

太平灵活配置混合型发起式证券投资基金
2017 年半年度报告
2017 年 6 月 30 日

基金管理人：太平基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一七年八月二十八日

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 24 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	7
4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
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.....	12
5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	12
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.....	12
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	12
6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	14
6.4 报表附注.....	16
7 投资组合报告	33
7.1 期末基金资产组合情况.....	33
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	34
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	37
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	38
7.6 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.....	39
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	39
7.8 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.....	39
7.9 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.....	39
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	39
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	40
7.12 投资组合报告附注.....	40
8 基金份额持有人信息	41
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	41

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	41
8.3 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	41
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	41
9 开放式基金份额变动	42
10 重大事件揭示	42
10.1 基金份额持有人大会决议	42
10.2 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	42
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	42
10.4 基金投资策略的改变	42
10.5 报告期内改聘会计师事务所情况	42
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	42
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	42
10.8 其他重大事件	44
11 影响投资者决策的其他重要信息	44
12 备查文件目录	45
12.1 备查文件目录	45
12.2 存放地点	45
12.3 查阅方式	45

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	太平灵活配置混合型发起式证券投资基金
基金简称	太平灵活配置
基金主代码	000986
交易代码	000986
基金运作方式	契约型开放式、发起式
基金合同生效日	2015 年 2 月 10 日
基金管理人	太平基金管理有限公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	2,290,407,441.61 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过优化资产配置和灵活运用多种投资策略，寻找推动经济增长的内在动力，精选具有较高成长性和投资价值的金融工具，在充分控制投资风险的基础上，力争实现持续稳定的投资回报。
投资策略	<p>(一) 资产配置策略</p> <p>本基金采用自上而下的多因素分析方法进行宏观策略研究，对宏观经济方面重大问题、突发事件、重大政策进行及时研究与评估，对影响证券市场的相关因素（政策、资金、利率走向、行业比较、上市公司盈利增长预期、估值水平、市场心理等）进行综合考量，分析和预测证券市场走势和行业热点，预测权益类资产和固定收益类资产的风险收益特征，确定中长期的资产配置方案。在公司投资决策委员会的统一指导下进行大类资产的配置与组合构建，合理确定本基金在股票、债券、股指期货等金融工具上的投资比例，并随着各类金融工具风险收益特征的相对变化，适时动态地调整各金融工具的投资比例，以最大限度地降低投资组合的风险并提高收益。</p> <p>(二) 股票投资策略</p> <p>本基金采用灵活的股票投资策略，充分挖掘中国经济结构调整和产业升级衍伸的投资机会，关注具有持续高成长性的行业和上市公司，以分享经济增长带来的投资回报。</p> <p>(三) 债券投资策略</p> <p>本基金债券投资策略主要包括久期策略、收益率曲线策略、类别选择策略、个券选择策略、可转换债券投资策略、中小企业私募债投资策略等。</p> <p>(四) 股指期货投资策略</p> <p>本基金在股指期货投资中将以控制风险为原则，以套期保值为目的，谨慎参与股指期货投资。本基金通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，对股指期货合约进行估值定价，并与股票现货资产进行匹配，实现多头或空头的套期保值操作。</p> <p>(五) 权证投资策略</p> <p>本基金将因为上市公司进行增发、配售以及投资分离交易的可转换公</p>

	<p>司债券等原因被动获得权证，或者在进行套利交易、避险交易以及权证价值严重低估等情形下将投资权证。</p> <p>本基金的权证投资，是在对权证标的证券进行基本面研究及估值的基础上，结合股价波动率等参数，运用数量化期权定价模型，投资于合理内在价值的权证品种。</p>
业绩比较基准	1 年期银行定期存款利率（税后）+2%
风险收益特征	本基金为混合型基金，本基金属于中高风险、中高收益的基金品种，其预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		太平基金管理有限公司	兴业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	陈吟绮	张志永
	联系电话	021-38556782	021-52629999-212004
	电子邮箱	disclosure@taipingfund.com.cn	zhangzhy@cib.com.cn
客户服务电话		021-38874600	95561
传真		021-38556677	021-62159217
注册地址		上海市虹口区邯郸路135号5幢 101室	福州市湖东路154号
办公地址		上海市浦东新区花园石桥路33 号花旗集团大厦17楼1708室	上海江宁路168号兴业大厦20 楼
邮政编码		200120	200041
法定代表人		汤海涛	高建平

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.taipingfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	上海市浦东新区花园石桥路 33 号花旗集团大厦 17 楼 1708 室

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	太平基金管理有限公司	上海市浦东新区花园石桥路 33 号花旗集团大厦 17 楼 1708 室

3 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期（2017年1月1日-2017年6月30日）
本期已实现收益	17,009,029.18
本期利润	73,645,230.89
加权平均基金份额本期利润	0.0322
本期加权平均净值利润率	4.80%
本期基金份额净值增长率	4.86%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)
期末可供分配利润	-766,426,152.09
期末可供分配基金份额利润	-0.3346
期末基金资产净值	1,583,206,545.52
期末基金份额净值	0.691
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-30.90%

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

2、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

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

3.2 基金净值表现

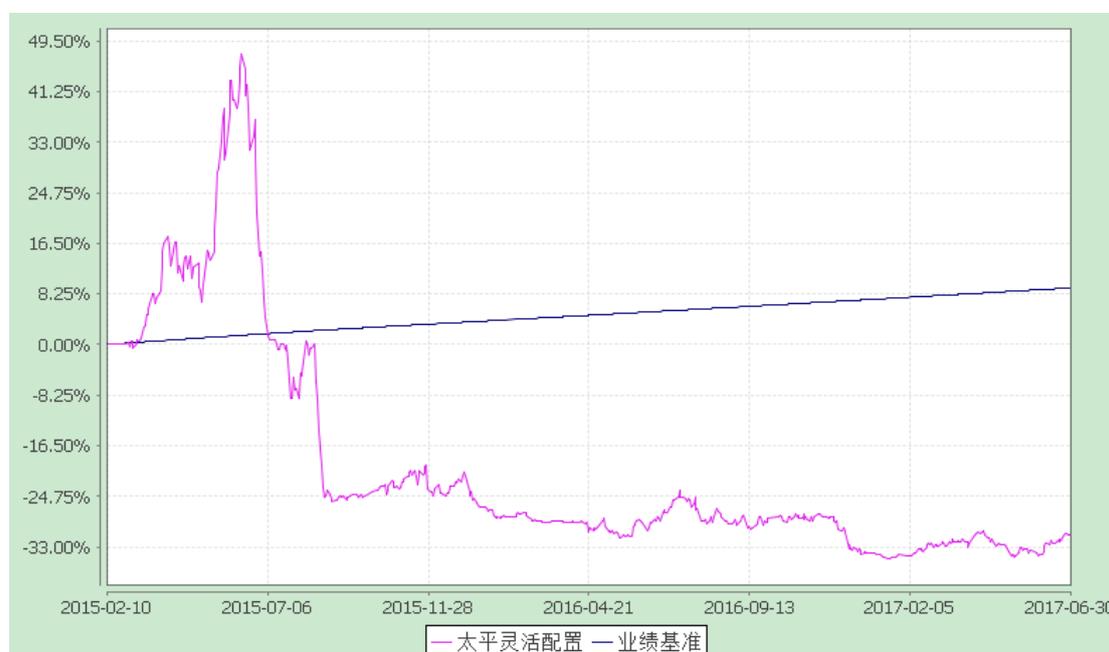
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去一个月	4.54%	0.55%	0.29%	0.01%	4.25%	0.54%
过去三个月	2.37%	0.64%	0.88%	0.01%	1.49%	0.63%
过去六个月	4.86%	0.55%	1.75%	0.01%	3.11%	0.54%
过去一年	-4.95%	0.73%	3.56%	0.01%	-8.51%	0.72%
自基金合同生效起至今	-30.90%	1.32%	9.24%	0.01%	-40.14%	1.31%

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

太平灵活配置混合型发起式证券投资基金
 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
 (2015 年 2 月 10 日至 2017 年 6 月 30 日)



注：本基金基金合同于2015年2月10日生效。按照本基金基金合同和招募说明书的约定，本基金建仓期为自基金合同生效之日起的六个月，截至2015年8月10日，本基金已完成建仓，基金的各项资产配置比例符合合同约定。

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

太平基金管理有限公司原名中原英石基金管理有限公司（以下简称“公司”）经中国证券监督管理委员会 2012 年 12 月 20 日证监许可[2012]1719 号文件批准，于 2013 年 1 月 23 日在上海市工商行政管理局注册成立。目前公司注册资本为人民币 2.27 亿元，其中太平资产管理有限公司出资占注册资本 70.04%，中原证券股份有限公司的出资占注册资本的 14.98%，安石投资管理有限公司的出资占注册资本的 14.98%。

目前公司经营范围为基金募集、基金销售、特定客户资产管理、资产管理等，在投资管理、策略设计、产品设计、客户服务等方面配置了专业团队及集中了优势资源，力求为客户创造长期持续

稳健的回报。截至本报告期末，公司共管理 3 只证券投资基金，即太平灵活配置混合型发起式证券投资基金、太平日日金货币市场基金、太平日日鑫货币市场基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

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		
独孤南薰	本基金的基金经理	2016-04-07	-	13	美国西北大学经济学学士，具有证券投资基金从业资格。2003 年 10 月起曾在台湾凯基证券上海研究部、工银瑞信基金管理有限公司、汇丰晋信基金管理有限公司、安信证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司担任研究员、高级研究员等职。2013 年 4 月加入本公司，先后担任研究员、投资经理、基金经理助理等职。2015 年 5 月 29 日至 2016 年 3 月 25 日担任量化动态多策略 alpha 资产管理计划投资经理。2016 年 4 月 7 日起担任太平灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理。中国国籍。
林开盛	本基金的基金经理	2017-05-09	-	8	上海财经大学金融学专业证券投资方向硕士。具有证券投资基金从业资格。2009 年 7 月至 2016 年 4 月在申银万国证券研究所任首席分析师，精通化工行业分析。2016 年 4 月加入本公司任研究发展部负责人，从事投资研究相关工作。2017 年 5 月 9 日起担任太平灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理。中国国籍。
翁锡赞	本基金的基金经理、太平日日金货币市场基金基金经理、太平日日鑫货币市场基金基金经理、固定收益部总监	2016-03-08	2017-05-09	12	复旦大学金融学硕士，具有证券投资基金从业资格。2004 年 1 月起曾在兴业基金管理有限公司（现兴业全球基金管理有限公司）任首席交易员和债券研究员，万家基金管理有限公司任基金经理助理，国泰基金管理有限公司任国泰货币市场证券投资基金基金经理（任职期间：2008 年 8 月 23 日至 2011 年 6 月 15 日）、国泰金鹿保本增值混合证券投资基金基金经理（任职期

				<p>间：2010 年 6 月 10 日至 2011 年 6 月 15 日）、社保 409、709 组合投资经理，东吴证券股份有限公司任债券投资部副总经理，国泰君安（香港）有限公司任国泰君安巨龙中国固定收益基金（RQFII）基金经理（任职期间：2012 年 3 月 9 日至 2013 年 11 月 22 日）、高级副总裁，在本公司任中原英石货币市场基金基金经理（任职期间：2014 年 9 月 11 日至 2015 年 10 月 21 日，该基金基金合同已终止）、太平灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理（任职期间：2016 年 3 月 8 日至 2017 年 5 月 9 日）。2016 年 11 月 4 日起担任太平日日金货币市场基金基金经理。2017 年 3 月 15 日起担任太平日日鑫货币市场基金基金经理。中国国籍。</p>
--	--	--	--	--

注：1、基金经理的任职日期和离职离任日期一般情况下指为公司对外公告之日；若该基金经理自本基金基金合同生效之日起即任职，则任职日期指本基金基金合同生效之日；

2、证券从业的含义遵从行业协会《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

本报告期内，本基金管理人严格遵守有关法律法规、监管部门的相关规定和本基金基金合同的约定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，为基金份额持有人谋求最大利益，不存在损害基金份额持有人利益的行为，未发生违法违规或未履行基金合同的情形。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，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》及公司公平交易管理的相关制度等的有关规定，从研究分析、投资决策、交易执行、事后稽核等环节进行严格规范，通过系统和人工相结合的方式在投资管理活动各环节贯彻和执行公平交易管理制度，公平对待本基金管理人管理的所有投资组合，未发现不同投资组合之间存在非公平交易的情况。

本报告期内，本基金管理人对不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异以及不同时间窗口（如日内、3 日内、5 日内）同向交易的交易价差进行分析，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。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发生本基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价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的 5% 的情形，未发现可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

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 年上半年 A 股市场走出大消费类领涨市场、周期类时有表现的局面，“漂亮 50”明显强于整体市场。本基金在报告期内，较好地把握了白酒、家电、医药等消费行业的机会，与此同时，也参与了周期行业的波段行情。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金的份额净值增长率为 4.86%，同期业绩比较基准收益率为 1.75%。

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 2017 年下半年，市场风险因素相较于上半年可能会有所减弱，经济或存在持续改善的可能性，投资机会有望继续出现。策略方面回避高估值标的，坚定持有低估值、真成长的消费类龙头、调控政策改善且低估值的房地产行业、发展空间广阔的新能源汽车产业链和具备弹性的油价回暖受益品种，同时力争抓住周期行业波段性机会。密切关注宏观经济数据，紧密跟踪中国经济增速边际变化的拐点，在控制仓位的同时，力争给投资者满意的回报。

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，本基金管理人严格按照《太平基金管理有限公司基金估值定价与评估制度》和《太平基金管理有限公司基金会计业务管理制度》以及相关法律法规的规定，有效地控制基金估值流程。公司估值委员会成员由营运总监负责，成员包括投资组合经理、行业研究员、风控人员、金融工程研究员及基金会计等人员组成，成员由估值所涉及的部门领导指定。上述参与估值流程人员均具有专业胜任能力和相关工作经验且基金经理不参与其管理基金的具体估值业务。本报告期内，参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金基金合同的相关约定，本基金本报告期内未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》规定，本基金为发起式基金，自本基金合同生效之日起至报告期末本基金合同生效未满三年，不适用《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条。

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

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本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遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认真复核了本半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：太平灵活配置混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	256,175,893.23	995,391,551.44
结算备付金		4,267,167.13	31,507.51
存出保证金		1,184,783.50	13,356.15
交易性金融资产	6.4.7.2	1,232,581,482.68	8,666,191.00

其中：股票投资		1,103,008,482.68	8,116,906.00
基金投资		-	-
债券投资		129,573,000.00	549,285.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	64,680,152.34	504,901,677.35
应收证券清算款		27,377,177.54	-
应收利息	6.4.7.5	2,124,941.20	263,027.65
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,588,391,597.62	1,509,267,311.10
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		839,646.48	-
应付赎回款		1,025.40	4,170.06
应付管理人报酬		1,905,923.13	134,410.62
应付托管费		317,653.87	22,401.75
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	1,930,672.76	17,726.94
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	190,130.46	160,007.84
负债合计		5,185,052.10	338,717.21
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.9	2,290,407,441.61	2,289,482,565.25
未分配利润	6.4.7.10	-707,200,896.09	-780,553,971.36
所有者权益合计		1,583,206,545.52	1,508,928,593.89
负债和所有者权益总计		1,588,391,597.62	1,509,267,311.10

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.691 元，基金份额总额 2,290,407,441.61 份。

6.2 利润表

会计主体：太平灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
一、收入		93,844,624.93	-781,430.80
1.利息收入		8,506,835.81	71,060.82
其中：存款利息收入	6.4.7.11	3,036,067.61	62,433.40
债券利息收入		1,747,150.53	8,627.42
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		3,723,617.67	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		28,700,623.74	-1,094,689.73
其中：股票投资收益	6.4.7.12	19,597,604.69	-1,113,798.44
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	238,212.26	-2,876.50
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	8,864,806.79	21,985.21
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	56,636,201.71	234,983.18
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	963.67	7,214.93
减：二、费用		20,199,394.04	197,537.33
1. 管理人报酬		11,403,109.30	80,033.12
2. 托管费		1,900,518.21	13,338.91
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	6,779,470.19	24,009.00
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.19	116,296.34	80,156.30
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		73,645,230.89	-978,968.13
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		73,645,230.89	-978,968.13

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：太平灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 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）	2,289,482,565.25	-780,553,971.36	1,508,928,593.89
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	73,645,230.89	73,645,230.89
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）	924,876.36	-292,155.62	632,720.74
其中：1.基金申购款	1,821,059.90	-587,393.26	1,233,666.64
2.基金赎回款	-896,183.54	295,237.64	-600,945.90
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）	2,290,407,441.61	-707,200,896.09	1,583,206,545.52
项目	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 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）	16,209,168.25	-3,483,995.27	12,725,172.98
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-978,968.13	-978,968.13
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-2,544,557.92	737,414.67	-1,807,143.25
其中：1.基金申购款	1,234,303.74	-340,259.13	894,044.61
2.基金赎回款	-3,778,861.66	1,077,673.80	-2,701,187.86
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）	13,664,610.33	-3,725,548.73	9,939,061.60

注：报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：宋小龙，主管会计工作负责人：宋卫华，会计机构负责人：孙波

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

太平灵活配置混合型发起式证券投资基金(原名为“中原英石灵活配置混合型发起式证券投资基金”,以下简称“太平灵活配置混合基金”、“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2014]1392 号文件核准,由太平基金管理有限公司负责公开募集并担任基金管理人和注册登记机构,兴业银行股份有限公司(以下简称“兴业银行”)担任基金托管人。基金管理人太平基金管理有限公司于 2015 年 1 月 23 日至 2015 年 2 月 5 日对符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者、人民币合格境外机构投资者和发起资金提供方以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者公开发售。募集期结束经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)验证并出具普华永道中天验字(2015)第 115 号验资报告后,向中国证监会报送基金备案材料。本基金基金合同于 2015 年 2 月 10 日正式生效。本基金为契约型开放式、发起式,存续期限不定期。本基金首次向社会公开发售且扣除认购费用后的募集资本金额共计人民币 13,555,569.64 元,上述募集资本根据基金份额初始面值人民币 1.00 折合为 13,555,569.64 份基金份额。截至 2015 年 2 月 9 日止,本基金经注册登记系统确认的募集期间有效认购资金按实际适用年利率计算产生的利息折份额部分共计人民币 1,657.80 元,按基金份额初始面值人民币 1.00 元折合为 1,657.80 份基金份额。本基金的基金管理人为太平基金管理有限公司,基金托管人为兴业银行股份有限公司。

根据本基金管理人于 2016 年 9 月 29 日发布的《太平基金管理有限公司关于旗下中原英石灵活配置混合型发起式证券投资基金更名的公告》,中原英石灵活配置混合型发起式证券投资基金自 2016 年 9 月 29 日起更名为太平灵活配置混合型发起式证券投资基金。

本基金为发起式基金。基金管理人股东资金、基金管理人固有资金、基金管理人高级管理人员、基金经理等投资管理人员认购金额不低于 1,000 万元,认购的基金份额持有期限不低于三年。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《太平灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资对象为良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票)、权证、股指期货、可转换债券、银行存款和债券等资产,以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金的投资组合比例为:股票投资占基金资产的比例为 0%-95%,权证投资占基金资产净值的比例为 0%-3%,固定收益类资产投资占基金资产的比例为 5%-100%,扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为:1 年期银行定期存款利率(税后)+2%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的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”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《太平灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 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。

6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期未发生重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 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》[适用于 OEF]、财税[2004]78 号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、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。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。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、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(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,股票的股息、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,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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位:人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
活期存款	256,175,893.23
定期存款	-
其中:存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计	256,175,893.23

6.4.7.2 交易性金融资产

单位:人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	1,046,770,611.55	1,103,008,482.68	56,237,871.13	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	-	-	
	银行间市场	129,459,380.00	129,573,000.00	113,620.00
	合计	129,459,380.00	129,573,000.00	113,620.00
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	

其他	-	-	-
合计	1,176,229,991.55	1,232,581,482.68	56,351,491.13

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本期末（2017 年 6 月 30 日）本基金未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返市场	64,680,152.34	-
合计	64,680,152.34	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本期末（2017 年 6 月 30 日）本基金未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	135,476.23
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	1,920.30
应收债券利息	1,976,961.64
应收买入返售证券利息	10,049.93
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	533.10
合计	2,124,941.20

6.4.7.6 其他资产

本期末（2017 年 6 月 30 日）本基金未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	1,922,943.63
银行间市场应付交易费用	7,729.13
合计	1,930,672.76

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1.29
其他应付款	-
预提审计费	31,240.60
预提信息披露费	149,588.57
预提账户维护费	9,300.00
合计	190,130.46

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,289,482,565.25	2,289,482,565.25
本期申购	1,821,059.90	1,821,059.90
本期赎回（以“-”号填列）	-896,183.54	-896,183.54
本期末	2,290,407,441.61	2,290,407,441.61

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-783,133,505.10	2,579,533.74	-780,553,971.36
本期利润	17,009,029.18	56,636,201.71	73,645,230.89
本期基金份额交易产生的变动数	-301,676.17	9,520.55	-292,155.62
其中：基金申购款	-602,271.68	14,878.42	-587,393.26
基金赎回款	300,595.51	-5,357.87	295,237.64
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-766,426,152.09	59,225,256.00	-707,200,896.09

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	2,988,505.02
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	42,412.90
其他	5,149.69
合计	3,036,067.61

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	2,115,892,194.29
减：卖出股票成本总额	2,096,294,589.60
买卖股票差价收入	19,597,604.69

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	92,760,379.11
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	90,364,420.00
减：应收利息总额	2,157,746.85
买卖债券差价收入	238,212.26

6.4.7.14 衍生工具收益

本报告期内本基金无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2017年1月1日至2017年6月30日
股票投资产生的股利收益	8,864,806.79
基金投资产生的股利收益	-
合计	8,864,806.79

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
1.交易性金融资产	56,636,201.71
——股票投资	56,521,646.71
——债券投资	114,555.00
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
合计	56,636,201.71

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
基金赎回费收入	963.67
合计	963.67

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
交易所市场交易费用	6,776,895.19
银行间市场交易费用	2,575.00
合计	6,779,470.19

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
预提审计费用	33,856.60
预提信息披露费	49,588.57

银行划款费用	9,651.17
账户维护费	23,200.00
合计	116,296.34

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无需要说明的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
太平基金管理有限公司（“太平基金”）	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构
太平资产管理有限公司（“太平资产”）	基金管理人的股东
兴业银行股份有限公司（“兴业银行”）	基金托管人
中原证券股份有限公司（“中原证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
安石投资管理有限公司（“安石投资”）	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2017年1月1日至2017年6月30日		2016年1月1日至2016年6月30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
中原证券股份有限公司	-	-	4,185,273.48	22.40%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间，未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间，未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间，未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.5 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6月30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
中原证券股份有限公司	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30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
中原证券股份有限公司	3,060.67	20.18%	-	-

注：1、交易佣金的计算方式：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。

2、上述交易佣金比率按市场佣金率计算，在合理商业条款范围内并符合行业标准。

3、本基金管理人因此从关联方获得的其他服务主要包括：为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月 30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月 30日
	当期发生的基金应支付的管理费	11,403,109.30
其中：支付销售机构的客户维护费	1,839.78	3,537.10

注：支付基金管理人太平基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值的 1.50% 年费率计提，每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：每日应计提的基金管理费=前一日的基金资产净值×1.50%÷当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月 30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6 月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,900,518.21	13,338.91

注：支付基金托管人兴业银行股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 年费率计提，每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：每日应计提的基金托管费=前一日的基金资产净值×0.25%÷当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期内及上年度可比期间，本基金未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 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6月30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日
基金合同生效日（2015年2月10日）持有的基金份额	10,001,375.14	10,001,375.14
期初持有的基金份额	10,001,375.14	10,001,375.14
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	10,001,375.14	10,001,375.14
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.44%	73.19%

注：本基金管理人按照本基金基金合同、招募说明书的约定费率进行认购、申购和赎回，不享有比其他投资人更优惠的费率。

6.4.10.4.2 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

报告期末及上年度末，其他关联方均未投资本基金。

6.4.10.5 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6月30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日
-------	----------------------------	---------------------------------

	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
兴业银行总行	256,175,893.23	2,988,505.02	1,903,679.59	62,215.07

注：本基金的银行存款由基金托管人兴业银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。除上表列示的金额外，本基金的证券交易结算资金通过托管银行备付金账户转存于中国证券登记结算有限责任公司，2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日止期间获得的备付金利息收入为人民币 42,412.9 元，2017 年 6 月 30 日结算备付金余额为人民币 4,267,167.13 元。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期内及上年度可比期间，本基金未在承销期内参与认购关联方承销的证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本报告期内及上年度可比期间，本基金无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本报告期内，本基金未进行利润分配。

6.4.12 期末（2017 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 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

6.4.12.1.1 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
002879	长缆科技	2017-06-05	2017-07-07	网下中签	18.02	18.02	1,313.00	23,660.26	23,660.26	-
002882	金龙羽	2017-06-15	2017-07-17	网下中签	6.20	6.20	2,966.00	18,389.20	18,389.20	-
603305	旭升股份	2017-06-30	2017-07-10	网下中签	11.26	11.26	1,351.00	15,212.26	15,212.26	-
603331	百达精工	2017-06-27	2017-07-05	网下中签	9.63	9.63	999.00	9,620.37	9,620.37	-
603617	君禾股份	2017-06-23	2017-07-03	网下中签	8.93	8.93	832.00	7,429.76	7,429.76	-
603933	睿能科技	2017-06-28	2017-07-06	网下中签	20.20	20.20	857.00	17,311.40	17,311.40	-
300670	大烨智能	2017-06-26	2017-07-03	网下中签	10.93	10.93	1,259.00	13,760.87	13,760.87	-

300671	富满电子	2017-06-27	2017-07-05	网下中签	8.11	8.11	942.00	7,639.62	7,639.62	-
300672	国科微	2017-06-30	2017-07-12	网下中签	8.48	8.48	1,257.00	10,659.36	10,659.36	-

6.4.12.2 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
600568	中珠医疗	2017-04-25	重大资产重组	19.16	2017-07-27	6.15	770,000.00	18,726,790.23	14,753,200.00	-
600643	爱建集团	2017-05-25	重大资产重组	14.98	2017-08-02	16.48	799,937.00	10,481,262.71	11,983,056.26	-
000887	中鼎股份	2017-04-28	重大资产重组	22.09	2017-07-14	19.88	112,256.00	2,803,506.90	2,479,735.04	-
300461	田中精机	2017-05-10	重大资产重组	64.25	-	-	207,600.00	13,458,594.93	13,338,300.00	-
300145	中金环境	2017-06-28	重大资产重组	16.92	-	-	599,913.00	10,094,912.85	10,150,527.96	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 6 月 30 日止，本基金未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 6 月 30 日止，本基金未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金属于混合型基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金，属于证券投资基金里中高风险、中高预期收益的品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资、货币市场工具、股指期货、权证等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的

主要目标是争取将相对风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险收益相匹配”的风险收益目标。

本基金管理人建立了董事会、经营管理层、风险管理部门、各职能部门在内的多级风险管理组织架构，并明确了相应的风险管理职能。董事会主要负责确定公司风险管理总体目标、制定公司风险管理战略和风险应对策略等事项。经营管理层及其下设的风险控制委员会负责指导、协调和监督各职能部门和各业务单元开展风险管理工作。公司设立独立于业务体系汇报路径的稽核风控部，对公司的风险管理承担独立评估、监控、检查和报告职责。公司各业务部门负责具体制定业务相关的风险措施、控制流程、监控指标等并负责具体实施，同时定期对本部门的风险进行评估。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放于信用良好的银行，与其相关的信用风险较小。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2017 年 6 月 30 日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券(2016 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持证券均在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017 年 6 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月 -1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	256,175,893.	-	-	-	-	-	-256,175,893.

	23						23
结算备付金	4,267,167.13	-	-	-	-	-	-4,267,167.13
存出保证金	1,184,783.50	-	-	-	-	-	-1,184,783.50
交易性金融资产	30,003,000.00	-99,570,000.00				1,103,008,482.68	1,232,581,482.68
买入返售金融资产	64,680,152.34	-	-	-	-	-	64,680,152.34
应收利息	-	-	-	-	-	-2,124,941.20	2,124,941.20
应收证券清算款						27,377,177.54	27,377,177.54
资产总计	356,310,996.20	-99,570,000.00				1,132,510,601.42	1,588,391,597.62
负债	-	-					
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,025.40	1,025.40
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,905,923.13	1,905,923.13
应付托管费	-	-	-	-	-	317,653.87	317,653.87
应付交易费用	-	-	-	-	-	1,930,672.76	1,930,672.76
其他负债	-	-	-	-	-	190,130.46	190,130.46
应付证券清算款						839,646.48	839,646.48
负债总计	-	-	-	-	-	5,185,052.10	5,185,052.10
利率敏感度缺口	356,310,996.20	-99,570,000.00				-1,127,325,549.32	1,583,206,545.52
上年度末 2016 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月 -1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	995,391,551.44	-	-	-	-	-	995,391,551.44
结算备付金	31,507.51	-	-	-	-	-	31,507.51
存出保证金	13,356.15	-	-	-	-	-	13,356.15
交易性金融资产	-	-	549,285.00	-	-	-8,116,906.00	8,666,191.00
买入返售金融资产	504,901,677.35	-	-	-	-	-	504,901,677.35
应收利息	-	-	-	-	-	263,027.65	263,027.65
资产总计	1,500,338,092.4	-	549,285.00	-	-	-8,379,933.65	1,509,267,311.10

负债							
应付赎回款						4,170.06	4,170.06
应付管理人报酬						134,410.62	134,410.62
应付托管费						22,401.75	22,401.75
应付交易费用						17,726.94	17,726.94
其他负债						160,007.84	160,007.84
负债总计						338,717.21	338,717.21
利率敏感度缺口	1,500,338.09		549,285.00			8,041,216.44	1,508,928.59
	2.4						3.89

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1.该利率敏感性分析基于本基金于资产负债表日的利率风险状况		
	2.该利率敏感性分析假定所有期限利率均以相同幅度变动 25 个基点,且除利率之外的其他市场变量保持不变		
	3.该利率敏感性分析并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的	
		影响金额(单位:人民币元)	
		本期末	上年度末
		2017年6月30日	2016年12月31日
	市场利率下降 25 个基点	171,555.52	-
	市场利率上升 25 个基点	-171,555.52	-

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价,因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券,所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响,也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中,采用“自上而下”的策略,通过对宏观经济情况及政策的分析,结合证券市场运行情况,做出资产配置及组合构建的决定;通过对单个证券的定性分析及定量分析,选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定

期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日		上年度末 2016 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	1,103,008,482.68	69.67	8,116,906.00	0.54
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	129,573,000.00	8.18	549,285.00	0.04
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,232,581,482.68	77.85	8,666,191.00	0.58

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
	沪深 300 指数上升 5%	67,909,411.25	-
	沪深 300 指数下降 5%	-67,909,411.25	-

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低

层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2017 年 6 月 30 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 1,103,008,482.68 元，属于第二层次的余额为 129,573,000.00 元，无属于第三层次的余额(2016 年 12 月 31 日：第一层次 8,116,906.00 元，第二层级 549,285.00 元，无属于第三层次的余额)。

(ii) 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债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间将相关股票和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，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2017 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2016 年 12 月 31 日：同)。

(d) 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应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

7 投资组合报告

7.1 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	1,103,008,482.68	69.44

	其中：股票	1,103,008,482.68	69.44
2	固定收益投资	129,573,000.00	8.16
	其中：债券	129,573,000.00	8.16
	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	64,680,152.34	4.07
	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	260,443,060.36	16.40
7	其他各项资产	30,686,902.24	1.93
8	合计	1,588,391,597.62	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	53,703,209.32	3.39
B	采矿业	124,415,008.85	7.86
C	制造业	751,927,142.66	47.49
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	19,876,868.90	1.26
G	交通运输、仓储和邮政业	5,849,327.25	0.37
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,639.62	0.00
J	金融业	86,984,643.82	5.49
K	房地产业	50,458,762.26	3.19
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	9,785,880.00	0.62
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	1,103,008,482.68	69.67

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	600497	驰宏锌锗	14,344,667	93,957,568.85	5.93
2	600594	益佰制药	4,059,880	61,953,768.80	3.91
3	002677	浙江美大	4,378,119	60,987,197.67	3.85
4	600030	中信证券	3,000,000	51,060,000.00	3.23
5	000060	中金岭南	4,465,819	50,017,172.80	3.16
6	600519	贵州茅台	90,000	42,466,500.00	2.68
7	000568	泸州老窖	699,914	35,401,650.12	2.24
8	000858	五粮液	619,959	34,506,917.94	2.18
9	601155	新城控股	1,799,939	33,370,869.06	2.11
10	300503	昊志机电	1,690,020	30,437,260.20	1.92
11	000998	隆平高科	1,305,330	28,743,366.60	1.82
12	600104	上汽集团	899,874	27,941,087.70	1.76
13	000651	格力电器	650,000	26,760,500.00	1.69
14	000333	美的集团	600,000	25,824,000.00	1.63
15	601318	中国平安	482,596	23,941,587.56	1.51
16	600660	福耀玻璃	900,000	23,436,000.00	1.48
17	002508	老板电器	530,763	23,077,575.24	1.46
18	000898	鞍钢股份	3,835,381	21,708,256.46	1.37
19	000963	华东医药	399,937	19,876,868.90	1.26
20	002242	九阳股份	929,947	18,292,057.49	1.16
21	002353	杰瑞股份	1,148,819	18,174,316.58	1.15
22	300136	信维通信	449,842	18,002,676.84	1.14
23	601118	海南橡胶	3,080,254	17,495,842.72	1.11
24	600518	康美药业	800,000	17,392,000.00	1.10
25	600500	中化国际	1,789,955	17,111,969.80	1.08
26	001979	招商蛇口	799,995	17,087,893.20	1.08

27	603868	飞科电器	269,967	16,694,759.28	1.05
28	000921	海信科龙	940,000	16,177,400.00	1.02
29	600585	海螺水泥	699,913	15,909,022.49	1.00
30	601857	中国石油	2,000,000	15,380,000.00	0.97
31	002271	东方雨虹	399,978	14,839,183.80	0.94
32	600568	中珠医疗	770,000	14,753,200.00	0.93
33	000878	云南铜业	1,087,984	14,350,508.96	0.91
34	300461	田中精机	207,600	13,338,300.00	0.84
35	000725	京东方 A	3,000,000	12,480,000.00	0.79
36	600643	爱建集团	799,937	11,983,056.26	0.76
37	000823	超声电子	800,000	11,536,000.00	0.73
38	601808	中海油服	936,000	10,333,440.00	0.65
39	300054	鼎龙股份	1,005,840	10,229,392.80	0.65
40	300145	中金环境	599,913	10,150,527.96	0.64
41	603588	高能环境	627,300	9,785,880.00	0.62
42	002234	民和股份	600,000	7,464,000.00	0.47
43	600741	华域汽车	289,970	7,028,872.80	0.44
44	601111	中国国航	599,931	5,849,327.25	0.37
45	600028	中国石化	800,000	4,744,000.00	0.30
46	002202	金风科技	300,000	4,641,000.00	0.29
47	600703	三安光电	200,000	3,940,000.00	0.25
48	002241	歌尔股份	190,000	3,663,200.00	0.23
49	002456	欧菲光	200,000	3,634,000.00	0.23
50	002366	台海核电	69,981	3,282,808.71	0.21
51	601231	环旭电子	200,000	3,142,000.00	0.20
52	300433	蓝思科技	99,940	2,907,254.60	0.18
53	000887	中鼎股份	112,256	2,479,735.04	0.16
54	002384	东山精密	100,000	2,470,000.00	0.16
55	002050	三花智控	150,000	2,448,000.00	0.15
56	002217	合力泰	224,000	2,213,120.00	0.14
57	600019	宝钢股份	300,000	2,013,000.00	0.13
58	002185	华天科技	260,000	1,882,400.00	0.12
59	000050	深天马 A	90,000	1,851,300.00	0.12
60	603801	志邦股份	1,405	47,489.00	0.00
61	603043	广州酒家	1,810	45,738.70	0.00
62	300666	江丰电子	2,276	43,448.84	0.00
63	603380	易德龙	1,298	35,370.50	0.00
64	002879	长缆科技	1,313	23,660.26	0.00
65	002881	美格智能	989	22,608.54	0.00
66	603679	华体科技	809	21,438.50	0.00
67	603938	三孚股份	1,246	20,932.80	0.00
68	002882	金龙羽	2,966	18,389.20	0.00
69	603933	睿能科技	857	17,311.40	0.00
70	603305	旭升股份	1,351	15,212.26	0.00

71	300669	沪宁股份	841	14,650.22	0.00
72	300670	大烨智能	1,259	13,760.87	0.00
73	603286	日盈电子	890	13,528.00	0.00
74	300672	国科微	1,257	10,659.36	0.00
75	603331	百达精工	999	9,620.37	0.00
76	300671	富满电子	942	7,639.62	0.00
77	603617	君禾股份	832	7,429.76	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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	000878	云南铜业	178,912,744.67	11.86
2	600497	驰宏锌锗	121,171,779.54	8.03
3	000937	冀中能源	115,566,933.97	7.66
4	000983	西山煤电	90,618,448.39	6.01
5	000898	鞍钢股份	86,421,527.76	5.73
6	000060	中金岭南	84,443,727.03	5.60
7	001979	招商蛇口	78,002,981.32	5.17
8	601009	南京银行	71,358,566.67	4.73
9	000709	河钢股份	71,094,211.00	4.71
10	600594	益佰制药	68,058,582.30	4.51
11	002677	浙江美大	65,148,211.73	4.32
12	600166	福田汽车	64,769,140.00	4.29
13	601668	中国建筑	60,922,387.60	4.04
14	600030	中信证券	51,425,680.44	3.41
15	000997	新大陆	48,230,728.80	3.20
16	000887	中鼎股份	44,398,158.03	2.94
17	000568	泸州老窖	42,804,329.19	2.84
18	601118	海南橡胶	42,153,384.22	2.79
19	601155	新城控股	40,554,232.59	2.69
20	603609	禾丰牧业	37,701,046.63	2.50
21	300503	昊志机电	37,202,395.98	2.47
22	603588	高能环境	36,070,519.62	2.39
23	600519	贵州茅台	35,789,176.02	2.37
24	600500	中化国际	34,719,822.59	2.30
25	300136	信维通信	34,617,343.35	2.29
26	600027	华电国际	32,158,226.94	2.13

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

7.4.2 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	000878	云南铜业	165,211,931.89	10.95
2	000937	冀中能源	122,636,981.72	8.13
3	000983	西山煤电	94,707,052.42	6.28
4	000709	河钢股份	83,774,131.47	5.55
5	601009	南京银行	75,990,193.92	5.04
6	601668	中国建筑	69,869,422.91	4.63
7	600166	福田汽车	69,040,074.00	4.58
8	000898	鞍钢股份	65,020,770.35	4.31
9	001979	招商蛇口	62,977,956.88	4.17
10	000997	新大陆	47,557,018.00	3.15
11	000060	中金岭南	39,307,364.46	2.60
12	000887	中鼎股份	38,763,612.33	2.57
13	603609	禾丰牧业	35,314,025.33	2.34
14	600909	华安证券	32,938,349.04	2.18
15	600027	华电国际	30,962,428.95	2.05
16	603588	高能环境	30,926,142.00	2.05
17	600497	驰宏锌锗	30,411,950.99	2.02
18	601225	陕西煤业	29,951,142.09	1.98
19	601169	北京银行	29,697,417.79	1.97
20	300011	鼎汉技术	26,908,269.25	1.78

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	3,134,664,519.57
卖出股票的收入（成交）总额	2,115,892,194.29

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

7.5 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	129,573,000.00	8.18
	其中：政策性金融债	129,573,000.00	8.18
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	129,573,000.00	8.18

7.6 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(%)
1	170204	17 国开 04	1,000,000	99,570,000.00	6.29
2	150417	15 农发 17	300,000	30,003,000.00	1.90

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同的约定，本基金不进行国债期货交易。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

根据本基金基金合同的约定，本基金不进行国债期货交易。

7.11.3 本期国债期货投资评价

根据本基金基金合同的约定，本基金不进行国债期货交易。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体没有出现被监管部门立案调查，或在本报告编制日前一年内受到公开谴责处罚的情况。

7.12.2 本报告期内，本基金投资的前十名股票中没有出现超出基金合同规定备选股票库的情形。

7.12.3 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	1,184,783.50
2	应收证券清算款	27,377,177.54
3	应收股利	-
4	应收利息	2,124,941.20
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	30,686,902.24

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8 基金份额持有人信息

8.1 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
245	9,348,601.80	2,286,175,881.97	99.82%	4,231,559.64	0.18%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	1,540,104.86	0.07%

8.3 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	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	0

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占 基金总份额 比例	发起份额总数	发起份额 占基金总 份额比例	发起份额承 诺持有期限
基金管理人固有资金	10,001,375.14	0.44%	10,001,375.14	0.44%	3 年
基金管理人高级管理人员	1,460,323.02	0.06%	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	11,461,698.16	0.50%	10,001,375.14	0.44%	-

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015 年 2 月 10 日）基金份额总额	13,557,227.44
本报告期期初基金份额总额	2,289,482,565.25
本报告期基金总申购份额	1,821,059.90
减：本报告期基金总赎回份额	896,183.54
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,290,407,441.61

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 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

本报告期内基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务，本报告期内本基金未改聘为其提供审计服务的会计师事务所。

10.6 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、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	
西南证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-

中原证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	1	1,279,051,030.66	24.37%	935,370.69	22.30%	-
兴业证券	1	1,142,439,368.39	21.77%	1,063,955.13	25.36%	-
中信建投	2	841,715,623.50	16.04%	615,547.36	14.67%	-
国海证券	1	705,241,792.67	13.44%	515,741.90	12.29%	-
招商证券	1	642,534,085.64	12.24%	598,390.28	14.26%	-
中泰证券	1	637,758,949.84	12.15%	466,390.14	11.12%	-

注：1、交易单元的选择标准和程序

拟被基金管理人租用交易单元的券商应符合以下标准：

- (1) 市场形象及财务状况良好。
- (2) 经营行为规范，内控制度健全，最近一年未因发生重大违规行为而受到国家监管部门的处罚。
- (3) 内部管理规范、严格，具备能够满足基金高效、安全运作的通讯条件。
- (4) 研究实力较强，具有专门的研究机构和专职研究人员，能及时、定期、全面地为基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、个股分析的研究报告及周到的信息服务。

根据上述标准进行考察后，由基金管理人的投资决策委员会确定租用券商的交易单元，并由基金管理人与被选择的券商签订协议。

2、报告期内基金租用券商交易单元的变更情况

本报告期内本基金新增租用西南证券、华泰证券、申万宏源证券、中信建投证券、中泰证券的 8 个交易单元。

10.7.2 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		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
西南证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中原证券	-	-	1,233,000,000.00	85.45%	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	170,749.18	23.71%	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-

国海证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	210,000,000.00	14.55%	-	-
中泰证券	549,505.00	76.29%	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	太平基金管理有限公司关于旗下基金增加销售机构并参加相关费率优惠活动的公告	《证券时报》、基金管理人网站	2017-02-07
2	太平基金管理有限公司关于旗下部分基金增加销售机构的公告	《证券时报》、基金管理人网站	2017-02-28
3	太平基金管理有限公司关于旗下部分基金增加销售机构的公告	《证券时报》、基金管理人网站	2017-03-28
4	太平基金管理有限公司关于旗下部分基金增加销售机构的公告	《证券时报》、基金管理人网站	2017-05-10
5	太平基金管理有限公司关于翁锡赉先生卸任太平灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理的公告	《证券时报》、基金管理人网站	2017-05-11
6	太平基金管理有限公司关于增聘林开盛先生担任太平灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理的公告	《证券时报》、基金管理人网站	2017-05-11

11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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	20170101-20170630	2,276,174,506.83	-	-	2,276,174,506.83	99.38%
产品特有风险							
<p>(1) 本基金作为混合型基金，投资于股票、债券、货币市场工具、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。因此股市、债市的变化将影响到本基金的业绩表现。</p> <p>(2) 本基金可投资于中小企业私募债。本基金所投资的中小企业私募债券之债务人如出现违约，或在交易过程中发生交收违约，或由于中小企业私募债券信用质量降低导致价格下降，可能造成基金财产损失。此外，受市场规模及交易活跃程度的影响，中小企业私募债券可能无法在同一价格水平上进行较大数量的买入或卖出，存在一定的流动性风险。</p> <p>(3) 本基金可投资于股指期货，股指期货作为一种金融衍生品，面临的主要风险是市场风险、</p>							

流动性风险、基差风险和保证金风险。具体为：

①市场风险是指由于股指期货价格变动而给投资人带来的风险。市场风险是股指期货投资中最主要的风险。

②流动性风险是指由于股指期货合约无法及时变现所带来的风险。

③基差风险是指股指期货合约价格和标的指数价格之间价格差的波动所造成的风险，以及不同股指期货合约价格之间价格差的波动所造成的期限价差风险。

④保证金风险是指由于无法及时筹措资金满足建立或维持股指期货合约头寸所要求的保证金而带来的风险。

(4) 本基金为发起式基金，基金合同生效三年后，若基金资产净值低于2亿元的，基金合同自动终止，投资者将面临基金合同可能终止的不确定性风险。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会关于核准本基金募集的批复
- 2、《太平灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》
- 3、《太平灵活配置混合型发起式证券投资基金招募说明书》
- 4、《太平灵活配置混合型发起式证券投资基金托管协议》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、法律法规及中国证监会要求的其他文件

12.2 存放地点

本基金管理人办公地点（地址：上海市浦东新区花园石桥路 33 号花旗集团大厦 17 楼 1708 室）

12.3 查阅方式

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人太平基金管理有限公司；部分备查文件可在本基金管理人公司网站上查阅。

客户服务电话：021-38874600

公司网址：www.taipingfund.com.cn

太平基金管理有限公司

二〇一七年八月二十八日