

# 太平基金管理有限公司关于太平灵活配置混合型发起式证券投资基金二〇一七年年度报告摘要的更正公告

太平基金管理有限公司于 2018 年 3 月 29 日发布的《太平灵活配置混合型发起式证券投资基金二〇一七年年度报告摘要》所登载的审计报告非普华永道会计师事务所(特殊普通合伙)所出具，其所附财务报表也非经普华永道会计师事务所(特殊普通合伙)审计，现更正如下：

## §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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 3 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本年度报告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。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	太平灵活配置
基金主代码	000986
交易代码	000986
基金运作方式	契约型开放式、发起式
基金合同生效日	2015年2月10日
基金管理人	太平基金管理有限公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	2,138,644,680.61份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过优化资产配置和灵活运用多种投资策略，寻找推动经济增长的内在动力，精选具有较高成长性和投资价值的金融工具，在充分控制投资风险的基础下，力争实现持续稳定的投资回报。
投资策略	<p>（一）资产配置策略</p> 本基金采用自上而下的多因素分析方法进行宏观策略研究，对宏观经济方面重大问题、突发事件、重大政策进行及时研究与评估，对影响证券市场的相关因素（政策、资金、利率走向、行业比较、上市公司盈利增长预期、估值水平、市场心理等）进行综合考量，分析和预测证券市场走势和行业热点，预测权益类资产和固定收益类资产的风险收益特征，确定中长期的资产配置方案。在公司投资决策委员会的统一指导下进行大类资

	<p>产的配置与组合构建，合理确定本基金在股票、债券、股指期货等金融工具上的投资比例，并随着各类金融工具风险收益特征的相对变化，适时动态地调整各金融工具的投资比例，以最大限度地降低投资组合的风险并提高收益。</p> <p>（二）股票投资策略</p> <p>本基金采用灵活的股票投资策略，充分挖掘中国经济结构调整和产业升级衍伸的投资机会，关注具有持续高成长性的行业和上市公司，以分享经济增长带来的投资回报。</p> <p>（三）债券投资策略</p> <p>本基金债券投资策略主要包括久期策略、收益率曲线策略、类别选择策略、个券选择策略、可转换债券投资策略、中小企业私募债投资策略等。</p> <p>（四）股指期货投资策略</p> <p>本基金在股指期货投资中将以控制风险为原则，以套期保值为目的，谨慎参与股指期货投资。本基金通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，对股指期货合约进行估值定价，并与股票现货资产进行匹配，实现多头或空头的套期保值操作。</p> <p>（五）权证投资策略</p> <p>本基金将因为上市公司进行增发、配售以及投资分离交易的可转换公司债券等原因被动获得权证，或者在进行套利交易、避险交易以及权证价值严重低估等情形下将投资权证。</p> <p>本基金的权证投资，是在对权证标的证券进行基本面研究及估值的基础上，结合股价波动率等参数，运用数量化期权定价模型，投资于合理内在价值的权证品种。</p>
业绩比较基准	1 年期银行定期存款利率（税后）+2%
风险收益特征	本基金为混合型基金，本基金属于中高风险、中高收益的基金品种，其预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。

## 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		太平基金管理有限公司	兴业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	陈吟绮	曾麓燕
	联系电话	021-38556782	021-52629999-212040
	电子邮箱	disclosure@taipingfund. com. cn	015292@cib. com. cn
客户服务电话		021-61560999	95561
传真		021-38556677	021-62535823

## 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. taipingfund. com. cn
基金年度报告备置地点	上海市浦东新区花园石桥路 33 号花旗集团大厦 17 楼 1708 室

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2017 年	2016 年	2015 年 2 月 10 日 (基金合同生效日) 至 2015 年 12 月 31 日
本期已实现收益	92, 029, 222. 82	-1, 317, 424. 78	-3, 755, 873. 67
本期利润	211, 256, 304. 96	-1, 730, 000. 40	-3, 628, 008. 63
加权平均基金份额本期利 润	0. 0929	-0. 0528	-0. 2465
本期基金份额净值增长率	13. 96%	-16. 05%	-21. 50%

3.1.2 期末数据和指标	2017 年末	2016 年末	2015 年末
期末可供分配基金份额利润	-0.3010	-0.3421	-0.2499
期末基金资产净值	1,606,243,668.91	1,508,928,593.89	12,725,172.98
期末基金份额净值	0.751	0.659	0.785

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

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

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

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	5.33%	0.59%	0.89%	0.01%	4.44%	0.58%
过去六个月	8.68%	0.49%	1.78%	0.01%	6.90%	0.48%
过去一年	13.96%	0.52%	3.56%	0.01%	10.40%	0.51%
自基金合同生效起至今	-24.90%	1.22%	11.18%	0.01%	-36.08%	1.21%

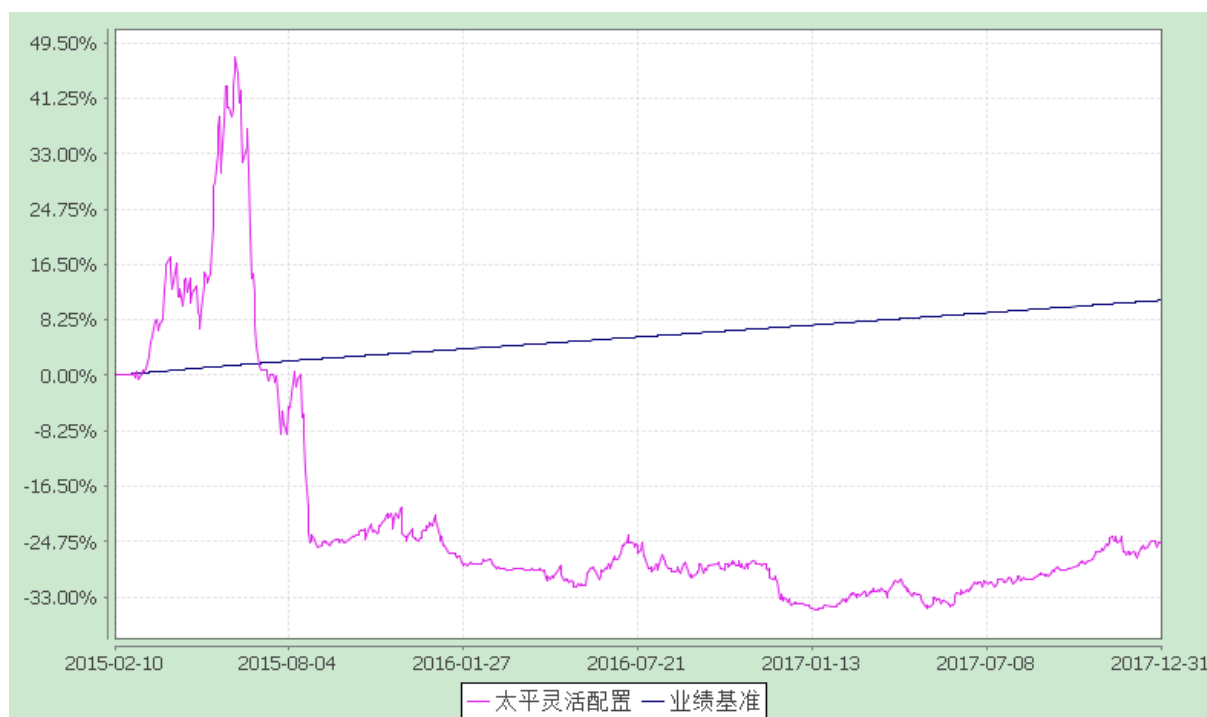
注：本基金的业绩比较基准为：1 年期银行定期存款利率（税后）+2%。

#### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

太平灵活配置混合型发起式证券投资基金

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

(2015年2月10日至2017年12月31日)

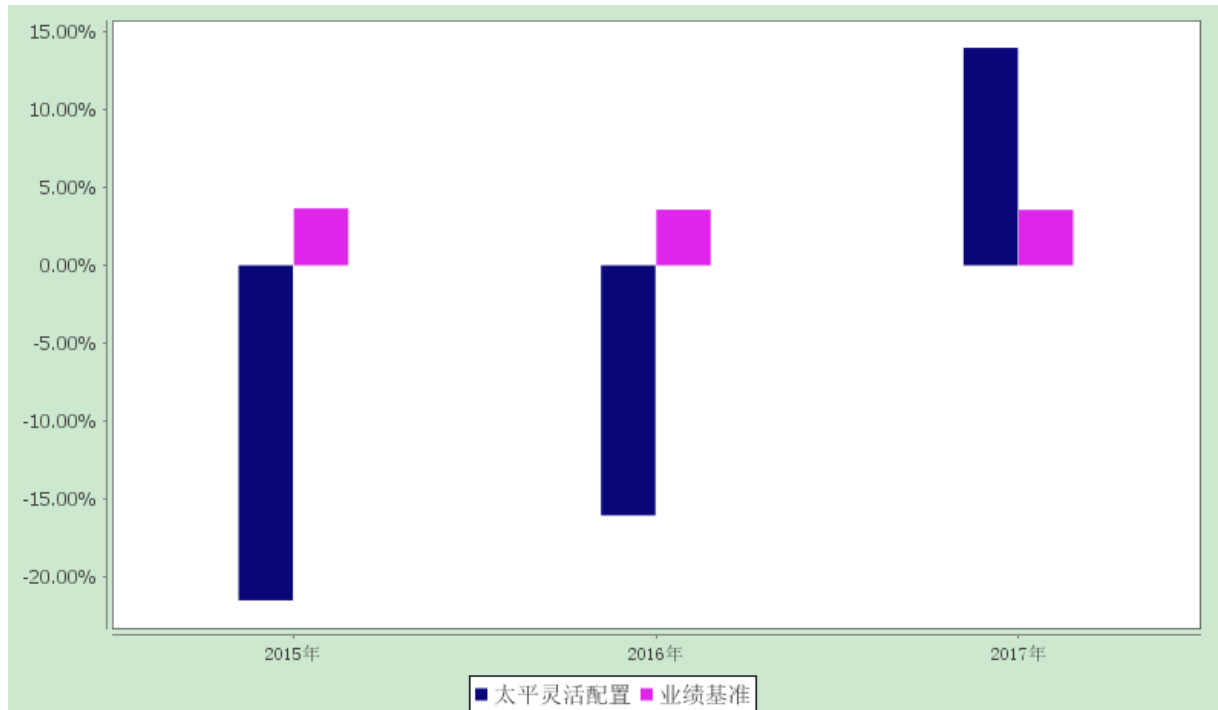


注：本基金基金合同于2015年2月10日生效；按照本基金基金合同和招募说明书的约定，本基金建仓期为自基金合同生效之日起的六个月，本基金已完成建仓，本基金的各项资产配置比例符合合同约定。

### 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

太平灵活配置混合型发起式证券投资基金

自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



注：1、本基金基金合同生效日为 2015 年 2 月 10 日，至本报告期末未满 5 年。  
2、合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自基金合同生效以来未进行过利润分配。

## § 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

太平基金管理有限公司原名中原英石基金管理有限公司（以下简称“公司”）经中国证券监督管理委员会 2012 年 12 月 20 日证监许可[2012]1719 号文件批准，于 2013 年 1 月 23 日在上海市工商行政管理局注册成立。目前公司注册资本为人民币 4 亿元，其中太平资产管理有限公司出资占注册资本 83%，中原证券股份有限公司的出资占注册资本的 8.5%，安石投资管理有限公司的出资占注册资本的 8.5%。

目前公司经营范围为基金募集、基金销售、特定客户资产管理、资产管理等，在投资管理、策略设计、产品设计、客户服务等方面配置了专业团队及集

中了优势资源，力求为客户创造长期持续稳健的回报。截至本报告期末，公司共管理 4 只证券投资基金，即太平灵活配置混合型发起式证券投资基金、太平日日金货币市场基金、太平日日鑫货币市场基金、太平改革红利精选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		
独孤南薰	本基金的基金经理	2016-04-07	-	14	美国西北大学经济学学士，具有证券投资基金从业资格。2003 年 10 月起曾在台湾凯基证券上海研究部、工银瑞信基金管理有限公司、汇丰晋信基金管理有限公司、安信证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司担任研究员、高级研究员等职。2013 年 4 月加入本公司，先后担任研究员、投资经理、基金经理助理等职。2015 年 5 月 29 日至 2016 年 3 月 25 日担任量化动态多策略 alpha 资产管理计划投资经理。2016 年 4 月 7 日起担任太平灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理。中国国籍。
林开盛	本基金的基金经理	2017-05-09	-	8	上海财经大学金融学专业证券投资方向硕士。具有证券投资基金从业资格。2009 年 7 月至 2016 年 4 月在申银万国证券研究所任首席分析师，精通化工行业分析。2016 年 4 月加入本公司任研究发展部负责人，从事投资研究相关工作。2017 年 5 月 9 日起担任太平灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理。中国国籍。



翁锡赞	本基金的基金经理、太平日日金货币市场基金经理、太平日日鑫货币市场基金基金经理、固定收益部总监	2016-03-08	2017-05-09	13	<p>复旦大学金融学硕士，具有证券投资基金从业资格。</p> <p>2004年1月起曾在兴业基金管理有限公司（现兴全基金管理有限公司）任首席交易员和债券研究员，万家基金管理有限公司任基金经理助理，国泰基金管理有限公司任国泰货币市场证券投资基金基金经理（任职期间：2008年8月23日至2011年6月15日）、国泰金鹿保本增值混合证券投资基金基金经理（任职期间：2010年6月10日至2011年6月15日）、社保409、709组合投资经理，东吴证券股份有限公司任债券投资部副总经理，国泰君安（香港）有限公司任国泰君安巨龙中国固定收益基金（RQFII）基金经理（任职期间：2012年3月9日至2013年11月22日）、高级副总裁，在本公司任中原英石货币市场基金基金经理（任职期间：2014年9月11日至2015年10月21日该基金合同已终止）；太平灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理（任职期间：2016年3月8日至2017年5月9日）；太平日日金货币市场基金基金经理（任职期间：2016年11月4日至2017年12月12日）；太平日日鑫货币市场基金基金经理（任职期间：2017年3月15日至2017年12月20日）。中国国籍。</p>
-----	--	------------	------------	----	--

注：1、基金经理的任职日期和离职离任日期一般情况下指为公司对外公告之日；

若该基金经理自本基金基金合同生效之日起即任职，则任职日期指本基金基金合同生效之日；

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关

规定。

#### **4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明**

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

#### **4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明**

##### **4.3.1 公平交易制度和控制方法**

在内控制度方面，公司根据相关法律法规制订了规范的投资管理制度和公平交易管理制度，以确保公司管理的不同投资组合得到公平对待，保护投资者合法权益。

在投资决策方面，研究团队为公司所有投资组合提供平等、公平的研究支持，所有投资组合共享公司统一的投资研究平台；严格实行各类资产管理业务之间的业务隔离和人员隔离制度，保证不同投资组合经理之间投资决策的独立性，各投资组合的持仓及交易信息等均有效隔离。在交易执行方面，实行集中交易制度，建立公平的交易分配制度，保证交易在各投资组合间的公正实施。在监控和稽核方面，交易部门在交易执行过程中对公平交易实施一线监控与报告，稽核风控部对投资交易行为进行持续监督和评估，定期进行公平交易的分析工作，每季度和每年度对不同投资组合的收益率差异以及同向交易和反向交易情况进行分析，加强对公平交易过程和结果的监督。

##### **4.3.2 公平交易制度的执行情况**

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

本报告期内，本基金管理人对不同投资组合的整体收益率差异、分投资类

别的收益率差异以及不同时间窗口（如日内、3日内、5日内）同向交易的交易价差进行分析，分析结果显示本投资组合与公司管理的其他投资组合在同向交易价差方面未出现异常。

#### **4.3.3 异常交易行为的专项说明**

本报告期内，未发生本基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情形，未发现可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

### **4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明**

#### **4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析**

本基金于2016年底出现较大金额的申购，2017年年初之时积极应对，逐步提高仓位，并且配置以行业有复苏迹象并且估值较低的大消费板块为主，取得了较好的收益。第三季度以后，随着供给侧改革的加深，周期行业纷纷出现了较大的涨幅，本基金也顺势进行了一系列的配置，获取较好收益。随着第四季度估值切换概念的显现，本基金在控制仓位的同时，又一次以大消费板块为主，适当加配房地产、金融板块。着眼未来，以大消费、金融地产为主，部分周期为辅的配置为2018年打下了良好的基础。

#### **4.4.2 报告期内基金的业绩表现**

本报告期内，本基金的份额净值增长率为13.96%，同期业绩比较基准收益率为3.56%。

### **4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望**

展望2018年，我们倾向于上半年的经济环境或许会好于下半年，市场的机会可能在上半年会更多一点。由于全球经济复苏，中国自身经济的韧性，中国经济在上半年可能依然会维持原有的态势运行。而中国乃至全球经济的最大的不确定性可能将来自于美国，我们也将紧密跟踪美国的经济表现、货币政策等影响较大的事件。从市场角度看，可能全年都不乏亮点。2017年大消费领衔的蓝筹股行情可能会有一定的持续性，但是扩散性将更加明显。龙头的溢价或许会转变为对于真正持续性增长的行业以及公司的溢价。随着金融、地产内在的

供给侧转变，金融地产的龙头受益于其稀缺性，或许也将会有较好的表现。我们可能将会在上半年，寻找有估值安全边际的成长股、受益于金融地产内生供给侧改革、基本面改善的行业等方面的投资机会，并适当地控制仓位，力争给投资者满意的回报。

#### **4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明**

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

#### **4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

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

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

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

## **§ 5 托管人报告**

### **5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明**

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

## 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

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

## § 6 审计报告

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）对太平灵活配置混合型发起式证券投资基金 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）变动表以及财务报表附注出具了标准无保留意见的审计报告【普华永道中天审字(2018)第 21603 号】。投资者可通过本基金年度报告正文查看该审计报告全文。

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：太平灵活配置混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2017 年 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	205,944,517.73	995,391,551.44
结算备付金		9,497,574.01	31,507.51
存出保证金		817,423.47	13,356.15
交易性金融资产	7.4.7.2	888,345,184.10	8,666,191.00
其中：股票投资		661,808,184.10	8,116,906.00
基金投资		-	-
债券投资		226,537,000.00	549,285.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	700,000,000.00	504,901,677.35
应收证券清算款		262,181.65	-
应收利息	7.4.7.5	4,784,649.03	263,027.65
应收股利		-	-
应收申购款		1,198.20	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
<b>资产总计</b>		<b>1,809,652,728.19</b>	<b>1,509,267,311.10</b>
<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>
负债：		-	-
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		199,974,619.18	-
应付赎回款		-	4,170.06
应付管理人报酬		2,023,795.19	134,410.62

应付托管费		337,299.22	22,401.75
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	801,045.69	17,726.94
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	272,300.00	160,007.84
<b>负债合计</b>		<b>203,409,059.28</b>	<b>338,717.21</b>
<b>所有者权益：</b>		-	-
实收基金	7.4.7.9	2,138,644,680.61	2,289,482,565.25
未分配利润	7.4.7.1 0	-532,401,011.70	-780,553,971.36
<b>所有者权益合计</b>		<b>1,606,243,668.91</b>	<b>1,508,928,593.89</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>		<b>1,809,652,728.19</b>	<b>1,509,267,311.10</b>

注：1、报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.751 元，基金份额总额 2,138,644,680.61 份。

2、本摘要中资产负债表和利润表所列附注号为年度报告正文中对应的附注号，投资者欲了解相应附注的内容，应阅读登载于基金管理人网站的年度报告正文。

## 7.2 利润表

会计主体：太平灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 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		250,379,845.25	-1,129,747.28

1. 利息收入		23,152,445.70	339,113.91
其中：存款利息收入	7.4.7.1 1	5,583,108.98	212,799.73
债券利息收入		6,233,342.40	15,004.41
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		11,335,994.32	111,309.77
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		107,854,147.39	-1,065,097.30
其中：股票投资收益	7.4.7.1 2	95,345,143.94	-1,117,833.99
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.1 3	815,856.12	-2,876.50
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.1 4	-	-
股利收益	7.4.7.1 5	11,693,147.33	55,613.19
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.1 6	119,227,082.14	-412,575.62
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 7	146,170.02	8,811.73
<b>减：二、费用</b>		<b>39,123,540.29</b>	<b>600,253.12</b>
1. 管理人报酬		23,662,573.44	275,441.33
2. 托管费		3,943,762.23	45,906.92



3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.1 8	11,287,512.86	92,004.87
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.1 9	229,691.76	186,900.00
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>211,256,304.96</b>	<b>-1,730,000.40</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>211,256,304.96</b>	<b>-1,730,000.40</b>

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：太平灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期：2017年1月1日至2017年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）	2,289,482,565.25	-780,553,971.36	1,508,928,593.89
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	211,256,304.96	211,256,304.96
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）	-150,837,884.64	36,896,654.70	-113,941,229.94

其中：1. 基金申购款	2, 866, 421. 75	-886, 666. 17	1, 979, 755. 58
2. 基金赎回款	-153, 704, 306. 39	37, 783, 320. 87	-115, 920, 985. 52
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	2, 138, 644, 680. 61	-532, 401, 011. 70	1, 606, 243, 668. 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）	16, 209, 168. 25	-3, 483, 995. 27	12, 725, 172. 98
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-1, 730, 000. 40	-1, 730, 000. 40
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, 273, 273, 397. 00	-775, 339, 975. 69	1, 497, 933, 421. 31
其中：1. 基金申购款	2, 277, 779, 974. 91	-776, 619, 765. 59	1, 501, 160, 209. 32
2. 基金赎回款	-4, 506, 577. 91	1, 279, 789. 90	-3, 226, 788. 01
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	2, 289, 482, 565. 25	-780, 553, 971. 36	1, 508, 928, 593. 89

(基金净值)			
--------	--	--	--

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告从 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：宋小龙，主管会计工作负责人：宋卫华，会计机构负责人：孙波

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

太平灵活配置混合型发起式证券投资基金(原名为中原英石灵活配置混合型发起式证券投资基金，以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2014]第 1392 号《关于准予中原英石灵活配置混合型发起式证券投资基金注册的批复》核准，由中原英石基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《中原英石灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 13,555,569.64 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2015)第 115 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《中原英石灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》于 2015 年 2 月 10 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 13,557,227.44 份基金份额，其中认购资金利息折合 1,657.80 份基金份额。本基金的基金管理人为太平基金管理有限公司，基金托管人为兴业银行股份有限公司。

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

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《太平灵活配置混合型发起式

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

本财务报表由本基金的基金管理人太平基金管理有限公司于 2018 年 3 月 30 日批准报出。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《太平灵活配置混合型发起式证券投资基金 基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定，发起式基金的基金合同生效三年后，若基金资产净值低于人民币两亿元的，基金合同自动终止。于 2017 年 12 月 31 日，本基金的基金资产净值为 1,606,243,668.91 元，且本基金的基金合同将于未来 12 个月内生效满三年，本基金的管理人预计基金资产净值届时将高于人民币两亿元，故本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2017 年度 财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期未发生重大会计差错的内容和更正金额。

#### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于2016年5月1日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自2016年5月1日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付

利息时代扣代缴 20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

#### 7.4.7 关联方关系

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年12月31日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月 31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
中原证券	-	-	15,881,665.94	23.51%

#### 7.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

#### 7.4.8.1.3 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的债券交易。

#### 7.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

#### 7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
-	-	-	-	-
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
中原证券	11,614.32	21.16%	6,539.17	40.74%

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

## 7.4.8.2 关联方报酬

### 7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年 12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年 12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	23,662,573.44	275,441.33
其中：支付销售机构的客户维护 费	4,278.53	5,657.51

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 1.50% / 当年天数。

### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年 12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年 12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	3,943,762.23	45,906.92

注：支付基金托管人兴业银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

### 7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

### 7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

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

份额单位：份



项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年 12月31日	2016年1月1日至2016年 12月31日
报告期初持有的基金份额	10,001,375.14	10,001,375.14
报告期内申购/买入总份额	-	-
报告期内因拆分变动份额	-	-
减：报告期内赎回/卖出总 份额	-	-
报告期末持有的基金份额	10,001,375.14	10,001,375.14
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.47%	0.44%

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

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

本基金本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

#### 7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2017年1月1日至2017年12月 31日		2016年1月1日至2016年12月 31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
兴业银行	205,944,517.73	5,484,135.10	995,391,551.44	212,141.22

注：本基金的银行存款由基金托管人兴业银行保管，按银行同业利率计息。

#### 7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2017年1月1日至2017年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位: 股/张)	总金额
中原证券	601019	山东出版	网下申购	12,630.00	128,320.80
中原证券	603103	横店影视	网下申购	2,021.00	31,224.45
中原证券	601949	中国出版	网下申购	14,559.00	48,627.06
上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位: 股/张)	总金额
-	-	-	-	-	-

#### 7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

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

##### 7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.9.1.1 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
603080	新疆火炬	2017-12-25	2018-01-03	新股未上市	13.60	13.60	1,187	16,143.20	16,143.20	-
603161	科华控股	2017-12-28	2018-01-05	新股未上市	16.75	16.75	1,239	20,753.25	20,753.25	-
002923	润都股份	2017-12-28	2018-01-05	新股未上	17.01	17.01	954	16,222	16,222	

				市				7.54	7.54	
300664	鹏鹞环保	2017-12-28	2018-01-05	新股未上市	8.88	8.88	3,640	32,323.20	32,323.20	-

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

#### 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	复牌开盘价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600332	白云山	2017-10-31	重大事项	32.14	2018-01-08	30.15	400,000.00	13,196,348.48	12,856,000.00	-
601600	中国铝业	2017-09-12	重大事项	8.09	2018-02-26	7.28	1,430,000.00	7,979,114.49	11,568,700.00	-
002919	名臣健康	2017-12-28	重大事项	35.26	2018-01-02	38.79	821.00	10,311.76	28,948.46	-

#### 7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末无从事债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2017 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 637,035,431.30 元，属于第二层次的余额为 251,309,752.80 元，无属于第三层次的余额(2016 年 12 月 31 日：第一层次 8,116,906.00 元，第二层次 549,285.00 元，无第三层次)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

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

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 增值税

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

根据财政部、国家税务总局于 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳

增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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

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

(3) 除公允价值和增值税外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	661,808,184.10	36.57
	其中：股票	661,808,184.10	36.57
2	固定收益投资	226,537,000.00	12.52
	其中：债券	226,537,000.00	12.52
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	700,000,000.00	38.68
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-

6	银行存款和结算备付金合计	215,442,091.74	11.91
7	其他各项资产	5,865,452.35	0.32
8	合计	1,809,652,728.19	100.00

## 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	584,650,403.56	36.40
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,143.20	0.00
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	17,942.76	0.00
H	住宿和餐饮业	9,791,972.00	0.61
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	17,492,270.78	1.09
K	房地产业	49,807,128.60	3.10
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	32,323.20	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-

R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	661,808,184.10	41.20

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	80,000	55,799,200.00	3.47
2	601155	新城控股	1,699,902	49,807,128.60	3.10
3	000858	五粮液	620,000	49,525,600.00	3.08
4	000568	泸州老窖	620,000	40,920,000.00	2.55
5	000333	美的集团	680,000	37,692,400.00	2.35
6	000651	格力电器	750,000	32,775,000.00	2.04
7	002677	浙江美大	1,699,912	28,813,508.40	1.79
8	600809	山西汾酒	400,000	22,796,000.00	1.42
9	601233	桐昆股份	1,010,000	22,714,900.00	1.41
10	300274	阳光电源	1,109,940	20,833,573.80	1.30

### 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	000878	云南铜业	186,198,946.67	12.34
2	600497	驰宏锌锗	121,171,779.54	8.03
3	000937	冀中能源	115,566,933.97	7.66
4	601155	新城控股	92,048,219.67	6.10
5	000983	西山煤电	90,618,448.39	6.01
6	000898	鞍钢股份	86,421,527.76	5.73

7	000060	中金岭南	84,443,727.03	5.60
8	001979	招商蛇口	78,002,981.32	5.17
9	601009	南京银行	71,358,566.67	4.73
10	000709	河钢股份	71,094,211.00	4.71
11	002677	浙江美大	68,585,502.53	4.55
12	600594	益佰制药	68,058,582.30	4.51
13	600166	福田汽车	64,769,140.00	4.29
14	601668	中国建筑	60,922,387.60	4.04
15	600585	海螺水泥	60,866,587.65	4.03
16	300182	捷成股份	58,798,558.79	3.90
17	600809	山西汾酒	57,058,453.33	3.78
18	600519	贵州茅台	55,323,088.02	3.67
19	600030	中信证券	51,425,680.44	3.41
20	000997	新大陆	48,230,728.80	3.20
21	601857	中国石油	47,809,215.00	3.17
22	000568	泸州老窖	45,147,398.19	2.99
23	000887	中鼎股份	44,398,158.03	2.94
24	300503	昊志机电	42,789,646.98	2.84
25	601118	海南橡胶	42,153,384.22	2.79
26	601318	中国平安	38,794,549.38	2.57
27	002508	老板电器	38,065,768.70	2.52
28	603609	禾丰牧业	37,701,046.63	2.50
29	603588	高能环境	36,070,519.62	2.39
30	000050	深天马 A	35,365,629.11	2.34
31	600500	中化国际	34,719,822.59	2.30
32	300136	信维通信	34,617,343.35	2.29
33	601966	玲珑轮胎	33,647,875.00	2.23
34	000998	隆平高科	33,473,602.94	2.22
35	000001	平安银行	32,413,119.50	2.15
36	603589	口子窖	32,163,966.00	2.13
37	600027	华电国际	32,158,226.94	2.13
38	601919	中远海控	30,690,047.22	2.03

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

#### 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	000878	云南铜业	186,910,917.04	12.39
2	600497	驰宏锌锗	131,013,126.45	8.68
3	000937	冀中能源	122,636,981.72	8.13
4	000983	西山煤电	94,707,052.42	6.28
5	000060	中金岭南	89,915,133.68	5.96
6	000898	鞍钢股份	87,167,042.71	5.78
7	000709	河钢股份	83,774,131.47	5.55
8	001979	招商蛇口	77,618,390.18	5.14
9	601009	南京银行	75,990,193.92	5.04
10	601155	新城控股	72,437,711.43	4.80
11	601668	中国建筑	69,869,422.91	4.63
12	600166	福田汽车	69,040,074.00	4.58
13	300182	捷成股份	60,751,440.83	4.03
14	002677	浙江美大	58,108,965.82	3.85
15	600594	益佰制药	56,377,780.01	3.74
16	600030	中信证券	51,849,925.00	3.44
17	600585	海螺水泥	48,631,992.26	3.22
18	601857	中国石油	48,024,691.08	3.18
19	000997	新大陆	47,557,018.00	3.15
20	600809	山西汾酒	44,846,697.74	2.97
21	300136	信维通信	44,136,353.21	2.93
22	000887	中鼎股份	40,876,488.25	2.71
23	603588	高能环境	38,728,426.00	2.57
24	300503	昊志机电	37,295,298.10	2.47
25	601118	海南橡胶	36,663,014.46	2.43
26	000998	隆平高科	36,491,692.66	2.42
27	603609	禾丰牧业	35,314,025.33	2.34
28	000001	平安银行	33,195,151.36	2.20
29	002234	民和股份	33,175,150.48	2.20
30	600909	华安证券	32,938,349.04	2.18
31	601919	中远海控	32,186,028.05	2.13
32	600027	华电国际	30,962,428.95	2.05

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

#### 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	4,450,457,792.08
卖出股票的收入（成交）总额	4,013,765,179.52

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

### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	146,268,000.00	9.11
	其中：政策性金融债	146,268,000.00	9.11
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	50,020,000.00	3.11
6	中期票据	30,249,000.00	1.88
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	226,537,000.00	14.10

### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	170410	17 农发 10	600,000	59,682,000.00	3.72
2	071721011	17 渤海证 券 CP011	500,000	50,020,000.00	3.11
3	170210	17 国开 10	500,000	46,670,000.00	2.91
4	101468005	14 中铝业	300,000	30,249,000.00	1.88

		MTN001			
5	170204	17 国开 04	200,000	19,960,000.00	1.24

### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资 明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益 明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

#### 8.10.2 本基金投资股指期货的 投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易 情况说明

#### 8.11.1 本期国债期货 投资政策

根据本基金基金合同的约定，本基金不进行国债期货交易。

#### 8.11.2 报告期末本基金 投资的国债期货持仓和损益 明细

根据本基金基金合同的约定，本基金不进行国债期货交易。

#### 8.11.3 本期国债期货 投资评价

根据本基金基金合同的约定，本基金不进行国债期货交易。

### 8.12 投资组合报告附注

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

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

### 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	817,423.47
2	应收证券清算款	262,181.65
3	应收股利	-
4	应收利息	4,784,649.03
5	应收申购款	1,198.20
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,865,452.35

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本特定资产本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## §9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例

251	8,520,496.74	2,135,118,479.97	99.84%	3,526,200.64	0.16%
-----	--------------	------------------	--------	--------------	-------

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	1,480,900.29	0.07%

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	0

### 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	10,001,375.14	0.47%	10,001,375.14	0.47%	3年
基金管理人高级管理人员	1,460,323.02	0.07%	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	20,577.27	0.001%	-	-	-
合计	11,482,275.43	0.537%	10,001,375.14	0.47%	-

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2015年2月10日)基金份额总额	13,557,227.44
---------------------------	---------------

本报告期期初基金份额总额	2,289,482,565.25
本报告期基金总申购份额	2,866,421.75
减：本报告期基金总赎回份额	153,704,306.39
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,138,644,680.61

## § 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

#### 1、基金管理人的重大人事变动情况

(1) 经太平基金管理有限公司第二届董事会 2017 年第十一次会议审议通过，于 2017 年 12 月 12 日起聘请邱宏斌先生为公司副总经理。上述事项已按规定向中国证券投资基金业协会和中国证券监督管理委员会上海监管局备案，并于 2017 年 12 月 14 日发布了《太平基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更的公告》。

(2) 经太平基金管理有限公司第二届董事会 2017 年第十二次会议审议通过，于 2017 年 12 月 25 日起聘请吴东先生为公司副总经理。上述事项已按规定向中国证券投资基金业协会和中国证券监督管理委员会上海监管局备案，并于 2017 年 12 月 26 日发布了《太平基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更的公告》。

#### 2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

本报告期内基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 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基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

#### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

#### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日（2015年2月10日）起聘请普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务，本报告期内本基金未改聘为其提供审计服务的会计师事务所。本报告期内应支付的审计费用为人民币陆万叁仟元整。

#### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

#### 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	
中原证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	1	1,701,855,040.15	20.12%	1,244,567.09	19.10%	-
兴业证券	1	1,480,528,376.66	17.50%	1,378,817.61	21.16%	-
招商证券	1	1,144,533,934.45	13.53%	1,065,901.60	16.36%	-
中泰证券	1	1,069,945,986.56	12.65%	771,553.07	11.84%	-
中信建投	2	992,478,502.78	11.73%	725,800.54	11.14%	-
国海证券	1	705,241,792.67	8.34%	515,741.90	7.91%	-
华泰证券	2	612,381,012.31	7.24%	264,119.36	4.05%	-

申万宏源证券	2	449,372,327.73	5.31%	328,627.00	5.04%	-
西南证券	1	303,121,281.52	3.58%	221,673.20	3.40%	-

注：1、交易单元的选择标准和程序

拟被基金管理人租用交易单元的券商应符合以下标准：

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

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

#### 2、报告期内基金租用券商交易单元的变更情况

本期新增中泰证券1个交易单元，中信建投2个交易单元，华泰证券2个交易单元，申万宏源证券2个交易单元，西南证券1个交易单元。

#### 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		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
中原证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	721,026.01	16.98%	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	880,000,000.00	14.61%	-	-



中泰证券	3,525,468.30	83.02%	1,070,000,000.00	17.76%	-	-
中信建投	-	-	200,000,000.00	3.32%	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	2,630,000,000.00	43.65%	-	-
申万宏源证券	-	-	1,245,000,000.00	20.66%	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-

## § 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	20170101-20171231	2,276,174,506.83	0.00	151,057,402.00	2,125,117,104.83	99.37%
<b>产品特有风险</b>							
<p>(1) 本基金作为混合型基金，投资于股票、债券、货币市场工具、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。因此股市、债市的变化将影响到本基金的业绩表现。</p> <p>(2) 本基金可投资于中小企业私募债。本基金所投资的中小企业私募债券之债务人如出现违约，或在交易过程中发生交收违约，或由于中小企业私募债券信用质量降低导致价格下降，可能造成基金财产损失。此外，受市场规模及交易活跃程度的影响，中小企业私募债券可能无法在同一价格水平上进行较大数量的买入或卖出，存在一定的流动性风险。</p> <p>(3) 本基金可投资于股指期货，股指期货作为一种金融衍生品，面临的主要风险是市场风险、流动性风险、基差风险和保证金风险。具体为：  ①市场风险是指由于股指期货价格变动而给投资人带来的风险。市场风险是股指期货投资中最主要的风险。  ②流动性风险是指由于股指期货合约无法及时变现所带来的风险。  ③基差风险是指股指期货合约价格和标的指数价格之间价格差的波动所造成的风险，以及不同股指期货合约价格之间价格差的波动所造成的期限价差风险。  ④保证金风险是指由于无法及时筹措资金满足建立或维持股指期货合约头寸所要求的保证金而带来的风险。</p> <p>(4) 本基金为发起式基金，基金合同生效三年后，若基金资产净值低于2亿元的，基</p>							

金合同自动终止，投资者将面临基金合同可能终止的不确定性风险。

## 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

由此给投资人带来的不便敬请谅解。

特此公告。

太平基金管理有限公司

二〇一八年四月十二日