

# 华融新锐灵活配置混合型证券投资基金 2017 年年度报告 摘要

2017 年 12 月 31 日

基金管理人：华融证券股份有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2018 年 3 月 29 日

## § 1 重要提示

### 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。基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 3 月 09 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中的财务资料经审计，德勤会计师事务所为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	华融新锐混合
场内简称	-
基金主代码	001068
前端交易代码	-
后端交易代码	-
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 4 月 15 日
基金管理人	华融证券股份有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	171,087,582.67 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	-
上市日期	-

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在有效控制组合风险的前提下获取超越业绩比较基准的稳健收益。
投资策略	<p>本基金将采取积极主动的资产配置策略，注重风险与收益的平衡，选择适应经济转型升级、能够为股东持续创造价值的优质标的，运用多样化的投资策略实行组合管理，实现基金资产的长期增值。</p> <p>1、资产配置策略</p> <p>从全球经济格局和中国经济发展方式的变化，分析经济的驱动力和阶段性特征，结合宏观政策、产业政策、结构变迁、市场情绪等对比分析大类资产风险收益比，合理分配各大类资产配置比例，以实现基金资产的稳健增值。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>本基金的股票投资秉承价值投资理念，采取定量和定性相结合的方法，深挖符合经济升级转型、发展潜力巨大的行业与公司，通过上下游产业链的实地调研对研究逻辑和结论进行验证，灵活运用多种低风险投资策略，把握市场投资机会。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>本基金将自上而下地在利率走势分析、债券供求分析基础上，灵活采用类属配置、个券选择、套利等投资</p>

	策略。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×50%+中证全债指数收益率×50%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于中等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		华融证券股份有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	徐乾山	贺倩
	联系电话	010-85556728	010-66060069
	电子邮箱	xuqianshan@hrsec.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-898-9999	95599
传真		010-85556592	010-68121816

## 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.fund.hrsec.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2017 年	2016 年	2015年4月15日(基金合同生效日)-2015年12月31日
本期已实现收益	6,676,538.86	-29,770,975.78	18,552,596.49
本期利润	19,058,578.05	-28,784,017.97	16,821,554.41
加权平均基金份额本期利润	0.0938	-0.1121	0.0292
本期基金份额净值增长率	10.08%	-10.25%	-0.50%
3.1.2 期末数据和指标	2017 年末	2016 年末	2015 年末
期末可供分配基金份额利润	-0.0915	-0.1211	-0.0174
期末基金资产净值	168,151,018.97	205,274,577.54	282,070,321.87
期末基金份额净值	0.983	0.893	0.995

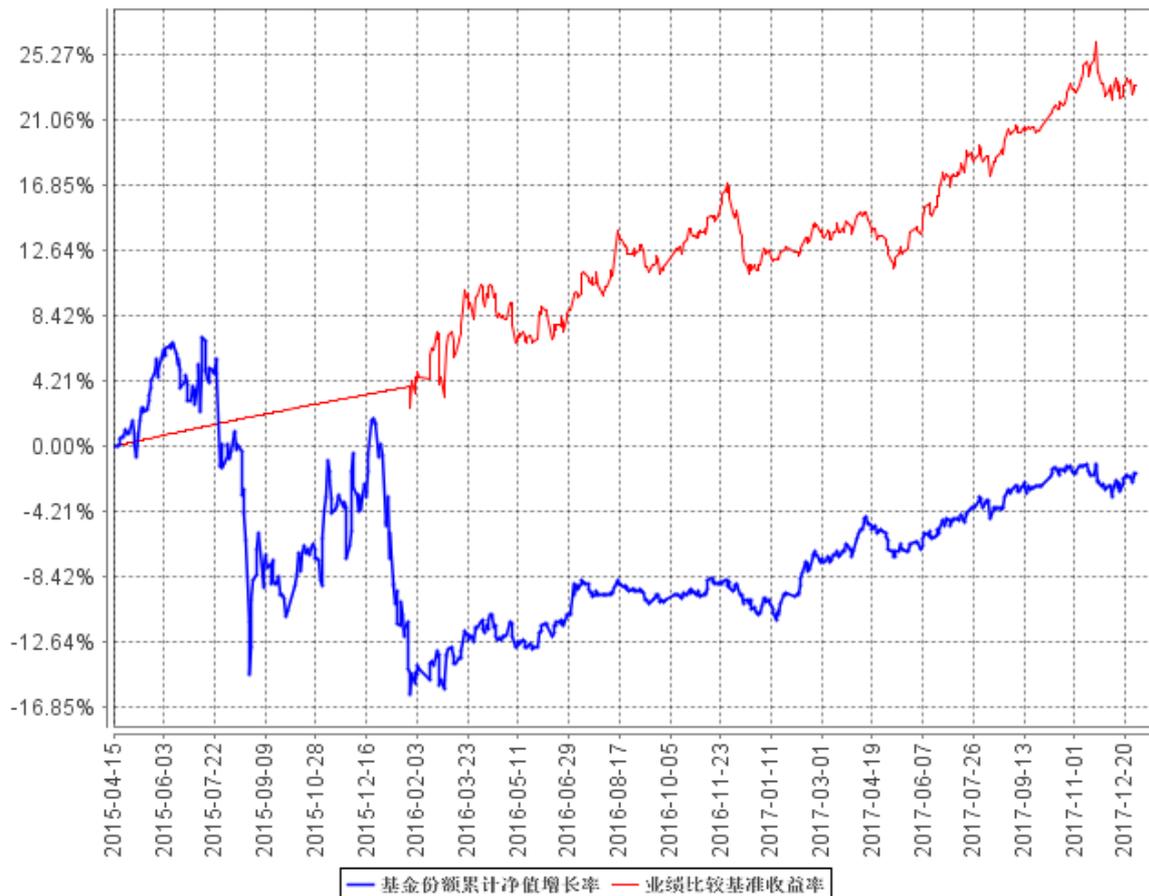
### 3.2 基金净值表现

#### 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	0.82%	0.32%	2.19%	0.41%	-1.37%	-0.09%
过去六个月	3.15%	0.29%	4.86%	0.35%	-1.71%	-0.06%
过去一年	10.08%	0.30%	10.30%	0.32%	-0.22%	-0.02%
自基金合同生效起至今	-1.70%	0.82%	23.28%	0.38%	-24.98%	0.44%

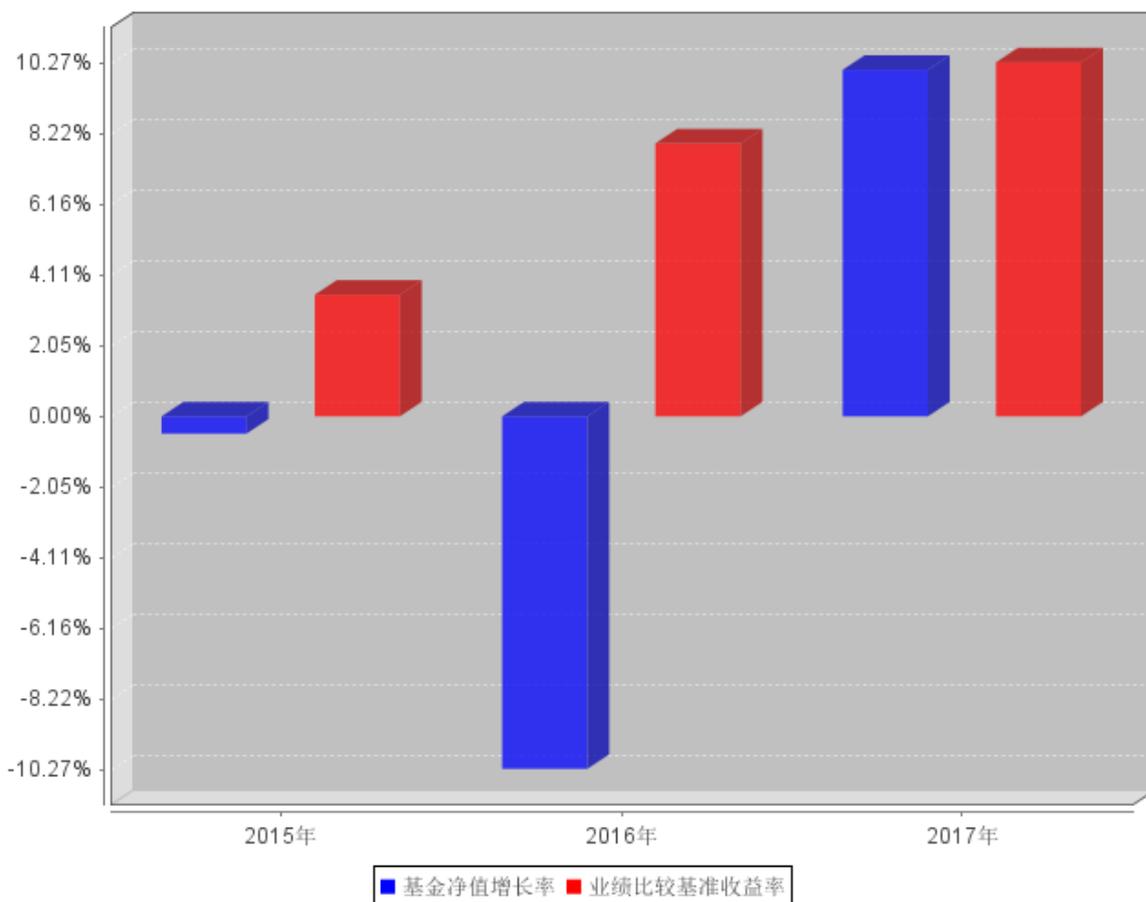
#### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



### 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
合计	-	-	-	-	

注：本基金自成立至今未进行利润分配活动。

## § 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

华融证券股份有限公司（以下简称“公司”）是经中国证监会批准，由中国华融资产管理股份有限公司（以下简称“中国华融”）作为主发起人，联合中国葛洲坝集团公司共同发起设立的全国

性证券公司。2007 年 9 月，公司在北京正式挂牌成立。目前，公司注册资本 51.42 亿元，其中：中国华融出资 42.04 亿元，中国葛洲坝集团有限公司、中国葛洲坝集团股份有限公司、深圳市科铭实业有限公司、北京纽森特投资有限公司、九江和汇进出口有限公司、星星集团有限公司、浙江金财控股集团有限公司、广州南雅房地产开发有限公司、吉林昊融集团股份有限公司、北京双融福泰投资有限公司、张家港市中达针织服饰制造有限公司、北京立磐国际贸易有限公司、宁波翰鹏瑞途股权投资合伙企业（有限合伙）、君豪实业发展（深圳）有限公司、宁波翰祺瑞途股权投资合伙企业（有限合伙）等 15 家股东共出资 9.38 亿元。公司的注册地址：北京市西城区金融大街 8 号。

公司总部设在北京，下设深圳总部、上海总部，北京、上海、深圳、湖南、新疆、湖北、陕西、贵州、四川、江西、海南、浙江、山东、福建、辽宁、广东等 16 家分公司，66 家营业部，控股华融期货有限责任公司与华融瑞泽投资管理有限公司。公司紧紧依托中国华融在资产管理、银行、信托和金融租赁等方面的综合优势，可为客户提供证券经纪、融资融券、证券承销与保荐、与证券交易及证券投资活动有关的财务顾问、证券投资咨询、证券自营、证券资产管理、投资顾问等综合化的财富管理服务。公司 2011-2017 年连续七年被中国证监会评为 A 类 A 级券商，2015、2017 年均被中国证监会评为 A 类 AA 级券商。2009 年、2011 年两次获评为“首都文明单位”，2014 年获评“首都精神文明建设标兵单位”，荣获 2014 年最佳资产管理券商，2015 年公司荣获中国债券市场优秀成员及债券业务进步奖第一名，“中国新三板最具投资眼光券商”，2016 年荣获中国最佳财富管理品牌，最具创新性的证券资产管理公司等奖项。

公司坚持以市场为导向，以客户为中心，以诚信、专业、稳健、共赢为经营宗旨，在社会各界和投资者的大力支持下，努力打造一家有尊严、有价值、有内涵、有实力、有责任的“五有”现代一流投资银行！

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
范贵龙	本基金的基金经理	2015 年 4 月 15 日	-	10	范贵龙, 男, 汉族, 1981 年生, 武汉大学金融学硕士, 特许金融分析师 (CFA), 金融风险管理师 (FRM), 具备 12 年金融行业工作经验。2006 年就职于中国建设银行, 2009 年 6 月加入华融证券, 历任市场研究

					部、资产管理二部、基金业务部。2015 年 9 月-2017 年 6 月任华融新利灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2015 年 4 月至今任华融新锐灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	--

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在本报告期内，基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为。基金管理人勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，严格遵守了《基金法》及其他有关法律法规、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

本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，在研究分析、投资决策、交易执行等各个环节，公平对待旗下所有投资组合。

公司建立投研管理平台并定期举行投研晨会、投研联席会等，建立健全投资授权制度，确保各投资组合公平获得研究资源，享有公平的投资决策机会。

针对公司旗下所有投资组合的交易所公开竞价交易，通过交易系统内的公平交易程序，对于不同投资组合同日同向买卖同一证券的指令自动进行比例分配。针对场外网下交易业务，公司依照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部场外、网下交易业务的相关规定，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。对于以公司名义进行的交易严格按照发行分配的原则或价格优先、比例分配的原则在各投资组合间进行分配。

### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，系统的公平交易程序运作良好，未出现异常情况。场外、网下业务公平交易制度执行情况良好，未出现异常情况。

公司对旗下各投资组合的交易行为进行监控和分析，对各投资组合不同时间窗口（1 日、3 日、5 日）内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了 T 检验，统计了溢价率占优比例。本报告期内，未出现违反公平交易制度的情况，公司旗下各基金不存在利益输送的行为。

### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

为规范投资行为，公平对待投资组合，公司制定了《异常交易管理办法》，对包括可能显著影响市场价格、可能导致不公平交易、可能涉嫌利益输送等异常交易行为做出了界定及相应的防范、控制措施。

报告期内严格执行公司相关制度，未发现本基金存在异常交易行为。公司严格控制旗下非指数型投资组合参与交易所公开竞价同日反向交易，按照有关指数的构成比例进行的投资导致出现的同日反向交易中，成交较少的单边交易量均未超过该证券当日成交量的 5%。

## 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 年股票市场窄幅波动，上证综指全年振幅创历史新低。全年来看，中证 100 指数涨幅超过 30%，创业板跌幅超过 10%，白酒板块指数接近翻倍，而餐饮纺织等跌幅超过 30%。个股方面，超过 70% 的个股收跌，中位数跌幅超过 20%，指数及个股表现严重分化，投资难度明显加大。

本基金始终坚持持有人利益优先的原则，坚持价值投资的理念，配置上稳中求胜。截止 12 月 31 日，单位净值 0.983，累计下跌 1.7%。

报告期内，本基金在控制总体风险的同时，通过优化低估值价值股和绩优成长股组合，积极参与新股以及可转债申购，提高产品收益率。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 0.9830 元；本报告期基金份额净值增长率为 10.08%，业绩比较基准收益率为 10.30%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2018 年，我们认为，宏观经济总体有望保持稳定，结构上继续优化；流动性将维持中性偏紧的态势；美联储仍然处在加息进程之中，随着经济的恢复和物价的上行，全球主要经济体出现梯次收缩货币的态势。

国内货币政策基调维持稳健中性，市场整体估值提升空间仍然受到制约，但是宏观经济以及微观企业业绩的好转也对市场构成一定支撑。未来三年国内宏观政策重点在防范化解重大风险、精准脱贫和污染防治三大攻坚战，2018 年以供给侧结构性改革为主线，统筹稳增长、促改革、调结构、惠民生、防风险。

大股东减持以及 IPO 的加速放行使股票供给增加，宏观流动性中性偏紧，但是资本市场对外开放的加快有望给市场带来增量资金。

综合来看，2018 年的股票市场可能维持震荡行情，投资机会需要更多的依靠自下而上精选个股，大盘股内部以及小盘股内部增长前景好的企业有望获得青睐。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人从合法、合规、保障基金持有人利益出发，由督察长领导独立于各业务部门的监察稽核部对基金投资运作、公司经营管理及员工行为的合法、合规性等进行了监察稽核，通过实时监控、定期检查、专项稽核、不定期抽查等方式，及时发现情况、提出整改意见、督促有关业务部门整改并跟踪改进落实情况，并按照相关要求定期制作监察稽核报告报公司管理层、董事会以及监管机构。

内部监察稽核的重点是：国家法律法规及行业监管规则的执行情况；基金合同的遵守情况；内部规章制度的执行情况；网络与信息系统安全情况；资讯监管与员工职业操守规范情况等。

(1) 进一步完善制度建设，构建适时、全面、严谨的内部控制体系。本基金管理人根据最新的法律法规等规范性文件，及时拟定了相关管理制度，并对原有制度体系进行了持续的更新和完善，对现有的制度体系进行了进一步梳理，同时，根据公司实际业务情况不断细化制度流程，进一步强化内部控制。

(2) 全面加强风险监控，不断提高风险管理水平。本基金管理人在原有基础上进一步提升内控管理水平，确保内部控制的独立性和权威性，事前、事中、事后风险控制有效结合，通过多种形式提高内控管理质量、优化风险管理水平。

(3) 有计划地开展监察稽核工作，确保工作的及时性、深入性和有效性。本年度内，本基金管理人通过日常监察与专项稽核相结合的方式，深入开展各项监察稽核工作包括对基金销售、宣传材料、客户服务、合同及其他法律资料、反洗钱工作、信息披露、信息系统与信息安全、基金投资运作（包括证券库、银行间交易对手的维护与管理、投资比例、投资权限、投资限制、研究支持、流动性风险等）、基金投资交易（包括公平交易、异常交易等）、基金运营、网上交易、专户业务管理、投委会管理、公司财务、公司治理、“三条底线”的防范及防控内幕交易等方面进行专项稽核。通过日常监察与专项稽核的方式，保证了内部监察稽核的全面性、实时性，强化了风险控制流程，提高了业务部门及人员的风险意识水平，从而较好地预防风险。

(4) 强化合规教育和培训。本基金管理人及时传达与基金相关的法律法规，并及时更新相关

管理制度，并将上述规定不断贯彻到相关制度及具体执行过程中，同时以组织公司内部培训、聘请外部律师提供法律专业培训等多种形式，提高全体员工的合规守法意识。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人同基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

本基金管理人设立估值委员会（委员包括估值业务分管领导以及投资部、研究部、监察稽核部、运作保障部等部门负责人及相关业务骨干），负责研究、指导基金估值业务。估值委员会委员和负责基金日常估值业务的基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经验。基金经理不介入基金日常估值业务；估值委员会决议之前会与涉及基金的基金经理进行充分沟通。运作保障部负责执行估值委员会制定的估值政策及决议。

参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突；本基金管理人未签约与估值相关的任何定价服务。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内依据基金合同的约定和基金运作情况，未进行利润分配。

#### 4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

本报告期内，会计师事务所对本基金未出具非标准意见。

#### 4.10 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

报告期内，本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国农业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

本报告期内，华融新锐灵活配置混合型证券投资基金的管理人——华融证券股份有限公司在华融新锐灵活配置混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，华融新锐灵活配置混合型证券投资基金未进行利润分配。

## 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对华融证券股份有限公司编制和披露的华融新锐灵活配置混合型证券投资基金 2017 年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

# § 6 审计报告

## 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	德师报（审）字（18）第 P00221 号

## 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	华融新锐灵活配置混合型证券投资基金全体持有人。
审计意见	我们认为，上述财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了华融新锐灵活配置混合型证券投资基金 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。

形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于华融新锐灵活配置混合型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	无。
其他事项	无。
其他信息	<p>华融证券股份有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括华融新锐灵活配置混合型证券投资基金 2017 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	编制和公允列报财务报表是贵基金管理人华融证券股份有限公司的责任。这种责任包括：(1) 按照企业会计准则的规定编制财务报表，并使其实现公允反映；(2) 设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见</p>

	提供了基础。	
会计师事务所的名称	德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）。	
注册会计师的姓名	郭新华	姜金玲
会计师事务所的地址	北京市东城区东方广场西二办公楼 8 层。	
审计报告日期	2018 年 3 月 29 日	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：华融新锐灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款		1,232,654.40	45,129,870.99
结算备付金		8,541,612.36	4,016,479.66
存出保证金		206,219.93	186,001.67
交易性金融资产		78,365,414.44	93,012,911.85
其中：股票投资		68,381,414.44	82,630,901.85
基金投资		-	-
债券投资		9,984,000.00	10,382,010.00
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		80,400,000.00	93,000,000.00
应收证券清算款		528,487.65	863,858.46
应收利息		246,656.00	215,058.97
应收股利		-	-
应收申购款		595.94	99.05
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		169,521,640.72	236,424,280.65
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2017 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 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		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	29,977,147.77
应付赎回款		668,054.54	17,893.80
应付管理人报酬		215,237.29	266,377.86
应付托管费		35,872.89	44,396.33
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		351,457.03	643,853.78
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		100,000.00	200,033.57
负债合计		1,370,621.75	31,149,703.11
<b>所有者权益：</b>			
实收基金		171,087,582.67	229,756,520.50
未分配利润		-2,936,563.70	-24,481,942.96
所有者权益合计		168,151,018.97	205,274,577.54
负债和所有者权益总计		169,521,640.72	236,424,280.65

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.9830 元，基金份额总额 171087582.67 份。

## 7.2 利润表

会计主体：华融新锐灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		24,844,990.99	-22,810,539.16
1. 利息收入		3,529,068.11	1,528,735.78
其中：存款利息收入		207,851.60	850,716.57
债券利息收入		261,840.45	135,158.34
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		3,059,376.06	542,860.87
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		8,923,526.56	-25,370,657.57
其中：股票投资收益		7,620,337.84	-26,521,630.33
基金投资收益		-	-
债券投资收益		33,325.02	115,071.21
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-

衍生工具收益		-	-
股利收益		1,269,863.70	1,035,901.55
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		12,382,039.19	986,957.81
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）		10,357.13	44,424.82
<b>减：二、费用</b>		5,786,412.94	5,973,478.81
1. 管理人报酬	7.4.8.2.1	2,899,207.97	3,440,341.72
2. 托管费	7.4.8.2.2	483,201.38	573,390.30
3. 销售服务费	7.4.8.2.3	-	-
4. 交易费用		2,366,900.48	1,725,399.14
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用		37,103.11	234,347.65
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		19,058,578.05	-28,784,017.97
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		19,058,578.05	-28,784,017.97

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华融新锐灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	229,756,520.50	-24,481,942.96	205,274,577.54
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	19,058,578.05	19,058,578.05
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）	-58,668,937.83	2,486,801.21	-56,182,136.62
其中：1. 基金申购款	748,600.69	-36,877.41	711,723.28
2. 基金赎回款	-59,417,538.52	2,523,678.62	-56,893,859.90
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）	171,087,582.67	-2,936,563.70	168,151,018.97
项目	上年度可比期间 2016年1月1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）	283,518,608.71	-1,448,286.84	282,070,321.87
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-28,784,017.97	-28,784,017.97
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）	-53,762,088.21	5,750,361.85	-48,011,726.36
其中：1. 基金申购款	2,406,984.52	-237,018.10	2,169,966.42
2. 基金赎回款	-56,169,072.73	5,987,379.95	-50,181,692.78
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）	229,756,520.50	-24,481,942.96	205,274,577.54

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 18 至 19 财务报表由下列负责人签署：

_____ 祝献忠	_____ 杨铭海	_____ 董维
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

华融新锐灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）于 2015 年 1 月 28 日经中国证监会（证监许可[2015]132 号文）核准，由华融证券股份有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华融新锐灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。募集期结束经立信会计师事务所（特殊普通合伙）验证，并出具信会师报字[2015]第 722880 号验资报告。经向中国证监会备案，《华融新锐灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2015 年 4 月 15 日正式生

效，本基金为契约型开放式，存续期限不定。截止 2015 年 4 月 13 日，本基金募集资金人民币 1,010,044,560.32 元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币 67,004.87 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 1,010,044,560.32 元，折合 1,010,044,560.32 份基金份额。本基金的基金管理人为华融证券股份有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

本基金投资范围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、货币市场工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其它品种，本基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金将基金资产的 0%-95% 投资于股票，本基金保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×50%+中证全债指数收益率×50%。

#### **7.4.2 会计报表的编制基础**

本财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则——基本准则》、各项具体会计准则及相关规定（以下合称“企业会计准则”）并参考中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》的规定而编制。本财务报表以持续经营为基础编制。

#### **7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

本基金财务报表的编制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 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日期间的经营成果和净值变动情况。

#### **7.4.4 重要会计政策和会计估计**

本基金财务报表的编制所遵循的会计政策与上年度会计报表相一致未发生变动。

#### **7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

##### **7.4.5.1 会计政策变更的说明**

本基金本报告期无会计政策变更。

##### **7.4.5.2 会计估计变更的说明**

本基金本报告期无会计估计变更。

##### **7.4.5.3 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。

#### **7.4.6 税项**

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、

财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税补充政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入及基金取得的以下利息收入免征增值税：a) 同业存款；b) 买入返售金融资产(质押式、买断式)；c) 国债、地方政府债；d) 金融债券。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、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。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，于 2015 年 9 月 8 日前暂减按 25% 计入应纳税所得额，自 2015 年 9 月 8 日起，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

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

#### 7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
华融证券股份有限公司	基金管理人、注册登记与过户机构、销售机构
中国农业银行股份有限公司	基金托管人
中国华融资产管理股份有限公司	基金管理人的控股股东
华融瑞泽投资有限公司	基金管理人的控股子公司
华融期货有限责任公司	基金管理人的控股子公司

## 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 2017年1月1日至2017年12月31日		上年度可比期间 2016年1月1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
华融证券	1,769,469,411.89	100.00%	1,250,504,292.12	100.00%

#### 7.4.8.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年12月31日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日	
	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 成交总额的比 例
华融证券	527,681.00	100.00%	638,531.70	100.00%

#### 7.4.8.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年12月31日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日	
	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的比 例
华融证券	16,735,400,000.00	100.00%	3,419,700,000.00	100.00%

#### 7.4.8.1.4 权证交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日

	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
--	------	--------------	------	--------------

### 7.4.8.1.5 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1月1日至2017年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
华融证券	1,307,845.66	100.00%	351,407.03	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2016年1月1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 (%)
华融证券	924,440.03	100.00%	643,828.78	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 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
	当期发生的基金应支付的管理费	2,899,207.97
其中：支付销售机构的客户维护费	1,537,363.06	1,795,584.39

注：支付基金管理人华融证券股份有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.5% / 当年天数。

#### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
	当期发生的基金应支付的托管费	483,201.38

注：支付基金托管人中国农业银行股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值×0.25% / 当年天数。

### 7.4.8.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费各关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	
	当期发生的基金应支付的销售服务费	
合计	-	
获得销售服务费各关联方名称	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日	
	当期发生的基金应支付的销售服务费	
合计	-	

注：本基金本报告期内未产生销售服务费。

### 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

单位：人民币元

本期 2017年1月1日至2017年12月31日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出

注：本基金本报告期内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 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
	基金合同生效日（2015年4月15日）持有的基金份额	-
期初持有的基金份额	-	-
期间申购/买入总份额	-	-

期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	-	-
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	-

注：本基金本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2017 年 12 月 31 日		上年度末 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

#### 7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2016 年 1 月 1 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
中国农业银行股份有限公司	1,232,654.40	83,138.91	45,129,870.99	828,413.99

#### 7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：份）	总金额
上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：份）	总金额

注：本基金本报告期末未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内未有其他关联交易事项的说明。

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

#### 7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

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

7.4.10.1.2 受限证券类别：债券										
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

7.4.10.1.3 受限证券类别：权证										
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：份)	期末成本总额	期末估值总额	备注

注：本基金本报告期内未持有因认购新发/增发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
000688	建新矿业	2017年9月6日	临时停牌	10.95	-	-	150,000	1,577,400.00	1,642,500.00	-
000547	航天发展	2017年10月30日	临时停牌	10.83	-	-	140,000	1,640,200.00	1,516,200.00	-
600150	中国船舶	2017年9月27日	临时停牌	24.67	-	-	50,000	1,295,111.25	1,233,500.00	-
600273	嘉化能源	2017年10月26日	临时停牌	9.53	-	-	50,000	455,000.00	476,500.00	-

#### 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

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
合计				-	-

截至本报告期末，本基金没有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。

#### 7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金没有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。

#### 7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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	68,381,414.44	40.34
	其中：股票	68,381,414.44	40.34
2	固定收益投资	9,984,000.00	5.89
	其中：债券	9,984,000.00	5.89
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	80,400,000.00	47.43
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	9,774,266.76	5.77
7	其他各项资产	981,959.52	0.58
8	合计	169,521,640.72	100.00

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	239,000.00	0.14
B	采矿业	4,387,082.40	2.61

C	制造业	27,565,391.04	16.39
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	734,000.00	0.44
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	610,400.00	0.36
G	交通运输、仓储和邮政业	1,360,500.00	0.81
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,932,000.00	1.74
J	金融业	28,596,156.00	17.01
K	房地产业	631,500.00	0.38
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	580,300.00	0.35
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	745,085.00	0.44
S	综合	-	-
	合计	68,381,414.44	40.67

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有沪港通投资股票。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601398	工商银行	2,480,000	15,376,000.00	9.14
2	000858	五粮液	107,000	8,547,160.00	5.08
3	600276	恒瑞医药	87,000	6,001,260.00	3.57

4	600030	中信证券	209,100	3,784,710.00	2.25
5	600016	民生银行	401,400	3,367,746.00	2.00
6	601688	华泰证券	180,000	3,106,800.00	1.85
7	600718	东软集团	200,000	2,932,000.00	1.74
8	000726	鲁泰 A	210,000	2,299,500.00	1.37
9	002595	豪迈科技	110,004	2,118,677.04	1.26
10	600688	上海石化	300,000	1,899,000.00	1.13

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

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 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	601988	中国银行	16,112,000.00	7.85
2	600028	中国石化	13,791,000.00	6.72
3	600837	海通证券	13,767,800.00	6.71
4	601117	中国化学	12,389,220.00	6.04
5	601668	中国建筑	11,962,000.00	5.83
6	601857	中国石油	11,093,000.00	5.40
7	601766	中国中车	10,484,500.00	5.11
8	601229	上海银行	9,950,282.24	4.85
9	601688	华泰证券	9,684,100.00	4.72
10	600688	上海石化	7,628,200.00	3.72
11	600498	烽火通信	7,628,002.00	3.72
12	600197	伊力特	7,594,293.00	3.70
13	601006	大秦铁路	7,578,500.00	3.69
14	600029	南方航空	7,463,496.00	3.64
15	600718	东软集团	7,202,199.00	3.51
16	600585	海螺水泥	7,094,506.00	3.46
17	000538	云南白药	6,713,552.00	3.27
18	000895	双汇发展	6,582,114.50	3.21
19	000726	鲁泰 A	6,527,741.01	3.18
20	600383	金地集团	6,479,144.00	3.16
21	600703	三安光电	6,406,412.00	3.12

22	603589	口子窖	6,379,309.00	3.11
23	002475	立讯精密	6,281,651.00	3.06
24	600909	华安证券	6,107,745.00	2.98
25	600782	新钢股份	6,048,546.00	2.95
26	000776	广发证券	6,015,641.00	2.93
27	601328	交通银行	5,956,000.00	2.90
28	600000	浦发银行	5,950,418.50	2.90
29	600893	航发动力	5,772,548.00	2.81
30	600335	国机汽车	5,538,148.00	2.70
31	002419	天虹股份	5,503,990.00	2.68
32	600919	江苏银行	5,497,000.00	2.68
33	601009	南京银行	5,460,000.00	2.66
34	600873	梅花生物	5,426,238.78	2.64
35	300202	聚龙股份	5,394,529.03	2.63
36	601628	中国人寿	5,348,019.00	2.61
37	601166	兴业银行	5,214,000.00	2.54
38	300258	精锻科技	4,871,714.00	2.37
39	600518	康美药业	4,856,700.00	2.37
40	603993	洛阳钼业	4,663,823.00	2.27
41	600016	民生银行	4,607,700.00	2.24
42	000793	华闻传媒	4,601,400.00	2.24
43	002497	雅化集团	4,600,590.00	2.24
44	600297	广汇汽车	4,574,600.00	2.23
45	002087	新野纺织	4,502,800.00	2.19
46	600690	青岛海尔	4,430,438.00	2.16
47	601088	中国神华	4,313,209.96	2.10
48	000333	美的集团	4,224,724.27	2.06
49	601618	中国中冶	4,209,754.73	2.05
50	601336	新华保险	4,202,835.00	2.05
51	002450	康得新	4,185,850.00	2.04

#### 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	601988	中国银行	16,388,000.00	7.98
2	600028	中国石化	13,884,000.00	6.76
3	600837	海通证券	12,846,714.00	6.26
4	601117	中国化学	12,310,343.43	6.00
5	601668	中国建筑	12,174,772.00	5.93
6	601229	上海银行	11,697,409.00	5.70
7	601857	中国石油	11,067,000.00	5.39
8	601766	中国中车	10,691,824.00	5.21
9	000401	冀东水泥	8,590,653.92	4.18
10	002450	康得新	7,941,368.00	3.87
11	600197	伊力特	7,820,026.96	3.81
12	600029	南方航空	7,579,168.00	3.69
13	002087	新野纺织	7,468,075.75	3.64
14	600585	海螺水泥	7,296,018.24	3.55
15	601311	骆驼股份	7,180,834.00	3.50
16	000333	美的集团	7,177,839.00	3.50
17	600498	烽火通信	6,947,315.00	3.38
18	600893	航发动力	6,738,036.00	3.28
19	600782	新钢股份	6,728,342.08	3.28
20	000895	双汇发展	6,672,119.00	3.25
21	600718	东软集团	6,580,911.00	3.21
22	000538	云南白药	6,577,273.00	3.20
23	600703	三安光电	6,509,022.00	3.17
24	002475	立讯精密	6,503,921.19	3.17
25	601006	大秦铁路	6,298,762.00	3.07
26	603589	口子窖	6,284,193.00	3.06
27	601688	华泰证券	6,194,157.00	3.02
28	000776	广发证券	6,168,562.00	3.01
29	601328	交通银行	6,105,000.00	2.97
30	600383	金地集团	5,964,925.00	2.91
31	600909	华安证券	5,953,732.00	2.90
32	600000	浦发银行	5,947,143.30	2.90
33	300202	聚龙股份	5,775,889.17	2.81
34	600688	上海石化	5,768,395.00	2.81
35	002304	洋河股份	5,762,934.00	2.81
36	600873	梅花生物	5,572,349.00	2.71
37	600335	国机汽车	5,468,461.00	2.66
38	600919	江苏银行	5,464,562.00	2.66

39	601628	中国人寿	5,319,362.00	2.59
40	601618	中国中冶	5,316,654.19	2.59
41	601166	兴业银行	5,250,200.00	2.56
42	603993	洛阳钼业	5,188,000.00	2.53
43	300258	精锻科技	4,951,835.00	2.41
44	600518	康美药业	4,926,742.00	2.40
45	002497	雅化集团	4,904,488.00	2.39
46	000793	华闻传媒	4,719,974.00	2.30
47	600297	广汇汽车	4,675,242.00	2.28
48	002419	天虹股份	4,658,075.00	2.27
49	600690	青岛海尔	4,555,741.00	2.22
50	600500	中化国际	4,531,854.00	2.21
51	601718	际华集团	4,469,677.00	2.18
52	601636	旗滨集团	4,394,857.00	2.14
53	601009	南京银行	4,345,000.00	2.12
54	601088	中国神华	4,326,400.00	2.11
55	600741	华域汽车	4,322,295.39	2.11

### 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	867,697,322.90
卖出股票收入（成交）总额	901,898,682.89

### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	9,984,000.00	5.94
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）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-

10	合计	9,984,000.00	5.94
----	----	--------------	------

## 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
----	------	------	-------	------	--------------

注：本基金本报告期末未持有债券投资。

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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
----	------	------	-------	------	--------------

## 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

金额单位：人民币元

序号	权证代码	权证名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
----	------	------	-------	------	--------------

注：本基金本报告期末未持有权证投资。

## 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

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金的基金合同约定，本基金的投资范围不包括股指期货。

### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险指标说明
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：根据本基金的基金合同约定，本基金的投资范围不包括股指期货。

### 8.11.3 本期国债期货投资评价

根据本基金的基金合同约定，本基金的投资范围不包括股指期货。

## 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中发行主体未出现被监管部门立案调查或在报告编制期日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

### 8.12.2

-

### 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	206,219.93
2	应收证券清算款	528,487.65
3	应收股利	-
4	应收利息	246,656.00
5	应收申购款	595.94
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	981,959.52

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
----	------	------	------	---------------

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券投资。

### 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
----	------	------	-------------	---------------	----------

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

-

## § 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
4,196	40,773.97	5,114,682.22	2.99%	165,972,900.45	97.01%

### 9.3 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	2,748,532.65	1.6100%

### 9.4 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	50~100
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4月15日）基金份额总额	1,010,044,560.32
本报告期期初基金份额总额	229,756,520.50
本报告期基金总申购份额	748,600.69
减:本报告期基金总赎回份额	59,417,538.52
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	171,087,582.67

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 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

本基金托管人于2016年8月29日任命史静欣女士为中国农业银行股份有限公司托管业务部/养老金管理中心副总经理，负责管理证券投资基金托管业务。因工作需要，余晓晨先生于2017年3月8日不再担任中国农业银行股份有限公司托管业务部/养老金管理中心副总经理职务。

### 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、基金财产、基金托管业务的重大诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期无基金投资策略的改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金的审计机构是德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）。该审计机构首次为本基金提供审计服务。

### 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

本基金管理人、托管人及其高级管理人员没有发生受监管部门稽查或处罚的情形。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华融证券		21,769,469,411.89	100.00%	1,307,838.33	100.00%	-

#### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
华融证券	527,681.00	100.00%	16,735,400,000.00	100.00%	-	-

## § 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：本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期内无影响投资者决策的其他重要信息。

华融证券股份有限公司  
2018 年 3 月 29 日