

# 华泰柏瑞创新动力灵活配置混合型证券投资 基金 2017 年年度报告

2017 年 12 月 31 日

基金管理人：华泰柏瑞基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2018 年 3 月 28 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 27 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。

本年度报告财务资料已经审计，普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 2017 年 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
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.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 其他指标.....	9
3.4 过去三年基金的利润分配情况.....	9
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
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.....	16
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>17</b>
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	17
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.....	17
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.....	17
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>18</b>
6.1 审计报告基本信息.....	18
6.2 审计报告的基本内容.....	18
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>21</b>
7.1 资产负债表.....	21
7.2 利润表.....	22
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	23
7.4 报表附注.....	24
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>53</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	53
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	53
8.3 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.....	54
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	59
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	64
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.....	64

8.7 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 .....	64
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 .....	64
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 .....	65
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	65
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	65
8.12 投资组合报告附注 .....	65
<b>§9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>67</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	67
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	67
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 .....	67
<b>§10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>68</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>69</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	69
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 .....	69
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	69
11.4 基金投资策略的改变 .....	69
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	69
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 .....	69
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	69
11.8 其他重大事件 .....	73
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>79</b>
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 .....	79
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	79
<b>§13 备查文件目录 .....</b>	<b>80</b>
13.1 备查文件目录 .....	80
13.2 存放地点 .....	80
13.3 查阅方式 .....	80

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华泰柏瑞创新动力灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	华泰柏瑞创新动力混合
基金主代码	000967
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 2 月 6 日
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司
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	119,331,466.42 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在有效控制风险的前提下，本基金追求基金资产的长期增值，力争在中长期为投资者创造高于业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金将采取积极、主动的资产配置策略，精选与经济结构调整与转型主题直接相关，具备长期盈利能力提升的上市公司，力求实现基金资产的长期增值。
业绩比较基准	中证新兴产业指数收益率×60%+中债总指数（全价）收益率×40%
风险收益特征	本基金属于混合型基金，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		华泰柏瑞基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈晖	王永民
	联系电话	021-38601777	010-66594896
	电子邮箱	cs4008880001@huatai-pb.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-888-0001	95566
传真		021-38601799	010-66594942
注册地址		上海市浦东新区民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址		上海市浦东新区民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码		200135	100818

法定代表人	贾波	陈四清
-------	----	-----

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.huatai-pb.com">http://www.huatai-pb.com</a>
基金年度报告备置地点	上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层及托管人住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	上海湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼
注册登记机构	华泰柏瑞基金管理有限公司	上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层

## § 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 2 月 6 日(基金合同生效日)-2015 年 12 月 31 日
本期已实现收益	26,121,246.32	-6,345,647.58	483,599,511.05
本期利润	41,958,154.64	-31,503,675.64	508,625,192.76
加权平均基金份额本期利润	0.3179	-0.1825	0.7316
本期加权平均净值利润率	26.31%	-17.44%	63.99%
本期基金份额净值增长率	30.39%	-13.98%	26.60%
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	50,101,150.64	13,225,849.67	48,162,173.11
期末可供分配基金份额利润	0.4198	0.0887	0.2664
期末基金资产净值	169,432,617.06	162,362,426.85	228,951,387.40
期末基金份额净值	1.420	1.089	1.266
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	42.00%	8.90%	26.60%

注：1、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。

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、对期末可供分配利润，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。

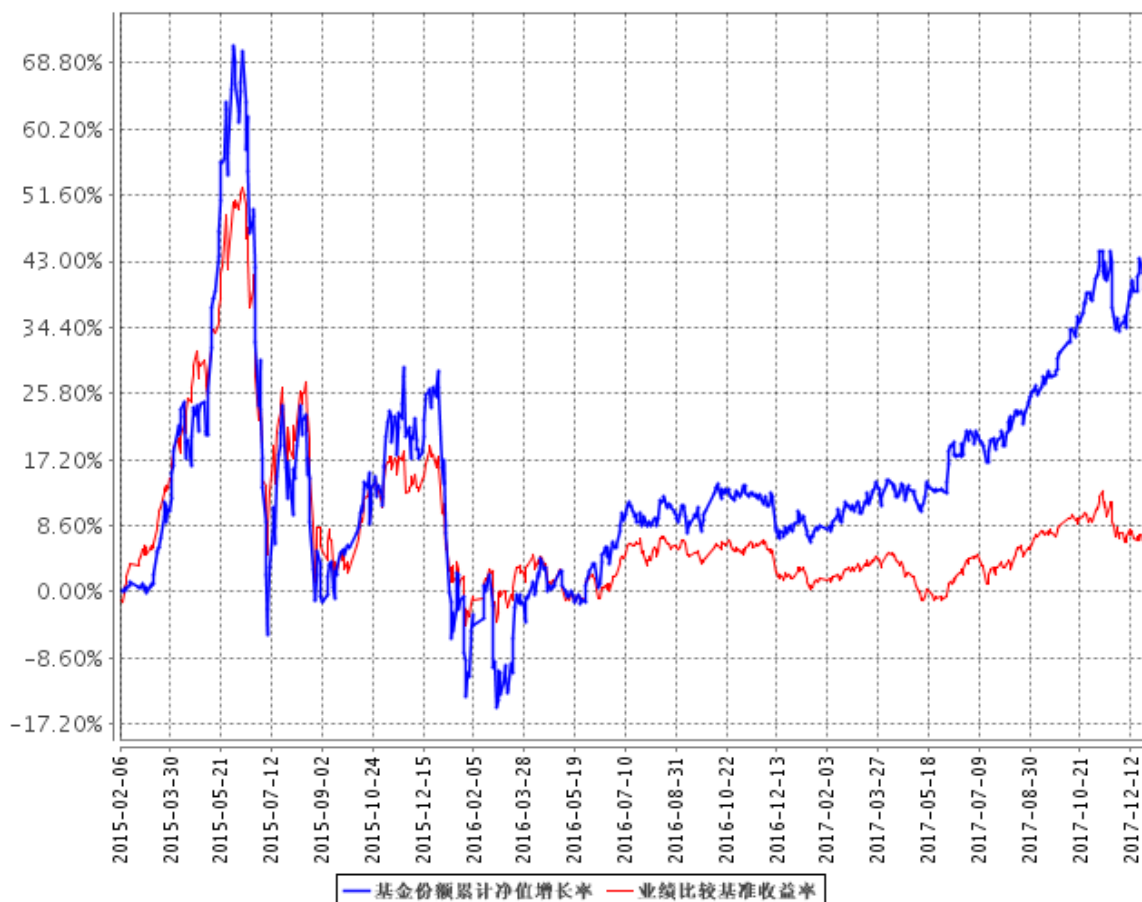
### 3.2 基金净值表现

#### 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	8.31%	1.06%	-1.44%	0.64%	9.75%	0.42%
过去六个月	17.55%	0.87%	2.38%	0.57%	15.17%	0.30%
过去一年	30.39%	0.80%	4.76%	0.52%	25.63%	0.28%
自基金合同生效起至今	42.00%	1.87%	6.97%	1.20%	35.03%	0.67%

### 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

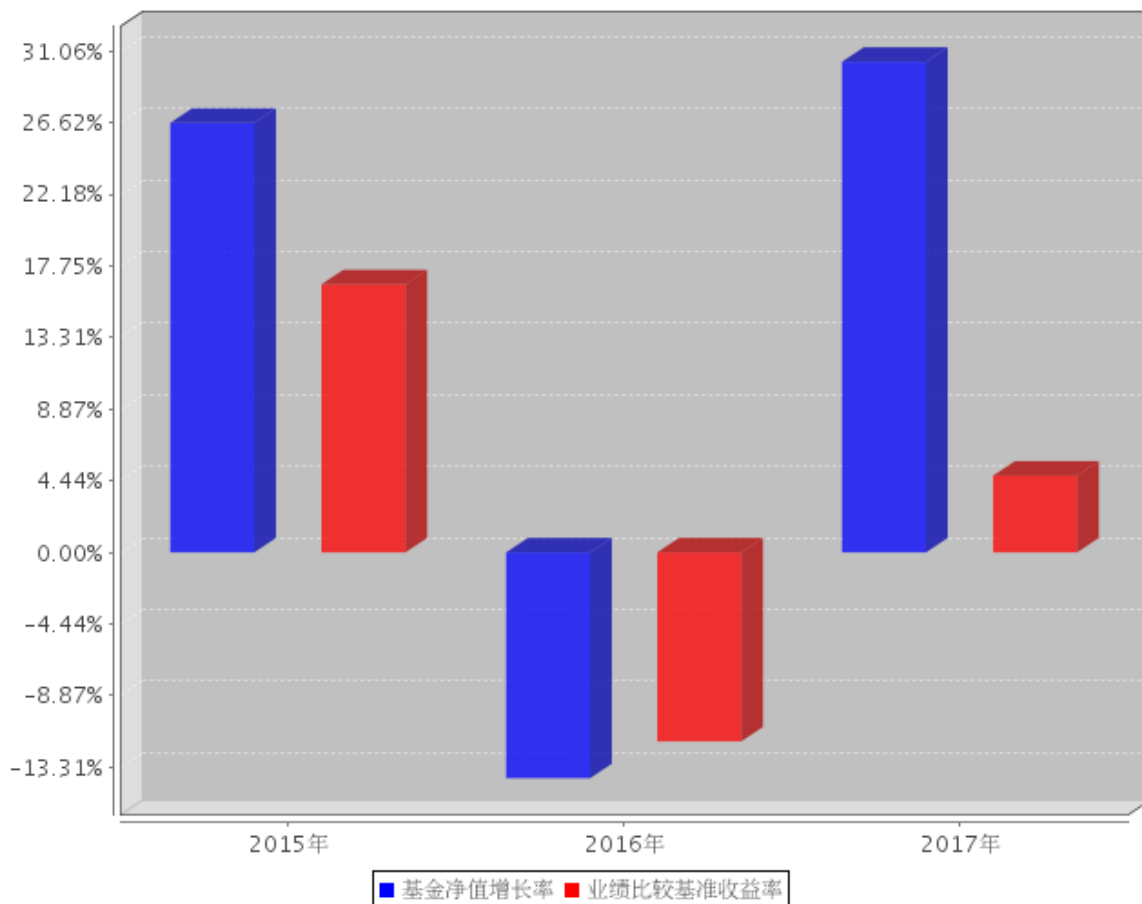


注：图示日期为 2015 年 2 月 6 日至 2017 年 12 月 31 日。本基金持有的股票占基金资产的比例为 0%-95%，其中投资于创新动力主题相关的证券资产不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金保留的现金或者到期日在 1 年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值 5%。



### 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



注：2015 年按实际存续期计算（实际存续期为 2015 年 2 月 6 日至 2015 年 12 月 31 日）。

### 3.3 其他指标

注：无

### 3.4 过去三年基金的利润分配情况

注：无。

## § 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

本基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司。华泰柏瑞基金管理有限公司是经中国证监会批准，于 2004 年 11 月 18 日成立的合资基金管理公司，注册资本为 2 亿元人民币。目前的股东构成为华泰证券股份有限公司、柏瑞投资有限责任公司（原 AIGGIC）和苏州新区高新技术产业股份有限公司，出资比例分别为 49%、49%和 2%。目前公司旗下管理华泰柏瑞盛世中国混合型证券投资基金、华泰柏瑞金字塔稳本增利债券型证券投资基金、上证红利交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金、华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金、华泰柏瑞货币市场证券投资基金、华泰柏瑞行业领先混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化先行混合型证券投资基金、华泰柏瑞亚洲领导企业混合型证券投资基金、上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞信用增利债券型证券投资基金、华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞稳健收益债券型证券投资基金、华泰柏瑞量化增强混合型证券投资基金、华泰柏瑞丰盛纯债债券型证券投资基金、华泰柏瑞季季红债券型证券投资基金、华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金、华泰柏瑞丰汇债券型证券投资基金、华泰柏瑞量化优选灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞创新动力灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞积极优选股票型证券投资基金、华泰柏瑞新利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞消费成长灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞惠利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞健康生活灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金、华泰柏瑞交易型货币市场基金、华泰柏瑞中国制造 2025 灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞激励动力灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞精选回报灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化对冲稳健收益定期开放混合型发起式证券投资基金、华泰柏瑞天添宝货币市场基金、华泰柏瑞爱利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞多策略灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞睿利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞新经济沪港深灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞鼎利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞行业竞争优势灵活配置

混合型证券投资基金、华泰柏瑞亨利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞兴利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞锦利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞泰利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞裕利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞价值精选 30 灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞嘉利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞盛利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化创优灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞生物医药灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞富利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化阿尔法灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞港股通量化灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞战略新兴产业混合型证券投资基金。截至 2017 年 12 月 31 日，公司基金管理规模为 826.34 亿元。

#### 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		
张慧	投资部总监助理、本基金的基金经理	2015 年 2 月 6 日	-	10 年	经济学硕士，10 年证券从业经历。2007 年 7 月至 2010 年 6 月任国泰君安证券股份有限公司研究员。2010 年 6 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任研究员、高级研究员、基金经理助理，2013 年 9 月起任华泰柏瑞盛世中国混合型证券投资基金的基金经理，2014 年 5 月起任华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金的基金经理。2015 年 2 月起任华泰柏瑞创新动力灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016 年 1 月起任投资部总监助理。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及其他相关法律、法规的规定以及本基金的《基金合同》的约定，在严格控制风险的基础上，忠实履行基金管理职责，为基金份额持有人谋求最

大利益。在本报告期内，基金投资管理符合有关法律、法规的规定及基金合同的约定，不存在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

报告期内，本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的要求，建立了科学完善的公平交易管理制度，从事前、事中和事后等环节严格控制不同基金之间可能发生的利益输送。投资部和研究部通过规范的决策流程公平对待不同投资组合。交易部对投资指令的合规性、有效性及合理性进行独立审核，对于场内交易的非组合指令启用投资管理系统中的公平交易模块；对于场外交易按照时间优先价格优先的原则公平对待不同帐户。风险管理部对报告期内的交易进行日常监控和分析评估，同时对投资组合的交易价差在不同时间窗（如日内、3日、5日）进行分析，综合判断各基金之间是否存在不公平交易或利益输送的可能，确保公平交易的实施。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，公司将投资管理职能和交易执行职能完全隔离，实行集中交易制度，由交易部为公募基金、专户理财和海外投资等业务统一交易服务，为公平交易的实施提供了较好的保障。目前公司公募基金、专户理财和海外投资业务的基金经理不存在兼任其它投资管理部门业务的情况，不同业务类别的投资经理之间互不干扰，独立做出投资决策。公司机构设置合理，公平交易的相关管理制度健全，投资决策流程完善，各项制度执行情况良好。交易价差分析表明公司旗下各基金均得到了公平对待，不存在非公平交易和利益输送的行为。经过对不同基金之间交易相同证券时的同向交易价差进行分析发现，报告期内基金之间的买卖交易价差总体上处于正常的合理水平。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金管理人根据《异常交易监控与管理办法》对投资交易过程中可能发生的异常交易行为进行监督和管理。投资部负责对异常交易行为进行事前识别和检查，交易部负责对异常交易行为的事中监督和控制，风险管理部及异常交易评估小组负责异常交易行为的事后审查和评估。本报告期内，该制度执行情况良好，无论在二级市场还是在大宗交易或者一级市场申购等交易中，均没有发现影响证券价格或者严重误导其他投资者等异常交易行为。

本报告期本基金与公司所管理的其他投资组合没有参与交易所公开竞价单边交易量超过该证券当日成交量 5% 的同日反向交易。

#### 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

17 年市场呈现分化行情，各领域的龙头公司受到市场追捧，低市盈率个股整体上战胜了高市盈率个股，在盈利和估值的双击下，绩优股趋势上行。全年沪深 300 指数上涨 21.8%，中证 500 指数略跌 0.2%，而创业板指数大跌 10.7%。

1 季度流动性环境持续收紧，但强势美元的局面较去年 4 季度得到一定的缓解，这导致人民币贬值的状况改善，海外资金有一定的回流趋势，市场指数小幅反弹。行业轮动的现象非常明显，周期、消费、成长均有轮动表现。进入 3 月之后，由于市场担心经济见顶回落，以及供给的释放加大，行业机会转向了消费和成长白马方向。以白酒、医药和电子为代表的行业在 3 月份取得了较大的超额收益。

进入 2 季度之后，金融“去杠杆”开始显著加快，短端利率快速抬升，市场恐慌情绪较重。6 月之后，监管部门的态度有所缓和，市场逐渐企稳，市场表现出先抑后扬的走势。投资者普遍选择业绩确定性较高的行业，消费类行业和大市值公司受到资金的青睐。

3 季度流动性环境较 2 季度宽松，央行态度更加缓和，金融监管基调在边际上有所放缓。同时，3 季度美元指数持续走低，加上人民币升值，使得海外资金有一定的回流趋势。周期、消费、成长及金融风格均有轮动表现，其中涨价周期股表现最为抢眼。7-8 月份，在“需求下滑慢于预期”叠加“供给收缩快于预期”的双重催化下，周期品价格快速上涨，带动上游煤炭、钢铁、有色金属等行业迎来一波年内最大“涨价”行情。而市场风险偏好的提升使得成长股自 7 月中下旬以后反弹明显，尤其以新能源汽车、5G、人工智能等新兴产业龙头个股涨幅靠前。

4 季度，市场先扬后抑，大部分个股在国庆第二周开始调整，白马股的上涨则延续到了 11 月中旬。随着年末效应和资管新规的影响，市场整体有一定回落。个股和行业分化剧烈，消费和金融取得了正收益，而小盘题材股、周期股跌幅居前。

本基金在报告期内对仓位方面没有做过多调整，行业结构上以消费性行业和电子等成长白马为基础配置，在 3 季度初期参与了钢铁、煤炭、有色等周期性行业的波段行情。在 8 月之后，逐步兑现这类股票的收益，增配了食品、白酒、成长以及金融类股票的比例，主题投资方面参与较少。在 4 季度操作以持仓结构的调整与优化为主。基金组合以有成长空间的成长股和景气度较高

的消费品为基础持仓，金融中相对看好银行的盈利修复。尽管在 11 月下旬的调整中基金净值有一定回落，但到年末时基金净值基本回到年内高点。

#### 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 1.420 元；本报告期基金份额净值增长率为 30.39%，业绩比较基准收益率为 4.76%。

#### 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 18 年，我们认为预期收益率要较 17 年降低。投资者面临的环境是经济温和放缓和流动性中性偏紧。经济韧性会比较强，供给侧改革的结果是企业盈利将围绕一个上升的盈利中枢波动，但需求回落的趋势较为确定。金融去杠杆不会松懈，但不发生处置风险的原则是政策的底线。实体经济的融资成本可能将抬升，长端利率高位震荡。18 年仍为结构性机会年份，预期收益的获得需建立在盈利增长的基础上，而非估值。

1 月份市场首先修复了相对估值最低的银行、地产、券商。接着行情围绕通胀受益的消费、周期板块，随着美国劳工数据的公布，最终演变为对全球通胀上行的极度担心，叠加金融去杠杆，市场全面下跌。

我们认为，在信贷逐渐收紧的背景下，18 年的宏观需求会呈现逐级回落的态势，这对于全部 A 股的盈利增速水平会产生不利的影响，但不至于回到 12-13 年的通缩水平。一方面，供给侧改革政策的动态调整，使得传统行业盈利的韧性强于过去，另一方面，龙头公司的行业集中度提升将带动其盈利状况好于所在行业整体的盈利水平。因此，结构性的细分龙头和个股机会仍然存在。

另外，我们需要关注全球宏观环境在 18 年的变化，这将制约今年每轮行情的高度。我们看到不仅美联储加息预期在逐步抬升，欧洲、日本也均有退出宽松计划的意图。对国内而言，信贷呈现出价升量缩的态势，并且短期内很难出现扭转这种预期的信号。这些流动性层面的因素，导致估值的扩张空间有限，因此对于预期波动带来的股价大幅变化，需要注意投资的节奏，这点会给收益率带来较大的差别。

自下而上来看，业绩导向的风格将会延续，对估值的容忍度将会降低。精选细分景气行业，挖掘个股是我们的投资思路。我们认为大消费+大金融是 18 年较好的基础性配置，业绩成长股和有成长属性且具备供给收缩能力的低估值周期股具有弹性。不同于 17 年的趋势策略，我们认为反转策略在 18 年可能较好。操作方面，目前本基金持仓结构相对均衡，以业绩成长+消费升级为主，金融和周期为辅。我们将择机增加大金融行业配比，择机减持周期股。随着财报逐渐披露，我们

将对组合的行业和公司构成做进一步优化，通过精选行业和个股获取超额收益。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2017 年度，本基金管理人在为基金份额持有人谋求最大利益的同时，始终将合规运作、防范风险工作放在各项工作的首位。依照公司内部控制的整体要求，继续致力于内控机制的完善，加强内部风险的控制与防范，确保各项法规和管理制度的落实，保证基金合同得到严格履行。公司监察部门按照规定的权限和程序，通过实时监控、现场检查、重点抽查和人员询问等方法，独立地开展基金运作和公司管理的合规性稽核，发现问题及时提出改进建议并督促业务部门进行整改，同时定期向董事长和公司管理层出具监察稽核报告。

本报告期内，基金管理人内部监察稽核主要工作如下：

(1) 全面开展基金运作合规监察工作，确保基金投资的独立性、公平性及合法合规

主要措施有：严格执行集中交易制度，各基金相互独立，交易指令由中央交易室统一执行完成；对基金投资交易系统事先进行合规性设置，并由风险控制部门进行实时监控，杜绝出现违规行为；严格检查基金的投资决策、研究支持、交易过程是否符合规定的程序；通过以上措施，保证了投资运作遵循投资决策程序与业务流程，保证了基金投资组合符合相关法规及基金合同规定，确保了基金投资行为的独立、公平及合法合规。

(2) 开展定期和专项监察稽核工作，确保各项业务活动的合法合规

本年度公司监察稽核部门开展了对公司基金投资、研究、销售、后台运营、反洗钱等方面的专项监察稽核活动。对稽核中发现问题及时发出合规提示函，要求相关部门限期整改，并对改进情况安排后续跟踪检查，确保各项业务开展合法合规。

(3) 促进公司各项内部管理制度的完善

按照相关法规、证监会等监管机关的相关规定和公司业务的发展的要求，公司法律监察部及时要求各部门制订或修改相应制度，促进公司各项内部管理制度的进一步完善。

(4) 通过各种合规培训提高员工合规意识

本年度公司监察稽核部门通过对公司所有新入职员工进行入职前合规培训、对全体人员开展行为规范培训、对基金投资管理人员进行专项合规培训、对员工进行反洗钱培训等，有效提高了公司员工的合规意识。

通过以上工作的开展，在本报告期内本基金运作过程中未发生违规情形，基金运作整体合法合规。在今后的工作中，本基金管理人承诺将一如既往的本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和

运用基金资产，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，为基金持有人谋求最大利益。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，基金管理人严格执行基金估值控制流程，定期评估估值技术的合理性，每日将估值结果报托管银行复核后对外披露。参与估值流程的人员包括负责运营的副总经理以及投资研究、风险控制、金融工程和基金事务部门负责人，基金经理不参与估值流程。参与人员的相关工作经历均在五年以上。参与各方之间不存在任何重大利益冲突。已采用的估值技术相关参数或定价服务均来自独立第三方。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同的规定，在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益分配每年至多 12 次；每次基金收益分配比例不得低于收益分配基准日可供分配利润的 25%；基金的收益分配比例以收益分配基准日可供分配利润为基准计算，收益分配基准日可供分配利润以收益分配基准日资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数为准。基金合同生效不满 3 个月，收益可不分配。截止本报告期末，本基金可分配收益为 13,225,849.67 元。

#### 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

注：无。



## § 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”）在华泰柏瑞创新动力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

### 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	普华永道中天审字(2018)第 21110 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	华泰柏瑞创新动力灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人：
审计意见	<p>(一)我们审计的内容</p> <p>我们审计了华泰柏瑞创新动力灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“华泰柏瑞创新动力混合基金”)的财务报表,包括 2017 年 12 月 31 日的资产负债表,2017 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二)我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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,公允反映了华泰柏瑞创新动力混合基金 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。</p>
形成审计意见的基础	<p>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。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。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于华泰柏瑞创新动力混合基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	-
管理层和治理层对财务报表的责任	华泰柏瑞创新动力混合基金的基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必

	<p>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。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估华泰柏瑞创新动力混合基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算华泰柏瑞创新动力混合基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督华泰柏瑞创新动力混合基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险;设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制,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。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时,根据获取的审计证据,就可能对华泰柏瑞创新动力混合基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性,审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露;如果披露不充分,我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而,未来的事项或情况可能导致华泰柏瑞创新动力混合基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露),并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p>

	我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通,包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所有限公司	
注册会计师的姓名	单峰	曹阳
会计师事务所的地址	上海湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼	
审计报告日期	2018 年 3 月 26 日	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：华泰柏瑞创新动力灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	17,493,250.02	17,224,318.04
结算备付金		477,004.64	783,506.36
存出保证金		54,392.29	119,679.68
交易性金融资产	7.4.7.2	153,570,928.67	144,059,563.61
其中：股票投资		153,570,628.67	144,059,563.61
基金投资		-	-
债券投资		300.00	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		1,599,902.57	1,313,936.96
应收利息	7.4.7.5	4,207.06	5,426.92
应收股利		-	-
应收申购款		137,804.63	1,306.63
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		173,337,489.88	163,507,738.20
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2017 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2016 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		635,463.27	59,974.46
应付赎回款		2,581,359.31	104,641.95
应付管理人报酬		208,363.95	207,896.71
应付托管费		34,727.31	34,649.43
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	230,455.06	372,940.57
应交税费		-	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	214,503.92	365,208.23
负债合计		3,904,872.82	1,145,311.35
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	119,331,466.42	149,136,577.18
未分配利润	7.4.7.10	50,101,150.64	13,225,849.67
所有者权益合计		169,432,617.06	162,362,426.85
负债和所有者权益总计		173,337,489.88	163,507,738.20

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.420 元，基金份额总额 119331466.42 份。

## 7.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞创新动力灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		47,121,826.13	-25,282,290.49
1. 利息收入		128,202.07	333,816.45
其中：存款利息收入	7.4.7.11	128,176.37	320,097.50
债券利息收入		25.70	9,562.84
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	4,156.11
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		31,107,654.07	-593,946.47
其中：股票投资收益	7.4.7.12	29,545,884.67	-1,245,523.50
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	3,273.88	5,970.00
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	1,558,495.52	645,607.03
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	15,836,908.32	-25,158,028.06
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	49,061.67	135,867.59
<b>减：二、费用</b>		5,163,671.49	6,221,385.15
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	2,390,551.12	2,713,841.69
2. 托管费	7.4.10.2.2	398,425.22	452,306.99

3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	2,141,202.75	2,664,681.91
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.20	233,492.40	390,554.56
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		41,958,154.64	-31,503,675.64
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		41,958,154.64	-31,503,675.64

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华泰柏瑞创新动力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）	149,136,577.18	13,225,849.67	162,362,426.85
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	41,958,154.64	41,958,154.64
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）	-29,805,110.76	-5,082,853.67	-34,887,964.43
其中：1. 基金申购款	20,374,093.48	6,492,649.16	26,866,742.64
2. 基金赎回款	-50,179,204.24	-11,575,502.83	-61,754,707.07
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）	119,331,466.42	50,101,150.64	169,432,617.06
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）	180,789,214.29	48,162,173.11	228,951,387.40
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-31,503,675.64	-31,503,675.64
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）	-31,652,637.11	-3,432,647.80	-35,085,284.91
其中：1. 基金申购款	29,607,451.28	505,192.25	30,112,643.53
2. 基金赎回款	-61,260,088.39	-3,937,840.05	-65,197,928.44
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）	149,136,577.18	13,225,849.67	162,362,426.85

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：

_____ 韩勇 _____	_____ 房伟力 _____	_____ 赵景云 _____
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

华泰柏瑞创新动力灵活配置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”)证监许可[2014]1362号《关于核准华泰柏瑞创新动力灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》核准,由华泰柏瑞基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞创新动力灵活配置混合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2,312,478,960.89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(2015)第102号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华泰柏瑞创新动力灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2015年2月6日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为2,312,980,881.15份基金份额,其中认购资金利息折合501,920.26份基金份额。本基金的基金管理人为华泰柏瑞基金



管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞创新动力灵活配置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具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、债券回购、银行存款、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规和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其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：本基金持有的股票占基金资产的比例为 0%-95%，其中投资于创新动力主题相关的证券资产不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金保留的现金或者到期日在 1 年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值 5%。中证新兴产业指数收益率 $\times$ 60%+中债总指数（全价）收益率 $\times$ 40%。

本财务报表由本基金的基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司于 2018 年 3 月 26 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 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定（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颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华泰柏瑞创新动力灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

#### 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

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。

##### 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。

本基金持有的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卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

#### 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。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。当本基金依法有权抵销债权债务且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；处置时其公允价值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也可按直线法计算。

#### 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也可按直线法计算。

#### 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(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)为正数，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(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) 于 2017 年 12 月 26 日前，对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。自 2017 年 12 月 26 日起，对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《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》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、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(可转换债券、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

根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《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》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》,对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票,本基金自2017年12月26日起改为按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。该估值技术变更对本基金无影响。

### 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) 对于内地投资者持有的基金类别，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 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
活期存款	17,493,250.02	17,224,318.04
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	17,493,250.02	17,224,318.04

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	137,866,066.70	153,570,628.67	15,704,561.97
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	300.00	300.00
	银行间市场	-	-
	合计	300.00	300.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	137,866,366.70	153,570,928.67	15,704,561.97
项目	上年度末 2016 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	144,191,909.96	144,059,563.61	-132,346.35
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	144,191,909.96	144,059,563.61	-132,346.35

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末无买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末无期末买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
----	-----	------



	2017 年 12 月 31 日	2016 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	3,937.34	4,973.32
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	242.73	394.42
应收债券利息	0.04	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	26.95	59.18
合计	4,207.06	5,426.92

#### 7.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2017 年 12 月 31 日	2016 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	230,455.06	372,940.57
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	230,455.06	372,940.57

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2017 年 12 月 31 日	2016 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	4,503.92	208.23
预提费用	210,000.00	365,000.00
合计	214,503.92	365,208.23

#### 7.4.7.9 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 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	149,136,577.18	149,136,577.18

本期申购	20,374,093.48	20,374,093.48
本期赎回（以“-”号填列）	-50,179,204.24	-50,179,204.24
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	119,331,466.42	119,331,466.42

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.10 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	64,314,460.28	-51,088,610.61	13,225,849.67
本期利润	26,121,246.32	15,836,908.32	41,958,154.64
本期基金份额交易产生的变动数	-14,122,106.08	9,039,252.41	-5,082,853.67
其中：基金申购款	11,375,892.22	-4,883,243.06	6,492,649.16
基金赎回款	-25,497,998.30	13,922,495.47	-11,575,502.83
本期已分配利润	-	-	-
本期末	76,313,600.52	-26,212,449.88	50,101,150.64

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

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
活期存款利息收入	116,054.79	302,995.65
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	10,833.78	12,445.09
其他	1,287.80	4,656.76
合计	128,176.37	320,097.50

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 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12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016 年12月31日
卖出股票成交总额	723,066,515.79	899,047,447.84
减：卖出股票成本总额	693,520,631.12	900,292,971.34
买卖股票差价收入	29,545,884.67	-1,245,523.50

### 7.4.7.13 债券投资收益

#### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

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
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	3,273.88	5,970.00
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	3,273.88	5,970.00

#### 7.4.7.13.2 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12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年 12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	174,499.54	10,086,155.79
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	171,200.00	10,003,000.00
减：应收利息总额	25.66	77,185.79
买卖债券差价收入	3,273.88	5,970.00

#### 7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益——赎回差价收入。

#### 7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益——申购差价收入。

#### 7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期内未投资资产支持证券。

#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

注：本基金本报告期内未投资贵金属。

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

##### 7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期内未投资衍生工具。

##### 7.4.7.15.2 衍生工具收益 ——其他投资收益

注：本基金本报告期内未投资衍生工具。

#### 7.4.7.16 股利收益

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
股票投资产生的股利收益	1,558,495.52	645,607.03
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	1,558,495.52	645,607.03

#### 7.4.7.17 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12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
1. 交易性金融资产	15,836,908.32	-25,158,028.06
——股票投资	15,836,908.32	-25,154,028.06
——债券投资	-	-4,000.00
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
合计	15,836,908.32	-25,158,028.06

### 7.4.7.18 其他收入

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
基金赎回费收入	39,501.61	130,955.43
转换费收入	9,560.06	4,912.16
合计	49,061.67	135,867.59

注：1、本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金财产。

2、本基金的转换费由转出基金赎回费用及基金申购补差费用构成，其中赎回费用的 25% 的部分归入基金资产。

### 7.4.7.19 交易费用

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
交易所市场交易费用	2,141,202.75	2,664,506.91
银行间市场交易费用	-	175.00
合计	2,141,202.75	2,664,681.91

### 7.4.7.20 其他费用

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
审计费用	60,000.00	65,000.00
信息披露费	150,000.00	300,000.00
银行划款手续费	5,492.40	7,554.56
银行间账户服务费	18,000.00	18,000.00
合计	233,492.40	390,554.56

### 7.4.7.21 分部报告

无。

## 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金无资产负债表日后事项。

## 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
华泰柏瑞基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记人、基金直销机构
中国银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
华泰证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构
柏瑞投资有限责任公司	基金管理人的股东
苏州新区高新技术产业股份有限公司	基金管理人的股东
华泰联合证券有限责任公司	基金管理人的股东华泰证券的控股子公司
柏瑞爱建资产管理(上海)有限公司	基金管理人的控股子公司

注：关联方与基金进行的关联交易均在正常业务范围内按照一般商业条款而订立的。

## 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 7.4.10.1.1 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
华泰证券股 份有限公司	149,917,158.27	10.67%	112,488,182.95	6.42%

#### 7.4.10.1.2 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

华泰证券股份有限公司	136,619.59	10.56%	-	-
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
华泰证券股份有限公司	102,511.02	6.37%	102,511.02	27.49%

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。权证交易不计佣金。

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。

### 7.4.10.2 关联方报酬

#### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

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
当期发生的基金应支付的管理费	2,390,551.12	2,713,841.69
其中：支付销售机构的客户维护费	1,093,626.01	1,257,096.56

注：支付基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为： $\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.5\% / \text{当年天数}$ 。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

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
当期发生的基金应支付的托管费	398,425.22	452,306.99

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：

$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数}$ 。

### 7.4.10.3 销售服务费

注：本期和上年可比期间均无数据。

### 7.4.10.4 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

#### 7.4.10.5.1 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
基金合同生效日（2015年2月6日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	4,848,690.59	4,848,690.59
期间申购/买入总份额	7,078,704.37	-
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	11,927,394.96	4,848,690.59
期末持有的基金份额占基金总份额比例	9.9952%	3.2512%

注：1. 期间申购/买入总份额含转换入份额。

2. 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。

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

注：本报告期及2016年度，除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

### 7.4.10.6 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	17,493,250.02	116,054.79	17,224,318.04	302,995.65

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。

### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期内未参与关联方承销证券。



### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

### 7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

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

#### 7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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
603161	科华控股	2017年12月28日	2018年1月5日	新股流通受限	16.75	16.75	1,239	20,753.25	20,753.25	-
002923	润都股份	2017年12月28日	2018年1月5日	新股流通受限	17.01	17.01	954	16,227.54	16,227.54	-
603080	新疆火炬	2017年12月25日	2018年1月3日	新股流通受限	13.60	13.60	1,187	16,143.20	16,143.20	-

7.4.12.1.2 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
128024	宁行转债	2017年12月5日	2018年1月12日	新债未上市	100.00	100.00	3	300.00	300.00	-

#### 7.4.12.2 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	复牌开盘价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
------	------	------	------	--------	------	-------	-------	--------	--------	----

002507	涪陵榨菜	2017年12月4日	重大事项	17.95	-	-	382,206	4,464,876.84	6,860,597.70	-
600309	万华化学	2017年12月5日	重大资产重组	37.67	-	-	41,354	1,677,964.31	1,557,805.18	-
600666	奥瑞德	2017年5月31日	重大事项	17.40	-	-	64,320	1,200,130.80	1,119,168.00	-
600150	中国船舶	2017年9月27日	重大资产重组	24.67	2018年3月21日	22.20	8,382	248,111.78	206,783.94	-
300730	科创信息	2017年12月25日	重大事项	41.55	2018年1月2日	45.71	821	6,863.56	34,112.55	-
002919	名臣健康	2017年12月28日	重大事项	35.26	2018年1月2日	38.79	821	10,311.76	28,948.46	-
601600	中国铝业	2017年9月12日	重大资产重组	6.64	-	-	2,400	15,627.04	15,936.00	-
300104	乐视网	2017年8月28日	重大资产重组	3.92	2018年1月24日	13.80	1,400	25,715.03	5,488.00	-
002366	台海核电	2017年12月6日	重大资产重组	26.45	-	-	200	5,128.60	5,290.00	-
600685	中船防务	2017年9月27日	重大资产重组	26.66	2018年3月21日	24.05	113	3,685.94	3,012.58	-

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。

### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末没有在银行间市场债券正回购交易中抵押的债券。

### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末没有在交易所市场债券正回购交易中抵押的债券。

## 7.4.13 金融工具风险及管理

### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金，为证券投资基金中的中高风险、中高收益品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资和债券投资等。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“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人建立的风险管理体系由“组织、制度、流程和报告”等四个方面构成。组织是指公司的风险管理组织架构包括董事会下设的风险管理与审计委员会、公司管理层的风险控制委员会、风险管理部和法律监察部以及公司各业务部门，董事会对建立基金风险管理内部控制系统和维持其有效性承担最终责任；制度是指风险管理相关的规章制度，是对组织职能及其工作流程等的具体规定；流程是风险管理的工作流程，它详细规定了各部门之间风险管理工作的内容和程序；报告是对流程的必要反映和记录，既是风险管理工作的重要环节，也是对风险管理工作的总结和披露。

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。

### 7.4.13.2 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在本基金的托管行中国银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。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 12 月 31 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.0002%(2016 年 12 月 31 日：无)。

#### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：无。

#### 7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
AAA	300.00	-
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	300.00	-

注：债券信用评级取自第三方评级机构的评级。

#### 7.4.13.3 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。

于 2017 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无

#### 7.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券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上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%，本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股股票不得超过该上市公司可流通股股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股股票，不得超过该上市公司可流通股股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。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。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

注：流动性受限资产、7 个工作日可变现资产的计算口径见《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》第四十条。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 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。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017 年 12 月 31	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
-----------------------	--------	--------	----------	-------	-------	-----	----

日							
资产							
银行存款	17,493,250.02	-	-	-	-	-	17,493,250.02
结算备付金	477,004.64	-	-	-	-	-	477,004.64
存出保证金	54,392.29	-	-	-	-	-	54,392.29
交易性金融资产	-	-	300.00	-	-	153,570,628.67	153,570,928.67
应收证券清算款	-	-	-	-	-	1,599,902.57	1,599,902.57
应收利息	-	-	-	-	-	4,207.06	4,207.06
应收申购款	-	-	-	-	-	137,804.63	137,804.63
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	18,024,646.95	-	300.00	-	-	155,312,542.93	173,337,489.88
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	635,463.27	635,463.27
应付赎回款	-	-	-	-	-	2,581,359.31	2,581,359.31
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	208,363.95	208,363.95
应付托管费	-	-	-	-	-	34,727.31	34,727.31
应付交易费用	-	-	-	-	-	230,455.06	230,455.06
其他负债	-	-	-	-	-	214,503.92	214,503.92
负债总计	-	-	-	-	-	3,904,872.82	3,904,872.82
利率敏感度缺口	18,024,646.95	-	300.00	-	-	151,407,670.11	169,432,617.06
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	17,224,318.04	-	-	-	-	-	17,224,318.04
结算备付金	783,506.36	-	-	-	-	-	783,506.36
存出保证金	119,679.68	-	-	-	-	-	119,679.68
交易性金融资产	-	-	-	-	-	144,059,563.61	144,059,563.61
应收证券清算款	-	-	-	-	-	1,313,936.96	1,313,936.96
应收利息	-	-	-	-	-	5,426.92	5,426.92
应收申购款	-	-	-	-	-	1,306.63	1,306.63
资产总计	18,127,504.08	-	-	-	-	145,380,234.12	163,507,738.20
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	59,974.46	59,974.46
应付赎回款	-	-	-	-	-	104,641.95	104,641.95

应付管理人报酬	-	-	-	-	-	207,896.71	207,896.71
应付托管费	-	-	-	-	-	34,649.43	34,649.43
应付交易费用	-	-	-	-	-	372,940.57	372,940.57
其他负债	-	-	-	-	-	365,208.23	365,208.23
负债总计	-	-	-	-	-	1,145,311.35	1,145,311.35
利率敏感度缺口	18,127,504.08	-	-	-	-	144,234,922.77	162,362,426.85

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2017 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.0002%(2016 年 12 月 31 日：无)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2016 年 12 月 31 日：同)。

#### 7.4.13.4.2 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。

#### 7.4.13.4.3 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。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金持有的股票占基金资产的比例为 0%-95%，其中投资于创新动力主题相关的证券资产不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金保留的现金或者到期日在 1 年以内的政府



债券的比例合计不低于基金资产净值 5%。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。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 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	153,570,628.67	90.64	144,059,563.61	88.73
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
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	153,570,628.67	90.64	144,059,563.61	88.73

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证 500 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：人民币万元）	
		本期末（2017 年 12 月 31 日）	上年度末（2016 年 12 月 31 日）
	1. 中证 500 指数上升 5%		626.00
2. 中证 500 指数下降 5%		-626.00	-729.00

#### 7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：无

#### 7.4.14 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

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。

持续的以公允价值计量的金融工具

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 143,680,362.27 元，属于第二层次的余额为 9,885,078.40 元，属于第三层次的余额为 5,488.00 元(2016 年 12 月 31 日：第一层次 133,615,619.49 元，第二层次 10,443,944.12 元，无属于第三层次的余额)。

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。

第三层次公允价值余额和本期变动金额

于本期末，本基金持有公允价值归属于第三层次的金融工具 5,488.00 元(2016 年 12 月 31 日：零元)。本基金本期净转入/(转出)第三层次的金额为 5,488.00 元，计入损益的第三层次金融工具公允价值变动为-20,227.03 元(2016 年度：零元)。

上述第三层次资产变动如下：

交易性金融资产

权益工具投资

2017 年 1 月 1 日	-
购买	-
出售	-
转入第三层级	5,488.00
转出第三层级	-
当期利得或损失总额	-
计入损益的利得或损失	-
2017 年 12 月 31 日	<u>5,488.00</u>

2017 年 12 月 31 日仍持有的资产计入 2017 年度损益的未实现利得或损失的变动

——公允价值变动损益	<u>-20,227.03</u>
------------	-------------------

计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值按照市净率定价模型确定。

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)。

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	153,570,628.67	88.60
	其中：股票	153,570,628.67	88.60
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	300.00	0.00
	其中：债券	300.00	0.00
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	17,970,254.66	10.37
8	其他各项资产	1,796,306.55	1.04
9	合计	173,337,489.88	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	327,982.00	0.19
B	采矿业	4,936,474.33	2.91
C	制造业	114,801,450.11	67.76
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,389,676.05	2.59
E	建筑业	68,776.58	0.04
F	批发和零售业	55,881.53	0.03
G	交通运输、仓储和邮政业	3,987,267.06	2.35
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,615,285.41	2.72
J	金融业	5,532,525.07	3.27
K	房地产业	1,139,454.00	0.67

L	租赁和商务服务业	7,976,386.48	4.71
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,801,830.64	1.06
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	3,920,824.00	2.31
R	文化、体育和娱乐业	16,815.41	0.01
S	综合	-	-
	合计	153,570,628.67	90.64

### 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：本基金本报告期内未投资港股通股票。

### 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	000636	风华高科	750,500	8,915,940.00	5.26
2	000858	五粮液	107,049	8,551,074.12	5.05
3	600521	华海药业	258,229	7,777,857.48	4.59
4	600887	伊利股份	230,430	7,417,541.70	4.38
5	002507	涪陵榨菜	382,206	6,860,597.70	4.05
6	600703	三安光电	250,543	6,361,286.77	3.75
7	000596	古井贡酒	93,100	6,113,877.00	3.61
8	603816	顾家家居	100,000	5,897,000.00	3.48
9	300232	洲明科技	403,497	5,770,007.10	3.41
10	002027	分众传媒	395,614	5,570,245.12	3.29
11	600702	沱牌舍得	114,707	5,352,228.62	3.16
12	000786	北新建材	233,737	5,259,082.50	3.10
13	600256	广汇能源	972,268	4,919,676.08	2.90
14	300065	海兰信	255,946	4,663,336.12	2.75
15	002139	拓邦股份	390,227	4,616,385.41	2.72
16	002120	韵达股份	86,704	3,969,309.12	2.34
17	600845	宝信软件	191,900	3,557,826.00	2.10
18	600872	中炬高新	136,515	3,380,111.40	1.99
19	601398	工商银行	545,156	3,379,967.20	1.99
20	300335	迪森股份	192,100	3,354,066.00	1.98

21	000661	长春高新	16,700	3,056,100.00	1.80
22	002304	洋河股份	26,400	3,036,000.00	1.79
23	601636	旗滨集团	431,000	2,689,440.00	1.59
24	002127	南极电商	194,544	2,371,491.36	1.40
25	300015	爱尔眼科	69,900	2,152,920.00	1.27
26	601336	新华保险	28,534	2,003,086.80	1.18
27	600563	法拉电子	36,500	1,854,565.00	1.09
28	600763	通策医疗	54,700	1,767,904.00	1.04
29	002573	清新环境	77,000	1,750,210.00	1.03
30	600487	亨通光电	42,477	1,716,920.34	1.01
31	600867	通化东宝	70,580	1,615,576.20	0.95
32	600309	万华化学	41,354	1,557,805.18	0.92
33	603799	华友钴业	18,990	1,523,567.70	0.90
34	002050	三花智控	74,400	1,364,496.00	0.81
35	000581	威孚高科	55,300	1,327,200.00	0.78
36	600622	光大嘉宝	62,700	1,126,719.00	0.66
37	600666	奥瑞德	64,320	1,119,168.00	0.66
38	002179	中航光电	25,906	1,020,178.28	0.60
39	002039	黔源电力	65,645	1,019,466.85	0.60
40	300203	聚光科技	25,400	902,970.00	0.53
41	000538	云南白药	8,316	846,485.64	0.50
42	000555	神州信息	41,600	488,800.00	0.29
43	002202	金风科技	18,679	352,099.15	0.21
44	002916	深南电路	3,068	267,621.64	0.16
45	600176	中国巨石	15,568	253,602.72	0.15
46	000998	隆平高科	8,800	226,336.00	0.13
47	600150	中国船舶	8,382	206,783.94	0.12
48	002920	德赛西威	4,569	178,784.97	0.11
49	600085	同仁堂	4,700	151,528.00	0.09
50	300310	宜通世纪	10,260	118,913.40	0.07
51	000738	航发控制	7,643	116,861.47	0.07
52	600522	中天科技	7,556	105,330.64	0.06
53	600372	中航电子	7,291	99,813.79	0.06
54	002583	海能达	5,264	97,436.64	0.06
55	002415	海康威视	2,495	97,305.00	0.06
56	000938	紫光股份	1,252	90,181.56	0.05
57	600885	宏发股份	2,100	86,877.00	0.05
58	300571	平治信息	1,800	84,240.00	0.05
59	002918	蒙娜丽莎	1,512	84,218.40	0.05

60	002252	上海莱士	3,800	75,430.00	0.04
61	603658	安图生物	1,400	74,508.00	0.04
62	601118	海南橡胶	12,600	69,930.00	0.04
63	002405	四维图新	2,500	65,975.00	0.04
64	000768	中航飞机	3,776	63,776.64	0.04
65	002236	大华股份	2,750	63,497.50	0.04
66	600062	华润双鹤	2,564	63,459.00	0.04
67	600196	复星医药	1,405	62,522.50	0.04
68	300024	机器人	3,057	57,532.74	0.03
69	300036	超图软件	3,559	54,950.96	0.03
70	600570	恒生电子	1,183	54,891.20	0.03
71	600582	天地科技	11,147	51,833.55	0.03
72	300136	信维通信	993	50,345.10	0.03
73	002456	欧菲科技	2,380	49,004.20	0.03
74	600498	烽火通信	1,677	48,347.91	0.03
75	002008	大族激光	933	46,090.20	0.03
76	002222	福晶科技	2,477	45,155.71	0.03
77	002812	创新股份	422	43,423.80	0.03
78	002241	歌尔股份	2,438	42,299.30	0.02
79	002475	立讯精密	1,795	42,074.80	0.02
80	300735	光弘科技	2,823	40,622.97	0.02
81	000063	中兴通讯	1,109	40,323.24	0.02
82	002915	中欣氟材	1,085	38,181.15	0.02
83	601186	中国铁建	3,347	37,285.58	0.02
84	600276	恒瑞医药	539	37,180.22	0.02
85	603477	振静股份	1,955	37,027.70	0.02
86	600104	上汽集团	1,139	36,493.56	0.02
87	601318	中国平安	518	36,249.64	0.02
88	002712	思美传媒	1,500	34,650.00	0.02
89	000333	美的集团	621	34,422.03	0.02
90	300730	科创信息	821	34,112.55	0.02
91	002714	牧原股份	600	31,716.00	0.02
92	000560	昆百大 A	3,300	31,482.00	0.02
93	601166	兴业银行	1,800	30,582.00	0.02
94	601989	中国重工	5,033	30,348.99	0.02
95	000625	长安汽车	2,400	30,240.00	0.02
96	002594	比亚迪	463	30,118.15	0.02
97	002273	水晶光电	1,235	29,133.65	0.02
98	002919	名臣健康	821	28,948.46	0.02



99	600549	厦门钨业	1,121	28,854.54	0.02
100	002292	奥飞娱乐	2,000	28,580.00	0.02
101	603019	中科曙光	700	28,168.00	0.02
102	300168	万达信息	1,899	25,598.52	0.02
103	002766	索菱股份	1,800	25,470.00	0.02
104	600392	盛和资源	1,336	25,384.00	0.01
105	300070	碧水源	1,456	25,290.72	0.01
106	000823	超声电子	1,800	24,390.00	0.01
107	000651	格力电器	546	23,860.20	0.01
108	300316	晶盛机电	1,100	23,001.00	0.01
109	300122	智飞生物	805	22,596.35	0.01
110	002922	伊戈尔	1,245	22,248.15	0.01
111	002410	广联达	1,100	21,560.00	0.01
112	603161	科华控股	1,239	20,753.25	0.01
113	600718	东软集团	1,371	20,098.86	0.01
114	000999	华润三九	722	19,638.40	0.01
115	002049	紫光国芯	401	19,243.99	0.01
116	300088	长信科技	2,427	19,003.41	0.01
117	601877	正泰电器	704	18,409.60	0.01
118	600535	天士力	505	17,967.90	0.01
119	603329	上海雅仕	1,183	17,957.94	0.01
120	601628	中国人寿	578	17,600.10	0.01
121	601088	中国神华	725	16,798.25	0.01
122	601288	农业银行	4,291	16,434.53	0.01
123	600038	中直股份	349	16,238.97	0.01
124	002923	润都股份	954	16,227.54	0.01
125	603080	新疆火炬	1,187	16,143.20	0.01
126	601600	中国铝业	2,400	15,936.00	0.01
127	600436	片仔癀	250	15,800.00	0.01
128	000826	启迪桑德	475	15,684.50	0.01
129	601328	交通银行	2,501	15,531.21	0.01
130	600118	中国卫星	592	14,948.00	0.01
131	002157	正邦科技	2,600	14,898.00	0.01
132	000776	广发证券	891	14,861.88	0.01
133	603111	康尼机电	1,056	14,256.00	0.01
134	601607	上海医药	587	14,199.53	0.01
135	600809	山西汾酒	239	13,620.61	0.01
136	002450	康得新	598	13,275.60	0.01
137	000807	云铝股份	1,286	13,155.78	0.01

138	600111	北方稀土	900	13,131.00	0.01
139	300059	东方财富	1,000	12,950.00	0.01
140	600048	保利地产	900	12,735.00	0.01
141	600282	南钢股份	2,500	12,100.00	0.01
142	002174	游族网络	541	12,064.30	0.01
143	600893	航发动力	445	11,974.95	0.01
144	300684	中石科技	827	11,528.38	0.01
145	601668	中国建筑	1,245	11,229.90	0.01
146	601766	中国中车	925	11,201.75	0.01
147	600066	宇通客车	458	11,024.06	0.01
148	000423	东阿阿胶	181	10,908.87	0.01
149	000917	电广传媒	1,200	10,872.00	0.01
150	600054	黄山旅游	746	10,645.42	0.01
151	601928	凤凰传媒	1,289	10,453.79	0.01
152	600386	北巴传媒	2,000	10,200.00	0.01
153	600031	三一重工	1,111	10,076.77	0.01
154	600782	新钢股份	1,513	9,955.54	0.01
155	601611	中国核建	935	9,602.45	0.01
156	600779	水井坊	200	9,360.00	0.01
157	600056	中国医药	358	8,910.62	0.01
158	000932	*ST 华菱	1,054	8,547.94	0.01
159	002465	海格通信	886	8,496.74	0.01
160	600518	康美药业	378	8,452.08	0.00
161	600808	马钢股份	2,045	8,445.85	0.00
162	002439	启明星辰	360	8,406.00	0.00
163	603655	朗博科技	881	8,193.30	0.00
164	002310	东方园林	400	8,068.00	0.00
165	002430	杭氧股份	565	7,893.05	0.00
166	600566	济川药业	203	7,744.45	0.00
167	600030	中信证券	415	7,511.50	0.00
168	002152	广电运通	1,000	7,440.00	0.00
169	000997	新大陆	400	7,172.00	0.00
170	600804	鹏博士	400	6,812.00	0.00
171	600037	歌华有线	500	6,495.00	0.00
172	601098	中南传媒	458	6,361.62	0.00
173	300166	东方国信	480	6,024.00	0.00
174	601939	建设银行	758	5,821.44	0.00
175	600446	金证股份	383	5,798.62	0.00
176	603355	莱克电气	113	5,568.64	0.00

177	300104	乐视网	1,400	5,488.00	0.00
178	002366	台海核电	200	5,290.00	0.00
179	000717	韶钢松山	543	4,810.98	0.00
180	300308	中际旭创	69	4,036.50	0.00
181	000400	许继电气	300	3,957.00	0.00
182	002138	顺络电子	238	3,946.04	0.00
183	000513	丽珠集团	51	3,388.95	0.00
184	002065	东华软件	400	3,280.00	0.00
185	000488	晨鸣纸业	182	3,033.94	0.00
186	600685	中船防务	113	3,012.58	0.00
187	002230	科大讯飞	50	2,957.00	0.00
188	300072	三聚环保	84	2,950.92	0.00
189	002142	宁波银行	153	2,724.93	0.00
190	002007	华兰生物	100	2,688.00	0.00
191	300115	长盈精密	121	2,428.47	0.00
192	600688	上海石化	373	2,361.09	0.00
193	603517	绝味食品	56	2,207.52	0.00
194	601601	中国太保	52	2,153.84	0.00
195	600491	龙元建设	201	1,899.45	0.00
196	002001	新和成	25	951.50	0.00
197	601800	中国交建	54	691.20	0.00
198	000725	京东方A	93	538.47	0.00
199	600019	宝钢股份	61	527.04	0.00
200	601633	长城汽车	41	471.09	0.00
201	600089	特变电工	39	386.49	0.00

## 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	601398	工商银行	13,665,097.00	8.42
2	000651	格力电器	11,519,765.67	7.10
3	002027	分众传媒	11,094,231.48	6.83
4	600104	上汽集团	9,222,287.00	5.68
5	600703	三安光电	9,121,193.42	5.62

6	600521	华海药业	9,007,093.34	5.55
7	600566	济川药业	8,839,028.69	5.44
8	000333	美的集团	8,768,677.28	5.40
9	000636	风华高科	8,760,547.00	5.40
10	300232	洲明科技	8,725,500.20	5.37
11	000858	五粮液	8,425,780.37	5.19
12	002507	涪陵榨菜	8,293,686.52	5.11
13	600309	万华化学	8,241,442.96	5.08
14	600019	宝钢股份	8,017,812.00	4.94
15	300418	昆仑万维	7,757,338.31	4.78
16	600056	中国医药	7,567,862.78	4.66
17	601600	中国铝业	7,089,705.00	4.37
18	603816	顾家家居	6,805,263.02	4.19
19	600887	伊利股份	6,735,448.00	4.15
20	000596	古井贡酒	6,634,977.00	4.09
21	002430	杭氧股份	6,584,214.95	4.06
22	002127	南极电商	6,336,149.00	3.90
23	601668	中国建筑	6,257,457.00	3.85
24	000776	广发证券	6,128,346.00	3.77
25	600054	黄山旅游	6,127,204.36	3.77
26	000786	北新建材	6,097,298.08	3.76
27	002008	大族激光	6,043,282.32	3.72
28	600030	中信证券	5,990,423.06	3.69
29	002139	拓邦股份	5,978,882.25	3.68
30	002241	歌尔股份	5,976,172.40	3.68
31	002174	游族网络	5,625,110.21	3.46
32	600872	中炬高新	5,517,430.52	3.40
33	600688	上海石化	5,447,771.00	3.36
34	300065	海兰信	5,378,018.00	3.31
35	600702	沱牌舍得	5,350,540.02	3.30
36	600487	亨通光电	5,252,849.00	3.24
37	300088	长信科技	5,115,028.51	3.15
38	601607	上海医药	4,845,617.00	2.98
39	000423	东阿阿胶	4,841,372.84	2.98
40	000983	西山煤电	4,790,651.00	2.95
41	601628	中国人寿	4,773,810.00	2.94

42	002415	海康威视	4,769,218.25	2.94
43	600518	康美药业	4,761,542.20	2.93
44	601288	农业银行	4,679,351.00	2.88
45	600256	广汇能源	4,656,164.00	2.87
46	002142	宁波银行	4,651,733.89	2.87
47	002195	二三四五	4,499,892.74	2.77
48	000717	韶钢松山	4,499,575.00	2.77
49	600808	马钢股份	4,219,987.00	2.60
50	600029	南方航空	4,049,165.00	2.49
51	002120	韵达股份	3,973,954.96	2.45
52	601012	隆基股份	3,967,611.32	2.44
53	601601	中国太保	3,955,186.00	2.44
54	002465	海格通信	3,928,471.73	2.42
55	300070	碧水源	3,892,875.60	2.40
56	601633	长城汽车	3,827,912.87	2.36
57	600809	山西汾酒	3,813,748.00	2.35
58	000963	华东医药	3,774,232.36	2.32
59	002456	欧菲科技	3,755,302.00	2.31
60	002460	赣锋锂业	3,667,454.08	2.26
61	002078	太阳纸业	3,634,938.60	2.24
62	000739	普洛药业	3,612,329.31	2.22
63	002222	福晶科技	3,576,136.00	2.20
64	600845	宝信软件	3,457,947.00	2.13
65	002466	天齐锂业	3,451,516.00	2.13
66	600111	北方稀土	3,358,081.00	2.07
67	300335	迪森股份	3,311,514.27	2.04
68	601088	中国神华	3,304,533.00	2.04
69	600062	华润双鹤	3,272,370.91	2.02
70	000826	启迪桑德	3,269,138.04	2.01

注：本项买入金额均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑其他交易费用。

#### 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	600056	中国医药	12,318,270.64	7.59

2	002430	杭氧股份	12,161,498.19	7.49
3	000651	格力电器	11,927,382.84	7.35
4	002236	大华股份	11,778,789.03	7.25
5	601398	工商银行	10,900,801.72	6.71
6	300232	洲明科技	10,343,626.84	6.37
7	600104	上汽集团	10,018,028.49	6.17
8	000333	美的集团	9,900,803.56	6.10
9	002239	奥特佳	9,316,853.32	5.74
10	002475	立讯精密	9,178,983.38	5.65
11	600566	济川药业	8,747,431.16	5.39
12	600019	宝钢股份	8,174,998.82	5.04
13	002008	大族激光	8,030,197.96	4.95
14	300418	昆仑万维	7,752,011.07	4.77
15	002519	银河电子	7,739,103.43	4.77
16	000826	启迪桑德	7,490,611.19	4.61
17	601607	上海医药	7,288,376.99	4.49
18	601600	中国铝业	7,170,633.00	4.42
19	002138	顺络电子	7,114,864.96	4.38
20	600309	万华化学	7,042,822.37	4.34
21	600703	三安光电	6,802,005.53	4.19
22	002027	分众传媒	6,501,450.44	4.00
23	600166	福田汽车	6,442,616.26	3.97
24	600298	安琪酵母	6,323,075.68	3.89
25	000858	五粮液	6,267,905.91	3.86
26	000717	韶钢松山	5,979,324.62	3.68
27	600519	贵州茅台	5,943,588.04	3.66
28	601668	中国建筑	5,924,977.89	3.65
29	000776	广发证券	5,923,284.16	3.65
30	600030	中信证券	5,915,952.00	3.64
31	002174	游族网络	5,815,335.35	3.58
32	002241	歌尔股份	5,789,456.51	3.57
33	603868	飞科电器	5,689,321.03	3.50
34	600054	黄山旅游	5,642,593.70	3.48
35	600518	康美药业	5,576,632.19	3.43
36	600688	上海石化	5,507,133.99	3.39
37	000423	东阿阿胶	5,380,661.70	3.31
38	002007	华兰生物	5,357,394.02	3.30
39	300088	长信科技	5,338,569.31	3.29

40	600885	宏发股份	5,164,807.15	3.18
41	002142	宁波银行	4,948,207.19	3.05
42	600109	国金证券	4,912,168.00	3.03
43	002415	海康威视	4,878,946.55	3.00
44	600809	山西汾酒	4,869,413.59	3.00
45	601628	中国人寿	4,759,476.88	2.93
46	601377	兴业证券	4,728,015.00	2.91
47	601288	农业银行	4,617,298.39	2.84
48	002507	涪陵榨菜	4,553,255.43	2.80
49	601601	中国太保	4,521,883.87	2.79
50	002460	赣锋锂业	4,505,345.72	2.77
51	000963	华东医药	4,439,207.19	2.73
52	600808	马钢股份	4,354,466.74	2.68
53	002195	二三四五	4,215,877.42	2.60
54	600487	亨通光电	4,201,757.97	2.59
55	600029	南方航空	4,194,926.00	2.58
56	002222	福晶科技	4,137,954.54	2.55
57	600160	巨化股份	4,063,237.73	2.50
58	300115	长盈精密	4,043,747.26	2.49
59	002456	欧菲科技	4,010,927.26	2.47
60	300070	碧水源	3,946,277.98	2.43
61	002465	海格通信	3,921,920.58	2.42
62	000501	鄂武商A	3,903,340.29	2.40
63	002273	水晶光电	3,869,314.95	2.38
64	002466	天齐锂业	3,866,186.69	2.38
65	601012	隆基股份	3,862,015.22	2.38
66	601633	长城汽车	3,774,257.63	2.32
67	600062	华润双鹤	3,595,020.85	2.21
68	000028	国药一致	3,542,661.67	2.18
69	000983	西山煤电	3,498,178.80	2.15
70	600511	国药股份	3,437,190.04	2.12
71	002019	亿帆医药	3,422,270.40	2.11
72	002078	太阳纸业	3,411,466.93	2.10
73	000709	河钢股份	3,319,150.09	2.04
74	002583	海能达	3,279,124.69	2.02
75	300136	信维通信	3,255,411.35	2.01

注：本项卖出金额均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑其他交易费用。

### 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	687,194,752.01
卖出股票收入（成交）总额	723,066,515.79

### 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）	300.00	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	300.00	0.00

### 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（%）
1	128024	宁行转债	3	300.00	0.00

### 8.7 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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。



### 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注：本基金本报告期内未持有股指期货。

### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

### 8.12 投资组合报告附注

#### 8.12.1

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查的，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的。

#### 8.12.2

基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的。

#### 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	54,392.29
2	应收证券清算款	1,599,902.57
3	应收股利	-
4	应收利息	4,207.06
5	应收申购款	137,804.63
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,796,306.55

#### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	002507	涪陵榨菜	6,860,597.70	4.05	停牌

## § 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
2,645	45,115.87	11,932,917.32	10.00%	107,398,549.10	90.00%

### 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	1,032,085.97	0.8649%

### 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	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（ 2015 年 2 月 6 日 ）基金份额总额	2,312,980,881.15
本报告期期初基金份额总额	149,136,577.18
本报告期基金总申购份额	20,374,093.48
减:本报告期基金总赎回份额	50,179,204.24
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	119,331,466.42

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内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

2017 年 7 月 12 日，经公司股东会批准，吴海云女士成为公司监事会主席。

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

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内基金未改聘为其审计的会计师事务所。本报告期基金应支付给普华永道中天会计师事务所有限公司的报酬为 60000 元人民币，该事务所已向本基金提供了 3 年的审计服务。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内基金管理人、基金托管人的托管业务部门及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

### 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	佣金	占当期佣金 总量的比例	

			例			
银河证券	1	283,647,947.91	20.19%	264,162.05	20.42%	-
长江证券	1	156,783,731.87	11.16%	146,012.07	11.29%	-
华泰证券	2	149,917,158.27	10.67%	136,619.59	10.56%	-
中信建投	2	127,618,339.06	9.09%	116,523.57	9.01%	-
华安证券	2	116,729,802.08	8.31%	107,109.89	8.28%	-
广发证券	2	114,983,641.25	8.19%	105,490.71	8.16%	-
兴业证券	1	100,337,843.61	7.14%	91,438.77	7.07%	-
光大证券	2	68,050,313.28	4.84%	62,013.92	4.79%	-
东北证券	1	62,670,591.13	4.46%	58,364.91	4.51%	-
华鑫证券	1	47,045,810.40	3.35%	42,873.05	3.31%	-
国泰君安	1	35,042,351.99	2.49%	32,634.49	2.52%	-
东吴证券	1	33,386,782.47	2.38%	30,425.26	2.35%	-
东方证券	2	20,399,636.44	1.45%	18,850.13	1.46%	-
方正证券	1	16,542,967.66	1.18%	15,406.17	1.19%	-
华融证券	1	13,219,698.57	0.94%	12,047.41	0.93%	-
中信证券	1	13,193,779.92	0.94%	12,023.52	0.93%	-
万联证券	2	12,957,321.22	0.92%	11,808.38	0.91%	-
瑞银证券	1	11,252,959.73	0.80%	10,254.90	0.79%	-
安信证券	1	11,022,090.01	0.78%	10,264.56	0.79%	-
恒泰证券	1	9,873,066.49	0.70%	9,194.81	0.71%	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
齐鲁证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-

国金证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-

注：1、选择代理证券买卖的证券经营机构的标准

公司应选择财务状况良好，经营行为规范，具备研究实力的证券公司及专业研究机构，向其或其合作券商租用基金专用交易席位。公司选择的提供交易单元的券商应当满足下列基本条件：

- 1) 具有相应的业务经营资格；
- 2) 诚信记录良好，最近两年无重大违法违规行为，未受监管机构重大处罚；
- 3) 资金雄厚，信誉良好。内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足本基金运作高度保密的要求。
- 4) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的需要，并能为基金提供全面的信息服务。
- 5) 具备研究实力，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时全面地为基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、股票分析的研究报告及周到的信息服务，并能根据基金投资的特定要求，提供专题研究报告。

2、选择代理证券买卖的证券经营机构的程序

基金管理人根据以上标准进行考察后确定证券经营机构的选择。基金管理人与被选择的证券经营机构签订交易单元租用协议和证券研究服务协议。

### 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
银河证券	172,288.50	98.73%	-	-	-	-

长江证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	2,211.04	1.27%	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-



中银国际	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-

### 11.8 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	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金实施增值税政策的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 12 月 30 日
2	华泰柏瑞基金管理有限公司关于参加交通银行手机银行渠道申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 12 月 30 日
3	华泰柏瑞基金管理有限公司关于增加凤凰金信（银川）基金销售有限公司为旗下部分基金代销机构同时开通基金转换、定投及申购定投费率优惠等业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 12 月 28 日
4	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金调整流通受限股票估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 12 月 26 日
5	华泰柏瑞基金管理有限公司关于增加天津万家财富资产管理有限公司为旗下部分基金代销机构同时开通基金转换及申购费率优惠等业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 12 月 6 日
6	华泰柏瑞基金管理有限公司关于参加上海好买基金销售有限公司转换业务费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 12 月 1 日

7	华泰柏瑞基金管理有限公司关于参加上海基煜基金销售有限公司申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 11 月 28 日
8	华泰柏瑞基金管理有限公司关于增加南京苏宁基金销售有限公司为旗下部分基金代销机构同时开通基金转换及申购费率优惠等业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 11 月 22 日
9	华泰柏瑞基金管理有限公司关于增加上海挖财金融信息服务有限公司为旗下部分基金代销机构同时开通基金定投及申购定投费率优惠等业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 11 月 3 日
10	华泰柏瑞创新动力灵活配置混合型证券投资基金 2017 年三季度报	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 10 月 25 日
11	华泰柏瑞基金管理有限公司关于增加中国国际金融股份有限公司为旗下部分基金代销机构同时开通基金转换及申购费率优惠等业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 10 月 13 日
12	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金在交通银行股份有限公司开通基金转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 9 月 28 日
13	华泰柏瑞基金管理有限公司关于增加交通银行股份有限公司为旗下部分基金代销机构同时开通基金定投并参加申购定投费率优惠等业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 9 月 26 日
14	华泰柏瑞创新动力更新招募说明	中国证券报、上海证	2017 年 9 月 18 日

	书正文（2017 年第 2 号）	券报、证券时报	
15	华泰柏瑞创新动力更新招募说明书摘要（2017 年第 2 号）	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 9 月 18 日
16	华泰柏瑞基金管理公司关于旗下部分基金在上海大智慧财富管理有限公司开通基金定投业务及参加费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 9 月 9 日
17	华泰柏瑞创新动力灵活配置混合型证券投资基金 2017 年半年报	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 8 月 26 日
18	华泰柏瑞创新动力灵活配置混合型证券投资基金 2017 年半年报摘要	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 8 月 26 日
19	华泰柏瑞基金管理有限公司关于增加中信证券股份有限公司为旗下部分基金代销机构同时开通基金转换、定投及申购定投费率优惠等业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 8 月 10 日
20	华泰柏瑞基金管理有限公司关于增加中信证券（山东）有限责任公司为旗下部分基金代销机构同时开通基金转换、定投及申购定投费率优惠等业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 8 月 10 日
21	华泰柏瑞基金管理有限公司关于增加中信期货有限公司为旗下部分基金代销机构同时开通基金转换、定投及申购定投费率优惠等业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 8 月 10 日
22	华泰柏瑞创新动力灵活配置混合型证券投资基金 2017 年第二季	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 7 月 20 日

	度报告		
23	华泰柏瑞基金管理有限公司关于参加上海汇付金融服务有限公司费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017年7月14日
24	华泰柏瑞基金管理有限公司关于参加佳泓(北京)基金销售有限公司费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017年7月14日
25	华泰柏瑞基金关于执行《证券期货投资者适当性管理办法》、《非居民金融账户涉税信息尽职调查管理办法》的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017年7月1日
26	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金参加蚂蚁(杭州)基金销售有限公司定投及转换费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017年6月22日
27	华泰柏瑞基金管理有限公司关于增加联储证券有限责任公司为旗下部分基金代销机构同时开通基金转换、定投及申购定投费率优惠等业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017年6月10日
28	华泰柏瑞基金管理有限公司关于增加上海基煜基金销售有限公司为代销机构同时开通基金转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017年6月6日
29	华泰柏瑞基金管理有限公司关于增加大有期货有限公司为旗下部分基金代销机构同时开通基金转换、定投及申购定投费率优惠等业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017年5月25日

30	华泰柏瑞基金关于增加伯嘉基金为旗下部分基金代销机构同时开通基金转换、定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 5 月 8 日
31	华泰柏瑞基金管理有限公司关于增加金惠家保险代理有限公司为旗下部分基金代销机构同时开通基金转换、定投及申购定投费率优惠等业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 4 月 28 日
32	华泰柏瑞创新动力灵活配置混合型证券投资基金 2017 年第一季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 4 月 24 日
33	华泰柏瑞基金管理有限公司关于增加上海华夏财富投资管理有限公司为旗下部分基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 4 月 18 日
34	华泰柏瑞创新动力灵活配置混合型证券投资基金 2016 年年度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 3 月 29 日
35	华泰柏瑞创新动力混合型证券投资基金 2016 年年报摘要	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 3 月 29 日
36	华泰柏瑞创新动力灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）摘要 2017 年第 1 号	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 3 月 21 日
37	华泰柏瑞创新动力灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）正文 2017 年第 1 号	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 3 月 21 日
38	华泰柏瑞基金管理有限公司关于参加宜信普泽投资顾问（北京）有限公司费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 3 月 8 日

39	华泰柏瑞基金关于增加上海朝阳永续基金销售有限公司为代销机构并开通基金转换和参加费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 3 月 1 日
40	华泰柏瑞基金管理有限公司关于增加华西证券股份有限公司为旗下部分基金代销机构同时开通基金转换、定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 3 月 1 日
41	华泰柏瑞基金管理有限公司关于变更旗下基金产品转换补差费计算方式的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 2 月 23 日
42	华泰柏瑞基金关于上海华信证券有限责任公司开通基金定投并参加费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 1 月 19 日
43	华泰柏瑞创新动力灵活配置混合型证券投资基金 2016 年四季报	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 1 月 19 日
44	华泰柏瑞基金关于增加新浪仓石为旗下部分基金代销机构同时开通基金转换、定投业务及申购定投费率优惠等业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 1 月 12 日
45	华泰柏瑞基金关于增加北京汇成为旗下部分基金代销机构同时开通基金转换、定投业务及申购定投费率优惠等业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2017 年 1 月 12 日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：本基金本报告期内未有单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、本基金的中国证监会批准募集文件
- 2、本基金的《基金合同》
- 3、本基金的《招募说明书》
- 4、本基金的《托管协议》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、本基金的公告

### 13.2 存放地点

上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层

托管人住所

### 13.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。投资者对本报告如有疑问，可咨询基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司。客户服务热线：400-888-0001（免长途费）021-3878 4638 公司网址：[www.huatai-pb.com](http://www.huatai-pb.com)

华泰柏瑞基金管理有限公司

2018 年 3 月 28 日