

华宝先进成长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：华宝基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2018 年 3 月 27 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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 3 月 23 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告中的财务资料已经审计，普华永道中天会计师事务所为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自 2017 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华宝先进成长混合型证券投资基金
基金简称	华宝先进成长混合
基金主代码	240009
交易代码	240009
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006 年 11 月 7 日
基金管理人	华宝基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	363,408,073.26 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	分享我国经济增长方式转变过程中和转变完成后的先进企业的成长，在控制风险的前提下为基金份额持有人谋求长期超额回报。
投资策略	本基金将使用定量与定性相结合的方法，选择具备创新能力强、注重资源节约与环境友好、充分发挥人力资源优势这三个先进因素之一的企业进行投资，重点关注国家产业结构调整中鼓励类行业，同时也兼顾有先进企业的传统行业。
业绩比较基准	新上证综指收益率
风险收益特征	本基金是一只主动投资的混合型基金，其长期平均预期风险和预期收益率低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金。

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		华宝基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	刘月华	王永民
	联系电话	021-38505888	010-66594896
	电子邮箱	xxpl@fsfund.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-700-5588、021-38924558	95566
传真		021-38505777	010-66594942

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.fsfund.com
基金年度报告备置地点	本基金年报置备地点包括基金管理人办公场所和基金托管人住所。

§ 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
本期已实现收益	-62,997,676.89	-317,600,587.43	1,202,525,899.64
本期利润	-5,834,669.55	-615,408,605.21	1,440,323,984.86
加权平均基金份额本期利润	-0.0139	-1.0961	1.9925
本期加权平均净值利润率	-0.49%	-36.33%	59.36%
本期基金份额净值增长率	-0.99%	-26.34%	91.45%
3.1.2 期末数据和指标	2017 年末	2016 年末	2015 年末
期末可供分配利润	661,718,225.93	843,623,202.06	1,832,617,265.46
期末可供分配基金份额利润	1.8209	1.8492	2.8655
期末基金资产净值	1,025,126,299.19	1,299,840,273.46	2,473,749,430.66
期末基金份额净值	2.8209	2.8492	3.8680
3.1.3 累计期末指标	2017 年末	2016 年末	2015 年末
基金份额累计净值增长率	246.75%	250.23%	375.46%

注：1、所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。

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

3、期末可供分配利润采用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。

4、净值相关数据计算中涉及天数的，包括所有交易日以及季末最后一自然日（如非交易日）。

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	-3.66%	0.98%	-1.23%	0.57%	-2.43%	0.41%
过去六个月	-0.27%	0.95%	3.59%	0.55%	-3.86%	0.40%
过去一年	-0.99%	0.84%	6.59%	0.55%	-7.58%	0.29%
过去三年	39.62%	2.01%	2.17%	1.67%	37.45%	0.34%
过去五年	120.43%	1.80%	45.45%	1.48%	74.98%	0.32%

自基金合同生效日起至 今	246.75%	1.75%	74.57%	1.72%	172.18%	0.03%
-----------------	---------	-------	--------	-------	---------	-------

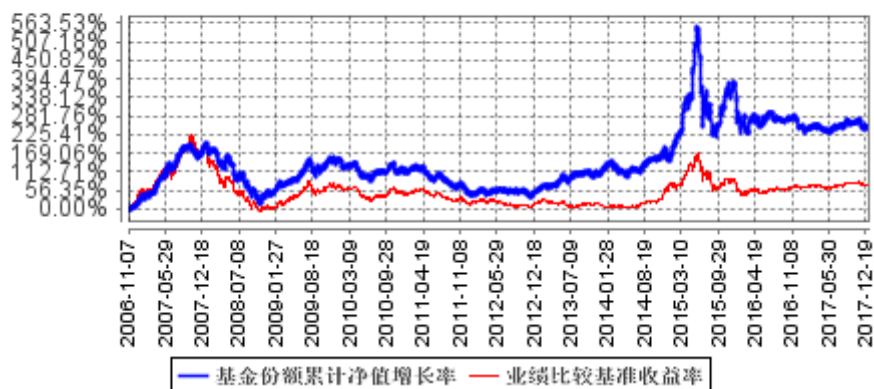
注：1、本基金业绩比较基准为：新上证综指收益率。

2、净值以及比较基准相关数据计算中涉及天数的，包括所有交易日以及季末最后一自然日（如非交易日）。

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

(2006 年 11 月 7 日至 2017 年 12 月 31 日)

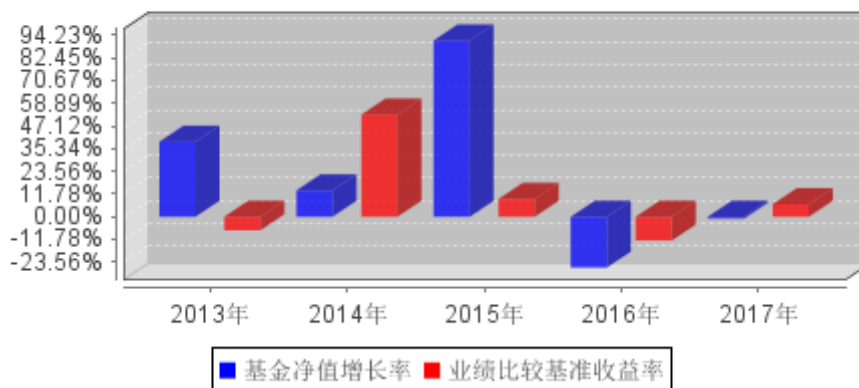
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：按照基金合同的约定，自基金成立日期的 6 个月内达到规定的资产组合，截至 2007 年 5 月 7 日，本基金已达到合同规定的资产配置比例。

3.2.3 过去五年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

过去五年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

本基金过去三年未实施利润分配。

§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

基金管理人是 2003 年 3 月 7 日正式成立的合资基金管理公司，截至本报告期末（2017 年 12 月 31 日），所管理的证券投资基金包括宝康系列基金、多策略基金、现金宝货币市场基金、动力组合基金、收益增长基金、先进成长基金、行业精选基金、海外中国成长基金、大盘精选基金、增强收益基金、中证 100 基金、上证 180 价值 ETF、上证 180 价值 ETF 联接基金、新兴产业基金、可转债基金、上证 180 成长 ETF、上证 180 成长 ETF 联接基金、华宝油气基金、医药生物基金、资源优选基金、华宝添益基金、服务优选基金、创新优选基金、生态中国基金、量化对冲基金、高端制造基金、品质生活基金、稳健回报基金、事件驱动基金、国策导向基金、新价值基金、新机遇基金、医疗分级基金、中证 1000 分级基金、万物互联基金、转型升级基金、核心优势基金、美国消费基金、宝鑫纯债基金、香港中小盘基金、中证全指证券公司 ETF、中证军工 ETF、新活力基金、沪深 300 指数增强基金、未来主导产业基金、新起点基金、红利基金、新动力基金、新飞跃基金、新回报基金、新优选基金、香港大盘基金、智慧产业基金、第三产业基金、新优享基金和银行 ETF，所管理的证券投资基金资产净值合计 124,360,151,012.53 元。

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		
季鹏	本基金基金经理、华宝宝康配置混合、华宝第三产业混合基金经理	2015 年 5 月 7 日	2017 年 12 月 27 日	11 年	硕士，拥有 CFA 资格。曾在香港大福证券、光大保德信基金管理有限公司从事行业研究、投资管理工作。2011 年 4 月加入华宝基金管理有限公司任高级策略分析师兼基金经理助理的职务。2013 年 8 月起任华宝宝康灵活配置证券投资基金基金经理。2015 年 5 月至 2017 年 5 月任华宝国策导向混合型证券投资基金基金经理。2015 年 5 月至

					2017 年 12 月兼任华宝先进成长混合型证券投资基金基金经理，2017 年 5 月任华宝第三产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理
曾豪	本基金基金经理、研究部总经理	2017 年 12 月 27 日	-	8 年	曾任中信证券股份有限公司担任执行总监兼首席分析师的职务。2015 年 6 月加入华宝基金管理有限公司,担任研究部总经理的职务。2017 年 12 月起担任华宝先进成长混合型证券投资基金基金经理。

注：1、任职日期以及离任日期均以基金公告为准。

2、证券从业含义遵从行业协会《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，本基金管理人遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《华宝先进成长混合型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋取最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

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

基金管理人从研究分析、授权、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动的各个环节出发制定了公司内部的公平交易制度以确保公司所有投资组合在各个环节得到公平的对待。公平交易制度和控制方法适用公司管理所有投资组合（包括公募基金、特定客户资产管理组合），对应的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动。

研究分析方面，公司使用统一的投资研究管理系统，并规定所有与投资业务相关的研究报告和股票入库信息必须在该系统中发表和存档。同时，该系统对所有投资组合经理设置相同的使用权限。

授权和投资决策方面，投资组合经理在其权限范围内的投资决策保持独立，并对其投资决策

的结果负责。通过各个系统的权限设置使投资组合经理仅能看到自己的组合情况。

交易执行方面，所有投资组合的投资指令必须通过交易系统分发和执行。对于交易所公开竞价交易，交易系统内置公平交易执行程序。公司内部制度规定此类交易指令需执行公平交易程序，由交易部负责人负责执行。针对其他不能通过系统执行公平交易程序且必须以公司名义统一进行交易的指令，公司内部制定相关制度流程以确保此类交易的公允分配。同时，公司根据法规要求在交易系统中设置一系列投资禁止与限制指标对公平交易的执行进行事前控制，主要包括限制公司旗下组合自身及组合间反向交易、对敲交易、银行间关联方交易等。

事后监督，公司的风险管理部作为独立第三方对所有投资行为进行事后监督，主要监督的事项包括以下内容。

1) 每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行分析。

2) 每季度和每年度对公司管理的不同投资组合所有交易所二级市场交易进行 1 日、3 日、5 日同向交易价差分析。

3) 对公司管理的不同投资组合的所有银行间债券买卖和回购交易进行分析。监督的内容包括以下几点，同一投资组合短期内对同一债券的反向交易，债券买卖到期收益率与中债登估价收益率之间的差异，回购利率与当日市场平均利率之间的差异。对上述监督内容存在异常的情况要求投资组合经理进行合理性解释。

4) 对非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购的申购方案和分配过程的公允性进行监督。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，基金管理人通过严格执行投资决策委员会议事规则、公司股票库管理制度、中央交易室制度、防火墙机制、系统中的公平交易程序、每日交易日结报告、定期基金投资绩效评价等机制，确保所管理的所有投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。同时，基金管理人严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定和公司内部制度要求，分析了本公司旗下所有投资组合之间的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异以及连续四个季度期间内、不同时间窗下同向交易的交易价差；分析结果未发现异常情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，基金管理人未发生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%。

本报告期内，本基金未发现异常交易行为。

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 年全年，A 股总体震荡向上，但结构性分化严重，行业差别明显；主板表现明显优于中小板和创业板。全年回顾，沪深 300 指数上涨 21.78%，上证指数上涨 6.56%，中小板指数上涨 16.73%，创业板指数下跌 10.67%，深圳指上涨 8.48%。上证指数全年表现明显好于中小板和创业板，特别是上证 50 表现较好，分行业来看，食品饮料、家电、银行、煤炭、钢铁板块，都录得较大的正收益；而餐饮旅游、计算机、传媒、纺织服装等板块大幅下跌，创业板股票普遍录得较大的负收益，市场资金表现出较大的向上证 50、行业龙头和消费品集中的趋势，而中小市值股票普遍录得较大的负收益，市场二八现象明显；全年资金主要来自海外资金和保险等机构，市场环境明显表现出机构化和强监管的趋势。回顾全年，本基金年初重仓成长股录得较大下跌拖累业绩，三月之后布局大量仓位在电子和消费品股票使得业绩有所回升，三季度又有择时操作周期股但是收益不明显，总体而言，全年业绩不理想，表现落后。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本报告期内基金份额净值增长率为-0.99%，同期业绩比较基准收益率为 6.59%，基金表现落后于比较基准 7.58%。

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，预计中国经济增长将继续保持总体平稳，但货币政策和全球经济前景较 2017 年明显复杂。在需求回温和供给侧改革的持续推动下，预计国内 2018 年的经济开局仍将不错，但通胀回升和金融去杠杆在继续推动货币政策收紧和强化金融监管；而同时美国和全球的经济复苏又在全球范围内推动通胀回升和美元利率的走强，全球和国内都开始逐步进入较明显的货币收紧周期，相信这将陆续影响股票市场。预计市场今年波动将明显加大，适当的灵活操作也是需要的。此外，2017、2018 年应该是中国股市对外开放，全球资金加大 A 股配置的重要阶段；在这一过程中，无论是对 A 股传统的投资方法、定价模式，还是资金话语权都在发生深刻变化；而目前证监会推行的注册制、退市制度等措施又在加速国内股市生态向机构化和价值化转型，我们需要格外重视这一变化。

就长期而言，我们对中国经济转型所带来的投资前景充满信心，但就 2018 年国内外的经济

环境而言，形势复杂，但黑天鹅事件也可能较多：多种信息将极有可能增大市场短期的波动，我们将继续保持此前小心谨慎的投资风格，需要紧密关注国内外宏观经济和政策变化，仓位较为灵活；标的选择上将紧密跟踪各行业景气度变化，精选优秀的公司并长期持有，分享这些公司中长期业绩快速增长带来的丰厚回报。感谢基金持有人一直以来对我们的支持，我们将继续勤勉尽责，努力为持有人创造好的回报。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

公司自 2003 年 3 月成立以来始终注重合规性和业务风险控制。加强对基金运作的内部操作风险控制、保障基金份额持有人的利益始终是公司制定各项内部制度、流程的指导思想。公司监察稽核部门对公司遵守各项法规和管理制度及公司所管理的各基金履行合同义务的情况进行核查，发现问题及时提出改进建议并督促业务部门进行整改，同时定期向监管部门、公司管理层及上级公司出具相关报告。

本报告期内，基金管理人内部监察稽核主要工作如下：

（一）规范员工行为操守，加强职业道德教育和风险教育。公司通过对新员工集中组织岗前培训、签署《个人声明书》等形式，明确员工的行为准则，防范道德风险。并在具体工作中坚持加强法规培训，努力培养员工的风险意识、合法合规意识。

（二）完善公司制度体系。公司一方面坚持制度的刚性，不轻易改变、简化已确立的流程。要求从一般员工、部门经理到业务总监，每个人都必须清楚自己的权力和职责，承担相应责任。另一方面，伴随市场变革和产品创新，公司的业务和管理方式也发生着变化。在长期的业务实践中，公司借鉴和吸收海外股东、国内同行经验，在符合公司基本制度的前提下，根据业务的发展不时调整。允许各级员工在职责范围内设计和调整自己的业务流程，涉及其它部门或领域的，由相应级别的负责人在符合公司已有制度的基础上协调和批准。公司根据法律法规的变化、监管要求和业务情况不断调整和细化市场、营运、投资研究各方面的分工和业务规则，并根据内部控制委员会和监察稽核部门提出的意见、建议调整或改善了前、中、后台的业务流程。

（三）有重点地全面开展内部审计稽核工作。2017 年，监察稽核部门按计划对公司营运、投资、市场部门进行了业务审计、依据《证券期货投资者适当性管理办法》对公司相关内部流程进行了差异性评估、根据监管要求开展了涉及投研、运营、销售等方面的专项自查；并与相关部门进行沟通，形成后续跟踪和业务上相互促进的良性循环，不断提高工作质量。

在今后的工作中，本基金管理人将继续坚持一贯的内部控制理念，完善内控制度，提高工作

水平，努力防范和控制各种风险，保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。

本基金管理人设有估值委员会，定期评价现行估值政策和程序，在发生了影响估值政策和程序的有效性、适用性的情况后及时修订估值方法。基金在投资新品种时，由估值委员会评价现有估值政策和程序的适用性。

（1）日常估值流程

本基金的估值由基金会计负责，基金会计以本基金为会计核算主体，基金会计核算独立于公司会计核算，独立建账、独立核算。基金会计采用专用的财务核算软件系统进行基金核算及帐务处理；每日按时接收成交数据及权益数据，进行基金估值。基金会计核算采用基金管理人与托管银行双人同步独立核算、相互核对的方式进行；基金会计每日就基金的会计核算、基金估值等与托管银行进行核对，每日估值结果必须与托管行核对一致后才能对外公告。

（2）特殊业务估值流程

根据中国证券监督管理委员会[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、中国证券投资基金业协会《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》、《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》、《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》等有关规定及本公司的估值制度，对特殊品种或由于特殊原因导致投资品种不存在活跃市场的情况，量化投资部根据估值委员会确定的对停牌股票或异常交易股票估值调整的方法（比如：指数收益法）进行估值，并兼顾行业研究员基于上市公司估值模型计算结果所提出的估值建议或意见。必要时基金经理也会就估值模型及估值方法的确定提出建议和意见，但由估值委员会做最终决策。

上述参与估值流程的人员均具备估值业务所需的专业胜任能力，参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期亏损，未有应分未分的利润。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人低于二百人或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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在华宝先进成长混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《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，本托管人根据《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，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§6 审计报告

普华永道中天会计师事务所为本基金出具了无保留意见的审计报告，投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：华宝先进成长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		242,486,169.59	374,853,581.36
结算备付金		13,233,142.70	6,869,536.11
存出保证金		577,166.11	634,854.55
交易性金融资产		802,469,004.85	926,543,000.39
其中：股票投资		802,469,004.85	926,543,000.39
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		-	-
应收证券清算款		6,078,031.73	2,132,711.99
应收利息		56,718.28	74,477.23
应收股利		-	-
应收申购款		122,967.41	457,319.13
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		1,065,023,200.67	1,311,565,480.76
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		27,502,104.72	3,013,342.93
应付赎回款		654,165.81	472,086.11
应付管理人报酬		1,327,270.12	1,685,697.35
应付托管费		221,211.69	280,949.55
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		9,911,729.62	5,633,070.61
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		280,419.52	640,060.75
负债合计		39,896,901.48	11,725,207.30
所有者权益：			
实收基金		363,408,073.26	456,217,071.40
未分配利润		661,718,225.93	843,623,202.06
所有者权益合计		1,025,126,299.19	1,299,840,273.46
负债和所有者权益总计		1,065,023,200.67	1,311,565,480.76

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值 2.8209 元，基金份额总额 363,408,073.26 份。

7.2 利润表

会计主体：华宝先进成长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		52,357,487.05	-552,486,888.58
1. 利息收入		2,408,102.00	3,680,526.96
其中：存款利息收入		1,939,437.73	3,183,701.42
债券利息收入		63.20	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		468,601.07	496,825.54
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-7,419,570.23	-259,656,015.96
其中：股票投资收益		-14,616,133.44	-263,690,800.48
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-63.20	-
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		7,196,626.41	4,034,784.52
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		57,163,007.34	-297,808,017.78
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）		205,947.94	1,296,618.20
减：二、费用		58,192,156.60	62,921,716.63
1. 管理人报酬		17,928,771.70	25,464,973.44
2. 托管费		2,988,128.67	4,244,162.29
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用		36,832,257.65	32,727,127.75
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用		442,998.58	485,453.15
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-5,834,669.55	-615,408,605.21
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-5,834,669.55	-615,408,605.21

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华宝先进成长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）	456,217,071.40	843,623,202.06	1,299,840,273.46
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-5,834,669.55	-5,834,669.55
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）	-92,808,998.14	-176,070,306.58	-268,879,304.72

其中：1. 基金申购款	12,897,283.38	23,795,016.74	36,692,300.12
2. 基金赎回款	-105,706,281.52	-199,865,323.32	-305,571,604.84
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）	363,408,073.26	661,718,225.93	1,025,126,299.19
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）	639,536,850.10	1,834,212,580.56	2,473,749,430.66
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-615,408,605.21	-615,408,605.21
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）	-183,319,778.70	-375,180,773.29	-558,500,551.99
其中：1. 基金申购款	185,993,183.24	367,948,978.04	553,942,161.28
2. 基金赎回款	-369,312,961.94	-743,129,751.33	-1,112,442,713.27
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）	456,217,071.40	843,623,202.06	1,299,840,273.46

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

黄小薏	向辉	张幸骏
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

华宝先进成长混合型证券投资基金(原名为华宝兴业先进成长股票型证券投资基金、华宝兴

业先进成长混合型证券投资基金，以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监基金字[2006]第 200 号《关于同意华宝兴业先进成长股票型证券投资基金募集的批复》核准，由华宝基金管理有限公司（原华宝兴业基金管理有限公司，已于 2017 年 10 月 17 日办理完成工商变更登记）依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华宝兴业先进成长股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 6,112,772,587.50 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2006)第 162 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华宝兴业先进成长股票型证券投资基金基金合同》于 2006 年 11 月 7 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 6,113,990,007.57 份基金份额，其中认购资金利息折合 1,217,420.07 份基金份额。本基金的基金管理人为华宝基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据 2014 年中国证监会令第 104 号《公开募集证券投资基金运作管理办法》，华宝兴业先进成长股票型证券投资基金于 2015 年 7 月 22 日公告后更名为华宝兴业先进成长混合型证券投资基金。

根据《华宝基金管理有限公司关于旗下基金更名事宜的公告》，华宝兴业先进成长混合型证券投资基金于 2017 年 12 月 30 日起更名为华宝先进成长混合型证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华宝先进成长混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为国内依法公开发行、上市的股票、债券及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。本基金股票投资比例为 60%-95%，其中投资于先进企业股票占非现金资产的比例不低于 80%，权证投资比例为 0%-3%，债券及现金投资比例为 5%-40%，其中，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于 5%。本基金的业绩比较基准是新上证综指收益率。

本财务报表由本基金的基金管理人华宝基金管理有限公司于 2018 年 3 月 22 日批准报出。

7.4.2 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》、《华宝先进成长混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注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。

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 2017 年度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 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/（累计亏损）。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；（3）本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

（1）对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

（2）对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（资产支持证券和私募债券除外）及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上

市或挂牌转让的固定收益品种(资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中央国债登记结算有限责任公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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政策的补充通知》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。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
华宝基金管理有限公司（“华宝基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人、基金销售机构
华宝信托有限责任公司（“华宝信托”）	基金管理人的股东
领先资产管理有限公司(Lyxor Asset Management S.A.)	截止至 2017 年 10 月 16 日，系基金管理人的股东
华平资产管理有限合伙(Warburg Pincus Asset Management, L.P.)	自 2017 年 10 月 17 日起，系基金管理人的股东
中国宝武钢铁集团有限公司（“宝武集团”）	华宝信托的最终控制人
华宝证券有限责任公司（“华宝证券”）	受宝武集团控制的公司
华宝投资有限公司（“华宝投资”）	受宝武集团控制的公司
宝钢集团财务有限责任公司（“宝钢财务”）	受宝武集团控制的公司

注：

- 1、下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。
- 2、2017 年 10 月 17 日，华宝基金管理有限公司正式完成上海市工商局变更登记备案手续，变更后公司的股权结构为：华宝信托有限责任公司持股 51%，Warburg Pincus Asset Management, L.P. 持股 49%。

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
华宝证券	2,520,550,962.55	10.35%	161,116,850.78	0.75%

7.4.8.1.2 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券交易。

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
华宝证券	80,000,000.00	19.33%	-	-

7.4.8.1.4 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

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
华宝证券	2,347,391.81	10.47%	503,487.34	5.08%
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

华宝证券	150,048.74	0.76%	1,115,197.90	19.80%
------	------------	-------	--------------	--------

注：

1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。
2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

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	17,928,771.70	25,464,973.44
其中：支付销售机构的客户维护费	2,416,187.21	2,864,068.83

注：支付基金管理人华宝基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50% 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 X 1.50% / 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	2,988,128.67	4,244,162.29

注：支付基金托管人中国银行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 X 0.25% / 当年天数。

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

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生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	上年度可比期间
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
期初持有的基金份额	217,642.44	273,962.26
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	-	56,319.82
期末持有的基金份额	217,642.44	217,642.44
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.06%	0.05%

注：基金管理人投资本基金适用的认(申)购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行。

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

本基金本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

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		上年度可比期间	
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日		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
中国银行	242,486,169.59	1,775,120.71	374,853,581.36	2,809,163.87

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

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

本基金本期末无因认购新发/增发证券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
601600	中国铝业	2017年9月12日	重大事项停牌	6.67	2018年2月26日	7.28	2,000,000	15,508,424.03	13,340,000.00	-
603986	兆易创新	2017年11月1日	重大事项停牌	163.12	2018年3月2日	150.00	30,000	4,110,486.60	4,893,600.00	-
300523	辰安科技	2017年10月20日	重大事项停牌	47.30	2018年2月6日	42.57	61,160	3,096,925.00	2,892,868.00	-
300730	科创信息	2017年12月25日	重大事项停牌	41.55	2018年1月2日	45.71	821	6,863.56	34,112.55	-

注：本基金截至 2017 年 12 月 31 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

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

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购，因此没有在银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购，因此没有在交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.10 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 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 781,308,424.30 元，属于第二层次的余额为 21,160,580.55 元，无属于第三层次的余额(2016 年 12 月 31 日：第一层次 850,364,758.91 元，第二层次 76,178,241.48 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)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售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 12 月 31 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) 增值税

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。

根据财政部、国家税务总局于 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

此外，财政部、国家税务总局于 2017 年 12 月 25 日颁布的财税[2017]90 号《关于租入固定资产进行税额抵扣等增值税政策的通知》对资管产品管理人自 2018 年 1 月 1 日起运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务的销售额确定做出规定。

上述税收政策对本基金截至 2017 年 12 月 31 日止的财务状况和经营成果无影响。

(3) 除公允价值和增值税外，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	802,469,004.85	75.35
	其中：股票	802,469,004.85	75.35
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	-	-
	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	255,719,312.29	24.01
7	其他各项资产	6,834,883.53	0.64
8	合计	1,065,023,200.67	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	574,174,344.47	56.01
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	33,893,629.75	3.31
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,064,334.23	0.49
J	金融业	103,910,789.36	10.14
K	房地产业	44,671,538.94	4.36
L	租赁和商务服务业	10,692,352.00	1.04

M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	30,062,016.10	2.93
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	802,469,004.85	78.28

8.2.2 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。

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	601318	中国平安	500,000	34,990,000.00	3.41
2	601398	工商银行	5,500,000	34,100,000.00	3.33
3	002531	天顺风能	3,999,940	32,399,514.00	3.16
4	002327	富安娜	2,936,464	30,686,048.80	2.99
5	002573	清新环境	1,322,570	30,062,016.10	2.93
6	603688	石英股份	1,915,000	29,988,900.00	2.93
7	601636	旗滨集团	4,419,200	27,575,808.00	2.69
8	002798	帝王洁具	466,200	25,692,282.00	2.51
9	300409	道氏技术	526,529	23,936,008.34	2.33
10	000858	五粮液	296,355	23,672,837.40	2.31

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www.fsfund.com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	000651	格力电器	175,940,650.46	13.54

2	600028	中国石化	165,073,866.73	12.70
3	601628	中国人寿	164,000,475.51	12.62
4	601318	中国平安	163,139,681.33	12.55
5	000858	五粮液	162,078,824.02	12.47
6	002456	欧菲科技	157,350,931.29	12.11
7	002236	大华股份	152,724,511.04	11.75
8	300136	信维通信	116,379,991.71	8.95
9	601600	中国铝业	116,316,915.80	8.95
10	000050	深天马 A	112,652,651.01	8.67
11	601398	工商银行	112,283,367.60	8.64
12	000933	神火股份	107,121,181.62	8.24
13	600887	伊利股份	104,552,850.02	8.04
14	002466	天齐锂业	101,590,765.51	7.82
15	600056	中国医药	101,013,372.43	7.77
16	601328	交通银行	98,501,614.94	7.58
17	002573	清新环境	95,162,635.59	7.32
18	600782	新钢股份	92,819,479.01	7.14
19	002460	赣锋锂业	86,621,879.95	6.66
20	600487	亨通光电	85,609,169.76	6.59
21	300433	蓝思科技	84,213,428.51	6.48
22	600498	烽火通信	82,694,454.30	6.36
23	600104	上汽集团	81,059,078.61	6.24
24	000002	万科 A	81,023,153.20	6.23
25	601111	中国国航	80,658,521.23	6.21
26	002497	雅化集团	77,168,321.20	5.94
27	000063	中兴通讯	77,088,613.79	5.93
28	600029	南方航空	77,055,094.15	5.93
29	300197	铁汉生态	76,838,409.02	5.91
30	601939	建设银行	76,369,708.06	5.88
31	601688	华泰证券	75,232,130.43	5.79
32	300409	道氏技术	74,455,115.35	5.73
33	002241	歌尔股份	74,316,104.84	5.72
34	002273	水晶光电	73,808,281.22	5.68
35	000725	京东方 A	73,301,863.16	5.64
36	600036	招商银行	71,717,808.22	5.52
37	300059	东方财富	71,168,021.09	5.48

38	002635	安洁科技	71,102,426.39	5.47
39	603799	华友钴业	69,785,782.34	5.37
40	600703	三安光电	68,939,108.10	5.30
41	300115	长盈精密	67,283,770.31	5.18
42	600690	青岛海尔	66,418,918.43	5.11
43	000049	德赛电池	66,054,248.44	5.08
44	002008	大族激光	65,613,636.80	5.05
45	600519	贵州茅台	65,300,759.65	5.02
46	600595	中孚实业	64,800,767.50	4.99
47	600884	杉杉股份	63,259,860.46	4.87
48	600779	水井坊	62,830,659.91	4.83
49	600282	南钢股份	62,298,254.47	4.79
50	000807	云铝股份	61,384,042.58	4.72
51	000630	铜陵有色	60,745,317.62	4.67
52	000983	西山煤电	60,336,111.54	4.64
53	000001	平安银行	59,972,125.79	4.61
54	000568	泸州老窖	59,256,118.00	4.56
55	600068	葛洲坝	58,466,628.92	4.50
56	600388	龙净环保	56,825,044.88	4.37
57	601857	中国石油	56,055,734.71	4.31
58	002709	天赐材料	54,698,759.34	4.21
59	000401	冀东水泥	53,727,945.02	4.13
60	600764	中电广通	53,668,737.21	4.13
61	600116	三峡水利	52,369,694.41	4.03
62	002475	立讯精密	51,371,016.40	3.95
63	600048	保利地产	50,373,055.58	3.88
64	600197	伊力特	50,089,217.37	3.85
65	002036	联创电子	49,496,254.29	3.81
66	600266	北京城建	49,308,749.08	3.79
67	000928	中钢国际	49,266,368.85	3.79
68	603816	顾家家居	48,579,747.90	3.74
69	601225	陕西煤业	48,566,182.82	3.74
70	002310	东方园林	48,422,043.30	3.73
71	002777	久远银海	47,960,007.57	3.69
72	002371	北方华创	47,932,364.92	3.69
73	002304	洋河股份	47,643,665.76	3.67

74	601717	郑煤机	47,237,427.84	3.63
75	603688	石英股份	47,018,271.52	3.62
76	600362	江西铜业	46,451,856.71	3.57
77	002555	三七互娱	45,866,592.33	3.53
78	601012	隆基股份	45,829,681.02	3.53
79	000488	晨鸣纸业	45,389,858.44	3.49
80	002128	露天煤业	45,040,481.32	3.47
81	600740	山西焦化	44,251,382.46	3.40
82	300113	顺网科技	44,187,355.34	3.40
83	000937	冀中能源	43,683,128.96	3.36
84	002712	思美传媒	43,432,373.44	3.34
85	600563	法拉电子	42,741,596.62	3.29
86	002185	华天科技	41,834,931.32	3.22
87	603626	科森科技	41,623,892.13	3.20
88	600584	长电科技	41,031,384.62	3.16
89	300588	熙菱信息	40,893,417.90	3.15
90	600741	华域汽车	40,571,459.26	3.12
91	600958	东方证券	39,901,931.45	3.07
92	601699	潞安环能	39,653,976.12	3.05
93	600837	海通证券	39,417,673.84	3.03
94	002035	华帝股份	39,229,739.56	3.02
95	600259	广晟有色	39,112,947.32	3.01
96	601800	中国交建	38,856,596.14	2.99
97	300241	瑞丰光电	38,809,181.50	2.99
98	000980	众泰汽车	38,188,160.88	2.94
99	300073	当升科技	38,177,869.61	2.94
100	300088	长信科技	37,980,224.00	2.92
101	601231	环旭电子	37,144,134.53	2.86
102	000898	鞍钢股份	37,096,296.22	2.85
103	603180	金牌厨柜	36,927,963.32	2.84
104	002078	太阳纸业	36,385,666.23	2.80
105	002027	分众传媒	36,377,717.84	2.80
106	002092	中泰化学	36,153,746.10	2.78
107	600549	厦门钨业	35,895,546.40	2.76
108	600110	诺德股份	35,555,670.11	2.74
109	002127	南极电商	35,506,099.51	2.73

110	300081	恒信东方	35,077,541.72	2.70
111	600999	招商证券	34,825,423.55	2.68
112	000960	锡业股份	34,581,883.76	2.66
113	600123	兰花科创	34,449,175.86	2.65
114	000060	中金岭南	34,251,491.80	2.64
115	300426	唐德影视	34,176,556.30	2.63
116	600801	华新水泥	34,104,331.74	2.62
117	000537	广宇发展	34,045,535.00	2.62
118	000830	鲁西化工	34,030,480.57	2.62
119	002583	海能达	33,904,377.50	2.61
120	000546	金圆股份	33,632,428.71	2.59
121	000878	云南铜业	33,416,533.40	2.57
122	000333	美的集团	33,095,012.57	2.55
123	600031	三一重工	32,860,175.88	2.53
124	000425	徐工机械	32,853,287.31	2.53
125	002531	天顺风能	32,016,913.06	2.46
126	002812	创新股份	31,769,752.00	2.44
127	300232	洲明科技	30,539,846.34	2.35
128	002050	三花智控	30,437,419.00	2.34
129	601958	金钼股份	30,339,179.49	2.33
130	300236	上海新阳	30,182,661.83	2.32
131	002327	富安娜	30,012,593.13	2.31
132	600176	中国巨石	29,486,088.52	2.27
133	300577	开润股份	29,421,606.33	2.26
134	600809	山西汾酒	29,291,234.28	2.25
135	600392	盛和资源	29,177,228.73	2.24
136	300083	劲胜智能	28,924,858.97	2.23
137	300078	思创医惠	28,722,258.65	2.21
138	600497	驰宏锌锗	28,397,712.98	2.18
139	002202	金风科技	28,344,842.84	2.18
140	603979	金诚信	27,987,541.88	2.15
141	601678	滨化股份	27,892,564.34	2.15
142	000603	盛达矿业	27,809,610.25	2.14
143	603833	欧派家居	27,489,220.30	2.11
144	002507	涪陵榨菜	27,442,213.68	2.11
145	300036	超图软件	27,411,374.49	2.11

146	600111	北方稀土	26,574,461.51	2.04
147	601636	旗滨集团	26,382,663.00	2.03

注：买入金额不包括相关交易费用。

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	600028	中国石化	181,716,378.73	13.98
2	000651	格力电器	181,042,488.22	13.93
3	002456	欧菲科技	180,434,846.59	13.88
4	002236	大华股份	173,444,315.40	13.34
5	601628	中国人寿	164,508,386.66	12.66
6	000858	五粮液	146,966,771.12	11.31
7	601318	中国平安	133,370,839.75	10.26
8	300136	信维通信	123,842,320.75	9.53
9	000933	神火股份	117,103,688.26	9.01
10	000050	深天马 A	114,358,233.80	8.80
11	601600	中国铝业	105,718,577.90	8.13
12	600056	中国医药	101,257,715.69	7.79
13	002466	天齐锂业	100,189,065.85	7.71
14	601328	交通银行	99,030,643.88	7.62
15	002460	赣锋锂业	98,712,489.64	7.59
16	600782	新钢股份	96,264,604.01	7.41
17	600887	伊利股份	95,557,713.64	7.35
18	600487	亨通光电	88,814,051.54	6.83
19	600104	上汽集团	86,193,442.73	6.63
20	300433	蓝思科技	84,962,346.29	6.54
21	600498	烽火通信	82,149,648.01	6.32
22	600029	南方航空	81,021,142.52	6.23
23	000063	中兴通讯	80,561,189.30	6.20
24	002497	雅化集团	80,142,537.87	6.17
25	601111	中国国航	79,778,755.42	6.14
26	002712	思美传媒	79,432,384.66	6.11
27	000725	京东方 A	79,238,608.00	6.10
28	601398	工商银行	78,941,797.16	6.07
29	600519	贵州茅台	78,822,426.39	6.06

30	000630	铜陵有色	78,055,272.05	6.00
31	002241	歌尔股份	77,302,293.45	5.95
32	601939	建设银行	77,026,236.69	5.93
33	601688	华泰证券	75,992,346.00	5.85
34	300115	长盈精密	75,035,339.33	5.77
35	300409	道氏技术	74,615,571.86	5.74
36	600703	三安光电	73,948,544.51	5.69
37	300197	铁汉生态	72,619,568.88	5.59
38	300059	东方财富	71,527,749.54	5.50
39	002635	安洁科技	71,320,572.77	5.49
40	603799	华友钴业	69,520,191.61	5.35
41	600690	青岛海尔	69,213,665.10	5.32
42	002008	大族激光	67,410,772.60	5.19
43	600779	水井坊	66,869,790.06	5.14
44	600884	杉杉股份	66,757,173.88	5.14
45	002573	清新环境	66,567,552.38	5.12
46	002777	久远银海	66,551,236.90	5.12
47	000983	西山煤电	65,180,906.30	5.01
48	000049	德赛电池	64,165,243.79	4.94
49	002273	水晶光电	63,064,516.18	4.85
50	000807	云铝股份	62,229,735.50	4.79
51	600595	中孚实业	62,104,053.35	4.78
52	300078	思创医惠	61,911,518.84	4.76
53	600282	南钢股份	61,624,828.38	4.74
54	000568	泸州老窖	61,621,180.42	4.74
55	601857	中国石油	60,630,662.90	4.66
56	000401	冀东水泥	58,389,244.38	4.49
57	000002	万科 A	57,942,510.07	4.46
58	600068	葛洲坝	57,602,921.76	4.43
59	600123	兰花科创	57,153,353.25	4.40
60	600764	中电广通	57,113,563.92	4.39
61	002709	天赐材料	56,254,994.70	4.33
62	600036	招商银行	54,180,563.65	4.17
63	002371	北方华创	51,665,413.39	3.97
64	000980	众泰汽车	51,596,956.01	3.97
65	600197	伊力特	51,400,944.43	3.95
66	600116	三峡水利	51,382,389.66	3.95
67	002597	金禾实业	50,488,109.68	3.88

68	601012	隆基股份	49,988,629.47	3.85
69	601225	陕西煤业	49,957,400.53	3.84
70	002555	三七互娱	49,124,660.30	3.78
71	300232	洲明科技	48,789,224.46	3.75
72	600266	北京城建	48,466,166.00	3.73
73	603816	顾家家居	48,234,604.11	3.71
74	002310	东方园林	48,130,202.44	3.70
75	000488	晨鸣纸业	47,697,450.56	3.67
76	002304	洋河股份	46,854,322.63	3.60
77	600362	江西铜业	46,746,352.20	3.60
78	000928	中钢国际	46,652,465.25	3.59
79	002128	露天煤业	44,344,387.88	3.41
80	601717	郑煤机	44,320,396.42	3.41
81	002036	联创电子	44,318,229.84	3.41
82	300588	熙菱信息	44,114,396.45	3.39
83	603008	喜临门	43,180,099.14	3.32
84	000937	冀中能源	43,169,376.24	3.32
85	002185	华天科技	42,950,688.07	3.30
86	600563	法拉电子	42,236,345.57	3.25
87	600740	山西焦化	42,038,693.18	3.23
88	000001	平安银行	41,995,332.87	3.23
89	600741	华域汽车	41,745,896.73	3.21
90	300241	瑞丰光电	41,735,145.66	3.21
91	603626	科森科技	41,640,947.48	3.20
92	600584	长电科技	41,617,330.11	3.20
93	000546	金圆股份	41,466,081.64	3.19
94	002078	太阳纸业	41,138,451.38	3.16
95	000960	锡业股份	41,015,383.74	3.16
96	300306	远方信息	40,218,998.86	3.09
97	300113	顺网科技	40,144,758.04	3.09
98	002094	青岛金王	39,934,701.81	3.07
99	600837	海通证券	39,466,668.04	3.04
100	600958	东方证券	39,305,376.84	3.02
101	002462	嘉事堂	38,527,576.78	2.96
102	601699	潞安环能	37,707,848.13	2.90
103	601800	中国交建	37,650,083.51	2.90
104	002092	中泰化学	37,594,147.86	2.89
105	600801	华新水泥	37,571,820.56	2.89

106	300073	当升科技	37,559,577.46	2.89
107	603180	金牌厨柜	37,499,539.21	2.88
108	000898	鞍钢股份	37,433,395.21	2.88
109	600259	广晟有色	37,236,493.30	2.86
110	600549	厦门钨业	36,939,715.90	2.84
111	601231	环旭电子	36,697,910.40	2.82
112	300377	赢时胜	36,251,282.95	2.79
113	300088	长信科技	36,189,441.07	2.78
114	000402	金融街	35,855,181.35	2.76
115	300081	恒信东方	35,352,743.63	2.72
116	000830	鲁西化工	35,121,289.57	2.70
117	600999	招商证券	35,060,541.33	2.70
118	000060	中金岭南	35,005,492.55	2.69
119	600388	龙净环保	34,167,840.86	2.63
120	000878	云南铜业	33,488,703.54	2.58
121	603678	火炬电子	33,386,174.72	2.57
122	600110	诺德股份	32,907,250.58	2.53
123	000333	美的集团	32,855,531.36	2.53
124	601958	金钼股份	31,670,918.33	2.44
125	300426	唐德影视	31,472,790.12	2.42
126	000739	普洛药业	31,381,185.08	2.41
127	002050	三花智控	30,774,461.60	2.37
128	002127	南极电商	30,482,962.26	2.35
129	002812	创新股份	30,457,166.12	2.34
130	000537	广宇发展	30,350,205.27	2.33
131	002221	东华能源	30,339,328.84	2.33
132	600809	山西汾酒	29,803,837.45	2.29
133	600048	保利地产	29,646,865.19	2.28
134	300207	欣旺达	29,616,600.62	2.28
135	000823	超声电子	29,406,422.69	2.26
136	603729	龙韵股份	29,239,036.46	2.25
137	300083	劲胜智能	28,536,627.57	2.20
138	300236	上海新阳	28,398,033.22	2.18
139	600497	驰宏锌锗	28,289,210.35	2.18
140	300577	开润股份	28,198,227.07	2.17
141	000603	盛达矿业	28,074,470.06	2.16
142	601678	滨化股份	27,968,055.95	2.15
143	002475	立讯精密	27,762,068.05	2.14

144	002507	涪陵榨菜	27,252,573.86	2.10
145	300036	超图软件	27,200,479.70	2.09
146	600392	盛和资源	26,854,978.02	2.07
147	603833	欧派家居	26,848,255.25	2.07
148	002599	盛通股份	26,710,460.40	2.05
149	600111	北方稀土	26,608,660.50	2.05
150	002027	分众传媒	26,542,525.39	2.04
151	300129	泰胜风能	26,387,288.21	2.03

注：卖出金额不包括相关交易费用。

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	12,092,771,816.16
卖出股票收入（成交）总额	12,259,392,685.60

注：买入股票成本、卖出股票收入均不包括相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金未投资股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金未投资股指期货。

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

本基金未投资国债期货。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金未投资国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

基金管理人没有发现本基金投资的前十名证券的发行主体在报告期内被监管部门立案调查，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚，无证券投资决策程序需特别说明。

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	577,166.11
2	应收证券清算款	6,078,031.73
3	应收股利	-
4	应收利息	56,718.28
5	应收申购款	122,967.41
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,834,883.53

8.12.4 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。

8.12.5 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的情况。

§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
22,618	16,067.21	1,379,690.93	0.38%	362,028,382.33	99.62%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	13,438.60	0.0037%

注：

（一）本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间：

10 万份至 50 万份（含）

（二）该只基金的基金经理持有该只基金份额总量的数量区间：

10 万份至 50 万份（含）

附：数量区间为 0、0 至 10 万份（含）、10 万份至 50 万份（含）、50 万份至 100 万份（含）、100 万份以上。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
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（2006年11月7日）基金份额总额	6,113,990,007.57
本报告期期初基金份额总额	456,217,071.40
本报告期基金总申购份额	12,897,283.38
减:本报告期基金总赎回份额	105,706,281.52
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	363,408,073.26

注：总申购份额含转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人的重大人事变动

2017 年 6 月 9 日，基金管理人发布高级管理人员变更公告，副总经理任志强因个人原因，自 2017 年 5 月 31 日起不再担任副总经理的职务。

2017 年 8 月 11 日，基金管理人发布高级管理人员变更公告，董事长郑安国先生因个人原因，自 2017 年 8 月 9 日起不再担任董事长的职务，由孔祥清先生接任公司董事长职务。

2017 年 9 月 29 日，基金管理人发布高级管理人员变更公告，聘任欧江洪先生为公司副总经理。

2017 年 9 月 29 日，基金管理人发布高级管理人员变更公告，韦历山先生因个人原因，自 2017 年 9 月 29 日起不再担任公司常务副总经理职务。

2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2017 年 8 月，陈四清先生担任中国银行股份有限公司董事长、执行董事、董事会战略发展委员会主席及委员等职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产和基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未发生变更。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

基金管理人为本基金聘任的会计师事务所在本报告期的审计报酬为 100,000.00 元人民币。目前该会计师事务所向本基金提供的审计服务持续期限为：本基金合同生效之日（2006 年 11 月 7 日）起至本报告期末。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、托管人及其高级管理人员未有受到稽查或处罚的情况。

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	
西南证券	2	25,289,160,942.85	21.72%	4,851,281.65	21.65%	-
中金国际	1	13,565,023,414.47	14.64%	3,248,804.34	14.50%	-
东方证券	1	13,514,950,168.00	14.43%	3,203,174.11	14.29%	-
申万宏源	3	2,643,437,864.62	10.86%	2,461,825.22	10.98%	-
华宝证券	1	12,520,550,962.55	10.35%	2,347,391.81	10.47%	-
光大证券	1	12,453,003,843.93	10.07%	2,235,423.64	9.97%	-
招商证券	1	11,482,183,314.11	6.09%	1,380,353.34	6.16%	-
华泰证券	1	11,422,168,618.45	5.84%	1,324,463.99	5.91%	-
长城证券	1	973,640,089.95	4.00%	906,749.48	4.05%	-
高华证券	1	263,137,211.24	1.08%	245,060.17	1.09%	-
渤海证券	1	223,513,673.52	0.92%	208,156.90	0.93%	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-

注：1、基金管理人选择交易单元的标准和程序如下：

（1）选择标准： 资质雄厚，信誉良好，注册资本不少于 5 亿元人民币；财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；经营行为规范，最近两年未因重大违规行为受到中国证监会和

中国人民银行处罚；内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；具备基金运作所需要的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需 要，并能为本基金提供全面的信息服 务；研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告；适当的 地域分散化。

（2）选择程序：（a）服务评价；（b）拟定备选交易单元；（c）签约。

2、本报告期租用的证券公司交易单元没有变化。

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
西南证券	-	-	-	-	-	-
中金国际	356,000.00	100.00%	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	143,800,000.00	34.75%	-	-
华宝证券	-	-	80,000,000.00	19.33%	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	70,000,000.00	16.92%	-	-
华泰证券	-	-	120,000,000.00	29.00%	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-

德邦证券	-	-	-	-	-
------	---	---	---	---	---

§12 影响投资者决策的其他重要信息

基金管理人于 2017 年 12 月 27 日发布《华宝基金管理有限公司关于旗下基金更名事宜的公告》，旗下已管理和已获批未募集的公开募集证券投资基金自 2017 年 12 月 30 日起变更基金名称（各基金的基金代码保持不变）。变更事项符合现行相关法律法规及基金合同的规定，对基金份额持有人利益无实质性不利影响。本次变更不影响本公司旗下基金已签署的全部法律文件的效力及履行。

根据上述公告，本基金自 2017 年 12 月 30 日起基金名称变更为“华宝先进成长混合型证券投资基金”。

华宝基金管理有限公司

2018 年 3 月 27 日