

新华泛资源优势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：新华基金管理股份有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一八年三月三十日

§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。

基金托管人中国工商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。

本报告中财务资料已经审计。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	14
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
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	15
§6 审计报告	15
6.1 审计意见	15
6.2 形成审计意见的基础	16
6.3 其他信息	16
6.4 管理层对财务报表的责任	16
6.5 注册会计师的责任	16
§7 年度财务报表	17
7.1 资产负债表	17
7.2 利润表	19
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	20
7.4 报表附注	22
§8 投资组合报告	45
8.1 期末基金资产组合情况	45
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	46
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	47
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	49

8.5	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	63
8.6	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	63
8.8	投资组合报告附注	63
§9	基金份额持有人信息	64
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	64
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	64
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	64
§10	开放式基金份额变动	65
§11	重大事件揭示	65
11.1	基金份额持有人大会决议	65
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	65
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	65
11.4	基金投资策略的改变	65
11.5	本报告期持有的基金发生的重大影响事件	65
11.6	为基金进行审计的会计师事务所情况	65
11.7	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	66
11.8	基金租用证券公司交易单元的有关情况	66
11.9	其他重大事件	68
12	影响投资者决策的其他重要信息	71
§13	备查文件目录	72
13.1	备查文件目录	72
13.2	存放地点	72
13.3	查阅方式	72

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	新华泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	新华泛资源优势混合
基金主代码	519091
交易代码	519091
基金运作方式	契约型开放式基金
基金合同生效日	2009 年 7 月 13 日
基金管理人	新华基金管理股份有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	188,714,948.35 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在有效控制风险的前提下,通过重点精选与集中配置具有社会资源和自然资源(泛资源)优势的股票,实现基金净值增长,以求持续地超越业绩比较基准。
投资策略	本基金采用“自下而上”结合“自上而下”的投资策略,通过股票选择、行业配置,结合自上而下的战术性大类资产配置策略,进行积极投资管理。
业绩比较基准	60%×沪深 300 指数 + 40%×上证国债指数
风险收益特征	本基金为混合型基金,属于证券投资基金中的中高等风险品种,预期风险和收益高于债券型、货币型基金,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		新华基金管理股份有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	齐岩	郭明
	联系电话	010-68779688	010-66105799
	电子邮箱	qiyan@ncfund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4008198866	95588

传真	010-68779528	010-66105798
注册地址	重庆市江北区聚贤岩广场6号 力帆中心2号楼19层	北京市西城区复兴门内大街55 号
办公地址	重庆市江北区聚贤岩广场6号 力帆中心2号楼19层	北京市西城区复兴门内大街55 号
邮政编码	400010	100140
法定代表人	陈重	易会满

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	www.ncfund.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公地

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	瑞华会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区永定门西滨河路 8 号院 7 号楼中海地产广场西塔 5-11 层
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2017 年	2016 年	2015 年
本期已实现收益	116,896,883.89	16,509,476.46	248,783,309.01
本期利润	117,076,665.42	-1,334,425.34	237,506,306.62
加权平均基金份额本期利润	0.3619	-0.0122	1.1650
本期加权平均净值利润率	14.28%	-0.64%	65.61%
本期基金份额净值增长率	20.41%	6.67%	51.25%

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	323,381,365.56	122,120,072.17	147,780,799.63
期末可供分配基金份额利润	1.7136	1.2543	1.1126
期末基金资产净值	512,096,313.91	219,479,937.78	280,610,402.14
期末基金份额净值	2.714	2.254	2.113
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	171.40%	125.40%	111.31%

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、以上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（例如基金申购费赎回费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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（为期末余额，不是当期发生数）。

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

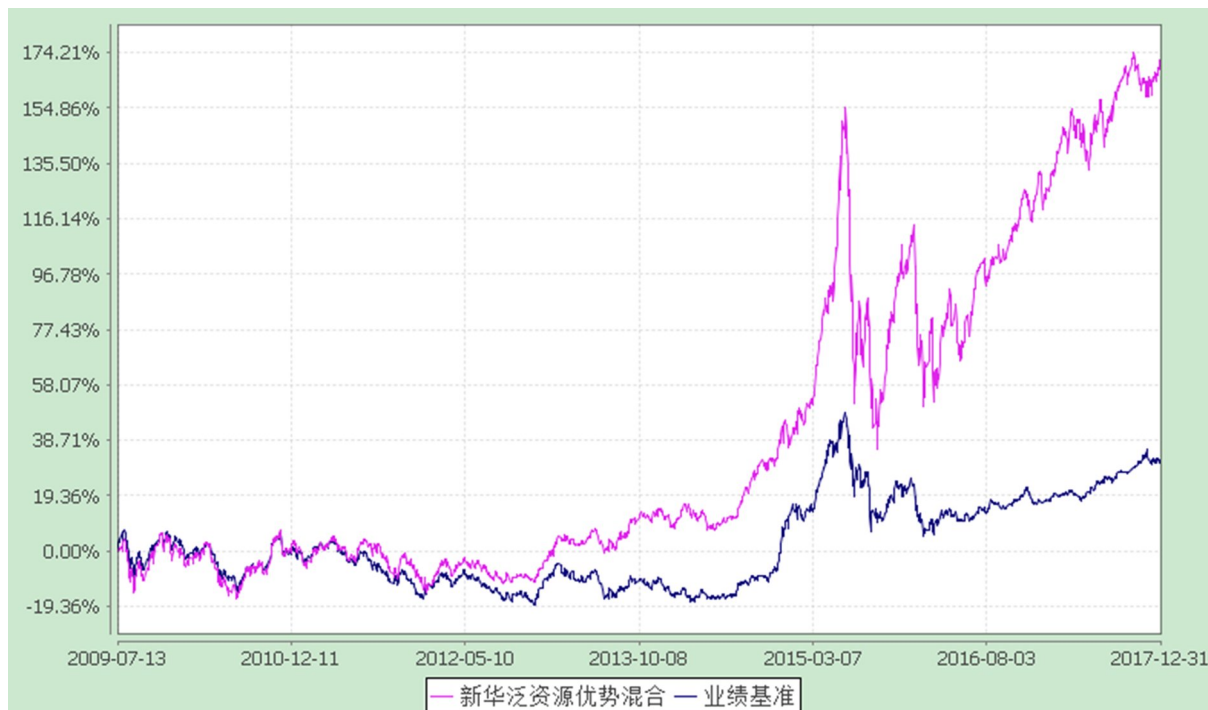
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	1.53%	0.80%	3.10%	0.48%	-1.57%	0.32%
过去六个月	8.17%	0.81%	6.04%	0.42%	2.13%	0.39%
过去一年	20.41%	0.87%	12.98%	0.38%	7.43%	0.49%
过去三年	94.27%	1.81%	15.49%	1.01%	78.78%	0.80%
过去五年	180.66%	1.49%	46.85%	0.93%	133.81%	0.56%
自基金合同生效起至今	171.40%	1.36%	31.62%	0.92%	139.78%	0.44%

注：1、本基金股票投资部分的业绩比较基准采用沪深 300 指数，债券投资部分的业绩比较基准采用上证国债指数，复合业绩比较基准为：60%*沪深 300 指数+40%*上证国债指数。

2、本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

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

自基金合同生效以来份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2009 年 7 月 13 日至 2017 年 12 月 31 日)

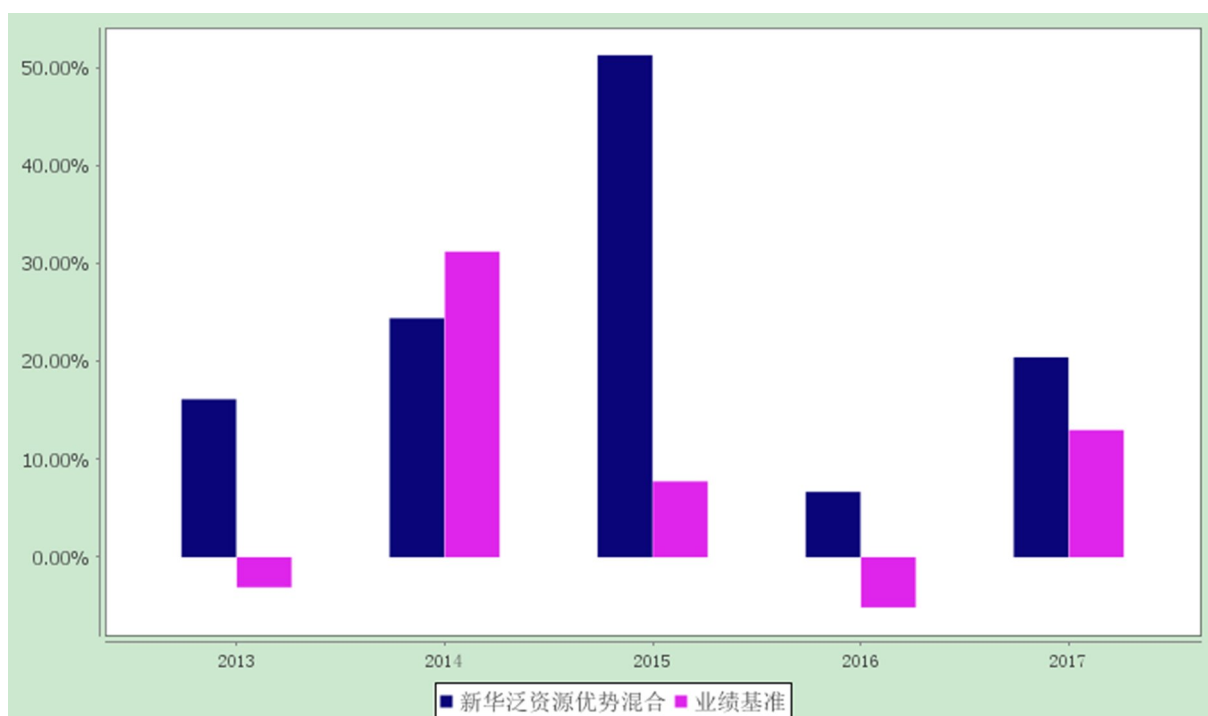


注：本基金于 2009 年 7 月 13 日基金合同生效。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

新华泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金

过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行过利润分配。

§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

新华基金管理股份有限公司经中国证券监督管理委员会批复，于 2004 年 12 月 9 日注册成立。注册地为重庆市，是我国西部首家基金管理公司。

截至 2017 年 12 月 31 日，新华基金管理股份有限公司旗下管理着四十五只开放式基金，即新华优选分红混合型证券投资基金、新华优选成长混合型证券投资基金、新华泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金、新华钻石品质企业混合型证券投资基金、新华行业周期轮换混合型证券投资基金、新华中小市值优选混合型证券投资基金、新华灵活主题混合型证券投资基金、新华优选消费混合型证券投资基金、新华纯债添利债券型发起式证券投资基金、新华行业轮换灵活配置混合型证券投资基金、新华趋势领航混合型证券投资基金、新华安享惠金定期开放债券型证券投资基金、新华壹诺宝货币市场基金、新华增怡债券型证券投资基金、新华惠鑫债券型证券投资基金（LOF）、新华鑫益灵活配置混合型证券投资基金、新华鑫利灵活配置混合型证券投资基金、新华鑫安保本一号混合型证券投资基金、新华中证环保产业指数分级证券投资基金、新华活期添利货币市场基金、新华增盈回报债券型证券投资基金、新华策略精选股票型证券投资基金、新华万银多元策略灵活配置混合型证券投资基金、新华稳健回报灵活配置混合型发起式证券投资基金、新华战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金、新华鑫回报混合型证券投资基金、新华积极价值灵活配置混合型证券投资基金、新华科技创新主题灵活配置混合型证券投资基金、新华增强债券型证券投资基金、新华鑫动力灵活配置混合型证券投资基金、新华丰盈回报债券型证券投资基金、新华健康生活主题灵活配置混合型证券投资基金、新华双利债券型证券投资基金、新华恒稳添利债券型证券投资基金、新华丰利债券型证券投资基金、新华鑫锐混合型证券投资基金、新华鑫弘灵活配置混合型证券投资基金、新华华瑞灵活配置混合型证券投资基金、新华外延增长主题灵活配置混合型证券投资基金、新华红利回报混合型证券投资基金、新华高端制造灵活配置混合型证券投资基金、新华华荣灵活配置混合型证券投资基金、新华鑫泰灵活配置混合型证券投资基金、新华恒益量化灵活配置混合型证券投资基金和新华华丰灵活配置混合型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理) 期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
栾江伟	本基金基金经理, 新华行业轮换灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华健康生活主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华策略精选股票型证券投资基金基金经理。	2015-08-03	-	8	硕士研究生, 历任新华基金管理股份有限公司研究部行业分析师、基金经理助理。

注: 1、此处的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日为准。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期, 新华基金管理股份有限公司作为新华泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金的管理人按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《新华泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金基金合同》以及其它有关法律法规的规定, 本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产, 在严格控制风险的基础上为持有人谋求最大利益。运作整体合法合规, 无损害基金持有人利益的行为。

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

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》(2011 年修订), 公司制定了《新华基金管理股份有限公司公平交易管理制度》。制度的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等所有投资管理活动, 同时包括授权、研究分析、投资决策、交易执行等投资管理活动相关的各个环节。

场内交易, 投资指令统一由交易部下达, 并且启动交易系统公平交易模块。根据公司制度, 严格禁止不同投资组合之间互为对手方的交易, 严格控制不同投资组合之间的同日反向交易。

场外交易中, 对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等交易, 交易部根据各投资组合经理申报的满足价格条件的数量进行比例分配。如有异议, 由交易部报投资总监、督察长、金融

工程部和监察稽核部，再次进行审核并确定最终分配结果。如果督察长认为有必要，可以召开风险管理委员会会议，对公平交易的结果进行评估和审议。对于银行间市场交易、固定收益平台、交易所大宗交易，投资组合经理以该投资组合的名义向交易部下达投资指令，交易部向银行间市场或交易对手询价、成交确认，并根据“时间优先、价格优先”的原则保证各投资组合获得公平的交易机会。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人严格执行了《新华基金管理股份有限公司公平交易制度》的规定。

基金管理人旗下所有投资组合连续 4 个季度的日内、3 日内以及 5 日内股票和债券交易同向交易价差分析及相应情景分析表明：债券同向交易频率偏低；股票同向交易溢价率较高的因素主要是受到市场因素影响造成个股当日价格振幅较大或者是组合经理个人对交易时机的判断，即成交价格的日内变化较大以及投资组合的成交时间不一致而导致个别组合间的交易价差较大，结合通过对平均溢价率、买入/卖出溢价率以及利益输送金额等不同组合不同时间段的同向交易价差分析表明投资组合间不存在利益输送的可能性。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

基金管理人原则上不允许同日反向交易行为的发生，本报告期内，未发生有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边成交量超过该证券当日成交量的 5% 的情况。

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，市场震荡上扬，上证主板走势好于创业板，超大市值为代表的白马股指数持续上涨，代表新兴产业的中小创个股持续回调。全年上证综指上涨 6.56%，沪深 300 上涨 21.78%，创业板指下跌 10.67%，新华泛资源基金上涨 20.41%，表现较好，基金多数时间中小创持仓比例较大，对净值构成较大压力，年末减仓部分中小创，大幅加仓低估值地产股，基金持股集中度仍然较高，板块配置方面，年末重点配置了房地产、农林牧渔、国防军工等板块。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2017 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 2.714 元，本报告期份额净值增长率为 20.41%，同期比较基准的增长率为 12.98%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

预计 2018 年货币、财政、货币政策中性偏紧，A 股资金面是个减量市场，仍然是结构性行情，

市场对中小创和主题的风险偏好会上升，对白马股无论是业绩还是增长要求都会提高。经济增长比较平稳，提高发展质量更为重要，经济防风险任务仍在进行，去杠杆、去库存压力缓解，补短板更突出。预计全年上证综指震荡整理为主，沪港通、深港通开通后，北上资金对 A 股白马股走势影响较大，所以 A 股白马走势与美股走势关联度很大，白马股权重较大，对上证综指影响大。创业板有超跌反弹行情，但因为估值仍然偏贵、流动性较差、上市公司财务成本有继续上升压力、外延并购仍然较难，内生增长不温不火，所以创业板难有大行情。2018 年将继续坚持价值投资，高增长成长和低估值价值股并重，适当参与主题投资。全年保持中性仓位。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人在开展内部监察稽核工作时本着合规运作、防范风险、保障基金份额持有人利益的宗旨，由独立于各业务部门的督察长和监察稽核部对公司的经营管理、基金的投资运作、基金的销售等公司所有业务及员工行为规范等方面进行定期和不定期检查，及时发现问题并督促相关部门进行整改，并定期制作监察稽核报告报中国证监会、董事会和公司管理层。

本报告期内，基金管理人内部监察稽核工作的重点包括以下几个方面：

一、督察长和监察稽核部督促、协助各业务部门按照法律法规和监管机构规定的要求，完善各项内部管理制度和业务流程，明确风险控制职责并具体落实相应措施，提高全体员工的风险意识，有效保障基金份额持有人的利益。

二、督察长和监察稽核部针对各部门具体业务建立了相应的检查指标及检查重点，通过现场检查、电脑监控、人员询问、重点抽查等一系列方法，定期对公司和基金日常运作的各项业务进行合法合规检查，并对基金投资交易行为过程实施实时监控，督促业务部门不断改进内部控制和风险管理，并按规定定期出具监察稽核报告报送监管机关、董事会和公司管理层。

三、根据中国证监会的规定，督察长和监察稽核部及时准确地向监管机关报送各项报告，并对公司所有对外信息，包括基金法定信息披露、基金产品宣传推介材料和媒体稿件等的合法合规情况进行事前审阅，确保其内容真实、准确、完整并符合中国证监会的相关规定。督察长和监察稽核部组织、协调各相关部门及时完成信息披露，确保公司的信息披露工作严格按照中国证监会规定的时间和方式进行。

四、在全公司范围内开展持续的学习和培训。督察长和监察稽核部对公司员工进行了法律法规的专项培训，并组织员工开展学习、讨论，提高和加深了公司员工对基金法律法规的认识和理解，明确风险控制职责，树立全员内控意识。

通过上述工作，在本报告期内，公司对本基金的管理始终都能按照法律法规、基金合同、招募

说明书和公司制度进行，充分维护和保障了基金持有人的合法权益。本基金管理人将一如既往地本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运用资金资产，以风险控制为核心，进一步提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范和控制各种风险，充分保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

4.7.1 有关参与估值流程各方及人员（或小组）的职责分工

4.7.1.1 估值工作小组的职责分工

公司建立估值工作小组对证券估值负责。估值工作小组由运作保障部负责人、基金会计、投资管理部、交易部、监察稽核部人员组成。每个成员都可以指定一个临时或者长期的授权人员。

估值工作小组职责：

- ① 制定估值制度并在必要时修改；
- ② 确保估值方法符合现行法规；
- ③ 批准证券估值的步骤和方法；
- ④ 对异常情况做出决策。

运作保障部负责人是估值工作小组的组长，运作保障部负责人在基金会计或者其他两个估值小组成员的建议下，可以提议召集估值工作小组会议。

估值决策由估值工作小组 2/3 或以上多数票通过。

4.7.1.2 基金会计的职责分工

基金会计负责日常证券资产估值。基金会计和公司投资管理部相互独立。在按照本估值制度和相关法规估值后，基金会计定期将证券估值表向估值工作小组报告，至少每月一次。

基金会计职责：

- ① 获得独立、完整的证券价格信息；
- ② 每日证券估值；
- ③ 检查价格波动并进行一般准确性评估；
- ④ 向交易员或基金经理核实价格异常波动，并在必要时向估值工作小组报告；
- ⑤ 对每日证券价格信息和估值结果进行记录；
- ⑥ 对估值调整和人工估值进行记录；
- ⑦ 向估值工作小组报送月度估值报告。

基金会计认为必要，可以提议召开估值工作小组会议。

4.7.1.3 投资管理部的职责分工

- ① 接受监察稽核部对所投资证券价格异常波动的问讯；
- ② 对停牌证券、价格异常波动证券、退市证券提出估值建议；
- ③ 评价并确认基金会计提供的估值报告；
- ④ 向估值工作小组报告任何他/她认为可能的估值偏差。

4.7.1.4 交易部的职责分工

- ① 对基金会计的证券价格信息需求做出即时回应；
- ② 通知基金会计关于证券停牌、价格突发性异常波动、退市等特定信息；
- ③ 评价并确认基金会计提供的估值报告。

4.7.1.5 监察稽核部的职责分工

- ① 监督证券的整个估值过程；
- ② 确保估值工作小组制定的估值政策得到遵守；
- ③ 确保公司的估值制度和符合现行法律、法规的要求；
- ④ 评价现行估值方法是否恰当反应证券公允价格的风险；
- ⑤ 对于估值表中价格异常波动的证券向投资部问讯；
- ⑥ 对于认为不合适或者不再合适的估值方法提交估值工作小组讨论。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，本基金未进行利润分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情况。

§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，本基金托管人在对新华泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，

严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地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，新华泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金的管理人——新华基金管理股份有限公司在新华泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，新华泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金未进行利润分配。

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

本托管人依法对新华基金管理股份有限公司编制和披露的新华泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金 2017 年年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

中国工商银行资产托管部

2018 年 3 月 16 日

§6 审计报告

瑞华审字[2018] 01360038 号

新华泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人：

我们审计了新华泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“新华泛资源基金”）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、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。

6.1 审计意见

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”）发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了新华泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年度的经营成果和基金净值变动情况。

6.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于新华泛资源基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

6.3 其他信息

新华泛资源基金管理人新华基金管理股份有限公司（以下简称“管理人”）管理层对其他信息负责。其他信息包括新华泛资源基金 2017 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。

我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。

结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。

基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。

6.4 管理层对财务报表的责任

编新华泛资源基金管理人管理层负责按照企业会计准则和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财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时，管理人管理层负责评估新华泛资源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，除非管理人管理层计划清算新华泛资源基金、终止运营或别无其他现实的选择。

管理人治理层负责监督新华泛资源基金的财务报告过程。

6.5 注册会计师的责任

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所导致，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。

在按照审计准则执行审计的过程中，我们运用了职业判断，并保持了职业怀疑。同时，我们也

执行以下工作：

（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。

（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。

（三）评价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。

（四）对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，就可能导致对新华泛资源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新华泛资源基金不能持续经营。

（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。

我们与新华泛资源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。

瑞华会计师事务所（特殊普通合伙） 中国注册会计师
张伟 胡慰

北京市东城区永定门西滨河路 8 号院 7 号楼中海地产广场西塔 5-11 层

2018 年 3 月 29 日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：新华泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
----	-----	-------------------------	--------------------------

资产：		-	-
银行存款	7.4.7.1	121,246,767.39	31,110,312.40
结算备付金		2,116,722.37	1,839,392.05
存出保证金		775,983.16	211,137.56
交易性金融资产	7.4.7.2	396,252,580.96	171,288,039.55
其中：股票投资		396,252,580.96	171,288,039.55
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		-	20,590,472.52
应收利息	7.4.7.5	22,954.81	7,929.25
应收股利		-	-
应收申购款		1,993,869.77	-
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		522,408,878.46	225,047,283.33
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
负债：		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		3,898,880.51	2,518,447.63
应付赎回款		3,028,872.86	152,300.56
应付管理人报酬		671,979.84	275,952.29

应付托管费		111,996.66	45,992.03
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	1,960,380.38	2,144,079.02
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	640,454.30	430,574.02
负债合计		10,312,564.55	5,567,345.55
所有者权益：		-	-
实收基金	7.4.7.9	188,714,948.35	97,359,865.61
未分配利润	7.4.7.10	323,381,365.56	122,120,072.17
所有者权益合计		512,096,313.91	219,479,937.78
负债和所有者权益总计		522,408,878.46	225,047,283.33

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值 2.714 元，基金份额总额 188,714,948.35 份。

7.2 利润表

会计主体：新华泛资源优势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	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
一、收入		146,807,108.58	9,016,836.95
1.利息收入	7.4.7.11	4,043,093.65	550,296.16
其中：存款利息收入		3,094,474.38	395,563.03
债券利息收入		230,827.39	11,368.77
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		717,791.88	143,364.36
其他利息收入		-	-

2.投资收益（损失以“-”填列）		140,820,496.44	26,241,051.68
其中：股票投资收益	7.4.7.12	135,548,558.40	25,564,618.56
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-85,050.00	185,085.48
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益	7.4.7.14	5,356,988.04	491,347.64
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.15	179,781.53	-17,843,901.80
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	1,763,736.96	69,390.91
减：二、费用		29,730,443.16	10,351,262.29
1. 管理人报酬		12,255,485.78	3,113,841.71
2. 托管费		2,042,581.04	518,973.61
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.17	15,009,757.06	6,317,427.59
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.18	422,619.28	401,019.38
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		117,076,665.42	-1,334,425.34
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		117,076,665.42	-1,334,425.34

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：新华泛资源优势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）	97,359,865.61	122,120,072.17	219,479,937.78
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	117,076,665.42	117,076,665.42
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）	91,355,082.74	84,184,627.97	175,539,710.71
其中：1.基金申购款	653,284,423.55	961,747,017.94	1,615,031,441.49
2.基金赎回款	-561,929,340.81	-877,562,389.97	-1,439,491,730.78
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）	188,714,948.35	323,381,365.56	512,096,313.91
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）	132,829,602.51	147,780,799.63	280,610,402.14
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-1,334,425.34	-1,334,425.34
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-35,469,736.90	-24,326,302.12	-59,796,039.02

列)			
其中：1.基金申购款	22,685,130.25	22,781,252.51	45,466,382.76
2.基金赎回款	-58,154,867.15	-47,107,554.63	-105,262,421.78
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）	97,359,865.61	122,120,072.17	219,479,937.78

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码（序号）从 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：陈重，主管会计工作负责人：张宗友，会计机构负责人：徐端骞

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

新华泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金(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[2009]384 号文件“关于核准新世纪泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金募集的批复”批准,由新华基金管理股份有限公司作为发起人,于 2009 年 6 月 2 日至 7 月 8 日向社会公开募集,首次募集资金总额 3,132,175,900.10 元,其中募集资金产生利息 531,078.20 元,并经万隆亚洲会计师事务所有限公司万亚会业字[2009]第 2453 号验资报告予以验证。2009 年 7 月 13 日办理基金备案手续,基金合同正式生效。本基金为契约型开放式证券投资基金,存续期不限,本基金管理人为新华基金管理股份有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《新华泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》及《新华泛资源优势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国内依法发行和上市各类股票、权证、债券、资产支持证券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金股票的投资比例占基金资产的 30%—80%,其中投资于具有自然资源优势和社会资源优势的股票市值不低于股票投资的 80%;其它金融工具的投资比例占基金资产的 20%-70%,其中持有的现金和到期日在一年以内的政府债券的合计比例不低于基金资产净值的 5%,权证投资占基金资产净值的 0%~3%。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: 60%*沪深 300 指数+ 40%*上证国债指数。

本财务报表由本基金的基金管理人新华基金管理股份有限公司于 2018 年 3 月 29 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营假设为基础编制，根据实际发生的交易和事项，按照财政部发布的《企业会计准则——基本准则》（财政部令第 33 号发布、财政部令第 76 号修订）、于 2006 年 2 月 15 日及其后颁布和修订的 42 项具体会计准则、企业会计准则应用指南、企业会计准则解释及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《新华泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注四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

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

本基金以人民币为记账本位币。

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、贷款和应收款项、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。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)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。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，其他以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

本基金目前暂无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

(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和其他金融负债。

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其他各类应付款项等。

除衍生工具所产生的金融负债外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融负债在资产负债表中以交易性金融负债列示。衍生工具所产生的金融负债在资产负债表中以衍生金融负债列示。

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，于交易日按取得时的公允价值作为初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券以及不作为有效套期工具的衍生工具等，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

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，期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以成本进行后续计量，在摊销时产生的利得或损失，应当确认为当期收益。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产；金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，终止确认该金融负债或其一部分。处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益。

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

(1) 股票投资

股票投资成本按交易日股票的公允价值入账，相关交易费用直接计入当期损益。

因股权分置改革而获得的非流通股股东支付的现金对价，于股权分置实施复牌日冲减股票投资成本；股票持有期间获得的股票股利(包括送红股和公积金转增股本)以及因股权分置改革而获得的股票，于除息日按股权登记日持有的股数及送股或转增比例，计算确定增加的股票数量。

卖出股票于交易日确认股票投资收益。卖出股票按移动加权平均法结转成本。

(2) 债券投资

买入债券于交易日确认为债券投资。债券投资成本按债券的公允价值入账，相关交易费用直接计入当期损益，上述公允价值不包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息（作为应收利息单独核算）。

配售及认购新发行的分离交易可转债，于实际取得日按照估值方法对分离交易可转债的认购成本进行分摊，确认应归属于债券部分的成本。

买入零息债券视同到期一次还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含报酬率后，逐日确认债券利息收入。

卖出债券于交易日确认债券投资收益。卖出债券按移动加权平均法结转成本。

(3) 权证投资

权证投资于交易日按公允价值入账，相关交易费用直接计入当期损益。

获赠的权证(包括配股权证)，在除权日按照持有的股数及获赠比例，计算确定增加的权证数量，成本为零。

配售及认购新发行的分离交易可转债而取得的权证，于实际取得日按照估值方法对分离交易可转债的认购成本进行分摊，确认应归属于权证部分的成本。

卖出权证于交易日确认权证投资收益。卖出权证的成本按移动加权平均法结转。

(4) 分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本。

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述（2）、（3）中相关原则进行计算。

(5) 买入返售金融资产

买入返售金融资产为本基金按照返售协议约定先买入再按固定价格返售证券等金融资产所融出的资金。

买入返售金融资产按交易日应支付或实际支付的全部价款入账，相关交易费用计入初始成本。

买入返售金融资产于返售到期日按账面余额结转。

(6) 卖出回购金融资产款

卖出回购金融资产款为本基金按照回购协议先卖出再按固定价格买入票据、证券等金融资产所融入的资金。

卖出回购金融资产款于交易日按照应收或实际收到的金额入账，相关交易费用计入初始成本。

卖出回购金融资产款于回购到期日按账面余额结转。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

(1) 估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。

存在活跃市场的金融资产或金融负债以活跃市场中的报价确定公允价值。不存在活跃市场的金融资产或金融负债采用估值技术确定公允价值。采用估值技术得出的结果反映估值日在公平交易中可能采用的交易价格。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。

对存在活跃市场的投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值；估值日无市价，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，采用最近交易市价确定公允价值。

对存在活跃市场的投资品种，如估值日无市价，且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25% 以上的，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价，确定公允价值。

当投资品种不再存在活跃市场，且其潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25% 以上的，采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定投资品种的公允价值。

(2) 主要资产的估值方法

① 股票投资

上市交易的股票按其估值日在证券交易所挂牌的市场交易收盘价估值；估值日无交易且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，按最近交易日的市场交易收盘价估值；估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价以确定公允价值并估值。

首次公开发行但未上市的股票按采用估值技术确定的公允价值估值，在估值技术难以可靠计量

公允价值的情况下按成本估值。

发行时明确一定期限限售期的股票（包括但不限于非公开发行股票、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，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票），按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

②债券投资

对在交易所市场上市交易或挂牌转让的实行净价交易的固定收益品种（含上交所可交换债），选取中证指数有限公司提供的相应品种当日的估值净价作为公允价值。

对在交易所市场上市交易的可转换债券（含深交所可交换债券），采用交易所每日收盘价（估值全价）扣减上一起息日至估值日每百元债券的税后应计利息（算头算尾）后的价格作为公允价值。

对在交易所市场挂牌转让的资产支持证券、私募债券和未上市债券，采用成本估值。

对于银行间市场上的固定收益品种，选取中国债券登记结算有限公司提供的相应品种当日的估值净价加上上一起息日至估值日每百元债券的税前应计利息（算头算尾）减去上一起息日至估值日每百元债券的税后应计利息（算头算尾）后的价格作为公允价值。

③如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值，本基金的管理人应根据具体情况与基金托管人商定后按最能反映公允价值的价格估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

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。申购、赎回、转换及分红再投资等引起的实收基金的变动分别于交易确认日认列。

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利得/(损失)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

(1) 利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除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，逐日确认债券利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后，逐日确认债券利息收入。

买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提，若合同利率与实际利率差异较小，则采用合同利率计算确定利息收入。

(2) 投资收益

股票投资收益为卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本的差额确认。

债券投资收益于交易日按卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本与应收利息(若有)后的差额确认。

衍生工具投资收益为交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本后的差额确认。

股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

(3) 公允价值变动损益

公允价值变动损益系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失，并于相关金融资产或金融负债卖出或到期时转出计入投资收益。

(4) 其他收入

其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量时确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

(1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 1.50%年费率计提；

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25%年费率计提；

(3) 卖出回购金融资产支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率)在回购期内逐日计提；

(4) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第三位的，则采用待摊或预提的方法。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 20%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(1)在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 20%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(2)本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；如投资者在不同销售机构选择的分红方式不同，基金注册登记机构将以投资者最后一次选择的分红方式为准；

(3)基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(4)每一基金份额享有同等分配权；

(5)法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期内未有其他重要的会计政策和会计估计。

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

本基金报告期末未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

根据中国证券投资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》（以下简称“估值业务指引”），自 2017 年 12 月 25 日起，本基金持有的流通受限股票参考估值业务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。该会计估计变更对本基金本期末的基金资产净值及本期损益均无影响。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金报告期末未发生差错更正。

7.4.6 税项

1、印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局决定从 2008 年 9 月 19 日起，调整证券（股票）交易印花税征收方式，将对买卖、继承、赠与所书立的 A 股、B 股股权转让书据按 0.1% 的税率对双方当事人征收证券（股票）交易印花税，调整为单边征税，即对买卖、继承、赠与所书立的 A 股、B 股股权转让书据的出让按 0.1% 的税率征收证券（股票）交易印花税，对受让方不再征税。

2、营业税、增值税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税补充政策的通知》的规定：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，对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

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。

3、个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[1998]55 号《关于证券投资基金有关税收问题的通知》、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》的规定：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。

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	上年度末
	2017 年 12 月 31 日	2016 年 12 月 31 日
活期存款	121,246,767.39	31,110,312.40
定期存款	-	-
其他存款	-	-
合计	121,246,767.39	31,110,312.40

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		394,003,938.30	396,252,580.96	2,248,642.66
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		394,003,938.30	396,252,580.96	2,248,642.66
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		169,219,178.42	171,288,039.55	2,068,861.13
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-

	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
	合计	169,219,178.42	171,288,039.55	2,068,861.13

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本报告期末及上年度末，本基金未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

本报告期末及上年度末，本基金未持有买入返售金融资产。

7.4.7.5 应收利息

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
应收活期存款利息	21,653.11	7,006.45
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	1,301.70	922.80
应收债券利息	-	-
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	-	-
合计	22,954.81	7,929.25

注：应收结算备付金利息包含结算保证金利息。

7.4.7.6 其他资产

本报告期末及上年度末，本基金未持有其他资产。

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	1,959,730.38	2,142,839.02
银行间市场应付交易费用	650.00	1,240.00
合计	1,960,380.38	2,144,079.02

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	250,000.00	250,000.00
应付赎回费	10,454.30	574.02
其他应付款	-	-
预提费用	380,000.00	180,000.00
银行手续费	-	-
债券利息税	-	-
应付后端申购费	-	-
合计	640,454.30	430,574.02

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	97,359,865.61	97,359,865.61
本期申购	653,284,423.55	653,284,423.55
本期赎回（以“-”号填列）	-561,929,340.81	-561,929,340.81
本期末	188,714,948.35	188,714,948.35

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	189,503,606.54	-67,383,534.37	122,120,072.17
本期利润	116,896,883.89	179,781.53	117,076,665.42
本期基金份额交易产生的变动数	130,814,353.01	-46,629,725.04	84,184,627.97
其中：基金申购款	1,385,800,523.63	-424,053,505.69	961,747,017.94
基金赎回款	-1,254,986,170.62	377,423,780.65	-877,562,389.97
本期已分配利润	-	-	-
本期末	437,214,843.44	-113,833,477.88	323,381,365.56

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	1,129,147.07	355,298.05
定期存款利息收入	1,877,916.67	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	87,410.64	40,264.98
其他	-	-
合计	3,094,474.38	395,563.03

注：结算备付金利息收入包含结算保证金利息。

7.4.7.12 股票投资收益

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
卖出股票成交总额	5,171,335,319.36	2,223,353,801.60
减：卖出股票成本总额	5,035,786,760.96	2,197,789,183.04
买卖股票差价收入	135,548,558.40	25,564,618.56

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	-85,050.00	185,085.48
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	-85,050.00	185,085.48

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	70,768,876.16	5,245,427.40
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	69,835,570.00	5,000,000.00
减：应收利息总额	1,018,356.16	60,341.92
买卖债券差价收入	-85,050.00	185,085.48

7.4.7.14 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	5,356,988.04	491,347.64
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	5,356,988.04	491,347.64

7.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	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
1.交易性金融资产	179,781.53	-17,843,901.80
——股票投资	179,781.53	-17,719,901.80
——债券投资	-	-124,000.00
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3.其他	-	-
合计	179,781.53	-17,843,901.80

7.4.7.16 其他收入

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
基金赎回费收入	1,742,757.24	68,806.34
转换费收入	20,979.72	584.57
其他	-	-
新股手续费返还	-	-
合计	1,763,736.96	69,390.91

7.4.7.17 交易费用

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
交易所市场交易费用	15,009,107.06	6,317,427.59
银行间市场交易费用	650.00	-
交易基金产生的费用	-	-
其中：申购费	-	-

赎回费	-	-
合计	15,009,757.06	6,317,427.59

7.4.7.18 其他费用

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
审计费用	80,000.00	80,000.00
信息披露费	300,000.00	300,000.00
债券账户维护费	40,500.00	18,000.00
汇划手续费	2,119.28	3,019.38
其他	-	-
合计	422,619.28	401,019.38

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 2017 年 12 月 31 日，本基金未发生需要披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报告签发日，本基金未发生需要披露的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
中国工商银行股份有限公司	基金托管人
新华基金管理股份有限公司	基金管理人、基金发起人
恒泰证券股份有限公司	基金管理人股东
恒泰长财证券有限责任公司	基金管理人股东的全资子公司
新华信托股份有限公司	基金管理人股东
杭州永原网络科技有限公司	基金管理人股东
北京新华富时资产管理有限公司	基金管理人的控股子公司
中央汇金投资有限责任公司	基金托管人股东

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
恒泰证券股份有限公司	2,002,724,723.04	19.21%	606,133,705.06	13.80%

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年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
恒泰证券股份有限公司	1,464,590.38	16.43%	156,663.64	7.99%
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
恒泰证券股份有限公司	443,265.14	11.92%	160,173.21	7.47%

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 2017年1月1日至2017年12 月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12 月31日
当期发生的基金应支付的管理费	12,255,485.78	3,113,841.71
其中：支付销售机构的客户维护费	3,078,470.68	957,303.44

注：基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5%的年费率逐日计提,逐日累计至每月月底,按月支付。

其计算公式为:日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.5%/当年天数

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12 月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12 月31日
当期发生的基金应支付的托管费	2,042,581.04	518,973.61

注：基金托管费按前一日的基金资产净值 0.25%的年费率逐日计提确认。

其计算公式为:日托管人报酬=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本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债券(含回购)交易。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

报告期内基金管理人未发生运用固有资金投资本基金的情况。

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

报告期内，除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年12月31日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	121,246,767.39	1,129,147.07	31,110,312.40	355,298.05

7.4.10.6 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参与关联方承销证券。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

7.4.10.7.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本报告期内，本基金资产的投资比例符合基金流动性风险管理的相关规定，流动性风险较低。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无收益分配事项。

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
300664	鹏鹞环保	2017-12-28	2018-01-05	网下中签	8.88	8.88	3,640.00	32,323.20	32,323.20	-
002923	润都股份	2017-12-28	2018-01-05	网下中签	17.01	17.01	763.00	12,978.63	12,978.63	-

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	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
------	------	------	------	--------	------	-----	----------	--------	--------	----

						盘单 价				
600485	信威集团	2016-12-26	重大事项停牌	16.01	-	-	331,900.00	5,603,839.00	5,313,719.00	-
002919	名臣健康	2017-12-28	重大事项停牌	35.26	2018-01-02	38.79	821.00	10,311.76	28,948.46	-
000540	中天金融	2017-08-21	重大事项停牌	7.35	-	-	569,450.00	3,899,332.36	4,185,457.50	-

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

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购。

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

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险管理委员会、监察稽核部、相关职能部门和业务部门构成的四级风险管理架构体系。

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，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。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管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。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。

本基金所持大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。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资产的公允价值。本基金所持有的金融负债的合同约定到期日均为一年以内且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

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

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有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。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。下表统计了本基金面临的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	121,246,767.39	-	-	-	121,246,767.39
结算备付金	2,116,722.37	-	-	-	2,116,722.37
存出保证金	775,983.16	-	-	-	775,983.16

交易性金融资产	-	-	-	396,252,580.96	396,252,580.96
应收利息	-	-	-	22,954.81	22,954.81
应收申购款	-	-	-	1,993,869.77	1,993,869.77
资产总计	124,139,472.92	-	-	398,269,405.54	522,408,878.46
负债					
应付证券清算款	-	-	-	3,898,880.51	3,898,880.51
应付赎回款	-	-	-	3,028,872.86	3,028,872.86
应付管理人报酬	-	-	-	671,979.84	671,979.84
应付托管费	-	-	-	111,996.66	111,996.66
应付交易费用	-	-	-	1,960,380.38	1,960,380.38
其他负债	-	-	-	640,454.30	640,454.30
负债总计	-	-	-	10,312,564.55	10,312,564.55
利率敏感度缺口	124,139,472.92	-	-	387,956,840.99	512,096,313.91
上年度末 2016 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	31,110,312.40	-	-	-	31,110,312.40
结算备付金	1,839,392.05	-	-	-	1,839,392.05
存出保证金	211,137.56	-	-	-	211,137.56
交易性金融资产	-	-	-	171,288,039.55	171,288,039.55
应收证券清算款	-	-	-	20,590,472.52	20,590,472.52
应收利息	-	-	-	7,929.25	7,929.25
资产总计	33,160,842.01	-	-	191,886,441.32	225,047,283.33
负债					
应付证券清算款	-	-	-	2,518,447.63	2,518,447.63
应付赎回款	-	-	-	152,300.56	152,300.56
应付管理人报酬	-	-	-	275,952.29	275,952.29
应付托管费	-	-	-	45,992.03	45,992.03
应付交易费用	-	-	-	2,144,079.02	2,144,079.02
其他负债	-	-	-	430,574.02	430,574.02

负债总计	-	-	-	5,567,345.55	5,567,345.55
利率敏感度缺口	33,160,842.01	-	-	186,319,095.77	219,479,937.78

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	其他市场变量不变，市场利率上升 25 个基点		
	其他市场变量不变，市场利率下降 25 个基点		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
	市场利率上升 25.00 bp	增加约 310,348.68	增加约 82,902.11
	市场利率下降 25.00 bp	减少约 310,348.68	减少约 82,902.11

注：本基金管理人运用 XRisk suite 风险控制系统对本基金投资组合中银行存款、结算备付金、债券资产做出以上利率风险的敏感性分析。

7.4.13.4.2 外汇风险

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

在其他价格风险分析中，本基金管理人主要分析市场价格风险的影响。市场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，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。于本报告期末，本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

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	公允价值	占基金

		资产净 值比例 (%)		资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	396,252,580.96	77.38	171,288,039.55	78.04
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
合计	396,252,580.96	77.38	171,288,039.55	78.04

注：本基金投资组合中股票的投资比例占基金资产的 30%—80%，其中投资于具有自然资源优势和社会资源优势的股票市值不低于股票投资的 80%；其他金融工具的投资比例占基金资产的 20%—70%，其中持有的现金和到期日在一年以内的政府债券的合计比例不低于基金资产净值的 5%，权证投资占基金资产净值的 0%—3%。

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	其他市场变量不变,沪深 300 指数上升 1%		
	其他市场变量不变,沪深 300 指数下降 1%		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
	沪深 300 指数上升 1%	增加约 2,754,519.10	增加约 2,148,218.33
	沪深 300 指数下降 1%	减少约 2,754,519.10	减少约 2,148,218.33

注：本基金管理人运用 XRisk suite 风险控制系统对本基金投资组合中股票资产做出以上其他价格风险的敏感性分析。

§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	396,252,580.96	75.85
	其中：股票	396,252,580.96	75.85
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	123,363,489.76	23.61
8	其他各项资产	2,792,807.74	0.53
9	合计	522,408,878.46	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	9,307,478.18	1.82
B	采矿业	-	-
C	制造业	214,612,668.13	41.91
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	3,755,784.00	0.73
F	批发和零售业	419,367.96	0.08
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	18,587,170.00	3.63
J	金融业	-	-
K	房地产业	135,871,710.76	26.53
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-

N	水利、环境和公共设施管理业	10,330,001.93	2.02
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	3,368,400.00	0.66
S	综合	-	-
	合计	396,252,580.96	77.38

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	600048	保利地产	2,980,000	42,167,000.00	8.23
2	002146	荣盛发展	3,885,252	37,026,451.56	7.23
3	600383	金地集团	2,755,728	34,804,844.64	6.80
4	601952	苏垦农发	2,351,463	33,226,172.19	6.49
5	000932	*ST 华菱	3,090,000	25,059,900.00	4.89
6	600760	中航黑豹	469,140	16,368,294.60	3.20
7	600893	航发动力	551,800	14,848,938.00	2.90
8	600879	航天电子	1,775,500	13,919,920.00	2.72
9	002368	太极股份	394,786	10,015,720.82	1.96
10	600598	北大荒	862,031	9,292,694.18	1.81
11	002036	联创电子	566,000	9,186,180.00	1.79
12	300408	三环集团	444,300	8,957,088.00	1.75
13	001979	招商蛇口	430,000	8,410,800.00	1.64
14	000002	万科 A	260,158	8,080,507.48	1.58
15	300495	美尚生态	533,458	7,884,509.24	1.54
16	300219	鸿利智汇	684,170	7,683,229.10	1.50
17	600416	湘电股份	520,300	6,498,547.00	1.27
18	002829	星网宇达	204,000	5,542,680.00	1.08
19	600485	信威集团	331,900	5,313,719.00	1.04
20	300370	安控科技	1,373,239	5,273,237.76	1.03
21	300431	暴风集团	238,320	5,195,376.00	1.01
22	300709	精研科技	70,000	5,063,100.00	0.99
23	300160	秀强股份	622,188	4,884,175.80	0.95
24	002157	正邦科技	851,711	4,880,304.03	0.95
25	002672	东江环保	270,000	4,387,500.00	0.86
26	002448	中原内配	470,000	4,230,000.00	0.83

27	000540	中天金融	569,450	4,185,457.50	0.82
28	600873	梅花生物	740,000	3,818,400.00	0.75
29	603717	天域生态	126,400	3,515,184.00	0.69
30	600482	中国动力	141,600	3,513,096.00	0.69
31	000666	经纬纺机	180,042	3,496,415.64	0.68
32	603365	水星家纺	140,000	3,235,400.00	0.63
33	600562	国睿科技	128,080	3,075,200.80	0.60
34	603605	珀莱雅	90,000	2,584,800.00	0.50
35	002658	雪迪龙	200,000	2,554,000.00	0.50
36	002020	京新药业	207,700	2,386,473.00	0.47
37	300336	新文化	200,000	2,284,000.00	0.45
38	002472	双环传动	230,000	2,251,700.00	0.44
39	300367	东方网力	130,000	1,960,400.00	0.38
40	300422	博世科	111,707	1,906,838.49	0.37
41	300306	远方信息	81,800	1,336,612.00	0.26
42	603345	安井食品	50,000	1,215,000.00	0.24
43	600340	华夏幸福	38,122	1,196,649.58	0.23
44	300440	运达科技	110,000	1,089,000.00	0.21
45	603466	风语筑	20,000	1,084,400.00	0.21
46	603908	牧高笛	30,000	1,080,000.00	0.21
47	002013	中航机电	100,000	1,079,000.00	0.21
48	600967	内蒙一机	81,800	985,690.00	0.19
49	600569	安阳钢铁	200,000	940,000.00	0.18
50	600737	中粮糖业	108,936	866,041.20	0.17
51	300297	蓝盾股份	84,867	809,631.18	0.16
52	002396	星网锐捷	35,500	766,445.00	0.15
53	300083	劲胜智能	100,000	759,000.00	0.15
54	300696	爱乐达	10,000	709,000.00	0.14
55	600446	金证股份	40,000	605,600.00	0.12
56	300190	维尔利	42,300	506,331.00	0.10
57	300366	创意信息	42,100	506,042.00	0.10
58	000705	浙江震元	51,018	419,367.96	0.08
59	300113	顺网科技	20,000	365,800.00	0.07
60	603010	万盛股份	10,000	277,100.00	0.05
61	002482	广田集团	30,000	240,600.00	0.05
62	002920	德赛西威	4,569	178,784.97	0.03
63	300735	光弘科技	3,764	54,163.96	0.01
64	002915	中欣氟材	1,085	38,181.15	0.01
65	603477	振静股份	1,955	37,027.70	0.01
66	300664	鹏鹞环保	3,640	32,323.20	0.01
67	002919	名臣健康	821	28,948.46	0.01
68	603283	赛腾股份	1,349	19,614.46	0.00
69	002696	百洋股份	800	14,784.00	0.00
70	002923	润都股份	763	12,978.63	0.00

71	300684	中石科技	827	11,528.38	0.00
72	300719	安达维尔	400	10,488.00	0.00
73	603655	朗博科技	881	8,193.30	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	600760	中航沈飞	173,594,170.33	79.09
2	600581	八一钢铁	91,630,538.47	41.75
3	600383	金地集团	90,572,905.95	41.27
4	002368	太极股份	79,925,334.09	36.42
5	601952	苏垦农发	71,021,694.03	32.36
6	002146	荣盛发展	68,546,695.97	31.23
7	600755	厦门国贸	60,310,995.54	27.48
8	600873	梅花生物	58,440,200.00	26.63
9	600048	保利地产	55,691,553.75	25.37
10	002396	星网锐捷	53,403,213.87	24.33
11	000625	长安汽车	52,684,486.76	24.00
12	000666	经纬纺机	52,527,112.22	23.93
13	002036	联创电子	52,256,350.53	23.81
14	600598	北大荒	46,328,117.47	21.11
15	600691	阳煤化工	43,678,551.30	19.90
16	300370	安控科技	43,153,911.77	19.66
17	300137	先河环保	41,274,901.86	18.81
18	603717	天域生态	39,840,716.50	18.15
19	000709	河钢股份	39,626,000.00	18.05
20	000002	万科 A	39,333,872.36	17.92
21	603180	金牌厨柜	38,621,925.00	17.60
22	600240	华业资本	38,495,611.23	17.54
23	300188	美亚柏科	37,245,335.92	16.97
24	002024	苏宁易购	36,473,680.41	16.62
25	300090	盛运环保	36,240,112.00	16.51
26	300033	同花顺	35,870,626.00	16.34
27	603900	莱绅通灵	35,833,362.02	16.33
28	600328	兰太实业	33,766,395.02	15.38
29	300271	华宇软件	33,025,688.88	15.05
30	002861	瀛通通讯	32,588,139.44	14.85
31	601718	际华集团	32,534,927.32	14.82

32	000932	*ST 华菱	31,705,002.39	14.45
33	300208	恒顺众昇	31,394,382.12	14.30
34	600068	葛洲坝	30,957,052.16	14.10
35	002233	塔牌集团	29,043,573.00	13.23
36	603778	乾景园林	28,881,167.80	13.16
37	600988	赤峰黄金	28,658,958.00	13.06
38	002157	正邦科技	28,636,245.63	13.05
39	000422	湖北宣化	25,603,138.00	11.67
40	000540	中天金融	25,386,447.00	11.57
41	600547	山东黄金	24,611,316.00	11.21
42	600390	五矿资本	24,338,272.98	11.09
43	600416	湘电股份	24,267,635.58	11.06
44	002556	辉隆股份	24,266,035.00	11.06
45	300161	华中数控	24,217,376.50	11.03
46	300050	世纪鼎利	24,185,631.66	11.02
47	300157	恒泰艾普	24,052,752.00	10.96
48	600010	包钢股份	24,050,000.00	10.96
49	603096	新经典	23,509,904.10	10.71
50	600028	中国石化	23,075,000.00	10.51
51	600115	东方航空	22,984,000.00	10.47
52	300047	天源迪科	22,726,238.82	10.35
53	300422	博世科	22,605,361.12	10.30
54	002446	盛路通信	22,580,005.03	10.29
55	300231	银信科技	22,113,528.00	10.08
56	603929	亚翔集成	22,094,203.00	10.07
57	000789	万年青	21,960,826.71	10.01
58	600482	中国动力	21,286,257.48	9.70
59	603517	绝味食品	21,212,874.25	9.67
60	002385	大北农	21,097,127.50	9.61
61	300219	鸿利智汇	21,025,858.36	9.58
62	000825	太钢不锈	20,980,000.00	9.56
63	601003	柳钢股份	20,955,246.40	9.55
64	000786	北新建材	20,880,630.00	9.51
65	600185	格力地产	20,483,522.40	9.33
66	600990	四创电子	20,378,982.96	9.29
67	002084	海鸥住工	20,022,471.57	9.12
68	002279	久其软件	19,580,046.96	8.92
69	002477	雏鹰农牧	19,566,555.98	8.91
70	601388	怡球资源	19,410,117.20	8.84
71	600737	中粮糖业	19,208,529.76	8.75
72	600170	上海建工	18,977,899.94	8.65
73	600685	中船防务	18,890,000.00	8.61
74	002158	汉钟精机	18,830,769.37	8.58
75	300238	冠昊生物	18,772,458.84	8.55

76	600743	华远地产	18,725,132.74	8.53
77	300113	顺网科技	18,307,607.00	8.34
78	600306	商业城	18,168,944.00	8.28
79	600684	珠江实业	18,075,147.20	8.24
80	002573	清新环境	17,907,864.50	8.16
81	300446	乐凯新材	17,713,680.00	8.07
82	600489	中金黄金	17,653,700.00	8.04
83	600893	航发动力	17,610,853.50	8.02
84	601668	中国建筑	17,223,000.00	7.85
85	300495	美尚生态	17,134,633.05	7.81
86	600138	中青旅	16,998,925.48	7.75
87	002887	绿茵生态	16,840,738.00	7.67
88	603955	大千生态	16,755,566.00	7.63
89	600015	华夏银行	16,392,000.00	7.47
90	300148	天舟文化	16,360,013.16	7.45
91	000623	吉林敖东	16,296,929.00	7.43
92	600039	四川路桥	16,220,827.50	7.39
93	300498	温氏股份	16,177,905.84	7.37
94	601328	交通银行	16,153,000.00	7.36
95	300577	开润股份	15,998,857.00	7.29
96	300336	新文化	15,778,223.28	7.19
97	000063	中兴通讯	15,702,093.84	7.15
98	600565	迪马股份	15,534,554.00	7.08
99	002604	ST 龙力	15,444,171.00	7.04
100	000898	鞍钢股份	15,343,173.00	6.99
101	600531	豫光金铅	15,266,464.13	6.96
102	300297	蓝盾股份	15,230,002.04	6.94
103	300613	富瀚微	15,200,300.00	6.93
104	000983	西山煤电	15,180,307.00	6.92
105	002282	博深工具	15,036,537.00	6.85
106	601688	华泰证券	15,013,902.00	6.84
107	600520	文一科技	14,849,473.79	6.77
108	002828	贝肯能源	14,831,089.98	6.76
109	600570	恒生电子	14,438,770.95	6.58
110	600879	航天电子	14,434,814.20	6.58
111	300315	掌趣科技	14,282,091.20	6.51
112	001979	招商蛇口	14,219,273.94	6.48
113	600594	益佰制药	14,117,146.21	6.43
114	600251	冠农股份	14,078,848.90	6.41
115	300632	光莆股份	13,987,443.24	6.37
116	300160	秀强股份	13,893,766.00	6.33
117	002683	宏大爆破	13,863,348.20	6.32
118	600385	山东金泰	13,480,314.00	6.14
119	000605	渤海股份	13,367,018.00	6.09

120	601880	大连港	13,355,000.00	6.08
121	601766	中国中车	13,163,000.00	6.00
122	600987	航民股份	13,158,717.08	6.00
123	600057	象屿股份	13,099,572.10	5.97
124	002215	诺普信	13,001,733.81	5.92
125	600266	北京城建	12,863,487.31	5.86
126	000089	深圳机场	12,838,000.00	5.85
127	300439	美康生物	12,762,603.63	5.81
128	600376	首开股份	12,713,055.25	5.79
129	300342	天银机电	12,701,061.36	5.79
130	000426	兴业矿业	12,590,627.80	5.74
131	002088	鲁阳节能	12,539,819.28	5.71
132	000668	荣丰控股	12,427,162.28	5.66
133	000401	冀东水泥	12,321,944.00	5.61
134	600583	海油工程	12,302,796.96	5.61
135	600109	国金证券	12,158,990.00	5.54
136	300193	佳士科技	12,145,357.00	5.53
137	002859	洁美科技	12,090,032.06	5.51
138	600926	杭州银行	11,961,986.01	5.45
139	000807	云铝股份	11,890,000.00	5.42
140	300049	福瑞股份	11,803,827.13	5.38
141	600765	中航重机	11,751,493.80	5.35
142	300548	博创科技	11,696,741.36	5.33
143	002045	国光电器	11,664,354.54	5.31
144	600340	华夏幸福	11,630,892.76	5.30
145	300602	飞荣达	11,609,288.12	5.29
146	002858	力盛赛车	11,397,400.00	5.19
147	300059	东方财富	11,304,019.00	5.15
148	600887	伊利股份	11,184,000.00	5.10
149	002124	天邦股份	11,136,766.00	5.07
150	002783	凯龙股份	11,119,715.00	5.07
151	002607	亚夏汽车	10,997,892.21	5.01
152	300094	国联水产	10,879,118.77	4.96
153	603060	国检集团	10,781,890.00	4.91
154	601929	吉视传媒	10,711,000.00	4.88
155	601333	广深铁路	10,635,500.00	4.85
156	002502	骅威文化	10,460,240.00	4.77
157	600219	南山铝业	10,423,882.37	4.75
158	000911	南宁糖业	10,414,970.00	4.75
159	300408	三环集团	10,393,108.00	4.74
160	601699	潞安环能	10,342,500.00	4.71
161	002672	东江环保	10,149,147.00	4.62
162	600458	时代新材	10,059,186.00	4.58
163	600022	山东钢铁	9,970,000.00	4.54

164	600016	民生银行	9,957,000.00	4.54
165	603179	新泉股份	9,897,944.95	4.51
166	300282	汇冠股份	9,839,596.62	4.48
167	601677	明泰铝业	9,692,061.12	4.42
168	600162	香江控股	9,580,554.50	4.37
169	600536	中国软件	9,520,162.00	4.34
170	300657	弘信电子	9,448,984.00	4.31
171	000066	中国长城	9,435,881.98	4.30
172	603232	格尔软件	9,381,000.00	4.27
173	600791	京能置业	9,336,365.00	4.25
174	603228	景旺电子	9,320,719.68	4.25
175	000683	远兴能源	9,120,000.00	4.16
176	000949	新乡化纤	8,975,150.00	4.09
177	000733	振华科技	8,958,563.00	4.08
178	601991	大唐发电	8,940,000.00	4.07
179	000948	南天信息	8,813,506.00	4.02
180	603078	江化微	8,765,400.00	3.99
181	002798	帝王洁具	8,681,869.00	3.96
182	300459	金科文化	8,537,276.00	3.89
183	600019	宝钢股份	8,536,000.00	3.89
184	600179	安通控股	8,490,623.00	3.87
185	000776	广发证券	8,330,345.00	3.80
186	600995	文山电力	8,304,658.76	3.78
187	600370	三房巷	8,268,323.50	3.77
188	600999	招商证券	8,258,226.40	3.76
189	603906	龙蟠科技	8,248,662.18	3.76
190	600729	重庆百货	8,197,244.00	3.73
191	000936	华西股份	8,134,731.30	3.71
192	002222	福晶科技	8,048,429.00	3.67
193	600500	中化国际	8,006,000.00	3.65
194	000686	东北证券	7,987,000.00	3.64
195	002047	宝鹰股份	7,810,000.00	3.56
196	600072	中船科技	7,735,098.33	3.52
197	600839	四川长虹	7,717,000.00	3.52
198	000530	大冷股份	7,714,430.40	3.51
199	000415	渤海金控	7,700,000.00	3.51
200	002118	紫鑫药业	7,662,860.90	3.49
201	600111	北方稀土	7,593,537.09	3.46
202	603728	鸣志电器	7,504,478.97	3.42
203	002829	星网宇达	7,502,352.00	3.42
204	600190	锦州港	7,325,192.56	3.34
205	600418	江淮汽车	7,200,734.50	3.28
206	300353	东土科技	7,190,762.00	3.28
207	601118	海南橡胶	7,166,681.00	3.27

208	002832	比音勒芬	7,086,677.65	3.23
209	300405	科隆股份	7,052,921.97	3.21
210	600741	华域汽车	7,011,100.00	3.19
211	300440	运达科技	6,995,473.00	3.19
212	600217	中再资环	6,969,000.00	3.18
213	002273	水晶光电	6,962,068.04	3.17
214	601229	上海银行	6,873,461.20	3.13
215	300639	凯普生物	6,779,035.55	3.09
216	601890	亚星锚链	6,762,000.00	3.08
217	600367	红星发展	6,758,351.00	3.08
218	002065	东华软件	6,758,024.00	3.08
219	600795	国电电力	6,700,000.00	3.05
220	600499	科达洁能	6,698,498.00	3.05
221	002343	慈文传媒	6,606,800.00	3.01
222	300576	容大感光	6,598,500.00	3.01
223	000400	许继电气	6,547,365.21	2.98
224	000835	长城动漫	6,475,400.00	2.95
225	000811	冰轮环境	6,462,727.50	2.94
226	300696	爱乐达	6,299,920.00	2.87
227	002593	日上集团	6,285,810.00	2.86
228	300581	晨曦航空	6,235,026.00	2.84
229	000404	华意压缩	6,030,387.00	2.75
230	600326	西藏天路	5,989,960.00	2.73
231	300030	阳普医疗	5,956,222.00	2.71
232	000429	粤高速 A	5,949,000.00	2.71
233	002406	远东传动	5,938,918.00	2.71
234	603970	中农立华	5,938,633.86	2.71
235	300431	暴风集团	5,929,011.30	2.70
236	601788	光大证券	5,891,000.00	2.68
237	603385	惠达卫浴	5,871,722.50	2.68
238	000546	金圆股份	5,729,905.00	2.61
239	603203	快克股份	5,714,988.00	2.60
240	300572	安车检测	5,675,228.00	2.59
241	002296	辉煌科技	5,673,101.00	2.58
242	002174	游族网络	5,672,273.00	2.58
243	601390	中国中铁	5,610,000.00	2.56
244	300310	宜通世纪	5,592,576.00	2.55
245	002596	海南瑞泽	5,587,361.00	2.55
246	603708	家家悦	5,553,760.48	2.53
247	300229	拓尔思	5,532,000.00	2.52
248	300709	精研科技	5,531,675.50	2.52
249	601988	中国银行	5,475,000.00	2.49
250	300651	金陵体育	5,474,273.00	2.49
251	300688	创业黑马	5,398,081.00	2.46

252	002448	中原内配	5,304,000.00	2.42
253	603466	风语筑	5,291,248.00	2.41
254	002013	中航机电	5,289,353.24	2.41
255	601628	中国人寿	5,281,000.00	2.41
256	601021	春秋航空	5,192,997.00	2.37
257	600855	航天长峰	5,152,300.00	2.35
258	600546	山煤国际	5,108,500.00	2.33
259	300588	熙菱信息	5,096,000.00	2.32
260	600125	铁龙物流	5,083,000.00	2.32
261	002866	传艺科技	5,054,906.20	2.30
262	000822	山东海化	5,008,848.28	2.28
263	300638	广和通	4,951,464.00	2.26
264	603444	吉比特	4,926,946.00	2.24
265	300623	捷捷微电	4,895,847.34	2.23
266	002053	云南能投	4,851,910.00	2.21
267	600150	中国船舶	4,832,000.00	2.20
268	603826	坤彩科技	4,802,199.01	2.19
269	300667	必创科技	4,756,730.00	2.17
270	000859	国风塑业	4,747,389.84	2.16
271	002912	中新赛克	4,739,026.00	2.16
272	002445	中南文化	4,732,554.06	2.16
273	002826	易明医药	4,725,000.00	2.15
274	002758	华通医药	4,669,848.39	2.13
275	601966	玲珑轮胎	4,661,643.00	2.12
276	000905	厦门港务	4,660,700.00	2.12
277	300566	激智科技	4,622,469.00	2.11
278	002497	雅化集团	4,612,000.00	2.10
279	300648	星云股份	4,600,600.00	2.10
280	600362	江西铜业	4,571,486.90	2.08
281	600259	广晟有色	4,566,700.00	2.08
282	601600	中国铝业	4,560,000.00	2.08
283	300436	广生堂	4,557,343.20	2.08
284	002472	双环传动	4,545,000.00	2.07
285	300620	光库科技	4,510,519.98	2.06
286	002314	南山控股	4,500,000.00	2.05
287	600061	国投资本	4,500,000.00	2.05
288	601818	光大银行	4,497,570.00	2.05
289	300400	劲拓股份	4,461,952.04	2.03
290	600449	宁夏建材	4,430,000.00	2.02

注：本项“买入金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以数量）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	600760	中航沈飞	183,428,455.32	83.57
2	600581	八一钢铁	109,783,302.57	50.02
3	300137	先河环保	98,193,683.92	44.74
4	002368	太极股份	76,745,524.42	34.97
5	600755	厦门国贸	64,073,104.96	29.19
6	600383	金地集团	58,772,207.00	26.78
7	002396	星网锐捷	57,476,561.00	26.19
8	600873	梅花生物	53,755,103.00	24.49
9	600691	阳煤化工	48,020,032.78	21.88
10	000625	长安汽车	47,923,992.62	21.84
11	000666	经纬纺机	45,922,959.87	20.92
12	600240	华业资本	44,654,770.96	20.35
13	300188	美亚柏科	42,936,603.66	19.56
14	603180	金牌厨柜	42,730,530.72	19.47
15	002036	联创电子	42,058,158.50	19.16
16	603717	天域生态	39,455,419.40	17.98
17	600598	北大荒	38,592,856.00	17.58
18	000709	河钢股份	38,338,848.00	17.47
19	603900	莱绅通灵	38,167,724.55	17.39
20	300370	安控科技	37,586,814.40	17.13
21	601952	苏垦农发	37,392,440.60	17.04
22	002024	苏宁易购	37,304,995.84	17.00
23	600328	兰太实业	36,509,045.00	16.63
24	300271	华宇软件	36,351,575.94	16.56
25	300090	盛运环保	35,638,745.75	16.24
26	300033	同花顺	35,058,719.54	15.97
27	601718	际华集团	33,557,209.62	15.29
28	300208	恒顺众昇	33,220,640.50	15.14
29	000540	中天金融	32,356,298.04	14.74
30	000002	万科A	31,507,671.40	14.36
31	002861	瀛通通讯	31,487,105.35	14.35
32	603778	乾景园林	31,022,256.08	14.13
33	002233	塔牌集团	30,784,280.27	14.03
34	600068	葛洲坝	30,292,799.00	13.80
35	300157	恒泰艾普	29,025,905.00	13.22
36	002146	荣盛发展	28,483,878.00	12.98
37	002157	正邦科技	26,963,032.75	12.28
38	600547	山东黄金	26,891,716.40	12.25

39	000422	湖北宣化	26,853,815.00	12.24
40	600988	赤峰黄金	26,367,224.00	12.01
41	603929	亚翔集成	26,357,173.77	12.01
42	002556	辉隆股份	24,966,808.50	11.38
43	600048	保利地产	24,874,657.90	11.33
44	601003	柳钢股份	24,220,864.56	11.04
45	000789	万年青	23,943,982.30	10.91
46	300422	博世科	23,676,652.45	10.79
47	300050	世纪鼎利	23,428,674.25	10.67
48	600010	包钢股份	23,305,864.00	10.62
49	600115	东方航空	23,227,052.00	10.58
50	600028	中国石化	23,144,000.00	10.54
51	000786	北新建材	23,133,358.86	10.54
52	300161	华中数控	22,907,788.99	10.44
53	600390	五矿资本	22,444,578.10	10.23
54	002446	盛路通信	22,120,461.21	10.08
55	600990	四创电子	21,936,386.63	9.99
56	603096	新经典	21,863,549.48	9.96
57	002282	博深工具	21,496,148.00	9.79
58	600185	格力地产	21,492,285.33	9.79
59	002385	大北农	21,417,538.42	9.76
60	601388	怡球资源	21,179,716.60	9.65
61	002477	雏鹰农牧	20,627,047.48	9.40
62	300231	银信科技	20,526,875.82	9.35
63	002279	久其软件	20,395,820.24	9.29
64	600685	中船防务	20,142,523.56	9.18
65	300446	乐凯新材	20,004,312.11	9.11
66	603517	绝味食品	19,863,333.12	9.05
67	002158	汉钟精机	19,593,890.39	8.93
68	300047	天源迪科	19,420,756.55	8.85
69	002573	清新环境	19,241,088.96	8.77
70	600743	华远地产	19,159,205.55	8.73
71	603955	大千生态	19,149,911.00	8.73
72	600482	中国动力	19,087,927.46	8.70
73	600684	珠江实业	19,048,267.54	8.68
74	002887	绿茵生态	19,000,995.00	8.66
75	000825	太钢不锈	18,685,285.00	8.51
76	600170	上海建工	18,677,000.00	8.51
77	600737	中粮糖业	18,001,846.00	8.20
78	600416	湘电股份	17,879,921.00	8.15
79	002604	ST 龙力	17,535,420.00	7.99
80	300113	顺网科技	17,315,855.75	7.89
81	600489	中金黄金	17,271,246.00	7.87
82	002084	海鸥住工	17,233,143.94	7.85

83	000063	中兴通讯	17,160,644.00	7.82
84	300577	开润股份	17,033,491.13	7.76
85	600306	商业城	16,907,515.00	7.70
86	601668	中国建筑	16,761,000.00	7.64
87	601328	交通银行	16,473,000.00	7.51
88	000623	吉林敖东	16,291,143.60	7.42
89	000605	渤海股份	16,250,000.00	7.40
90	002828	贝肯能源	16,180,219.18	7.37
91	300219	鸿利智汇	15,934,340.00	7.26
92	000983	西山煤电	15,913,035.12	7.25
93	300238	冠昊生物	15,773,875.68	7.19
94	300613	富瀚微	15,730,735.00	7.17
95	300498	温氏股份	15,688,445.74	7.15
96	002859	洁美科技	15,670,908.50	7.14
97	600039	四川路桥	15,617,225.69	7.12
98	600015	华夏银行	15,550,788.80	7.09
99	600138	中青旅	15,487,647.34	7.06
100	000898	鞍钢股份	15,476,308.00	7.05
101	600531	豫光金铅	14,934,574.00	6.80
102	601688	华泰证券	14,874,286.00	6.78
103	600251	冠农股份	14,866,528.00	6.77
104	600570	恒生电子	14,716,456.00	6.71
105	300297	蓝盾股份	14,714,044.04	6.70
106	600565	迪马股份	14,669,371.50	6.68
107	000733	振华科技	14,150,290.78	6.45
108	300315	掌趣科技	14,123,565.20	6.44
109	600520	文一科技	13,871,484.07	6.32
110	600057	象屿股份	13,777,838.66	6.28
111	600583	海油工程	13,776,127.31	6.28
112	000807	云铝股份	13,604,656.00	6.20
113	300148	天舟文化	13,479,634.25	6.14
114	002088	鲁阳节能	13,477,426.30	6.14
115	600987	航民股份	13,391,906.84	6.10
116	600594	益佰制药	13,320,893.31	6.07
117	300632	光莆股份	13,286,506.24	6.05
118	002215	诺普信	13,271,991.82	6.05
119	601880	大连港	13,145,294.00	5.99
120	000426	兴业矿业	13,102,691.67	5.97
121	002607	亚夏汽车	13,097,808.21	5.97
122	000948	南天信息	13,077,833.57	5.96
123	601766	中国中车	13,035,166.50	5.94
124	002683	宏大爆破	12,953,717.32	5.90
125	600266	北京城建	12,907,327.00	5.88
126	000089	深圳机场	12,863,658.00	5.86

127	300342	天银机电	12,827,088.50	5.84
128	600385	山东金泰	12,701,564.64	5.79
129	300657	弘信电子	12,576,400.00	5.73
130	002858	力盛赛车	12,417,900.00	5.66
131	300602	飞荣达	12,372,231.88	5.64
132	300439	美康生物	12,364,435.18	5.63
133	000401	冀东水泥	12,141,251.00	5.53
134	600376	首开股份	12,087,317.81	5.51
135	300336	新文化	11,960,848.83	5.45
136	300193	佳士科技	11,888,822.60	5.42
137	600109	国金证券	11,858,853.50	5.40
138	300049	福瑞股份	11,538,731.34	5.26
139	002045	国光电器	11,534,618.19	5.26
140	600765	中航重机	11,521,364.04	5.25
141	002124	天邦股份	11,190,171.20	5.10
142	300059	东方财富	11,100,500.00	5.06
143	600887	伊利股份	11,069,282.11	5.04
144	300339	润和软件	10,946,634.75	4.99
145	601699	潞安环能	10,861,506.00	4.95
146	300282	汇冠股份	10,730,984.20	4.89
147	601333	广深铁路	10,683,832.00	4.87
148	600340	华夏幸福	10,597,955.00	4.83
149	000911	南宁糖业	10,556,406.00	4.81
150	600219	南山铝业	10,545,838.82	4.80
151	600016	民生银行	10,402,000.00	4.74
152	600458	时代新材	10,398,482.00	4.74
153	000668	荣丰控股	10,369,367.48	4.72
154	600926	杭州银行	10,330,389.41	4.71
155	300548	博创科技	10,311,594.00	4.70
156	603228	景旺电子	10,030,574.93	4.57
157	600022	山东钢铁	10,010,000.00	4.56
158	601929	吉视传媒	9,979,378.94	4.55
159	600162	香江控股	9,844,056.00	4.49
160	601677	明泰铝业	9,811,795.31	4.47
161	603179	新泉股份	9,636,731.20	4.39
162	603232	格尔软件	9,630,342.00	4.39
163	300094	国联水产	9,562,273.71	4.36
164	002502	骅威文化	9,506,760.00	4.33
165	600179	安通控股	9,403,247.00	4.28
166	600791	京能置业	9,342,750.00	4.26
167	300495	美尚生态	9,329,440.43	4.25
168	603078	江化微	9,255,398.65	4.22
169	000683	远兴能源	9,190,544.00	4.19
170	300030	阳普医疗	9,036,493.00	4.12

171	603060	国检集团	9,010,685.15	4.11
172	002783	凯龙股份	8,979,231.00	4.09
173	603906	龙蟠科技	8,717,250.32	3.97
174	002222	福晶科技	8,707,481.50	3.97
175	600536	中国软件	8,651,285.00	3.94
176	000936	华西股份	8,562,702.00	3.90
177	601991	大唐发电	8,500,574.00	3.87
178	000415	渤海金控	8,470,000.00	3.86
179	002047	宝鹰股份	8,444,000.00	3.85
180	600999	招商证券	8,262,206.95	3.76
181	600500	中化国际	8,226,052.00	3.75
182	600370	三房巷	8,194,555.00	3.73
183	000066	中国长城	8,185,592.32	3.73
184	300160	秀强股份	8,184,810.18	3.73
185	002798	帝王洁具	8,170,149.64	3.72
186	600019	宝钢股份	8,151,000.00	3.71
187	000776	广发证券	8,066,009.00	3.68
188	600072	中船科技	8,055,915.40	3.67
189	000932	*ST 华菱	8,021,524.00	3.65
190	300459	金科文化	7,853,109.00	3.58
191	600729	重庆百货	7,825,817.88	3.57
192	600111	北方稀土	7,786,966.00	3.55
193	000968	蓝焰控股	7,783,508.38	3.55
194	300440	运达科技	7,777,073.16	3.54
195	002118	紫鑫药业	7,735,673.58	3.52
196	603728	鸣志电器	7,697,067.59	3.51
197	000530	大冷股份	7,682,903.70	3.50
198	002406	远东传动	7,472,461.73	3.40
199	600995	文山电力	7,455,390.00	3.40
200	002273	水晶光电	7,315,923.75	3.33
201	601890	亚星锚链	7,255,098.36	3.31
202	600839	四川长虹	7,250,034.00	3.30
203	600217	中再资环	7,205,037.00	3.28
204	000400	许继电气	7,204,233.87	3.28
205	600190	锦州港	7,195,660.92	3.28
206	002832	比音勒芬	7,164,197.60	3.26
207	300639	凯普生物	7,154,194.56	3.26
208	600499	科达洁能	7,046,013.00	3.21
209	601118	海南橡胶	7,041,067.15	3.21
210	600741	华域汽车	7,032,609.00	3.20
211	600795	国电电力	7,001,899.00	3.19
212	000949	新乡化纤	6,997,118.00	3.19
213	000686	东北证券	6,909,141.08	3.15
214	002612	朗姿股份	6,899,409.00	3.14

215	002343	慈文传媒	6,714,599.00	3.06
216	300353	东土科技	6,652,532.00	3.03
217	600367	红星发展	6,641,653.00	3.03
218	300405	科隆股份	6,636,480.18	3.02
219	600850	华东电脑	6,629,496.00	3.02
220	000811	冰轮环境	6,577,069.48	3.00
221	300696	爱乐达	6,510,238.00	2.97
222	300243	瑞丰高材	6,368,165.00	2.90
223	002593	日上集团	6,367,757.00	2.90
224	300581	晨曦航空	6,360,725.00	2.90
225	601229	上海银行	6,332,825.36	2.89
226	002065	东华软件	6,316,304.00	2.88
227	603826	坤彩科技	6,290,017.94	2.87
228	002672	东江环保	6,240,300.00	2.84
229	000835	长城动漫	6,205,500.00	2.83
230	600418	江淮汽车	6,192,884.45	2.82
231	300576	容大感光	6,169,665.00	2.81
232	001979	招商蛇口	6,099,883.22	2.78
233	600326	西藏天路	6,092,115.80	2.78
234	000546	金圆股份	6,075,381.00	2.77
235	603970	中农立华	6,025,588.90	2.75
236	000429	粤高速 A	5,974,388.00	2.72
237	000404	华意压缩	5,972,467.32	2.72
238	300572	安车检测	5,964,072.59	2.72
239	002596	海南瑞泽	5,860,391.00	2.67
240	601788	光大证券	5,828,000.00	2.66
241	600855	航天长峰	5,816,357.00	2.65
242	603708	家家悦	5,799,505.52	2.64
243	300688	创业黑马	5,788,495.00	2.64
244	603203	快克股份	5,786,024.60	2.64
245	300310	宜通世纪	5,706,985.00	2.60
246	002235	安妮股份	5,586,055.53	2.55
247	300377	赢时胜	5,477,218.83	2.50
248	002174	游族网络	5,467,485.48	2.49
249	300667	必创科技	5,460,926.00	2.49
250	601988	中国银行	5,450,000.00	2.48
251	000822	山东海化	5,444,605.78	2.48
252	601390	中国中铁	5,443,800.00	2.48
253	601628	中国人寿	5,385,900.00	2.45
254	600125	铁龙物流	5,253,701.99	2.39
255	300229	拓尔思	5,220,265.00	2.38
256	002686	亿利达	5,213,960.00	2.38
257	603385	惠达卫浴	5,196,230.00	2.37
258	601021	春秋航空	5,190,383.00	2.36

259	300623	捷捷微电	5,116,825.20	2.33
260	300651	金陵体育	5,047,339.00	2.30
261	300648	星云股份	5,033,600.00	2.29
262	002053	云南能投	5,025,108.00	2.29
263	002445	中南文化	5,001,859.05	2.28
264	002866	传艺科技	4,986,130.92	2.27
265	600546	山煤国际	4,941,103.00	2.25
266	002912	中新赛克	4,921,053.00	2.24
267	002826	易明医药	4,903,702.00	2.23
268	002296	辉煌科技	4,896,846.00	2.23
269	600295	鄂尔多斯	4,880,470.00	2.22
270	603444	吉比特	4,875,100.00	2.22
271	300638	广和通	4,862,138.00	2.22
272	600362	江西铜业	4,824,658.87	2.20
273	000905	厦门港务	4,818,586.00	2.20
274	300436	广生堂	4,785,072.56	2.18
275	300620	光库科技	4,752,872.86	2.17
276	600449	宁夏建材	4,720,500.00	2.15
277	002497	雅化集团	4,678,013.00	2.13
278	000606	神州易桥	4,676,033.00	2.13
279	002758	华通医药	4,668,034.74	2.13
280	603260	合盛硅业	4,655,895.08	2.12
281	300566	激智科技	4,645,528.00	2.12
282	601966	玲珑轮胎	4,631,674.00	2.11
283	600150	中国船舶	4,628,105.00	2.11
284	300400	劲拓股份	4,598,997.00	2.10
285	601600	中国铝业	4,587,000.00	2.09
286	601818	光大银行	4,542,260.00	2.07
287	000707	双环科技	4,538,674.00	2.07
288	000859	国风塑业	4,523,335.37	2.06
289	000710	贝瑞基因	4,511,780.00	2.06
290	002013	中航机电	4,475,727.62	2.04
291	600061	国投资本	4,438,643.06	2.02

注：本项“卖出金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以数量）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

买入股票的成本（成交）总额	5,260,571,520.84
卖出股票的收入（成交）总额	5,171,335,319.36

注：本项“买入股票的成本（成交）总额”与“卖出股票的收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 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。

8.6 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.6.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本报告期末本基金无股指期货投资。

8.6.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金合同尚无股指期货投资政策。

8.7 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.7.1 本期国债期货投资政策

本基金合同尚无国债期货投资政策。

8.7.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本报告期末本基金无国债期货投资。

8.7.3 本期国债期货投资评价

本报告期末本基金无国债期货投资。

8.8 投资组合报告附注

8.8.1 本报告期末本基金投资的前十名证券没有被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.8.2 本报告期末本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定备选股票库。

8.8.3 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	775,983.16
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	22,954.81
5	应收申购款	1,993,869.77
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,792,807.74

8.8.4 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。

8.8.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

8.8.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例
15,600	12,097.11	25,368,303.66	13.44%	163,346,644.69	86.56%

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	106,442.00	0.06%

注：本公司所有从业人员持有本基金份额总量为106,442.00份。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
----	-------------------

本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0

注：本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间为 0~10 万份；该只基金的基金经理持有该只基金份额总量的数量区间为 0 份。

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2009 年 7 月 13 日)基金份额总额	3,132,175,900.10
本报告期期初基金份额总额	97,359,865.61
本报告期基金总申购份额	653,284,423.55
减：本报告期基金总赎回份额	561,929,340.81
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	188,714,948.35

§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

2017 年 2 月 17 日，林艳芳女士离任本基金管理人新华基金管理股份有限公司副总经理。

本基金托管人的专门基金托管部门本报告期内未发生重大人事变动。

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

本报告期本基金投资策略未发生改变。

11.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

本报告期本基金未持有基金。

11.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金未发生改聘会计师事务所情况。报告年度应支付给其报酬 80000 元人民币。

审计年限为 1 年。自 2009 年至 2017 年，瑞华会计师事务所为本基金连续提供 9 年审计服务。

11.7 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，本基金无管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

11.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.8.1 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	
国元证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
宏信证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
恒泰证券	2	2,002,724,723.04	19.21%	1,464,590.38	16.43%	-
长江证券	1	1,446,523,884.85	13.87%	1,347,148.11	15.11%	-
招商证券	1	1,128,847,400.83	10.83%	1,051,295.89	11.80%	-
中信证券	1	1,090,130,057.49	10.46%	1,015,235.97	11.39%	-
广发证券	1	721,248,193.37	6.92%	671,698.58	7.54%	-
方正证券	1	659,666,367.13	6.33%	482,415.01	5.41%	-
国泰君安	1	636,893,152.13	6.11%	593,137.93	6.65%	-
海通证券	1	608,909,946.24	5.84%	567,075.41	6.36%	-
安信证券	1	419,649,248.09	4.03%	390,820.00	4.38%	-
中金证券	1	412,314,684.40	3.95%	301,526.63	3.38%	-
国信证券	1	390,971,520.50	3.75%	364,111.40	4.09%	-
宏源证券	1	366,589,474.29	3.52%	268,086.76	3.01%	-
西南证券	1	354,052,300.91	3.40%	258,918.08	2.90%	-
华泰证券	1	187,183,299.04	1.80%	136,887.13	1.54%	-

注：本基金根据中国证券监督管理委员会《关于加强证券投资基金监管有关问题的通知》（证监基字[1998]29号）以及《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，本基金报告期内共租用22个交易席位，其中报告期内新增2个交易席位，退租1个交易席位。新增席位为：东北证券上海交易所席位、东北证券深圳交易所席位。退租席位为：中信证券上海交易所席位。

一、交易席位的分配依据

交易席位的分配以券商实力及其所提供的研究支持为基础，主要考察点包括：

- 1、经营行为稳健规范，内控制度健全。
- 2、具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要。
- 3、具有较强的全方位金融服务能力和水平。

二、交易席位的选择流程

- 1、研究部根据上述标准考察后确定选用交易席位的券商。
- 2、与被选中的证券经营机构签订席位租用协议。

三、交易量的分配

交易量的分配以券商所提供的服务及研究支持为基础，主要考察点包括：

1、券商提供独立的或第三方研究报告及服务，包括宏观经济、行业分析、公司研发、市场数据、财经信息、行业期刊、组合分析软件、绩效评估、研讨会、统计信息、交易评估等，用以支持投资决策。

2、以季度为单位对经纪商通过评分的方式进行考核，由基金经理、研究员和交易员分别打分，根据经纪商给投资带来的增值确定经纪商的排名。

考核的内容包括上一季度经纪交易执行情况、提供研究报告数量、研究报告质量和及时性、受邀讲解次数及效果、主动推介次数及效果等。考核结果将作为当期交易量分配的依据，交易量大小和评分高低成正比。

- 3、交易部负责落实交易量的实际分配工作。

11.8.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国元证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
宏信证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	60,000,000.00	6.00%	-	-

长江证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	120,000,000.00	12.00%	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	100,000,000.00	10.00%	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
中金证券	-	-	150,000,000.00	15.00%	-	-
国信证券	-	-	220,000,000.00	22.00%	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	350,000,000.00	35.00%	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-

注：回购交易不包含非担保交收金额。

11.9 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	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加肯特瑞财富为销售机构并参加申购费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2017-01-07
2	新华基金管理股份有限公司关于调整创金启富代销的部分开放式基金申购金额下限的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2017-01-07
3	新华基金管理股份有限公司新华泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金基金恢复申购（转换转入、赎回、转换转出、定期定额投资）公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2017-01-17
4	新华基金管理股份有限公司关于调整长期停牌股票估值方法的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2017-01-17
5	新华泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金 2016 年第 4 季度报告	中国证券报、证券时报、上海证券报、公司网站	2017-01-20
6	新华基金管理股份有限公司关于调整旗下部分基金申购、赎回及最低持有份额的数额限制的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2017-02-15
7	新华基金管理股份有限公司基金行业高级管	中国证券报、证券时报、	2017-02-18

	理人员变更公告	上海证券报、证券日报、 公司网站	
8	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加交通银行股份有限公司手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠的公告	中国证券报、证券时报、 上海证券报、证券日报、 公司网站	2017-02-23
9	新华泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金招募说明书(更新)全文	公司网站	2017-02-25
10	新华泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金招募说明书(更新)摘要	中国证券报、证券时报、 上海证券报、公司网站	2017-02-25
11	新华基金管理股份有限公司关于调整凯石财富代销的部分开放式基金定投金额下限的公告	中国证券报、证券时报、 上海证券报、证券日报、 公司网站	2017-03-24
12	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金继续参加中国工商银行股份有限公司个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、 上海证券报、证券日报、 公司网站	2017-03-30
13	新华泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金 2016 年年度报告	中国证券报、证券时报、 上海证券报、公司网站	2017-03-31
14	新华泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金 2017 年第 1 季度报告	中国证券报、证券时报、 上海证券报、公司网站	2017-04-21
15	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加交通银行股份有限公司手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠的公告	中国证券报、证券时报、 上海证券报、证券日报、 公司网站	2017-04-22
16	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加苏宁基金销售公司为销售机构并参加申购费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、 上海证券报、证券日报、 公司网站	2017-04-26
17	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加一路财富(北京)信息科技股份有限公司网上申购费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、 上海证券报、证券日报、 公司网站	2017-05-11
18	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加广发银行股份有限公司为销售机构的公告	中国证券报、证券时报、 上海证券报、证券日报、 公司网站	2017-06-20
19	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加上海基煜基金销售有限公司为销售机构并参加申购费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、 上海证券报、证券日报、 公司网站	2017-06-28
20	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加交通银行股份有限公司手机银行渠道基金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、证券时报、 上海证券报、证券日报、 公司网站	2017-06-30
21	新华基金管理股份有限公司关于旗下基金 2017 年半年度最后一个交易日资产净值揭示公告	中国证券报、证券时报、 上海证券报、证券日报、 公司网站	2017-07-01
22	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基	中国证券报、证券时报、	2017-07-04

	金参加交通银行股份有限公司网上银行基金申购手续费费率优惠的公告	上海证券报、证券日报、 公司网站	
23	新华基金管理股份有限公司关于变更长期停牌股票估值方法的公告	中国证券报、证券时报、 上海证券报、证券日报、 公司网站	2017-07-19
24	新华泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金 2017 年第 2 季度报告	中国证券报、证券时报、 上海证券报、公司网站	2017-07-21
25	关于旗下部分基金参加华西证券股份有限公司基金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、证券时报、 上海证券报、证券日报、 公司网站	2017-07-28
26	新华基金关于旗下部分基金参加华泰证券基金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、证券时报、 上海证券报、证券日报、 公司网站	2017-07-29
27	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加华泰证券股份有限公司基金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、证券时报、 上海证券报、证券日报、 公司网站	2017-08-01
28	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加中泰证券股份有限公司基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、 上海证券报、证券日报、 公司网站	2017-08-25
29	新华泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金招募说明书(更新) 摘要	中国证券报、证券时报、 上海证券报、公司网站	2017-08-26
30	新华泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金招募说明书(更新) 全文	公司网站	2017-08-26
31	新华泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金 2017 年半年度报告	中国证券报、证券时报、 上海证券报、公司网站	2017-08-29
32	新华基金管理股份有限公司关于新华泛资源参加银河证券股份有限公司基金申购费率优惠活动的公告	公司网站	2017-09-01
33	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加武汉市伯嘉基金销售有限公司为销售机构并参加申购费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、 上海证券报、证券日报、 公司网站	2017-09-12
34	新华基金管理股份有限公司关于变更长期停牌股票估值方法的公告	中国证券报、证券时报、 上海证券报、证券日报、 公司网站	2017-10-11
35	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金在武汉市伯嘉基金销售有限公司开通定期定额投资业务、基金转换业务的公告	中国证券报、证券时报、 上海证券报、证券日报、 公司网站	2017-10-14
36	新华泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金 2017 年第 3 季度报告	中国证券报、证券时报、 上海证券报、公司网站	2017-10-26
37	新华基金管理股份有限公司关于旗下基金参加中信银行股份有限公司申购费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、 上海证券报、证券日报、 公司网站	2017-11-15
38	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金在中信银行股份有限公司开通基金转换业	中国证券报、证券时报、 上海证券报、证券日报、	2017-11-23

	务的公告	公司网站	
39	新华基金管理股份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、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2017-12-22
40	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加中国工商银行股份有限公司基金定期定额投资业务优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2017-12-29
41	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加交通银行股份有限公司手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2017-12-29
42	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加中国农业银行股份有限公司基金申购、定期定额投资业务费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2017-12-29
43	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加中国邮政储蓄银行股份有限公司个人网上银行和手机银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2017-12-29
44	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加浙商银行股份有限公司基金申购及定期定额投资业务费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2017-12-29
45	新华基金管理股份有限公司关于旗下基金 2017 年年度最后一个交易日资产净值揭示公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2017-12-30
46	关于新华基金管理股份有限公司旗下产品实施增值税政策的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、公司网站	2017-12-30

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	20170406-20171025	62,551,130.25	0.00	62,551,130.25	0.00	0.00%
产品特有风险							
1、赎回申请延期办理的风险 机构投资者大额赎回时易构成本基金发生巨额赎回，中小投资者可能面临小额赎回，中小投资者可能面临小额赎回申请也需要与机构投资者按同比例部分延期办理的风险； 2、基金净值大幅波动的风险							

机构投资者大额赎回时，基金管理人进行基金财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动；

3、提前终止基金合同的风险

机构投资者赎回后，可能出现基金资产净值低于5000万元的情形，若连续六十个工作日出现基金资产净值低于5000万元情形的，基金管理人可能提前终止基金合同，基金财产将进行清算；

4、基金规模过小导致的风险

机构投资者赎回后，可能导致基金规模过小。基金可能会面临投资银行间债券、交易所债券时交易困难的情形。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期本基金未有影响投资者决策的其他重要信息。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会批准新世纪泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金募集的文件
- (二) 关于申请募集新世纪泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金之法律意见书
- (三) 中国证监会关于核准新世纪基金管理有限公司变更公司名称、变更住所的批复
- (四) 更新的《新华泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》
- (五) 《新华泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- (六) 《新华泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- (七) 《新华基金管理股份有限公司开放式基金业务规则》
- (八) 更新的《新华泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》
- (九) 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- (十) 基金托管人业务资格批件及营业执照
- (十一) 重庆市工商行政管理局关于核准新华基金管理有限公司变更公司名称、变更住所的批复
- (十二) 中国证监会要求的其他文件

13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

13.3 查阅方式

投资者可在营业时间内免费查阅，也可按工本费购买复印件，或通过本基金管理人网站查阅。

新华基金管理股份有限公司

二〇一八年三月三十日