

华融新利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	华融新利
场内简称	—
基金主代码	001797
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 9 月 2 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	33,900,442.17 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	通过灵活运用多种投资策略，在有效控制风险的前提下力争获取高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	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的优质标的，运用多样化的投资策略实行组合管理。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率* 30%+1 年期人民币定期存款基准利率*70%
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 9 月 2 日 (基金合同生效日)-2015 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-967,654.58	9,079,254.57	1,396,429.18
本期利润	-1,159,901.34	5,563,926.01	4,810,250.19
加权平均基金份额本期利润	-0.0255	0.0567	0.0084
本期基金份额净值增长率	-1.26%	1.98%	0.90%
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	0.0161	0.0292	0.0053
期末基金资产净值	34,447,250.33	81,180,658.77	1,212,874,657.72
期末基金份额净值	1.016	1.029	1.009

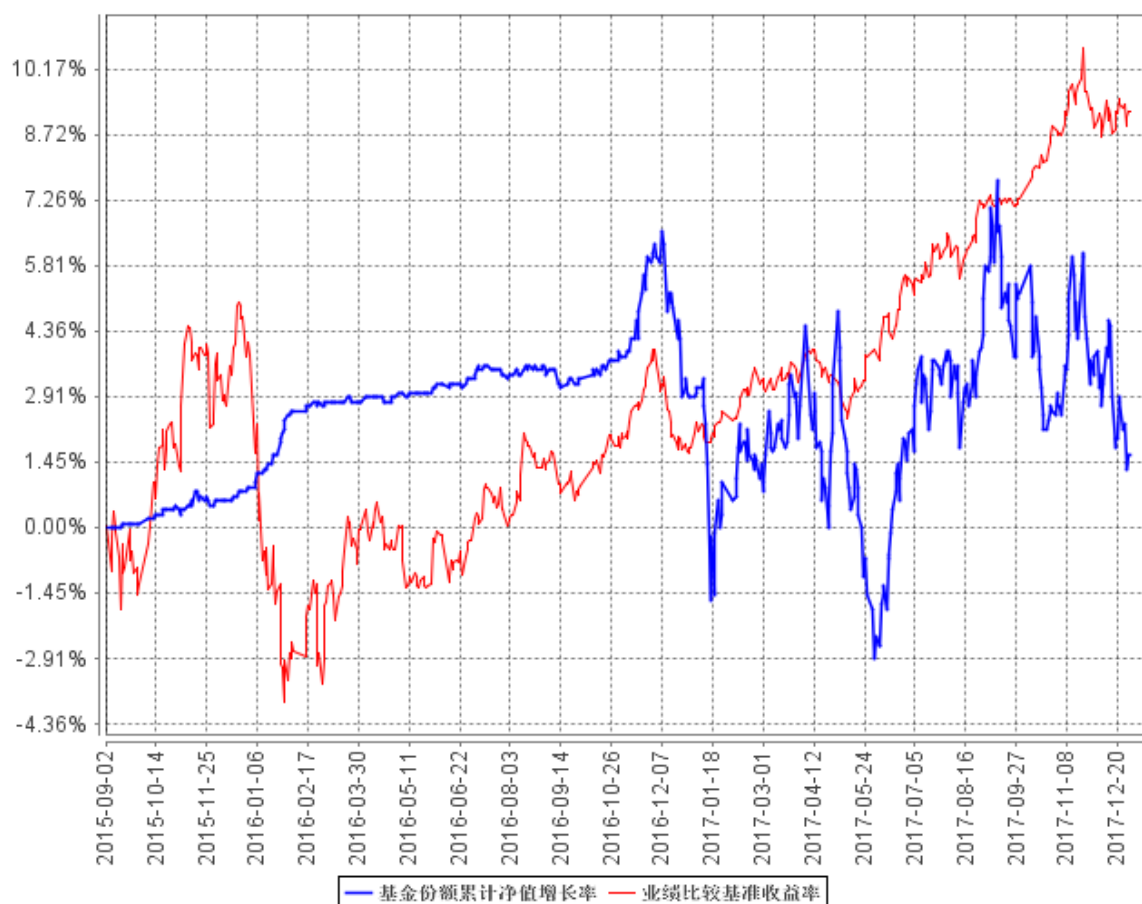
3.2 基金净值表现

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	-3.42%	0.62%	1.81%	0.24%	-5.23%	0.38%
过去六个月	-0.49%	0.60%	3.50%	0.21%	-3.99%	0.39%
过去一年	-1.26%	0.63%	7.33%	0.19%	-8.59%	0.44%
自基金合同生效起至今	1.60%	0.43%	9.24%	0.36%	-7.64%	0.07%

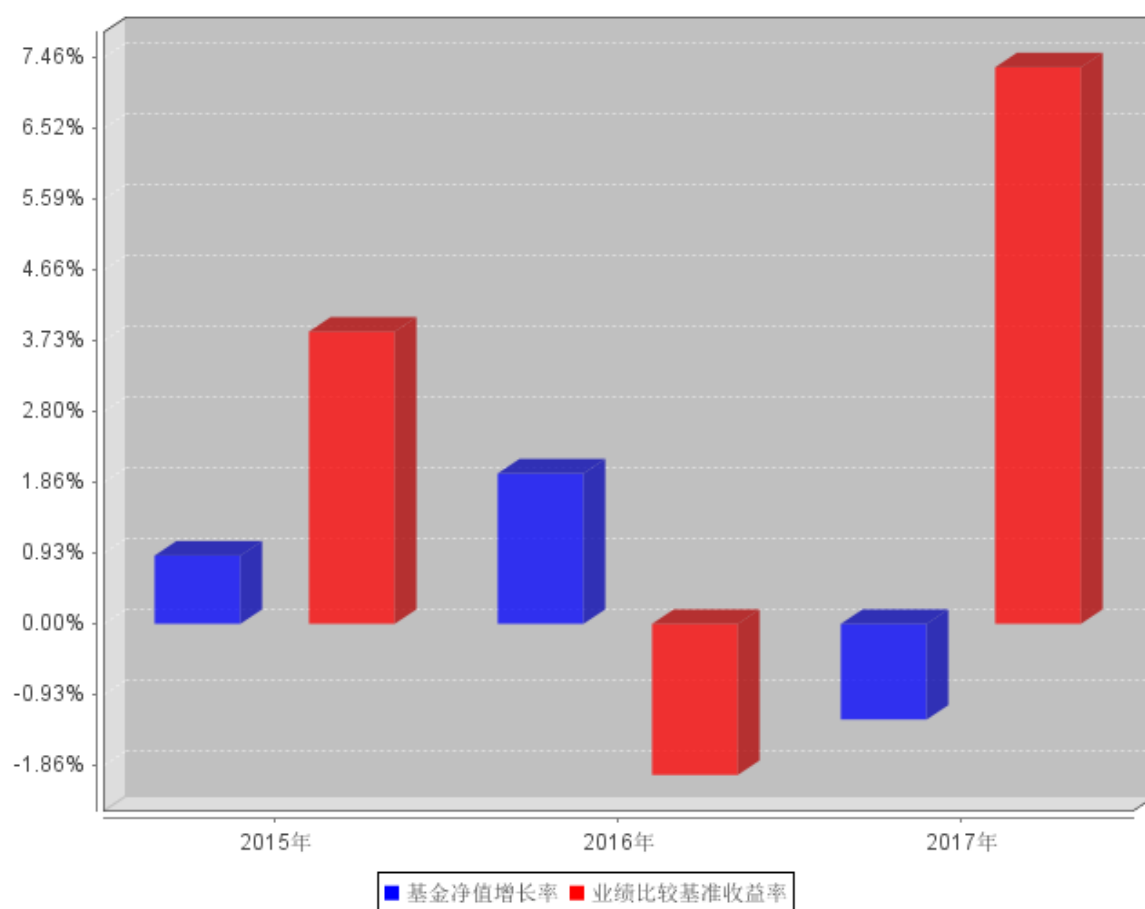
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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、宁波翰鹏瑞詮股权投资合伙企业（有限合伙）、君豪实业发展（深圳）有限公司、宁波翰祺瑞詮股权投资合伙企业（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		
靳冰馨	本基金的基金经理	2017 年 5 月 5 日	-	20	2011-2015 年，任职中国民族证券有限责任公司，从事证券投资研究及交易工作；2016 年任职方正证券股份有限公司，从事证券投资研究工作；2017 年 1 月进入华融证券股份有限公司从事证券投资研究工作。2017 年 5 月至今，任华融新利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。

杜骐臻	本基金的 基金经理	2017 年 7 月 12 日	2017 年 11 月 13 日	4	杜骐臻，毕业于普渡大学 Krannert 商学院，硕士研究生学历。先后任职北京康拓红外股份有限公司、美国 GraniteCreekPartners。2014 年 6 月加入华融证券，担任行业研究员、交易员。2016 年 8 月担任华融新锐灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理。2017 年 7 月 12 日至 2017 年 11 月 13 日担任华融新利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。
胡爽	本基金的 基金经理 助理	2016 年 8 月 1 日	-	2	胡爽，美国波士顿大学金融数学硕士学历。2011 年 7 月于野村证券（香港）总部担任研究员。2013 年 9 月就职于新华社下属中国证券报研究中心，2015 年 7 月就职于华融证券基金业务部任研究员，担任基金业务部研究员。2016 年 8 月担任华融新利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

在本报告期内，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《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

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《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。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 年以来证券市场宽幅震荡，结构性行情特征明显，本基金产品配置低风险资产和现金流动性管理，积累安全收益，同时积极参加新股申购；构建核心-卫星策略，以优质绩优蓝筹股为核心，以优选成长股及主题投资个股为卫星，辐射市场热点，增加产品弹性。细研行业，精选个券，结合实体经济利润改善和市场主题投资多维度审慎选取高价值低估值股票。产品积极寻找市场热点，通过对仓位控制降低投资风险。配置价值与成长股，1-2 季度以新能源汽车产业链、苹果产业链、大消费等行业为主，3-4 季度配置行业有通信、电子、食品饮料、家电、5G、人工智能、钢铁等。

风物长宜放眼量，投资是长期的行为，秉承稳健者远行理念，尽全力为投资者获取稳定的回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.0160 元；本报告期基金份额净值增长率为-1.26%，业绩比较基准收益率为 7.33%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

预计国内经济增速会保持一定韧性，固定资产投资和基建放缓，进出口稳健，消费增速有望保持稳定；中央经济会议中将工作重点放在防风险、环保治理、扶贫攻坚，工作目标转向为提升质量和效率。全年货币政策稳健，通胀前高并可控，经济增长结构出现调整，新的增长点不断加强。2018 年预计经济弱复苏，中小企业的个股业绩复苏的弹性更大，同时预计消费升级、新经济、新技术有望得到市场的认同，预计二线蓝筹及成长个股机会更大。

2018 年市场预计仍将体现为分化和结构特征，多策略与低相关性配置是首选，在增加收益的同时控制风险，等待市场更明确的趋势性机会到来。预计一季度市场经济增长稳定，通胀小幅回升，盈利确定（年报）是市场表现的有利因素，尤其关注春节前市场的变化，兼顾蓝筹与成长的投资平衡。关注的行业 TMT, 券商，医药，电子，军工、周期等，主题投资有 5G、光纤光缆、人工智能、租售同权、新能源汽车链等。

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，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历。

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

本基金本报告期编制的财务报表经德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）审计并出具标准无保留意见报告。

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的情形。

报告期内，本基金自 2017 年 4 月 28 日至 2017 年 7 月 24 日，已连续 59 个工作日资产净值低于五千万元。

报告期内，本基金自 2017 年 9 月 5 日起，截至报告期末，已连续 79 个工作日资产净值低于五千万元。公司正在拟定相关应对方案。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—华融证券股份有限公司 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算

和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本托管人认为，华融证券股份有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认为，华融证券股份有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

§ 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 P00222 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	华融新利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，公允反映了华融新利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，我们独立于华融新利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	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利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。 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。 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。 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。
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	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。 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。 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。

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	上海市黄浦区延安东路 222 号 30 楼
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：华融新利灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款		1,770,211.61	30,772,002.44
结算备付金		1,840,814.15	2,871,032.97
存出保证金		56,835.70	54,370.06
交易性金融资产		11,198,600.00	20,521,909.90
其中：股票投资		11,198,600.00	20,521,909.90
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		19,800,000.00	50,000,000.00
应收证券清算款		400,485.09	-
应收利息		-8,099.63	5,876.94
应收股利		-	-
应收申购款		3,495.81	575,800.00
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		35,062,342.73	104,800,992.31
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-

衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		288,739.48	19,983,083.32
应付赎回款		129,204.63	3,151,522.98
应付管理人报酬		16,631.63	45,394.00
应付托管费		4,157.94	11,348.51
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		76,197.51	225,057.54
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		100,161.21	203,927.19
负债合计		615,092.40	23,620,333.54
所有者权益：			
实收基金		33,900,442.17	78,880,896.64
未分配利润		546,808.16	2,299,762.13
所有者权益合计		34,447,250.33	81,180,658.77
负债和所有者权益总计		35,062,342.73	104,800,992.31

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0160 元，基金份额总额 33900442.17 份。

7.2 利润表

会计主体：华融新利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
一、收入		67,003.19	7,005,624.14
1. 利息收入		867,420.81	1,472,479.50
其中：存款利息收入		74,097.50	600,979.76
债券利息收入		-	300.47
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		793,323.31	871,199.27
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-1,015,348.85	4,399,603.43
其中：股票投资收益		-1,049,554.95	4,315,620.22
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-	39,023.33
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		34,206.10	44,959.88
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-192,246.76	-3,515,328.56
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）		407,177.99	4,648,869.77
减：二、费用		1,226,904.53	1,441,698.13
1. 管理人报酬	7.4.8.2.1	282,038.09	621,564.58
2. 托管费	7.4.8.2.2	70,509.57	155,391.16
3. 销售服务费	7.4.8.2.3	-	-
4. 交易费用		843,425.48	429,824.34
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用		30,931.39	234,918.05
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-1,159,901.34	5,563,926.01
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-1,159,901.34	5,563,926.01

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华融新利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）	78,880,896.64	2,299,762.13	81,180,658.77
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-1,159,901.34	-1,159,901.34
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）	-44,980,454.47	-593,052.63	-45,573,507.10
其中：1. 基金申购款	72,821,979.80	2,550,494.68	75,372,474.48
2. 基金赎回款	-117,802,434.27	-3,143,547.31	-120,945,981.58
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）	33,900,442.17	546,808.16	34,447,250.33
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）	1,201,815,671.75	11,058,985.97	1,212,874,657.72
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	5,563,926.01	5,563,926.01
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）	-1,122,934,775.11	-14,323,149.85	-1,137,257,924.96
其中：1. 基金申购款	146,745,961.58	5,148,217.77	151,894,179.35
2. 基金赎回款	-1,269,680,736.69	-19,471,367.62	-1,289,152,104.31
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）	78,880,896.64	2,299,762.13	81,180,658.77

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 - 至 - 财务报表由下列负责人签署：

祝献忠

基金管理人负责人

杨铭海

主管会计工作负责人

董维

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

华融新利灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）于 2015 年 8 月 5 日经中国证监会（证监许可[2015]1907 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《华融新利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 725475 号验资报告。经向中国证监会备案，《华融新利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2015 年 9 月 2 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 9 月 1 日，本基金募集资金人民币 263,756,837.54 元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币 11,080.92 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 263,756,837.54 元，折合 263,756,837.54 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）、股指期货、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* 30%+1 年期人民币定期存款基准利率* 70%。

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 日止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	631,777,884.55	100.00%	326,544,061.60	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	-	-	329,323.80	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	4,900,000,000.00	100.00%	2,866,400,000.00	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
--	------	----------------------	------	----------------------

注：本基金本报告期内无权证交易。

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	467,433.84	100.00%	76,197.51	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	241,335.87	100.00%	225,057.54	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	282,038.09	621,564.58
其中：支付销售机构的客户维护费	17,609.53	9,186.35

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 0.6%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×0.6%/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	70,509.57	155,391.16

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 0.15%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×0.15%/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 9 月 2 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：本基金于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

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方未持有本基金份额。

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	1,770,211.61	31,250.35	30,772,002.44	464,926.10

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：本基金本报告期及上年度可比期间均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
601003	柳钢股份	2017 年 10 月 17 日	临时停牌	7.98	-	-	90,000	770,500.00	718,200.00	-

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	11,198,600.00	31.94
	其中：股票	11,198,600.00	31.94
2	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	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	19,800,000.00	56.47
	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	3,611,025.76	10.30
7	其他各项资产	452,716.97	1.29
8	合计	35,062,342.73	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	694,440.00	2.02
B	采矿业	—	—
C	制造业	7,801,410.00	22.65
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	—	—
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	1,810,750.00	5.26

	业		
J	金融业	-	-
K	房地产业	892, 000. 00	2. 59
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	-	-
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	11, 198, 600. 00	32. 51

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	000063	中兴通讯	30, 000	1, 090, 800. 00	3. 17
2	600487	亨通光电	26, 000	1, 050, 920. 00	3. 05
3	002185	华天科技	110, 000	937, 200. 00	2. 72
4	002405	四维图新	35, 000	923, 650. 00	2. 68
5	002050	三花股份	50, 000	917, 000. 00	2. 66
6	002285	世联行	80, 000	892, 000. 00	2. 59
7	002230	科大讯飞	15, 000	887, 100. 00	2. 58
8	600522	中天科技	60, 000	836, 400. 00	2. 43
9	601003	柳钢股份	90, 000	718, 200. 00	2. 08
10	000998	隆平高科	27, 000	694, 440. 00	2. 02

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	603799	华友钴业	9,915,828.20	12.21
2	603993	洛阳钼业	6,707,247.00	8.26
3	002340	格林美	6,614,614.17	8.15
4	300136	信维通信	6,584,886.04	8.11
5	000823	超声电子	5,197,073.00	6.40
6	002230	科大讯飞	5,195,452.27	6.40
7	600110	诺德股份	5,175,560.00	6.38
8	600884	杉杉股份	4,656,395.00	5.74
9	600522	中天科技	4,568,349.00	5.63
10	002635	安洁科技	4,098,906.10	5.05
11	002239	金 飞 达	4,019,189.33	4.95
12	002285	世联行	3,542,678.20	4.36
13	600456	宝钛股份	3,509,505.00	4.32
14	600711	盛屯矿业	3,366,230.00	4.15
15	000636	风华高科	3,272,645.00	4.03
16	002310	东方园林	3,160,466.00	3.89
17	000049	德赛电池	3,060,119.00	3.77
18	300033	同花顺	2,919,444.00	3.60
19	300174	元力股份	2,915,342.00	3.59
20	002537	海立美达	2,859,013.00	3.52
21	300335	迪森股份	2,834,161.79	3.49
22	002460	赣锋锂业	2,822,020.59	3.48
23	600592	龙溪股份	2,735,264.24	3.37
24	600487	亨通光电	2,704,306.00	3.33
25	300409	道氏技术	2,702,777.00	3.33
26	300320	海达股份	2,665,590.00	3.28
27	600080	金花股份	2,647,766.31	3.26
28	600050	中国联通	2,630,017.00	3.24

29	002738	中矿资源	2,629,974.60	3.24
30	002241	歌尔声学	2,587,424.28	3.19
31	600498	烽火通信	2,570,108.00	3.17
32	002691	石中装备	2,534,942.00	3.12
33	002273	水晶光电	2,503,649.00	3.08
34	300073	当升科技	2,469,497.45	3.04
35	000728	国元证券	2,410,981.00	2.97
36	002050	三花股份	2,383,775.00	2.94
37	600421	仰帆控股	2,382,554.00	2.93
38	002620	瑞和股份	2,335,094.00	2.88
39	002497	雅化集团	2,103,714.00	2.59
40	300275	梅安森	2,034,699.00	2.51
41	002281	光迅科技	2,031,475.00	2.50
42	300340	科恒股份	2,022,264.00	2.49
43	300682	朗新科技	2,007,658.00	2.47
44	300309	吉艾科技	1,942,077.94	2.39
45	000762	西藏矿业	1,869,986.69	2.30
46	000651	格力电器	1,867,200.00	2.30
47	000063	中兴通讯	1,837,557.00	2.26
48	002405	四维图新	1,817,661.50	2.24
49	300338	开元仪器	1,783,030.00	2.20
50	300308	中际装备	1,758,559.00	2.17
51	002600	江粉磁材	1,746,742.00	2.15
52	601003	柳钢股份	1,741,400.00	2.15
53	002456	欧菲光	1,702,896.00	2.10
54	600569	安阳钢铁	1,653,045.00	2.04
55	300201	海伦哲	1,640,000.00	2.02
56	600766	园城黄金	1,639,666.00	2.02
57	002158	汉钟精机	1,637,967.00	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	603799	华友钴业	11,962,869.49	14.74

2	300136	信维通信	8,425,912.68	10.38
3	603993	洛阳钼业	6,795,177.00	8.37
4	002340	格林美	6,455,528.00	7.95
5	600110	诺德股份	5,699,026.23	7.02
6	000823	超声电子	5,379,524.40	6.63
7	600884	杉杉股份	4,846,624.43	5.97
8	000636	风华高科	4,717,568.19	5.81
9	002635	安洁科技	4,584,069.00	5.65
10	002230	科大讯飞	4,413,990.32	5.44
11	002239	金 飞 达	4,010,923.64	4.94
12	002669	康达新材	3,867,398.09	4.76
13	600522	中天科技	3,703,337.00	4.56
14	002460	赣锋锂业	3,466,578.00	4.27
15	600456	宝钛股份	3,333,101.00	4.11
16	000903	云内动力	3,222,400.00	3.97
17	002310	东方园林	3,188,829.00	3.93
18	600711	盛屯矿业	3,151,685.00	3.88
19	000049	德赛电池	3,046,499.00	3.75
20	600592	龙溪股份	3,036,581.00	3.74
21	300097	智云股份	2,955,854.00	3.64
22	300174	元力股份	2,915,511.00	3.59
23	300033	同花顺	2,741,018.80	3.38
24	300282	汇冠股份	2,693,918.59	3.32
25	300073	当升科技	2,655,891.00	3.27
26	300409	道氏技术	2,629,933.00	3.24
27	002537	海立美达	2,623,938.00	3.23
28	002241	歌尔声学	2,600,018.14	3.20
29	300320	海达股份	2,551,064.00	3.14
30	300335	迪森股份	2,530,829.84	3.12
31	600080	金花股份	2,502,411.80	3.08
32	002738	中矿资源	2,497,142.00	3.08
33	600050	中国联通	2,488,200.00	3.07
34	000728	国元证券	2,448,629.70	3.02
35	002273	水晶光电	2,430,287.00	2.99
36	002285	世联行	2,387,814.00	2.94
37	600766	园城黄金	2,349,080.00	2.89
38	002620	瑞和股份	2,240,641.00	2.76
39	002497	雅化集团	2,180,495.00	2.69

40	000651	格力电器	2,120,400.00	2.61
41	300340	科恒股份	2,074,212.00	2.56
42	600498	烽火通信	2,067,980.08	2.55
43	002281	光迅科技	2,048,633.30	2.52
44	002691	石中装备	2,041,080.00	2.51
45	600892	大晟文化	2,039,370.00	2.51
46	300275	梅安森	2,036,275.66	2.51
47	600421	仰帆控股	2,025,453.00	2.49
48	600487	亨通光电	1,941,553.00	2.39
49	300682	朗新科技	1,935,955.00	2.38
50	002600	江粉磁材	1,823,788.00	2.25
51	000762	西藏矿业	1,812,358.00	2.23
52	300678	中科信息	1,803,983.68	2.22
53	300201	海伦哲	1,774,483.00	2.19
54	300308	中际装备	1,746,413.00	2.15
55	300338	开元仪器	1,722,843.02	2.12
56	002456	欧菲光	1,715,455.50	2.11
57	600477	杭萧钢构	1,679,449.00	2.07
58	000887	中鼎股份	1,642,202.00	2.02
59	002158	汉钟精机	1,633,859.00	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	311,904,063.18
卖出股票收入（成交）总额	319,948,321.37

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	-	-
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	-	-

注：本基金本报告期末未持有债券投资。

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

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国债期货。

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国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

本基金本报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，未发现基金投资前十名证券的发行主体本期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。

8.12.2

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	56,835.70
2	应收证券清算款	400,485.09
3	应收股利	-

4	应收利息	-8,099.63
5	应收申购款	3,495.81
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	452,716.97

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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	601003	柳钢股份	718,200.00	2.08	停牌

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 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
865	39,191.26	5,888,698.29	17.37%	28,011,743.88	82.63%

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	3,931,235.69	11.6000%

持有本基金		
-------	--	--

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	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	50~100

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015年9月2日）基金份额总额	263,756,837.54
本报告期期初基金份额总额	78,880,896.64
本报告期基金总申购份额	72,821,979.80
减:本报告期基金总赎回份额	117,802,434.27
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	33,900,442.17

§ 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）。

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

—

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	2	631,777,884.55	100.00%	467,433.84	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	—	—	4,900,000,000.00	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

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	20170101-20170427	19,266,859.34	-	19,266,859.34	0.00	0.00%
	2	20170117-20170525	14,519,845.11	-	14,519,845.11	0.00	0.00%
个人	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
-							

12.2 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