

**永赢量化灵活配置混合型发起式证券投资基金**  
**2017 年年度报告摘要**

2017 年 12 月 31 日

基金管理人:永赢基金管理有限公司

基金托管人:华泰证券股份有限公司

送出日期:2018 年 03 月 30 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。

基金托管人华泰证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 3 月 28 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。

本报告中财务资料经审计。

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

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	永赢量化灵活配置混合型发起式证券投资基金
基金简称	永赢量化灵活配置混合发起式
基金主代码	001754
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年09月01日
基金管理人	永赢基金管理有限公司
基金托管人	华泰证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	56,492,789.33份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	<p>本基金通过灵活应用多种量化策略，在充分控制基金财产风险和保证基金财产流动性的基础上，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金财产的长期稳健增值。</p>
投资策略	<p>本基金采用多因子选股策略为主，辅以事件驱动以及宏观择时等其他量化策略，力争实现稳定的绝对回报。</p> <p>1、多因子选股策略</p> <p>该策略以对中国股票市场较长期的回测研究为基础，运用量化多因子模型框架，结合定性指标和定量指标，综合考虑上市公司基本经营状况和市场对股票的反应两大因素，通过计算市场上所有股票的管理质量、价值、成长变化、市场情绪以及行业特殊因素等量化因子，将计算结果组合成alpha模型，同时结合风险模型构建股票现货组合。基金经理根据市场状况及变化对各类信息的重要性做出具有一定前瞻性的判断，适时调整各因子类别的具体组成及权重。</p> <p>(1) 基本面因子</p> <p>管理质量：利用计算横截面多种比率来判断上市公</p>

司的报表质量以及管理能力，例如衡量报表质量的应收应付因子，衡量管理能力的周转率、偿债能力、ROA和ROE等因子；

成长变化：通过计算时间序列上各种比率的变化来衡量公司基本面的成长性；

价值：判断公司的股票价格相对于它的内在价值是否合理。由于内在价值无法直接计算，我们通过计算全市场所有公司的利润、销售量、总资产等多种指标来综合间接反映公司的内在价值。

## （2）市场因子

市场情绪：从技术面的动量、反转、枢轴突破等指标来衡量投资者情绪；

分析师预测：通过扫描市场上分析师观点的变化来预测市场反应。

## 2、事件驱动策略

该策略通过对某些公司事件和市场事件的研究，分析事件对股价造成波动的方向，以赚取超额收益。此外，该策略还利用市场上存在的金融产品定价非有效性，实现套利收益。

## 3、宏观择时策略

该策略通过计算和跟踪多种宏观经济变量和市场变量，运用计量经济学方法对未来大盘走势进行预测。

## 4、其他投资策略

### （1）债券投资策略

出于对流动性、有效利用基金财产的考虑，本基金适时对债券进行投资。通过深入分析宏观经济数据、货币政策和利率变化趋势等因素，制定久期控制下的投资策略，构造能够提供稳定收益的债券和货币市场工具组合。

### （2）金融衍生工具投资策略

在法律法规允许的范围内，本基金可基于谨慎原则运用权证、股票指数期货等相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理，以控制投资组合风险、提高投资效率，从而更好地实现本基金的投资目标。

业绩比较基准	95%*沪深300指数收益率+5%*银行活期存款利率（税后）
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金，预期风险和预期收益水平高于货币市场基金、债券型基金，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	永赢基金管理有限公司	华泰证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	毛慧
	联系电话	021-51690145
	电子邮箱	maoh@maxwealthfund.com
客户服务电话	021-51690111	95597
传真	021-51690177	025-83387215

### 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.maxwealthfund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2017年	2016年	2015年9月1日（基金合同生效日）-2015年12月31日
本期已实现收益	5,256,218.87	-8,678,657.67	14,593,008.03
本期利润	6,195,038.97	-9,655,379.85	14,346,110.20

加权平均基金份额本期利润	0.1073	-0.1022	0.0539
本期加权平均净值利润率	10.14%	-10.86%	5.35%
本期基金份额净值增长率	6.59%	-4.87%	6.80%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	2017年末	2016年末	2015年末
期末可供分配利润	4,712,496.02	964,885.43	8,371,341.21
期末可供分配基金份额利润	0.0834	0.0163	0.0679
期末基金资产净值	61,205,285.35	60,002,958.63	131,585,086.93
期末基金份额净值	1.083	1.016	1.068
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	2017年末	2016年末	2015年末
基金份额累计净值增长率	8.30%	1.60%	6.80%

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

2、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。

3、期末可供分配利润为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	-5.58%	0.81%	4.82%	0.76%	-10.40%	0.05%
过去六个月	5.56%	0.85%	9.44%	0.66%	-3.88%	0.19%
过去一年	6.59%	0.83%	20.63%	0.60%	-14.04%	0.23%
自基金合同生效起至今	8.30%	1.19%	18.95%	1.15%	-10.65%	0.04%

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、本基金业绩比较基准为95%\*沪深300指数收益率+5%\*银行活期存款利率（税后）。

### 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

永赢量化灵活配置混合型发起式证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2015年09月01日-2017年12月31日)



注：本基金在六个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同约定。

### 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



注：图中列示的2015年度基金净值增长率按该年度本基金实际存续期9月1日（基金合同生效日）起至12月31日止计算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金的合同生效日为2015年9月1日，截至2017年12月31日，本基金未进行过利润分配。

## § 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

永赢基金管理有限公司（以下简称“公司”）于2013年10月8日取得了中国证监会《关于核准设立永赢基金管理有限公司的批复》（证监许可[2013]1280号），随后，公司于2013年10月11日取得商务部《中华人民共和国外商投资企业批准证书》（商外资资审字[2013]008号），并于2013年11月7日在国家工商行政管理总局注册成立，此后，于2013年11月12日取得中国证监会核发的《基金管理资格证书》（编号A087），并于2017年3月14日获得中国证监会颁发的信用代码为913302007178854322的《中华人民共和国经营证券期货业务许可证》。2014年8月18日，公司完成工商变更登记，注册资本由人民币壹点伍亿元增至人民币贰亿元；2018年1月25日，公司完成增资，注册资本由



人民币贰亿元增至人民币玖亿元。目前，公司的股权结构为宁波银行股份有限公司持股71.49%，利安资产管理公司持股28.51%。

截止2017年12月31日，本基金管理人共管理10只开放式证券投资基金，即永赢货币市场基金、永赢天天利货币市场基金、永赢量化混合型发起式证券投资基金、永赢量化灵活配置混合型发起式证券投资基金、永赢稳益债券型证券投资基金、永赢双利债券型证券投资基金、永赢丰益债券型证券投资基金、永赢添益债券型证券投资基金、永赢瑞益债券型证券投资基金、永赢永益债券型证券投资基金。

#### 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		
张大木	基金经理	2015-09-01	-	17	张大木先生，硕士，17年金融行业投资研究经验，其中10年证券相关从业经验，曾任美国沃顿商学院高级数据分析师；巴克莱全球投资公司（BGI）投资分析员；博时基金管理有限公司投资经理兼量化分析师。现任永赢基金管理有限公司总经理助理兼量化投资总监。

注：1、任职时间和离任日期一般情况下指公司做出决定之日；若该基金经理自基金合同生效日起即任职，则任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券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

在本报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《永赢量化灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，并本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作合法合规，无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

为了公平对待投资人，保护投资人利益，避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为，本基金管理人根据《证券投资基金法》、《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司特定客户资产管理业务试点办法》等法律法规和内部制度，制定和修订了《公平交易制度》。

通过组织结构的设置、工作制度、流程和技术手段全面落实公平交易原则在具体业务（包括研究分析、投资决策、交易执行等）环节中的实现，在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时，确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。同时，通过对投资交易行为的日常监控和事后分析评估来加强对公平交易过程和结果的监督。

在研究分析方面，本基金管理人建立了规范、完善的研究管理平台，规范了研究人员的投资建议、研究报告的发布流程，使各投资组合经理在获取投资建议的及时性、准确性及深度等方面得到公平对待。

在投资决策方面，首先，本基金管理人建立健全投资授权制度，明确投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体的职责和权限。投资决策委员会和投资总监等管理机构和人员不得对投资经理在授权范围内的投资活动进行干预。投资经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作必须经过严格的审批程序；其次，本基金管理人建立投资组合投资信息的管理及保密制度，除分管投资副总及投资总监等因业务管理的需要外，不同投资经理之间的持仓和交易等重大非公开投资信息相互隔离；另外，本基金管理人还建立机制要求公募投资经理与特定客户资产投资经理互相隔离，且不能互相授权投资事宜。

在交易执行方面，本基金管理人设立了独立于投资管理职能的交易部，通过实行集中交易制度和公平的交易分配制度，确保各投资组合享有公平的交易执行机会；此外，本基金管理人对于可能导致涉嫌不公平交易和利益输送的反向交易行为也制定并落实了严格的管理：（1）对于交易所公开竞价的同向交易，交易部按照“时间优先、价格优先”的原则，采取“未委托数量比例法”，通过系统的公平交易模块实现公平交易；

（2）对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以本基金管理人名义进行的交易，各投资经理在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量，交易部按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配；（3）对于银行间市场的现券交易，交易部在银行间市场开展独立、公平的询价，并由监察稽核部对交易价格的公允性（根据市场公认的第三方信息）、交易对手和交易方式进行事后审核，确保交易得到公平和公允的执行。对于由于特殊原因不能参与以上提到的公平交易程序的交易指令，投资经理须提出申请并阐明具体原因，交由交易总监及监察稽核总监进行严格的公平性审核；（4）严格禁止同一投资组合或不同投资组合之间在同一交易日内进行反向交易（除完全按照有关指数的构成比例进行投资的组合或严格依据量化模型进行投资的组合外）。确因投资组合的投资策略或流动性等需要而发生的不同投资组合之间的同日

反向交易，相关投资经理须向风险管理委员会提供决策依据并留存记录备查。

在日常监控和事后分析评估方面，监察稽核部开展日内和定期的工作对公平交易执行情况作整体监控和效果评估。其中日常监控包括了日内不定点对交易系统的抽查监控；对非公开发行业股票申购、以本基金管理人名义进行的债券一级市场申购的申购方案和分配过程进行审核和监控；以及对银行间交易过程中投资组合与交易对手之间议价交易的交易方式和交易价格的公允性进行审查。事后分析评估上，监察稽核部在每个季度的《公平交易报告》中，对不同组合间同一投资标的、临近交易日的同向交易和反向交易的合理性开展分析评估。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本基金管理人主要通过建立有纪律、规范化的投资研究和决策流程、交易流程，以及强化事后监控分析来确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。本基金管理人规定了严格的投资权限管理制度、投资备选库管理制度和集中交易制度等，并重视交易执行环节的公平交易措施，以“时间优先、价格优先”作为执行指令的基本原则，通过投资交易系统内的公平交易模块，以尽可能确保公平对待各投资组合。

本基金管理人交易部和监察稽核部进行日常投资交易行为监控，监察稽核部负责对各账户公平交易进行事后分析，于每季度分别对所管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异以及不同时间窗口同向交易的交易价差进行分析，通过分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

报告期内本基金管理人严格执行公平交易制度，公平对待旗下各投资组合，未发现任何违反公平交易的行为。本报告期内，公平交易制度执行情况良好。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

### 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

2017年，A股市场走势分化严重，与过去十年市场整体风格偏好出现明显偏离，以沪深300为代表的大盘蓝筹强势上涨，其余个股则出现较为明显的调整。在本报告期内，本基金遵循稳健原则，利用量化模型灵活配置基金资产，由于受历史回测框架体系限制，本基金主要采用的量化多因子模型在2017年行情中表现一般，超额收益水平处于历史均值下限区域。

未来，我们将继续保持谨慎，灵活配置基金资产，在进一步有效控制产品风险的前提下，力争本产品的平衡运行。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末永赢量化灵活配置混合发起式基金份额净值为1.083元;本报告期内,基金份额净值增长率为6.59%,同期业绩比较基准收益率为20.63%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2017年,A股市场走势分化严重,与过去十年市场整体风格偏好出现明显偏离,以沪深300为代表的大盘蓝筹强势上涨,其余个股则出现较为明显的调整。在本报告期内,本基金遵循稳健原则,利用量化模型灵活配置基金资产,由于受历史回测框架体系限制,本基金主要采用的量化多因子模型在2017年行情中表现一般,超额收益水平处于历史均值下限区域。

未来,我们将继续保持谨慎,灵活配置基金资产,在进一步有效控制产品风险的前提下,力争本产品的平衡运行。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照相关法律法规规定,设有估值委员会,并制定了相关制度及流程。估值委员会主要负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督,确保基金估值的公允与合理。报告期内相关基金估值政策由托管银行进行复核。本基金管理人估值委员会由分管运营的总经理助理负责,成员包括总经理、督察长、分管投资的总经理助理、分管运营的总经理助理、基金运营部负责人、监察稽核部负责人。以上成员均具有丰富的行业分析、会计核算等证券投资基金行业从业经验及专业能力。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况,可向估值委员会报告并提出相关意见和建议,但不参与最终估值决策。参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突,一切以投资者利益最大化为最高准则。

报告期内,本基金依据签署的《中债收益率曲线和中债估值最终用户服务协议》从中央国债登记结算有限责任公司取得中债估值服务;本基金与中证指数有限公司根据《中证债券估值数据服务协议》而取得中证数据估值服务。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配,符合相关法规及基金合同的规定。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内本基金管理人无应说明的预警信息。

### § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在本报告期内（2017年01月01日至2017年12月31日），永赢量化灵活配置混合型发起式证券投资基金基金托管人-华泰证券股份有限公司按时进行了基金的投资交易清算，及时完成了基金名下的资金划拨，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，并严格遵守了基金合同和各项法律法规的相关规定，履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人依基金合同约定对基金管理人的投资运作行为进行了监督，对本基金资产净值计算、费用开支方面进行了复核，未发现基金管理人存在损害本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

本托管人复核了本基金2017年年度报告中的有关财务数据、净值表现、收益分配、投资组合报告等内容，相关内容真实、准确和完整。

## § 6 审计报告

本基金2017年年度财务会计报告经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师签字出具了无保留意见的审计报告。投资者可通过登载于本管理人网站的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：永赢量化灵活配置混合型发起式证券投资基金

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	5,067,180.55	5,241,162.13
结算备付金		1,940,887.61	1,150,832.88
存出保证金		81,202.88	456,607.87
交易性金融资产	7.4.7.2	54,831,334.87	55,212,057.79

其中：股票投资		54,831,334.87	55,212,057.79
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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	3,332.79	2,540.84
应收股利		-	-
应收申购款		-	30,053.59
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		61,923,938.70	62,093,255.10
<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		-	-
应付赎回款		4,034.37	1,405,451.26
应付管理人报酬		78,080.50	79,998.58
应付托管费		10,410.75	10,666.46
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	246,127.73	314,165.84
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	380,000.00	280,014.33
负债合计		718,653.35	2,090,296.47
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	56,492,789.33	59,038,073.20
未分配利润	7.4.7.1 0	4,712,496.02	964,885.43
所有者权益合计		61,205,285.35	60,002,958.63
负债和所有者权益总计		61,923,938.70	62,093,255.10

注：报告截止日2017年12月31日，基金份额净值1.083元，基金份额总额56,492,789.33份。

## 7.2 利润表

会计主体：永赢量化灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期：2017年01月01日至2017年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2017年01月01日至2017年12月31日	上年度可比期间2016年01月01日至2016年12月31日
<b>一、收入</b>		9,801,279.82	-4,383,991.26
1. 利息收入		103,279.72	283,430.18
其中：存款利息收入	7.4.7.1 1	103,279.72	240,563.98
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	42,866.20
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		8,752,587.59	-3,789,766.46
其中：股票投资收益	7.4.7.1 2	7,850,061.08	-4,804,623.87

基金投资收益	7.4.7.1 3	-	-12,126.75
债券投资收益	7.4.7.1 4	-	-
资产支持证券投资收 益	7.4.7.1 4.2	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.1 5	-	-
衍生工具收益	7.4.7.1 6	9,480.00	473,020.00
股利收益	7.4.7.1 7	893,046.51	553,964.16
3. 公允价值变动收益（损失 以“-”号填列）	7.4.7.1 8	938,820.10	-976,722.18
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号 填列）	7.4.7.1 9	6,592.41	99,067.20
<b>减：二、费用</b>		3,606,240.85	5,271,388.59
1. 管理人报酬	7.4.10. 2.1	915,112.04	1,339,726.70
2. 托管费	7.4.10. 2.2	122,014.98	178,630.24
3. 销售服务费	7.4.10. 2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.2 0	2,239,113.83	3,448,031.49
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支 出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.2 1	330,000.00	305,000.16



三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		6,195,038.97	-9,655,379.85
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		6,195,038.97	-9,655,379.85

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：永赢量化灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期：2017年01月01日至2017年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2017年01月01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)	59,038,073.20	964,885.43	60,002,958.63
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	6,195,038.97	6,195,038.97
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-2,545,283.87	-2,447,428.38	-4,992,712.25
其中：1. 基金申购款	30,404,392.94	-295,065.15	30,109,327.79
2. 基金赎回款	-32,949,676.81	-2,152,363.23	-35,102,040.04
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）	56,492,789.33	4,712,496.02	61,205,285.35
项 目	上年度可比期间 2016年01月01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)	123,213,745.72	8,371,341.21	131,585,086.93
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-9,655,379.85	-9,655,379.85
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)	-64,175,672.52	2,248,924.07	-61,926,748.45
其中：1. 基金申购款	11,367,556.07	-1,006,067.47	10,361,488.60
2. 基金赎回款	-75,543,228.59	3,254,991.54	-72,288,237.05
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)	59,038,073.20	964,885.43	60,002,958.63

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：

芦特尔

高利民

虞俏依

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

永赢量化灵活配置混合型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”），系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[2015]1700号文《关于准予永赢量化灵活配置混合型发起式证券投资基金注册的批复》的核准，由基金管理人永赢基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于2015年9月1日正式生效，首次设立募集规模为302,140,249.57份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人及注册登记机构为永赢基金管理有限公司，基金托管人为华泰证券股份有限公司。

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（国债、金融债、企业/公司债、次级债、可转换债券（含

分离交易可转债）、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、股指期货、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

本基金股票资产的投资比例占基金资产的0-95%；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，现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%。本基金参与股指期货交易后，应符合法律法规规定和基金合同约定的投资限制并遵守相关期货交易所的业务规则。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。

本基金的业绩比较基准为：95%\*沪深300指数收益率+5%\*银行活期存款利率（税后）。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则-基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《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〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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于2017年12月31日的财务状况以及2017年度的经营成果和净值变动情况。

#### 7.4.4 本报告期内所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 7.4.6 税项

##### 7.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年4月24日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的3‰调整为1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年9月19日起，调整由出让

方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

#### 7.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自2016年5月1日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140号文《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、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自2018年1月1日起，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（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自2018年1月1日起，资管产品管理人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，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让2017年12月31日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的股票收盘价（2017年最后一个交易日

处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

#### 7.4.6.3 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

#### 7.4.6.4 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自2008年10月9日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《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》的规定，自2013年1月1日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按25%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；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101号文《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》的规定，自2015年9月8日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

#### 7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
永赢基金管理有限公司（“永赢基金”）	基金管理人、基金发起人、基金注册登记机构、基金销售机构
华泰证券股份有限公司（“华泰证券”）	基金托管人、基金代销机构
宁波银行股份有限公司（“宁波银行”）	基金管理人的股东、基金代销机构
利安资金管理公司	基金管理人的股东
员工股东	基金管理人的股东
华泰期货有限公司	基金托管人的子公司
永赢资产管理有限公司（“永赢资产”）	基金管理人的子公司

注：1、以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

2、根据中国证券监督管理委员会2017年12月27日证监许可（2017）2415号《关于核准永赢基金管理有限公司变更股权的批复》，永赢基金管理有限公司原自然人股东将其所持18.51%转让给利安资金管理公司，并于2018年1月10日完成工商变更登记。

#### 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01月01日至2017年12月31日		上年度可比期间 2016年01月01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	352,796,018.64	17.30%	2,116,520,127.24	89.46%

###### 7.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

###### 7.4.8.1.3 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01月01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	324,463.61	31.40%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2016年01月01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	1,951,471.06	96.05%	233,824.10	74.43%

注：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证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。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。

#### 7.4.8.1.4 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

#### 7.4.8.1.5 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年01月01日至2017年12月31日		上年度可比期间 2016年01月01日至2016年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
华泰证券	-	-	665,200,000.00	100.00%

#### 7.4.8.2 关联方报酬

##### 7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年01月01日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年01月01日至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	915, 112. 04	1, 339, 726. 70
其中：支付销售机构的客户维护费	258, 639. 61	555, 406. 32

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的1.50%的年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times \text{基金管理费率} / \text{当年天数}$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。

#### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年01月01日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年01月01日至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	122, 014. 98	178, 630. 24

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的0.20%的年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times \text{基金托管费率} / \text{当年天数}$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。

#### 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

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

#### 7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2017年01月01日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年01月01日至2016年12月31日



	月31日	日至2016年12月31日
基金合同生效日（2015年09月01日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	10,004,850.00	10,004,850.00
报告期间申购/买入总份额	21,073,761.85	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	31,078,611.85	10,004,850.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	55.01%	16.95%

注：期间申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2017年12月31日		上年度末 2016年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
员工股东	69,997.82	0.12%	988.73	0.00%

#### 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

本基金本报告期末及上年度末均无由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入。

#### 7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

#### 7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期末存放于华泰期货的结算备付金金额为人民币474,953.29元。本基金本报告期通过华泰期货买卖股指期货成交额为人民币4,045,080.00元，当期发生的基金应支付给华泰期货的交易费用为人民币124.36元，本报告期末无应付华泰期货的交易费用余额。

本基金上年度末存放于华泰期货的结算备付金金额为人民币465,597.65元。本基金

上年度可比期间通过华泰期货买卖股指期货成交额为人民币238,839,740.00元，当期发生的基金应支付给华泰期货的交易费用为人民币7,422.35元，上年度末无应付华泰期货的交易费用余额。

#### 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
600309	万华化学	2017-12-05	重大事项停牌	37.94	-	-	29,300	1,073,453.47	1,111,642.00	-
600686	金龙汽车	2017-12-28	重大事项停牌	13.03	2018-01-10	13.03	19,600	244,124.67	255,388.00	-

##### 7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2017年12月31日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

###### 7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2017年12月31日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

#### 7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 7.4.10.1 公允价值

###### 7.4.10.1.1 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贷款和应收款项以及其他金融负债，

其因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

#### 7.4.10.1.2 以公允价值计量的金融工具

##### 7.4.10.1.2.1 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人民币53,464,304.87元，属于第二层次的余额为人民币1,367,030.00元，属于第三层次余额为人民币0.00元（于2016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人民币52,707,112.49元，属于第二层次的余额为人民币2,504,945.30元，属于第三层次余额为人民币0.00元）。

##### 7.4.10.1.2.2 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可转换债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别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不将相关股票和可转换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，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。

##### 7.4.10.1.2.3 第三层次公允价值余额和本期变动金额

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工具第三层次公允价值本期未发生变动。

#### 7.4.10.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

#### 7.4.10.3 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

#### 7.4.10.4 财务报表的批准

本财务报表已于2018年3月26日经本基金的基金管理人批准。

## § 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	54,831,334.87	88.55
	其中：股票	54,831,334.87	88.55
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	7,008,068.16	11.32
8	其他各项资产	84,535.67	0.14
9	合计	61,923,938.70	100.00

## 8.2 报告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

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	200,991.00	0.33
B	采矿业	2,630,556.00	4.30
C	制造业	33,962,408.40	55.49
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,179,739.00	3.56
E	建筑业	398,080.00	0.65
F	批发和零售业	4,920,224.47	8.04
G	交通运输、仓储和邮政业	2,725,820.00	4.45
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,034,858.00	3.32

J	金融业	688,080.00	1.12
K	房地产业	4,030,171.00	6.58
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	424,349.00	0.69
N	水利、环境和公共设施管理业	496,386.00	0.81
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	139,672.00	0.23
S	综合	-	-
	合计	54,831,334.87	89.59

### 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	600398	海澜之家	118,900	1,153,330.00	1.88
2	603288	海天味业	21,200	1,140,560.00	1.86
3	600566	济川药业	29,800	1,136,870.00	1.86
4	600309	万华化学	29,300	1,111,642.00	1.82
5	601238	广汽集团	44,700	1,102,302.00	1.80
6	600665	天地源	251,200	1,072,624.00	1.75
7	600688	上海石化	169,000	1,069,770.00	1.75
8	600377	宁沪高速	107,700	1,060,845.00	1.73

9	600297	广汇汽车	129,300	1,036,986.00	1.69
10	600618	氯碱化工	95,400	1,033,182.00	1.69

#### 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	600585	海螺水泥	13,638,526.89	22.73
2	601179	中国西电	13,151,220.42	21.92
3	600713	南京医药	12,975,097.11	21.62
4	600688	上海石化	11,781,725.23	19.64
5	600808	马钢股份	10,188,617.01	16.98
6	600600	青岛啤酒	9,890,610.50	16.48
7	600708	光明地产	9,151,107.67	15.25
8	600271	航天信息	8,805,139.72	14.67
9	600188	兖州煤业	8,674,424.08	14.46
10	603100	川仪股份	8,457,804.46	14.10
11	600875	东方电气	8,073,261.98	13.45
12	600466	蓝光发展	8,022,529.00	13.37
13	600823	世茂股份	8,006,041.40	13.34
14	600606	绿地控股	7,887,118.00	13.14
15	600297	广汇汽车	7,850,728.76	13.08
16	600398	海澜之家	7,650,916.71	12.75

17	600548	深高速	7,422,851.69	12.37
18	603288	海天味业	7,421,000.72	12.37
19	600998	九州通	7,259,106.25	12.10
20	603868	飞科电器	7,201,156.00	12.00
21	600894	广日股份	7,010,957.93	11.68
22	600261	阳光照明	6,853,589.80	11.42
23	600483	福能股份	6,743,411.84	11.24
24	603228	景旺电子	6,648,298.00	11.08
25	601218	吉鑫科技	6,575,634.82	10.96
26	600361	华联综超	6,538,903.93	10.90
27	600694	大商股份	6,410,169.44	10.68
28	600835	上海机电	6,252,889.60	10.42
29	600390	五矿资本	6,040,979.48	10.07
30	600096	云天化	6,019,020.00	10.03
31	601908	京运通	5,993,757.54	9.99
32	601607	上海医药	5,925,221.00	9.87
33	600019	宝钢股份	5,854,468.78	9.76
34	600299	安迪苏	5,833,131.99	9.72
35	600295	鄂尔多斯	5,807,387.01	9.68
36	600573	惠泉啤酒	5,793,513.22	9.66
37	603198	迎驾贡酒	5,684,686.06	9.47
38	601231	环旭电子	5,659,367.66	9.43
39	600362	江西铜业	5,321,774.00	8.87
40	600612	老凤祥	5,125,470.20	8.54
41	600537	亿晶光电	5,074,790.10	8.46
42	600309	万华化学	5,048,180.00	8.41
43	600757	长江传媒	4,976,038.33	8.29
44	601238	广汽集团	4,974,904.00	8.29
45	600697	欧亚集团	4,971,308.88	8.29
46	600642	申能股份	4,970,539.83	8.28
47	600418	江淮汽车	4,941,207.20	8.23

48	600691	阳煤化工	4,892,545.00	8.15
49	600618	氯碱化工	4,802,072.87	8.00
50	603018	中设集团	4,689,558.24	7.82
51	600213	亚星客车	4,659,007.78	7.76
52	000338	潍柴动力	4,619,359.48	7.70
53	600312	平高电气	4,595,809.00	7.66
54	603188	亚邦股份	4,560,897.88	7.60
55	603025	大豪科技	4,512,666.66	7.52
56	600327	大东方	4,506,908.84	7.51
57	601579	会稽山	4,381,081.27	7.30
58	600611	大众交通	4,380,803.05	7.30
59	600566	济川药业	4,361,854.00	7.27
60	600850	华东电脑	4,338,824.49	7.23
61	600582	天地科技	4,317,158.50	7.19
62	600569	安阳钢铁	4,230,052.00	7.05
63	600183	生益科技	4,195,484.70	6.99
64	600273	嘉化能源	4,193,409.50	6.99
65	600444	国机通用	4,172,852.34	6.95
66	600675	中华企业	4,133,120.48	6.89
67	600308	华泰股份	4,098,519.41	6.83
68	000625	长安汽车	4,085,629.12	6.81
69	600845	宝信软件	4,064,847.47	6.77
70	600513	联环药业	4,064,070.04	6.77
71	600282	南钢股份	4,043,094.00	6.74
72	600746	江苏索普	4,033,514.10	6.72
73	600377	宁沪高速	3,987,193.00	6.64
74	600216	浙江医药	3,956,970.59	6.59
75	600775	南京熊猫	3,909,034.00	6.51
76	603806	福斯特	3,884,260.43	6.47
77	600268	国电南自	3,836,260.00	6.39
78	600615	丰华股份	3,818,112.56	6.36



79	600350	山东高速	3,761,840.10	6.27
80	600623	华谊集团	3,755,115.00	6.26
81	600359	新农开发	3,676,384.22	6.13
82	600218	全柴动力	3,660,768.87	6.10
83	601339	百隆东方	3,635,421.34	6.06
84	600721	百花村	3,632,507.00	6.05
85	600839	四川长虹	3,585,301.88	5.98
86	600475	华光股份	3,567,942.35	5.95
87	600801	华新水泥	3,464,689.36	5.77
88	600419	天润乳业	3,441,314.35	5.74
89	601877	正泰电器	3,415,605.00	5.69
90	600723	首商股份	3,410,598.39	5.68
91	600664	哈药股份	3,376,430.00	5.63
92	600983	惠而浦	3,297,044.82	5.49
93	000422	湖北宜化	3,295,669.00	5.49
94	600422	昆药集团	3,284,894.84	5.47
95	600567	山鹰纸业	3,262,970.00	5.44
96	000869	张裕A	3,221,697.34	5.37
97	600602	云赛智联	3,140,134.26	5.23
98	600978	宜华生活	3,125,889.06	5.21
99	600805	悦达投资	3,109,296.74	5.18
100	600667	太极实业	3,069,482.00	5.12
101	603858	步长制药	3,067,252.00	5.11
102	600026	中远海能	3,047,404.00	5.08
103	600961	株冶集团	3,034,100.91	5.06
104	603828	柯利达	3,030,692.60	5.05
105	600651	飞乐音响	3,023,845.00	5.04
106	600665	天地源	3,015,437.00	5.03
107	600356	恒丰纸业	2,997,005.56	4.99
108	603556	海兴电力	2,992,043.00	4.99
109	600819	耀皮玻璃	2,951,348.47	4.92

110	603989	艾华集团	2,939,140.00	4.90
111	601313 (现代码: 601360)	江南嘉捷 (现名称: 三六零)	2,932,349.82	4.89
112	601636	旗滨集团	2,888,510.00	4.81
113	603677	奇精机械	2,872,024.00	4.79
114	002083	孚日股份	2,802,111.00	4.67
115	600409	三友化工	2,792,149.00	4.65
116	600561	江西长运	2,779,531.48	4.63
117	600827	百联股份	2,751,062.57	4.58
118	600889	南京化纤	2,739,470.00	4.57
119	600067	冠城大通	2,730,781.00	4.55
120	600580	卧龙电气	2,723,852.34	4.54
121	601919	中远海控	2,683,960.16	4.47
122	603015	弘讯科技	2,671,976.10	4.45
123	600060	海信电器	2,669,291.90	4.45
124	300305	裕兴股份	2,660,617.67	4.43
125	600339	中油工程	2,646,878.99	4.41
126	600073	上海梅林	2,630,730.12	4.38
127	601677	明泰铝业	2,584,150.00	4.31
128	600408	安泰集团	2,580,729.00	4.30
129	000902	新洋丰	2,571,385.52	4.29
130	600804	鹏博士	2,542,023.44	4.24
131	603421	鼎信通讯	2,514,856.00	4.19
132	600210	紫江企业	2,506,108.00	4.18
133	000031	中粮地产	2,502,621.00	4.17
134	002666	德联集团	2,466,683.92	4.11
135	600704	物产中大	2,464,606.05	4.11
136	603979	金诚信	2,452,551.00	4.09
137	000039	中集集团	2,448,704.00	4.08
138	600681	百川能源	2,423,628.81	4.04
139	000666	经纬纺机	2,411,799.00	4.02

140	600810	神马股份	2,408,734.64	4.01
141	300171	东富龙	2,362,477.00	3.94
142	601225	陕西煤业	2,356,641.82	3.93
143	601233	桐昆股份	2,354,676.80	3.92
144	000521	美菱电器	2,277,288.21	3.80
145	600973	宝胜股份	2,262,291.46	3.77
146	600166	福田汽车	2,210,459.00	3.68
147	603600	永艺股份	2,200,897.50	3.67
148	002309	中利集团	2,197,668.48	3.66
149	600376	首开股份	2,196,218.96	3.66
150	300214	日科化学	2,191,202.00	3.65
151	000404	华意压缩	2,179,432.26	3.63
152	000729	燕京啤酒	2,177,742.00	3.63
153	600129	太极集团	2,175,967.70	3.63
154	601038	一拖股份	2,129,730.00	3.55
155	002420	毅昌股份	2,126,885.00	3.54
156	600420	现代制药	2,119,970.00	3.53
157	600320	振华重工	2,106,942.00	3.51
158	600597	光明乳业	2,092,757.00	3.49
159	600563	法拉电子	2,092,208.96	3.49
160	600587	新华医疗	2,088,063.00	3.48
161	601567	三星医疗	2,080,590.00	3.47
162	601628	中国人寿	2,063,503.00	3.44
163	600269	赣粤高速	2,046,409.80	3.41
164	600761	安徽合力	2,015,040.66	3.36
165	000488	晨鸣纸业	2,013,613.00	3.36
166	600782	新钢股份	1,978,127.00	3.30
167	601137	博威合金	1,961,270.00	3.27
168	002004	华邦健康	1,941,686.70	3.24
169	300146	汤臣倍健	1,929,655.00	3.22
170	000708	大冶特钢	1,927,284.75	3.21

171	601616	广电电气	1,924,161.00	3.21
172	603167	渤海轮渡	1,922,788.00	3.20
173	002394	联发股份	1,910,639.00	3.18
174	002540	亚太科技	1,903,614.80	3.17
175	002398	建研集团	1,895,554.28	3.16
176	002009	天奇股份	1,892,086.13	3.15
177	600676	交运股份	1,877,888.68	3.13
178	600335	国机汽车	1,877,888.20	3.13
179	000701	厦门信达	1,873,623.53	3.12
180	000550	江铃汽车	1,872,737.00	3.12
181	603020	爱普股份	1,857,976.03	3.10
182	601258	庞大集团	1,835,965.00	3.06
183	601899	紫金矿业	1,832,370.00	3.05
184	600586	金晶科技	1,832,228.00	3.05
185	603369	今世缘	1,827,390.84	3.05
186	002458	益生股份	1,817,479.00	3.03
187	600333	长春燃气	1,773,775.17	2.96
188	600707	彩虹股份	1,770,175.86	2.95
189	603328	依顿电子	1,730,498.46	2.88
190	601211	国泰君安	1,684,734.00	2.81
191	600082	海泰发展	1,683,766.69	2.81
192	600090	同济堂	1,681,731.00	2.80
193	600601	方正科技	1,673,460.42	2.79
194	603599	广信股份	1,670,183.00	2.78
195	600151	航天机电	1,657,710.00	2.76
196	600517	置信电气	1,647,974.00	2.75
197	603899	晨光文具	1,643,274.54	2.74
198	000570	苏常柴A	1,635,650.00	2.73
199	000543	皖能电力	1,613,652.00	2.69
200	600238	海南椰岛	1,607,136.00	2.68
201	601208	东材科技	1,594,041.50	2.66

202	603658	安图生物	1,580,913.47	2.63
203	603160	汇顶科技	1,578,779.00	2.63
204	600506	香梨股份	1,575,758.00	2.63
205	600519	贵州茅台	1,567,259.00	2.61
206	600751	天海投资	1,558,717.00	2.60
207	601727	上海电气	1,550,561.00	2.58
208	601898	中煤能源	1,528,648.00	2.55
209	603031	安德利	1,524,143.00	2.54
210	603993	洛阳钼业	1,518,362.00	2.53
211	000055	方大集团	1,514,914.00	2.52
212	002026	山东威达	1,512,802.05	2.52
213	000665	湖北广电	1,502,462.40	2.50
214	002104	恒宝股份	1,492,175.00	2.49
215	000429	粤高速 A	1,486,662.40	2.48
216	603738	泰晶科技	1,477,332.70	2.46
217	000876	新希望	1,475,572.00	2.46
218	600768	宁波富邦	1,469,430.00	2.45
219	002541	鸿路钢构	1,458,594.02	2.43
220	002152	广电运通	1,447,222.00	2.41
221	601010	文峰股份	1,446,614.00	2.41
222	600755	厦门国贸	1,444,126.00	2.41
223	000023	深天地 A	1,437,874.00	2.40
224	600796	钱江生化	1,436,668.00	2.39
225	600997	开滦股份	1,430,583.86	2.38
226	600237	铜峰电子	1,426,178.00	2.38
227	000726	鲁泰 A	1,419,950.00	2.37
228	600438	通威股份	1,405,575.60	2.34
229	600089	特变电工	1,405,461.39	2.34
230	000036	华联控股	1,403,706.03	2.34
231	600470	六国化工	1,398,841.00	2.33
232	000908	景峰医药	1,382,858.82	2.30

233	300195	长荣股份	1,371,236.00	2.29
234	601318	中国平安	1,361,731.00	2.27
235	300154	瑞凌股份	1,361,676.77	2.27
236	600306	商业城	1,356,565.66	2.26
237	000957	中通客车	1,348,104.00	2.25
238	601186	中国铁建	1,326,925.99	2.21
239	600742	一汽富维	1,324,551.00	2.21
240	600068	葛洲坝	1,310,728.52	2.18
241	600516	方大炭素	1,308,303.59	2.18
242	300157	恒泰艾普	1,303,207.00	2.17
243	002416	爱施德	1,299,098.50	2.17
244	000835	长城动漫	1,295,299.14	2.16
245	601800	中国交建	1,290,073.00	2.15
246	600057	象屿股份	1,283,247.00	2.14
247	002005	德豪润达	1,266,518.00	2.11
248	600340	华夏幸福	1,265,706.00	2.11
249	600741	华域汽车	1,262,342.42	2.10
250	600776	东方通信	1,260,244.00	2.10
251	000919	金陵药业	1,250,286.00	2.08
252	601222	林洋能源	1,242,392.00	2.07
253	600487	亨通光电	1,233,992.00	2.06
254	600686	金龙汽车	1,225,044.00	2.04
255	002234	民和股份	1,220,636.00	2.03
256	000761	本钢板材	1,216,440.83	2.03
257	002727	一心堂	1,215,484.00	2.03
258	600132	重庆啤酒	1,214,706.00	2.02
259	600527	江南高纤	1,202,228.00	2.00

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

#### 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	600585	海螺水泥	14,056,742.03	23.43
2	600713	南京医药	13,245,396.28	22.07
3	601179	中国西电	12,365,601.17	20.61
4	600688	上海石化	10,857,134.54	18.09
5	600600	青岛啤酒	10,528,508.79	17.55
6	600808	马钢股份	9,259,916.90	15.43
7	600708	光明地产	8,844,040.95	14.74
8	600271	航天信息	8,799,369.60	14.66
9	600875	东方电气	8,343,224.98	13.90
10	600823	世茂股份	8,296,751.78	13.83
11	600466	蓝光发展	8,148,229.58	13.58
12	600188	兖州煤业	7,977,565.97	13.30
13	603100	川仪股份	7,958,567.64	13.26
14	600295	鄂尔多斯	7,717,935.98	12.86
15	600297	广汇汽车	7,410,034.30	12.35
16	600894	广日股份	7,403,473.89	12.34
17	600548	深高速	7,211,686.16	12.02
18	600835	上海机电	7,186,497.37	11.98
19	600694	大商股份	7,173,399.28	11.96
20	600606	绿地控股	7,171,188.00	11.95
21	600261	阳光照明	7,089,635.17	11.82
22	600998	九州通	6,999,233.74	11.66
23	600483	福能股份	6,973,970.16	11.62

24	601607	上海医药	6,653,754.76	11.09
25	603868	飞科电器	6,614,315.26	11.02
26	600361	华联综超	6,583,167.96	10.97
27	601218	吉鑫科技	6,555,075.22	10.92
28	600398	海澜之家	6,442,910.00	10.74
29	603288	海天味业	6,440,306.00	10.73
30	601908	京运通	6,272,500.20	10.45
31	603228	景旺电子	6,033,900.00	10.06
32	600096	云天化	6,010,884.84	10.02
33	600390	五矿资本	5,852,227.60	9.75
34	603198	迎驾贡酒	5,751,525.02	9.59
35	600299	安迪苏	5,745,614.90	9.58
36	601231	环旭电子	5,742,482.00	9.57
37	600019	宝钢股份	5,702,028.40	9.50
38	600362	江西铜业	5,486,742.00	9.14
39	600697	欧亚集团	5,421,052.22	9.03
40	600537	亿晶光电	5,331,137.00	8.88
41	603188	亚邦股份	5,290,415.89	8.82
42	600418	江淮汽车	5,289,257.89	8.81
43	000338	潍柴动力	5,226,734.20	8.71
44	600573	惠泉啤酒	5,221,221.65	8.70
45	600691	阳煤化工	5,177,396.03	8.63
46	600757	长江传媒	5,124,816.80	8.54
47	600327	大东方	5,031,534.86	8.39
48	600642	申能股份	5,030,243.31	8.38
49	600612	老凤祥	5,020,337.85	8.37
50	603018	中设集团	4,716,505.51	7.86
51	600213	亚星客车	4,644,945.44	7.74
52	600569	安阳钢铁	4,629,589.00	7.72
53	600850	华东电脑	4,587,951.60	7.65
54	600273	嘉化能源	4,555,529.36	7.59



55	600308	华泰股份	4,488,363.72	7.48
56	600312	平高电气	4,441,862.00	7.40
57	600183	生益科技	4,399,946.42	7.33
58	601579	会稽山	4,370,202.45	7.28
59	600444	国机通用	4,356,948.38	7.26
60	600746	江苏索普	4,349,445.89	7.25
61	600582	天地科技	4,330,541.00	7.22
62	600611	大众交通	4,232,917.50	7.05
63	600309	万华化学	4,208,683.00	7.01
64	600845	宝信软件	4,196,284.48	6.99
65	600801	华新水泥	4,102,111.20	6.84
66	600216	浙江医药	4,082,200.85	6.80
67	600675	中华企业	4,053,954.80	6.76
68	600218	全柴动力	4,027,903.60	6.71
69	600723	首商股份	4,025,829.26	6.71
70	603025	大豪科技	3,969,946.00	6.62
71	601339	百隆东方	3,955,788.06	6.59
72	000625	长安汽车	3,911,970.98	6.52
73	600268	国电南自	3,862,564.68	6.44
74	600623	华谊集团	3,843,498.00	6.41
75	601238	广汽集团	3,823,941.00	6.37
76	603806	福斯特	3,817,609.86	6.36
77	600350	山东高速	3,796,947.80	6.33
78	600359	新农开发	3,778,959.00	6.30
79	600618	氯碱化工	3,768,782.51	6.28
80	600026	中远海能	3,737,001.84	6.23
81	601877	正泰电器	3,688,568.84	6.15
82	600615	丰华股份	3,660,770.00	6.10
83	600805	悦达投资	3,656,486.85	6.09
84	600721	百花村	3,627,202.05	6.05
85	600839	四川长虹	3,624,213.00	6.04

86	600475	华光股份	3,618,690.08	6.03
87	600513	联环药业	3,584,896.20	5.97
88	600664	哈药股份	3,471,268.26	5.79
89	601313 (现代码: 601360)	江南嘉捷 (现名称: 三六零)	3,460,057.94	5.77
90	600775	南京熊猫	3,447,672.00	5.75
91	600419	天润乳业	3,400,580.09	5.67
92	600282	南钢股份	3,307,226.58	5.51
93	600602	云赛智联	3,295,872.59	5.49
94	600422	昆药集团	3,281,523.70	5.47
95	600067	冠城大通	3,277,264.00	5.46
96	000869	张裕A	3,261,305.47	5.44
97	600983	惠而浦	3,249,712.97	5.42
98	601677	明泰铝业	3,236,667.00	5.39
99	600651	飞乐音响	3,215,901.00	5.36
100	600667	太极实业	3,209,547.00	5.35
101	601636	旗滨集团	3,203,807.37	5.34
102	600566	济川药业	3,121,026.28	5.20
103	002083	孚日股份	3,111,915.68	5.19
104	600356	恒丰纸业	3,104,338.14	5.17
105	000422	湖北宜化	3,091,809.00	5.15
106	600978	宜华生活	3,068,772.29	5.11
107	600567	山鹰纸业	3,061,772.00	5.10
108	603828	柯利达	3,035,041.50	5.06
109	600210	紫江企业	3,024,946.00	5.04
110	603989	艾华集团	2,999,789.00	5.00
111	000666	经纬纺机	2,984,517.53	4.97
112	600961	株冶集团	2,960,524.00	4.93
113	600377	宁沪高速	2,930,894.00	4.88
114	600060	海信电器	2,914,896.16	4.86
115	000521	美菱电器	2,876,119.52	4.79

116	603677	奇精机械	2,782,292.56	4.64
117	600580	卧龙电气	2,779,388.38	4.63
118	600889	南京化纤	2,730,610.02	4.55
119	000404	华意压缩	2,723,540.84	4.54
120	600804	鹏博士	2,718,010.00	4.53
121	600129	太极集团	2,708,896.00	4.51
122	600073	上海梅林	2,695,731.36	4.49
123	603858	步长制药	2,692,150.00	4.49
124	002666	德联集团	2,690,141.47	4.48
125	002309	中利集团	2,677,518.56	4.46
126	600561	江西长运	2,641,102.66	4.40
127	300171	东富龙	2,640,842.07	4.40
128	300305	裕兴股份	2,622,764.06	4.37
129	000031	中粮地产	2,568,793.00	4.28
130	600335	国机汽车	2,553,633.01	4.26
131	603979	金诚信	2,545,772.50	4.24
132	000902	新洋丰	2,545,546.00	4.24
133	600761	安徽合力	2,521,836.45	4.20
134	600973	宝胜股份	2,511,226.92	4.19
135	600810	神马股份	2,492,207.00	4.15
136	600819	耀皮玻璃	2,467,499.00	4.11
137	600408	安泰集团	2,454,884.98	4.09
138	000039	中集集团	2,454,529.00	4.09
139	601233	桐昆股份	2,406,331.12	4.01
140	601919	中远海控	2,402,555.00	4.00
141	600827	百联股份	2,361,813.00	3.94
142	300214	日科化学	2,353,748.74	3.92
143	603167	渤海轮渡	2,348,441.00	3.91
144	000550	江铃汽车	2,283,977.00	3.81
145	600704	物产中大	2,229,341.90	3.72
146	600166	福田汽车	2,219,641.00	3.70

147	603015	弘讯科技	2,205,622.00	3.68
148	000708	大冶特钢	2,201,190.18	3.67
149	600587	新华医疗	2,194,282.00	3.66
150	603556	海兴电力	2,183,919.00	3.64
151	603020	爱普股份	2,183,179.00	3.64
152	002394	联发股份	2,182,973.11	3.64
153	000729	燕京啤酒	2,178,234.00	3.63
154	601038	一拖股份	2,171,424.25	3.62
155	600320	振华重工	2,153,836.00	3.59
156	300146	汤臣倍健	2,150,747.04	3.58
157	603600	永艺股份	2,137,857.18	3.56
158	002009	天奇股份	2,133,126.00	3.56
159	002420	毅昌股份	2,103,075.00	3.50
160	600563	法拉电子	2,086,589.00	3.48
161	600269	赣粤高速	2,078,174.64	3.46
162	002458	益生股份	2,074,793.60	3.46
163	600597	光明乳业	2,074,634.29	3.46
164	601567	三星医疗	2,053,970.00	3.42
165	603599	广信股份	2,032,635.12	3.39
166	000726	鲁泰A	2,024,094.80	3.37
167	601137	博威合金	2,010,566.16	3.35
168	600782	新钢股份	1,983,071.00	3.30
169	000488	晨鸣纸业	1,978,184.00	3.30
170	600741	华域汽车	1,957,577.65	3.26
171	002104	恒宝股份	1,955,993.05	3.26
172	002398	建研集团	1,951,627.00	3.25
173	601616	广电电气	1,946,082.00	3.24
174	002004	华邦健康	1,944,925.47	3.24
175	600665	天地源	1,941,521.56	3.24
176	002540	亚太科技	1,928,052.20	3.21
177	600420	现代制药	1,913,217.80	3.19

178	603369	今世缘	1,909,990.86	3.18
179	600376	首开股份	1,907,150.25	3.18
180	600409	三友化工	1,894,989.25	3.16
181	601258	庞大集团	1,892,365.00	3.15
182	601628	中国人寿	1,875,965.00	3.13
183	600676	交运股份	1,865,393.00	3.11
184	601208	东材科技	1,864,972.99	3.11
185	600755	厦门国贸	1,859,464.00	3.10
186	000701	厦门信达	1,858,483.92	3.10
187	601899	紫金矿业	1,833,235.00	3.06
188	000665	湖北广电	1,801,802.60	3.00
189	600586	金晶科技	1,791,580.00	2.99
190	600333	长春燃气	1,776,570.00	2.96
191	600339	中油工程	1,759,862.07	2.93
192	000908	景峰医药	1,741,709.68	2.90
193	600997	开滦股份	1,731,574.46	2.89
194	600681	百川能源	1,705,314.20	2.84
195	000036	华联控股	1,696,645.37	2.83
196	603993	洛阳钼业	1,691,192.00	2.82
197	002026	山东威达	1,683,183.68	2.81
198	601211	国泰君安	1,681,862.00	2.80
199	600601	方正科技	1,680,276.00	2.80
200	600707	彩虹股份	1,680,219.00	2.80
201	600151	航天机电	1,671,320.91	2.79
202	600090	同济堂	1,669,699.00	2.78
203	600082	海泰发展	1,653,689.65	2.76
204	600238	海南椰岛	1,634,516.00	2.72
205	603899	晨光文具	1,616,103.06	2.69
206	600519	贵州茅台	1,610,263.00	2.68
207	601225	陕西煤业	1,599,536.00	2.67
208	000570	苏常柴A	1,598,099.30	2.66

209	603658	安图生物	1,590,885.53	2.65
210	000543	皖能电力	1,590,233.00	2.65
211	603160	汇顶科技	1,585,666.00	2.64
212	000429	粤高速 A	1,572,306.62	2.62
213	600517	置信电气	1,559,446.00	2.60
214	000600	建投能源	1,553,817.00	2.59
215	603328	依顿电子	1,549,813.65	2.58
216	600751	天海投资	1,536,382.00	2.56
217	002641	永高股份	1,534,479.66	2.56
218	600506	香梨股份	1,505,794.38	2.51
219	000876	新希望	1,488,701.47	2.48
220	601898	中煤能源	1,485,043.00	2.47
221	002541	鸿路钢构	1,480,412.09	2.47
222	000650	仁和药业	1,477,932.00	2.46
223	601010	文峰股份	1,472,472.00	2.45
224	002727	一心堂	1,460,734.00	2.43
225	002152	广电运通	1,456,534.80	2.43
226	600796	钱江生化	1,449,852.00	2.42
227	000957	中通客车	1,428,708.00	2.38
228	300195	长荣股份	1,419,018.00	2.36
229	600438	通威股份	1,403,008.22	2.34
230	600487	亨通光电	1,390,266.00	2.32
231	600089	特变电工	1,389,726.00	2.32
232	601318	中国平安	1,379,489.00	2.30
233	002234	民和股份	1,366,713.12	2.28
234	603421	鼎信通讯	1,355,542.00	2.26
235	000023	深天地 A	1,338,954.00	2.23
236	601186	中国铁建	1,325,425.00	2.21
237	000055	方大集团	1,322,338.96	2.20
238	600068	葛洲坝	1,321,034.00	2.20
239	300154	瑞凌股份	1,320,288.74	2.20

240	300157	恒泰艾普	1,309,925.74	2.18
241	000835	长城动漫	1,303,103.76	2.17
242	601222	林洋能源	1,298,955.50	2.16
243	600237	铜峰电子	1,291,145.00	2.15
244	600776	东方通信	1,286,229.13	2.14
245	002005	德豪润达	1,273,447.00	2.12
246	002416	爱施德	1,271,174.74	2.12
247	601727	上海电气	1,265,845.00	2.11
248	600340	华夏幸福	1,260,521.00	2.10
249	600966	博汇纸业	1,260,180.00	2.10
250	600742	一汽富维	1,258,968.00	2.10
251	000921	海信科龙	1,251,259.00	2.09
252	600132	重庆啤酒	1,241,805.00	2.07
253	000919	金陵药业	1,237,221.00	2.06
254	600683	京投发展	1,227,207.00	2.05
255	600100	同方股份	1,226,329.00	2.04
256	002006	精功科技	1,220,507.00	2.03
257	000100	TCL 集团	1,211,902.00	2.02

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

#### 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	1,015,533,046.92
卖出股票收入（成交）总额	1,024,702,651.02

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

#### 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所有资产支持证券投资明细**

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

**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**

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动	风险说明
-	-	-	-	-	-
公允价值变动总额合计（元）					-
股指期货投资本期收益（元）					-
股指期货投资本期公允价值变动（元）					-

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

**8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策**

本基金采用灵活配置策略，可利用股指期货调节系统性风险。

在报告期内，本基金管理人密切关注市场动态，针对当前股指期货基差贴水状态进行现货替代操作，优化资金利用效率，合理管理产品系统性风险，符合既定的投资政策和投资目标。

**8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

本基金本报告期内未投资国债期货。

**8.12 投资组合报告附注**



8.12.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责、处罚。

8.12.2 基金投资的前十名股票中，不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

### 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	81,202.88
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,332.79
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	84,535.67

### 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

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	600309	万华化学	1,111,642.00	1.82	重大资产重组

## §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
627	90,100.14	31,078,611.85	55.01%	25,414,177.48	44.99%

## 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	107,413.34	0.19%

## 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	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## 9.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份 额总数	持有份 额占基 金总份 额比例（ %）	发起份 额总数	发起份 额占基 金总份 额比例（ %）	发起份额承 诺持有期限
基金管理人固有资金	-	-	-	-	-
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

第 50 页，共 53 页

基金合同生效日(2015年09月01日)基金份额总额	302,140,249.57
本报告期期初基金份额总额	59,038,073.20
本报告期基金总申购份额	30,404,392.94
减:本报告期基金总赎回份额	32,949,676.81
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	56,492,789.33

## § 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

经永赢基金管理有限公司第二届董事会2017年书面决议审议通过,赵楠先生、田中甲先生不再担任永赢基金副总经理职务。本基金管理人已于2017年7月1日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报以及公司网站登载了《永赢基金管理有限公司高级管理人员变更公告》。上述变更事项已按有关规定向中国证券监督管理委员会和上海证监局报备。

本报告期内,本基金托管人的托管部门没有发生重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及本基金管理人、基金财产及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,本基金管理人的基金投资策略严格遵循本基金《基金合同》及《招募说明书》中披露的基本投资策略,未发生显著的改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自合同生效日起聘请安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金提供审计服务。报告期内本基金未改聘会计师事务所。报告期内应支付给聘任会计师事务所的报酬为50,000.00元。

### 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

本报告期内未发生基金管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚的情况。

## 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	
信达证券	2	661,830,355.02	32.45%	216,496.36	20.95%	-
华泰证券	2	352,796,018.64	17.30%	324,463.61	31.40%	-
申万宏源证券	2	382,163,084.70	18.74%	279,476.50	27.05%	新增
海通证券	2	384,545,320.50	18.85%	127,399.56	12.33%	新增
华福证券	2	258,161,646.31	12.66%	85,527.81	8.28%	新增

注：根据中国证监会的有关规定，我司在综合考量证券经营机构的财务状况、经营状况、研究能力的基础上，选择基金专用交易席位，并由本基金管理人董事会授权管理层批准。

### 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		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
信达证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-	-	-

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

## 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2017年11月1日 - 2017年12月31日	10,004,850.00	21,073,761.85	0.00	31,078,611.85	55.01%
产品特有风险							
本基金在本报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金总份额20%的情况，存在可能因投资者的大额申购或赎回造成基金份额波动的风险。							

永赢基金管理有限公司  
二〇一八年三月三十日