.67
应付销售服务费	—	—
应付交易费用	804,443.17	630,965.83
应交税费	—	—
应付利息	—	—
应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	132,875.66	140,861.03
负债合计	9,046,039.19	2,483,155.31
所有者权益:		
实收基金	178,566,189.95	138,850,507.45
未分配利润	135,612,088.89	47,931,903.50
所有者权益合计	314,178,278.84	186,782,410.95
负债和所有者权益总计	323,224,318.03	189,265,566.26

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.759 元，基金份额总额 178,566,189.95 份。

7.2 利润表

会计主体：富国宏观策略灵活配置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	上年度可比期间
-----	----	---------

	(2017年01月01日至 2017年12月31日)	(2016年01月01日至 2016年12月31日)
一、收入	73,937,682.61	-16,992,369.56
1. 利息收入	879,392.56	705,709.37
其中：存款利息收入	257,954.40	321,279.92
债券利息收入	291,033.48	268,244.26
资产支持证券利息收入	—	—
买入返售金融资产收入	330,404.68	116,185.19
其他利息收入	—	—
2. 投资收益（损失以“-”填列）	57,022,622.61	-9,968,172.84
其中：股票投资收益	56,289,903.64	-10,602,597.59
基金投资收益	—	—
债券投资收益	26,379.46	-43,322.86
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	706,339.51	677,747.61
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	15,937,602.14	-7,868,529.80
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	—	—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	98,065.30	138,623.71
减：二、费用	9,034,608.93	8,591,433.01
1. 管理人报酬	3,464,342.82	2,977,168.07
2. 托管费	577,390.47	496,194.65
3. 销售服务费	—	—
4. 交易费用	4,755,822.58	4,868,247.72
5. 利息支出	—	—
其中：卖出回购金融资产支出	—	—
6. 其他费用	237,053.06	249,822.57
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	64,903,073.68	-25,583,802.57
减：所得税费用	—	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	64,903,073.68	-25,583,802.57

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：富国宏观策略灵活配置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）	138,850,507.45	47,931,903.50	186,782,410.95

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	64,903,073.68	64,903,073.68
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）	39,715,682.50	22,777,111.71	62,492,794.21
其中：1. 基金申购款	92,531,593.45	48,432,443.29	140,964,036.74
2. 基金赎回款	-52,815,910.95	-25,655,331.58	-78,471,242.53
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）	178,566,189.95	135,612,088.89	314,178,278.84
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）	154,183,053.01	93,393,101.06	247,576,154.07
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-25,583,802.57	-25,583,802.57
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）	-15,332,545.56	-6,939,010.09	-22,271,555.65
其中：1. 基金申购款	64,950,814.51	23,637,909.08	88,588,723.59
2. 基金赎回款	-80,283,360.07	-30,576,919.17	-110,860,279.24
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）	-	-12,938,384.90	-12,938,384.90
五、期末所有者权益（基金净值）	138,850,507.45	47,931,903.50	186,782,410.95

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及、《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	222,833,019.83	7.07	137,735,331.22	4.27
申万宏源	77,529,005.67	2.46	144,193,658.63	4.47

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	30,000,000.00	5.76	20,000,000.00	3.51
申万宏源	—	—	6,000,000.00	1.05

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	205,242.36	7.12	85,258.82	10.60
申万宏源	72,202.79	2.50	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（%）
海通证券	125,954.18	4.27	8,914.06	1.41
申万宏源	134,288.33	4.55	15,355.56	2.43

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。

7.4.4.2 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	3,464,342.82	2,977,168.07
其中：支付销售机构的客户维护费	805,613.52	709,273.21

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

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	577,390.47	496,194.65

注：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	22,991,465.34	229,648.19	20,491,208.46	284,687.58

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
002027	分众传媒	2017-08-18	2018-02-22	大宗交易	8.60	13.52	350,000	3,010,000.00	4,732,000.00	—
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	—
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	—
603080	新疆火炬	2017-12-25	2018-01-03	新股认购	13.60	13.60	1,187	16,143.20	16,143.20	—
603161	科华控股	2017-12-28	2018-01-05	新股认购	16.75	16.75	1,239	20,753.25	20,753.25	—

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	—
601600	中国铝业	2017-09-12	重大事项停牌	6.67	2018-02-26	7.28	562,600	4,060,862.00	3,752,542.00	—

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 190,293,907.14 元，属于第二层次的余额为人民币 13,859,937.65 元，属于第三层次余额为人民币 4,732,000.00 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 145,033,358.81 元，属于第二层次的余额为人民币 16,836,483.08 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：

上年度末余额人民币 0.00 元，2017 年度转入第三层次人民币 3,010,000.00 元，转出第三层次人民币 0.00 元，当期计入损益的利得或损失总额人民币 1,722,000.00 元，购买人民币 0.00 元，卖出人民币 0.00 元，本期末人民币 4,732,000.00 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人民币 1,722,000.00 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	198,892,844.79	61.53
	其中：股票	198,892,844.79	61.53
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	9,993,000.00	3.09
	其中：债券	9,993,000.00	3.09
	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	60,000,000.00	18.56
	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	24,876,049.30	7.70
8	其他各项资产	29,462,423.94	9.12
9	合计	323,224,318.03	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	24,825,469.00	7.90
C	制造业	141,771,986.01	45.12
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,143.20	0.01
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	1,104,450.00	0.35
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	—	—
J	金融业	9,034,180.00	2.88
K	房地产业	5,993,423.12	1.91
L	租赁和商务服务业	15,647,482.26	4.98
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	499,711.20	0.16
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	198,892,844.79	63.31

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	600519	贵州茅台	28,000	19,529,720.00	6.22
2	002027	分众传媒	1,002,800	13,923,424.00	4.43
3	601233	桐昆股份	440,915	9,916,178.35	3.16
4	000858	五粮液	115,500	9,226,140.00	2.94
5	600522	中天科技	642,100	8,950,874.00	2.85
6	601601	中国太保	196,000	8,118,320.00	2.58
7	600487	亨通光电	182,410	7,373,012.20	2.35
8	000568	泸州老窖	111,700	7,372,200.00	2.35
9	600703	三安光电	240,821	6,114,445.19	1.95
10	002390	信邦制药	689,114	5,823,013.30	1.85

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	600487	亨通光电	25,687,902.88	13.75
2	601318	中国平安	24,647,792.82	13.20
3	000789	万年青	23,481,252.53	12.57
4	600801	华新水泥	22,590,358.85	12.09
5	600519	贵州茅台	21,291,313.00	11.40
6	000858	五粮液	19,465,112.00	10.42
7	600703	三安光电	19,406,348.90	10.39
8	601601	中国太保	18,816,693.42	10.07
9	600522	中天科技	18,434,076.63	9.87
10	600887	伊利股份	17,154,128.52	9.18
11	002027	分众传媒	16,713,438.68	8.95
12	600585	海螺水泥	16,359,396.23	8.76
13	600782	新钢股份	15,818,124.00	8.47
14	000651	格力电器	15,034,146.86	8.05
15	000807	云铝股份	13,709,320.29	7.34
16	600595	中孚实业	13,232,528.70	7.08
17	002456	欧菲科技	12,491,942.18	6.69
18	000933	神火股份	11,872,601.25	6.36
19	601600	中国铝业	11,804,838.00	6.32
20	000063	中兴通讯	11,679,804.00	6.25
21	600066	宇通客车	11,368,717.80	6.09
22	601888	中国国旅	11,179,783.94	5.99
23	002110	三钢闽光	11,121,977.85	5.95
24	000333	美的集团	10,808,776.98	5.79
25	002450	康得新	10,725,232.07	5.74
26	000983	西山煤电	10,239,871.59	5.48
27	000568	泸州老窖	10,097,823.00	5.41
28	601233	桐昆股份	10,009,478.26	5.36
29	300070	碧水源	9,952,695.00	5.33
30	002236	大华股份	9,924,498.00	5.31
31	600338	西藏珠峰	9,554,101.00	5.12
32	300133	华策影视	9,363,808.28	5.01
33	601225	陕西煤业	9,135,704.00	4.89

34	600348	阳泉煤业	8,933,804.00	4.78
35	002008	大族激光	8,916,181.00	4.77
36	601336	新华保险	8,542,763.00	4.57
37	000639	西王食品	8,514,437.10	4.56
38	600449	宁夏建材	8,474,397.04	4.54
39	000886	海南高速	8,435,891.96	4.52
40	002304	洋河股份	8,368,767.00	4.48
41	002460	赣锋锂业	8,115,373.17	4.34
42	600231	凌钢股份	8,052,338.00	4.31
43	300310	宜通世纪	8,016,301.80	4.29
44	002384	东山精密	8,016,262.00	4.29
45	601398	工商银行	7,984,453.00	4.27
46	601328	交通银行	7,874,920.00	4.22
47	002466	天齐锂业	7,815,876.00	4.18
48	002390	信邦制药	7,716,472.84	4.13
49	002415	海康威视	7,554,899.00	4.04
50	300308	中际旭创	7,472,197.00	4.00
51	603626	科森科技	7,368,766.14	3.95
52	000423	东阿阿胶	7,292,961.00	3.90
53	002001	新和成	7,216,791.00	3.86
54	603938	三孚股份	7,144,560.00	3.83
55	603589	口子窖	7,123,810.00	3.81
56	002635	安洁科技	7,081,743.00	3.79
57	300274	阳光电源	7,047,279.20	3.77
58	300122	智飞生物	6,875,052.00	3.68
59	601988	中国银行	6,782,451.00	3.63
60	600208	新湖中宝	6,720,176.12	3.60
61	002036	联创电子	6,681,163.51	3.58
62	000537	广宇发展	6,617,944.00	3.54
63	600720	祁连山	6,559,062.00	3.51
64	000786	北新建材	6,553,774.00	3.51
65	601636	旗滨集团	6,544,889.00	3.50
66	600426	华鲁恒升	6,453,560.50	3.46
67	002051	中工国际	6,386,997.50	3.42
68	600188	兖州煤业	6,375,684.00	3.41
69	002050	三花智控	6,357,989.35	3.40
70	002116	中国海诚	6,354,396.00	3.40
71	300121	阳谷华泰	6,179,897.53	3.31
72	002217	合力泰	6,146,418.00	3.29
73	300601	康泰生物	6,144,534.61	3.29
74	600068	葛洲坝	6,077,600.56	3.25

75	600521	华海药业	6,047,374.00	3.24
76	300197	铁汉生态	5,992,074.96	3.21
77	600581	八一钢铁	5,970,419.00	3.20
78	000612	焦作万方	5,945,260.16	3.18
79	600176	中国巨石	5,855,981.56	3.14
80	600889	南京化纤	5,842,932.00	3.13
81	000703	恒逸石化	5,748,275.10	3.08
82	600259	广晟有色	5,723,354.00	3.06
83	600990	四创电子	5,697,552.00	3.05
84	600555	海航创新	5,672,591.00	3.04
85	300236	上海新阳	5,550,976.00	2.97
86	601117	中国化学	5,545,758.00	2.97
87	000761	本钢板材	5,526,158.59	2.96
88	603799	华友钴业	5,518,488.00	2.95
89	002366	台海核电	5,504,319.10	2.95
90	002493	荣盛石化	5,396,194.00	2.89
91	000596	古井贡酒	5,371,065.00	2.88
92	300481	濮阳惠成	5,332,107.00	2.85
93	600518	康美药业	5,265,078.00	2.82
94	600346	恒力股份	5,244,316.00	2.81
95	300408	三环集团	5,239,632.69	2.81
96	002271	东方雨虹	5,213,359.77	2.79
97	002343	慈文传媒	5,178,658.00	2.77
98	000615	京汉股份	5,144,724.01	2.75
99	601800	中国交建	5,139,682.00	2.75
100	603638	艾迪精密	5,083,768.00	2.72
101	600967	内蒙一机	4,971,634.58	2.66
102	600502	安徽水利	4,916,014.00	2.63
103	601628	中国人寿	4,894,934.72	2.62
104	300271	华宇软件	4,804,720.00	2.57
105	000538	云南白药	4,765,979.00	2.55
106	300207	欣旺达	4,720,286.74	2.53
107	600110	诺德股份	4,708,997.00	2.52
108	600963	岳阳林纸	4,633,745.40	2.48
109	000963	华东医药	4,622,384.00	2.47
110	000582	北部湾港	4,540,215.00	2.43
111	002045	国光电器	4,533,684.03	2.43
112	300065	海兰信	4,497,372.50	2.41
113	000725	京东方A	4,492,773.00	2.41
114	300457	赢合科技	4,462,621.00	2.39
115	600309	万华化学	4,421,091.00	2.37

116	002555	三七互娱	4,394,145.00	2.35
117	000401	冀东水泥	4,393,222.00	2.35
118	300058	蓝色光标	4,391,340.00	2.35
119	002431	棕榈股份	4,382,810.00	2.35
120	002138	顺络电子	4,367,406.00	2.34
121	002430	杭氧股份	4,364,406.00	2.34
122	600337	美克家居	4,360,697.95	2.33
123	300130	新国都	4,355,930.00	2.33
124	300413	快乐购	4,217,119.22	2.26
125	000976	华铁股份	4,208,816.13	2.25
126	002285	世联行	4,153,982.00	2.22
127	300545	联得装备	4,122,109.00	2.21
128	000630	铜陵有色	3,952,975.00	2.12
129	600549	厦门钨业	3,945,674.00	2.11
130	600808	马钢股份	3,941,911.00	2.11
131	600436	片仔癀	3,931,541.00	2.10
132	300418	昆仑万维	3,926,849.00	2.10
133	002712	思美传媒	3,924,404.14	2.10
134	000709	河钢股份	3,860,975.00	2.07
135	300450	先导智能	3,844,771.17	2.06
136	600028	中国石化	3,822,819.00	2.05
137	002174	游族网络	3,769,907.48	2.02

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	601318	中国平安	26,675,918.82	14.28
2	000789	万年青	24,523,472.18	13.13
3	600801	华新水泥	24,408,472.97	13.07
4	600487	亨通光电	23,932,753.60	12.81
5	600703	三安光电	19,502,481.99	10.44
6	000858	五粮液	18,045,555.14	9.66
7	600782	新钢股份	15,911,835.37	8.52
8	000807	云铝股份	15,870,564.64	8.50
9	600887	伊利股份	15,498,898.33	8.30
10	000651	格力电器	15,209,184.64	8.14
11	600585	海螺水泥	14,968,091.50	8.01
12	000423	东阿阿胶	14,564,926.51	7.80
13	600595	中孚实业	14,086,773.32	7.54
14	000063	中兴通讯	13,788,919.00	7.38
15	600519	贵州茅台	13,734,008.54	7.35
16	002456	欧菲科技	13,548,305.67	7.25

17	000933	神火股份	13,361,748.20	7.15
18	002110	三钢闽光	11,919,567.37	6.38
19	002450	康得新	11,881,421.46	6.36
20	000333	美的集团	11,542,821.72	6.18
21	601888	中国国旅	11,484,973.79	6.15
22	600066	宇通客车	11,071,993.65	5.93
23	601601	中国太保	10,947,282.68	5.86
24	600338	西藏珠峰	10,528,979.00	5.64
25	002008	大族激光	10,303,998.88	5.52
26	600522	中天科技	9,980,306.00	5.34
27	300070	碧水源	9,813,939.77	5.25
28	002460	赣锋锂业	9,438,405.93	5.05
29	002384	东山精密	9,311,672.91	4.99
30	300133	华策影视	9,224,482.11	4.94
31	002236	大华股份	8,951,409.03	4.79
32	000639	西王食品	8,574,081.41	4.59
33	600449	宁夏建材	8,485,805.26	4.54
34	601600	中国铝业	8,400,642.50	4.50
35	601336	新华保险	8,390,343.08	4.49
36	601398	工商银行	8,282,480.00	4.43
37	600231	凌钢股份	8,268,117.00	4.43
38	002466	天齐锂业	8,102,606.39	4.34
39	002366	台海核电	8,100,805.03	4.34
40	300310	宜通世纪	7,921,164.71	4.24
41	000630	铜陵有色	7,605,957.18	4.07
42	601328	交通银行	7,580,422.00	4.06
43	603626	科森科技	7,503,587.09	4.02
44	000983	西山煤电	7,446,093.19	3.99
45	000976	华铁股份	7,442,529.33	3.98
46	300207	欣旺达	7,408,402.06	3.97
47	300308	中际旭创	7,400,307.64	3.96
48	300274	阳光电源	7,335,221.93	3.93
49	600208	新潮中宝	7,295,759.00	3.91
50	002635	安洁科技	7,213,898.55	3.86
51	002415	海康威视	7,154,731.89	3.83
52	000537	广宇发展	7,098,008.00	3.80
53	600521	华海药业	6,999,038.39	3.75
54	002174	游族网络	6,988,622.37	3.74
55	600259	广晟有色	6,791,959.40	3.64
56	600889	南京化纤	6,765,708.72	3.62
57	300121	阳谷华泰	6,744,194.88	3.61

58	601988	中国银行	6,743,301.32	3.61
59	002036	联创电子	6,733,681.10	3.61
60	300197	铁汉生态	6,729,983.02	3.60
61	002050	三花智控	6,680,349.85	3.58
62	000612	焦作万方	6,660,046.10	3.57
63	600720	祁连山	6,595,145.00	3.53
64	600068	葛洲坝	6,499,232.13	3.48
65	002051	中工国际	6,448,926.37	3.45
66	000615	京汉股份	6,346,875.24	3.40
67	300457	赢合科技	6,198,531.84	3.32
68	002217	合力泰	6,176,737.45	3.31
69	300450	先导智能	6,168,723.11	3.30
70	000568	泸州老窖	6,156,753.05	3.30
71	002116	中国海诚	6,130,139.91	3.28
72	600348	阳泉煤业	6,058,529.11	3.24
73	600141	兴发集团	6,029,496.63	3.23
74	600309	万华化学	5,950,379.00	3.19
75	000596	古井贡酒	5,933,316.69	3.18
76	002027	分众传媒	5,903,254.78	3.16
77	000538	云南白药	5,847,981.42	3.13
78	600990	四创电子	5,749,967.48	3.08
79	002271	东方雨虹	5,635,630.55	3.02
80	002304	洋河股份	5,624,985.00	3.01
81	600581	八一钢铁	5,585,991.88	2.99
82	600809	山西汾酒	5,570,781.99	2.98
83	300408	三环集团	5,550,593.42	2.97
84	600518	康美药业	5,460,601.65	2.92
85	601117	中国化学	5,355,602.53	2.87
86	000761	本钢板材	5,321,068.38	2.85
87	300122	智飞生物	5,187,228.76	2.78
88	603799	华友钴业	5,184,831.00	2.78
89	002343	慈文传媒	5,169,795.49	2.77
90	300481	濮阳惠成	5,157,975.65	2.76
91	002045	国光电器	5,142,148.90	2.75
92	601800	中国交建	5,095,788.54	2.73
93	002431	棕榈股份	5,067,541.89	2.71
94	603589	口子窖	5,021,009.00	2.69
95	600110	诺德股份	5,006,498.00	2.68
96	601628	中国人寿	4,998,054.24	2.68
97	300271	华宇软件	4,926,295.00	2.64
98	000786	北新建材	4,874,251.26	2.61

99	600038	中直股份	4,830,957.94	2.59
100	600337	美克家居	4,768,845.35	2.55
101	300236	上海新阳	4,646,115.45	2.49
102	000709	河钢股份	4,635,106.50	2.48
103	002430	杭氧股份	4,632,148.00	2.48
104	600963	岳阳林纸	4,592,465.94	2.46
105	600409	三友化工	4,588,220.81	2.46
106	002001	新和成	4,544,370.00	2.43
107	000963	华东医药	4,487,335.38	2.40
108	000915	山大华特	4,451,687.70	2.38
109	000401	冀东水泥	4,422,323.49	2.37
110	603638	艾迪精密	4,421,827.60	2.37
111	600967	内蒙一机	4,381,162.54	2.35
112	002555	三七互娱	4,369,194.71	2.34
113	000886	海南高速	4,361,046.00	2.33
114	600555	海航创新	4,327,961.71	2.32
115	002138	顺络电子	4,276,878.87	2.29
116	300601	康泰生物	4,258,311.86	2.28
117	300059	东方财富	4,247,335.10	2.27
118	600549	厦门钨业	4,239,931.00	2.27
119	300058	蓝色光标	4,161,091.74	2.23
120	600392	盛和资源	4,133,171.00	2.21
121	002285	世联行	4,072,344.92	2.18
122	600426	华鲁恒升	4,062,417.22	2.17
123	002281	光迅科技	4,007,739.43	2.15
124	600808	马钢股份	3,991,420.96	2.14
125	300065	海兰信	3,976,882.00	2.13
126	300418	昆仑万维	3,939,271.00	2.11
127	000582	北部湾港	3,937,318.35	2.11
128	600072	中船科技	3,870,256.18	2.07
129	002511	中顺洁柔	3,839,532.50	2.06
130	300545	联得装备	3,835,582.46	2.05
131	600502	安徽水利	3,820,589.13	2.05
132	300115	长盈精密	3,813,420.84	2.04
133	002542	中化岩土	3,779,832.66	2.02
134	600855	航天长峰	3,777,721.00	2.02
135	002502	骅威文化	3,772,222.12	2.02
136	603938	三孚股份	3,764,070.00	2.02

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	1,567,378,708.80
--------------	------------------

卖出股票收入（成交）总额	1,592,571,781.68
--------------	------------------

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	9,993,000.00	3.18
	其中：政策性金融债	9,993,000.00	3.18
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	可转债（可交换债）	—	—
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	9,993,000.00	3.18

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	170203	17 国开 03	100,000	9,993,000.00	3.18

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	201,942.22
2	应收证券清算款	27,100,551.53
3	应收股利	—
4	应收利息	360,484.05
5	应收申购款	1,799,446.14
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	29,462,423.94

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	4,732,000.00	1.51	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 13,923,424.00 元，其中大宗交易限售股票部分公允价值为 4,732,000.00 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(%)
7,698	23,196.44	87,928,569.62	49.24	90,637,620.33	50.76

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	586,844.21	0.3286

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	10~50

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(2013年04月12日)基金份额总额	985,181,503.69
报告期期初基金份额总额	138,850,507.45
本报告期基金总申购份额	92,531,593.45
减：本报告期基金总赎回份额	52,815,910.95
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	178,566,189.95

§ 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5万元人民币，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	120,333,770.21	3.82	—	—	—	—	—	—	110,444.37	3.83	
渤海证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
长城证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
长江证券	2	660,661,686.83	20.95	—	—	304,500,000.00	58.50	—	—	602,060.12	20.88	
东北证券	2	46,083,153.00	1.46	—	—	9,000,000.00	1.73	—	—	41,995.70	1.46	
东财证券	2	312,595,256.42	9.91	—	—	70,000,000.00	13.45	—	—	284,868.13	9.88	
高华证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
光大证券	2	108,921,640.45	3.45	—	—	—	—	—	—	99,259.94	3.44	
广发证券	2	96,580,366.99	3.06	—	—	—	—	—	—	88,013.78	3.05	
国海证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
国泰君安	2	95,879,100.71	3.04	—	—	60,000,000.00	11.53	—	—	88,751.97	3.08	
国信证券	1	283,229,094.37	8.98	—	—	—	—	—	—	258,107.40	8.95	
海通证券	2	222,833,019.83	7.07	—	—	30,000,000.00	5.76	—	—	205,242.36	7.12	
华泰证券	1	125,159,065.10	3.97	—	—	—	—	—	—	114,057.63	3.96	
华信证券	2	390,488,903.28	12.38	47,581.02	100.00	—	—	—	—	355,852.55	12.34	

平安证券	2	47,247,458.71	1.50	—	—	—	—	—	—	43,056.28	1.49
瑞银证券	2	40,253,648.64	1.28	—	—	—	—	—	—	36,682.80	1.27
上海证券	1	4,776,821.90	0.15	—	—	—	—	—	—	4,448.59	0.15
申万宏源	1	77,529,005.67	2.46	—	—	—	—	—	—	72,202.79	2.50
太平洋证券	2	5,172,114.06	0.16	—	—	—	—	—	—	4,713.30	0.16
天风证券	2	225,433,244.19	7.15	—	—	36,000,000.00	6.92	—	—	205,436.42	7.12
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	55,279,388.97	1.75	—	—	—	—	—	—	50,376.00	1.75
中金公司	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
中泰证券	2	65,445,262.55	2.08	—	—	8,000,000.00	1.54	—	—	59,639.84	2.07
中信建投	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
中信山东	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
中信证券	1	169,830,405.25	5.39	—	—	3,000,000.00	0.58	—	—	158,163.86	5.49
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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2017-01-01 至 2017-04-09	30,500,363.11	-	-	30,500,363.11	17.08%
产品特有风险							
<p>本基金于本报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情形，本基金管理人已经采取措施，审慎确认大额申购与大额赎回，防控产品流动性风险并公平对待投资者。本基金管理人提请投资者注意因单一投资者持有基金份额集中导致的产品流动性风险、大额赎回风险以及净值波动风险等特有风险。</p>							