

泰康策略优选灵活配置混合型证券投资基金 2017 年年度报告摘要

2017 年 12 月 31 日

基金管理人：泰康资产管理有限责任公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2018 年 3 月 29 日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及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(以下简称“工商银行”)根据本基金合同规定，于 2018 年 3 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告财务资料已经审计，普华永道中天会计师事务所有限公司（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，基金管理人在本报告中对相关事项亦有详细说明，请投资者注意阅读。

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

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	泰康策略优选混合
基金主代码	003378
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 11 月 28 日
基金管理人	泰康资产管理有限责任公司
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	745,592,565.30 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	积极主动地配置资产，并通过对类属资产灵活运用多种策略，在合理控制风险的基础上，追求超越业绩比较基准的收益水平，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金将利用基金管理人多年来在宏观经济分析上的丰富经验和积累，通过基金管理人自身研发构建的固定收益投资决策分析体系（FIFAM 系统）和权益投资决策分析体系（MVPCT 系统）定期评估宏观经济和投资环境，并对全球及国内经济发展进行评估和展望。在此基础上，判断未来市场投资环境的变化以及市场发展的主要推动因素，预测关键经济变量，并运用泰康资产配置模型，根据股票和债券资产的预期收益和风险，确定大类资产配置比例。 股票投资方面，本基金将结合市场环境灵活运用多种投资策略，多维度分析股票的投资价值，充分挖掘市场中潜在的投资机会，实现基金资产的长期稳健增值。 债券投资方面，本基金根据中长期的宏观经济走势和经济周期波动趋势，判断债券市场的未来走势，并形成对未来市场利率变动方向的预期，动态调整组合的久期和期限结构配置。另外，本基金将利用内部信用评级体系对债券发行人及其发行的债券进行信用评估，分析违约风险以及合理信用利差水平，识别信用债的投资价值。
业绩比较基准	60%*沪深 300 指数收益率+35%*中债新综合财富(总值)指数收益率+5%*金融机构人民币活期存款利率(税后)
风险收益特征	本基金为混合型基金，预期收益和预期风险水平低于股票型基金，高于债券型基金与货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		泰康资产管理有限责任公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责	姓名	陈玮光	郭明

人	联系电话	010-58753683	010-66105799
	电子邮箱	chenwg06@taikangamc.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4001895522	95588
传真		010-57818785	010-66105798

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.tkfunds.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人办公地、基金托管人的住所

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2017 年	2016 年 11 月 28 日(基金合同生效日)-2016 年 12 月 31 日
本期已实现收益	51,280,733.09	1,024,609.37
本期利润	118,150,827.62	1,583,528.53
加权平均基金份额本期利润	0.1538	0.0046
本期基金份额净值增长率	15.01%	0.46%
3.1.2 期末数据和指标	2017 年末	2016 年末
期末可供分配基金份额利润	0.0290	0.0030
期末基金资产净值	831,466,518.50	347,318,305.75
期末基金份额净值	1.1152	1.0046

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。

（3）本基金所述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。

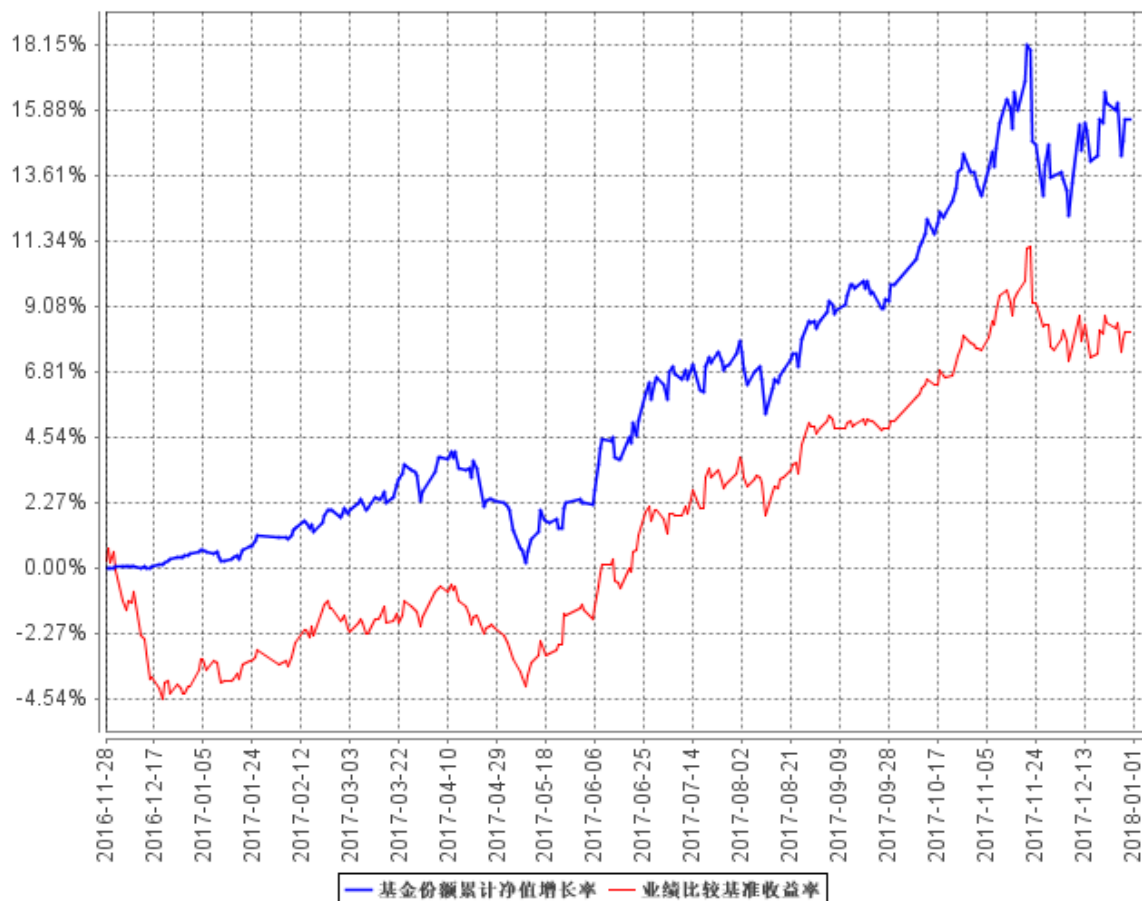
3.2 基金净值表现

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	5.21%	0.75%	2.91%	0.48%	2.30%	0.27%
过去六个月	8.40%	0.59%	6.07%	0.42%	2.33%	0.17%
过去一年	15.01%	0.48%	12.80%	0.38%	2.21%	0.10%
自基金合同生效起至今	15.54%	0.46%	8.16%	0.40%	7.38%	0.06%

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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

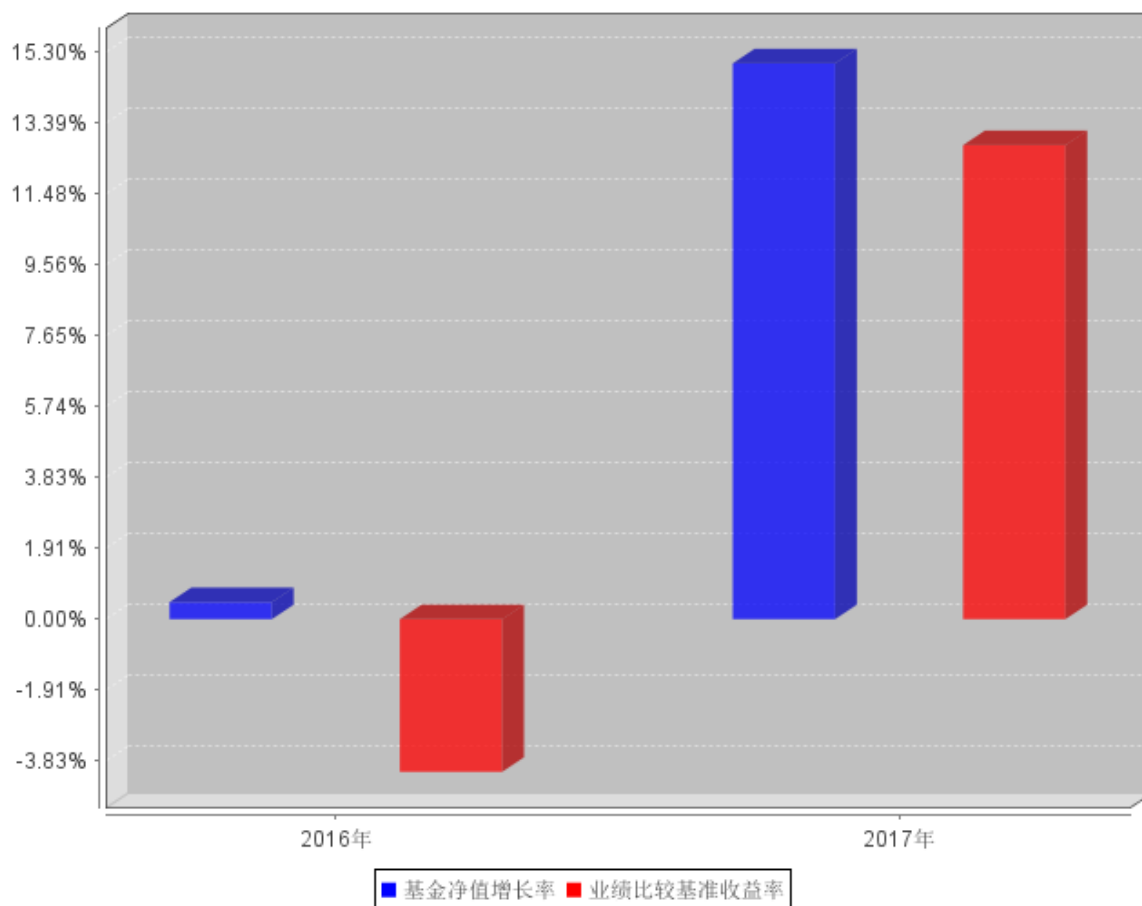


注：1、本基金基金合同于 2016 年 11 月 28 日生效。

2、按照本基金的基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定，建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合基金合同约定。

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

自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金成立于 2016 年 11 月 28 日，2016 年度净值增长率的计算期间为 2016 年 11 月 28 日至 2016 年 12 月 31 日。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额 分红数	现金形式发放 总额	再投资形式发 放总额	年度利润分配合 计	备注
2017	0.4100	5,191,949.51	25,171,902.03	30,363,851.54	注：-
2016	-	-	-	-	注：-
合计	0.4100	5,191,949.51	25,171,902.03	30,363,851.54	注：-

§ 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

泰康资产管理有限责任公司(以下简称“泰康资产”或“公司”)成立于 2006 年 2 月,前身为泰康人寿保险股份有限公司资产管理中心。泰康资产具有丰富的多领域资产配置经验,投资范围涵盖固定收益投资、权益投资、境外投资、基础设施及不动产投资、股权投资、金融产品投资等,所提供的服务和产品包括保险资金投资管理、另类项目投资管理、企业年金投资管理、金融同业业务、财富管理服务、资产管理产品、养老金产品、境外理财产品、QDII(合格境内机构投资者)专户、公募基金产品等。

2015 年 4 月,泰康资产公募基金管理业务资格正式获得监管机构批准,成为首家获得该业务资格的保险资产管理公司。截至 2017 年 12 月 31 日,公司管理着泰康薪意保货币市场基金、泰康新回报灵活配置混合型证券投资基金、泰康新机遇灵活配置混合型证券投资基金、泰康稳健增利债券型证券投资基金、泰康安泰回报混合型证券投资基金、泰康沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金、泰康宏泰回报混合型证券投资基金、泰康恒泰回报灵活配置混合型证券投资基金、泰康丰盈债券型证券投资基金、泰康安益纯债债券型证券投资基金、泰康策略优选灵活配置混合型证券投资基金、泰康安惠纯债债券型证券投资基金、泰康沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金、泰康金泰回报 3 个月定期开放混合型证券投资基金、泰康兴泰回报沪港深混合型证券投资基金、泰康年年红纯债一年定期开放债券型证券投资基金、泰康现金管家货币市场基金、泰康泉林量化价值精选混合型证券投资基金、泰康安悦纯债 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、泰康景泰回报混合型证券投资基金和泰康瑞坤纯债债券型证券投资基金共二十一只公开募集证券投资基金。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
任慧娟	本基金基金经理	2016 年 12 月 21 日	—	11	任慧娟于 2015 年 8 月加入泰康资产管理有限责任公司,现担任公募事业部固定收益投资经理。2007 年 7 月至 2008 年 7 月在阳光财产保险公司资金运用部统计分析岗工作,2008

					年 7 月至 2011 年 1 月在阳光保险集团资产管理中心历任风险管理岗、债券研究岗，2011 年 1 月起任固定收益投资经理，至 2015 年 8 月在阳光资产管理公司固定收益部投资部任高级投资经理。2015 年 12 月 9 日至今担任泰康薪意保货币市场基金基金经理。2016 年 5 月 9 日至今担任泰康新机遇灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2016 年 7 月 13 日至今担任泰康恒泰回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2016 年 8 月 24 日至今担任泰康丰盈债券型证券投资基金基金经理。2016 年 12 月 21 日至今担任泰康策略优选灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2017 年 9 月 8 日至今担任泰康现金管家货币市场基金基金经理。
桂跃强	本基金基金经理	2016 年 11 月 28 日	-	11	桂跃强于 2015 年 8 月加入泰康资产，现担任公募事业部股票投资负责人。2007 年 9 月至 2015 年 8 月曾任职于新华基金管理有限公司，担任基金管理部副总监。历任新华泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华中小市值优选混合型证券投资基金基金经理、新华信用增益债券型证券投资基金基金经理、新华行

					业周期轮换股票型证券投资基金基金经理。 2015 年 12 月 8 日至今任泰康新机遇灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2016 年 6 月 8 日至今任泰康宏泰回报混合型证券投资基金基金经理。2016 年 11 月 28 日起至今担任泰康策略优选灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2017 年 6 月 15 日起至今担任泰康兴泰回报沪港深混合型证券投资基金基金经理。2017 年 6 月 20 日起至今担任泰康恒泰回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2017 年 12 月 13 日起至今担任泰康景泰回报混合型证券投资基金基金经理。 2018 年 1 月 19 日至今任泰康均衡优选混合型证券投资基金基金经理。
金宏伟	本基金基金经理	2017 年 8 月 28 日	-	6	金宏伟于 2016 年 12 月加入泰康资产，现任公募事业部投资部股票投资总监。2006 年 7 月至 2012 年 3 月曾任中钢集团工程总包项目经理、工程师、国际商务师。2012 年 3 月至 2016 年 12 月历任新华基金行业研究员、中上游行业组长、中游及 TMT 行业组长、研究部总监助理、专户投资部投资经理。2017 年 8 月 28 日至今担任泰康新机遇灵活配置混合型证券投资基金、泰康策

					略优选灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
经惠云	本基金基金经理	2017 年 12 月 25 日	-	9	经惠云于 2016 年 10 月加入泰康资产管理有限责任公司，现担任公募事业部投资部固定收益投资总监。2009 年 7 月至 2015 年 6 月在银华基金管理有限公司历任固定收益部研究员，以及银华中证成长股债恒定组合 30/70 指数证券投资基金、银华永兴纯债分级债券型发起式证券投资基金、银华信用双利债券型证券投资基金、银华中证中票 50 指数债券型证券投资基金（LOF）基金经理，2015 年 6 月至 2016 年 9 月在大成基金管理有限公司担任固定收益总部基金经理，期间曾任大成景华一年定期开放债券型证券投资基金基金经理。2017 年 12 月 25 日至今担任泰康策略优选灵活配置混合型证券投资基金、泰康景泰回报混合型证券投资基金、泰康年年红纯债一年定期开放债券型证券投资基金基金经理。

注：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。表中的任职日期和离任日期均指公司相关公告中的披露日期。

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《证券法》、《证券投资基金法》、本基金合同和其他有关法律法规的规定，在基金管理运作中，本基金的投资范围、投资比例、投资组合、证券交易行为、信息披露等符合有关法律法规、行业监管规则和基金合同等规定，本基金没有发生重大违法违规

行为,没有运用基金财产进行内幕交易和操纵市场行为以及进行有损基金投资人利益的关联交易,整体运作合法、合规。本基金将继续一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产,在规范基金运作和严格控制投资风险的前提下,努力为基金份额持有人谋求最大利益。

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

本基金管理人制定了公平交易制度和流程,并按照证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规的相关规定,从组织架构、岗位设置和业务流程、系统和制度建设、内控措施和信息披露等多方面,确保不同投资组合在投资管理活动中得到公平对待,杜绝不同投资组合之间进行利益输送,保护投资者合法权益。

公司公平交易管理制度要求交易以及投资管理过程中各个相关环节符合公平交易的监管要求。投资组合能够公平地获得投资信息、投资建议,并在投资决策委员会的制度规范下独立决策,实施投资决策时享有公平的机会。所有组合投资决策与交易执行保持隔离,任何组合必须经过公司交易部集中交易。各组合享有平等的交易权利,共享交易资源,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

本基金管理人公平对待旗下管理的所有基金和组合,建立了公平交易制度和流程,并严格执行。报告期内,本基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度,通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。在投资管理活动中,各投资组合按投资管理制度和流程独立决策,并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金管理人建立了异常交易的监控与报告制度,对异常交易行为进行事前、事中和事后的监控。报告期内,没有出现本基金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 5%的情况。报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2017 年全年,宏观经济韧性较强,四季度的 GDP 增速分别是 6.9、6.9、6.8、6.8,上半年经济增速有所回升,下半年企稳。从三大需求来看,投资增速前高后低,但主要原因是基建投资增速的下滑,房地产投资的韧性较强,而制造业投资在四季度则有所回升;零售增速保持平稳,出口得益于全球经济复苏而显著改善。CPI 较为温和, PPI 小幅回落,但仍然保持高位。央行的货币

政策总体稳健中性，公开市场利率全年跟随美联储加息三次，流动性保持在紧平衡的态势。汇率方面，受经济韧性强、美元指数贬值的影响，人民币呈现震荡升值的态势。

权益市场方面，2017 年 A 股市场总体上涨，上证综指从 3100 点附近震荡上涨至 3300 点附近，涨幅 6.56%。但市场分化明显，大盘蓝筹走势强劲，中小创表现较弱。从行业来看，食品饮料、家电、非银金融、银行和强周期品种涨幅居前。

债券市场方面，利率震荡上行，全年调整的幅度较大。具体来看，年初由于跟随美联储调整公开市场利率，银监会“三三四”检查、金融监管趋严，利率有所上行；年中受到环保督察的影响，基本面小幅低于预期，同时监管强调协调推进，利率步入到震荡的行情；进入到四季度，十九大政通人和，修正了市场对经济的预期，同时通胀预期再起，资管新规等监管政策密集出台，多重利空叠加，导致利率快速上行。全年来看，10Y 国债上行 87bp，10Y 国开上行 114bp。

权益投资方面，基于对市场的判断，基金在下半年适当提高了权益仓位。基金主要配置了偏蓝筹价值风格的品种，并对少数长期前景看好、竞争优势突出、估值合理的成长品种，采取越跌越买策略，立足于长期持股。在行业上，基金重点参与了家用电器、银行、房地产、非银金融等板块，以及食品饮料、医药生物等受益于消费升级的板块。

固收投资方面，本基金采取了短久期配置策略，主要获取债券票息持有收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.1152 元；本报告期基金份额净值增长率为 15.01%，业绩比较基准收益率为 12.80%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，基本上，2018 年的经济仍然能维持较强的韧性。从投资来看，不受环保限产影响的行业，其投资增速一直保持在高位，内生增长的动能较强；从出口来看，尽管人民币近期有所升值，全球经济的强劲复苏，仍然对出口形成支撑；居民收入的回升、棚改的持续推进，也对 2018 年的消费形成利好。

权益市场方面，考虑到经济的稳健性和政策的灵活性明显增强，我们对中长期的市场保持谨慎乐观的观点。从经济上看，随着微观企业与个人活跃度的明显提升，经济有望保持较强增长动能。从政治环境上看，“十九大”提出新方位、新方略指引新征程，也将推升市场风险偏好。从板块上看，我们认为部分白马蓝筹股依然具备估值修复的空间。在 A 股市场开放背景下，A 股的估值标准将越来越国际化，2017 年蓝筹白马的估值修复幅度较为明显，但从历史和国际角度对这些板块估值与盈利等方面的横纵比较来看，家电、食品饮料、金融等行业在盈利和估值等方面相对全球同业仍具备相当的吸引力，部分蓝筹股持续上涨目前还具备基本面支持。此外，随着次龙

头股票估值和业绩的逐渐匹配，成长黑马也逐渐进入“击球区”，值得重点关注。

债券市场方面，从政策角度看，严监管不会改变，同时不少政策文件即将正式出台，市场仍然还有调整的压力；货币政策在基本面韧性强、金融防风险的背景下，稳健中性的基调仍将维持，资金面紧平衡的态势难以改变。从供需角度看，一季度债券的供给较少，但在银行缺负债的背景下，配置力量并不强劲。结合以上因素，债券市场仍然难以出现明显的趋势性机会。但也应该看到，目前市场在经历了快速的调整之后，短端收益率水平已经处于历史相对较高水平，具备了较好的配置价值，套息空间也比较充足。投资策略上，本基金计划继续采取短久期配置策略，力求获取较为稳定的票息持有价值。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照相关法律法规规定，设有估值小组，并制定了相关制度及流程。公司估值小组设成员若干名，成员由各相关部门组成，包括风险控制部、运营管理中心公募运营部、公募投资部、监察稽核部、公募产品部等。估值小组成员均具有相关工作经验及专业胜任能力。

本公司基金经理参与讨论估值原则及方法，但不参与最终估值决策。

本报告期内，本基金管理人根据《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》对在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票依据流动性折扣确定股票价值。参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突，一切以投资者利益最大化为最高准则。

与估值相关的机构包括上海、深圳证券交易所，中国证券登记结算有限责任公司，中央国债登记结算有限责任公司以及中国基金业协会等。

本基金所采用的估值流程及估值结果均已经过会计师事务所鉴证，并经托管银行复核确认。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，根据相关法律法规和基金合同要求以及实际运作情况，本基金应分配且已分配利润 30,363,851.54 元；本基金本报告期末无应分配而尚未分配利润的情况。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期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基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对泰康策略优选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，泰康策略优选灵活配置混合型证券投资基金的管理人——泰康资产管理有限责任公司在泰康策略优选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，泰康策略优选灵活配置混合型证券投资基金对基金份额持有人进行了 1 次利润分配，分配金额为 30,363,851.54 元。

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

本托管人依法对泰康资产管理有限责任公司编制和披露的泰康策略优选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。

§ 6 审计报告

本基金 2017 年年度报告经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计，注册会计师签字出具了无保留意见的审计报告。投资者可阅读年度报告正文查看审计报告全文。

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：泰康策略优选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	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	9,566,475.70	41,243,643.68
结算备付金	6,011,274.57	1,553,058.89
存出保证金	212,414.49	-
交易性金融资产	831,203,500.54	232,449,797.60
其中：股票投资	675,857,628.74	14,415,700.00
基金投资	-	-
债券投资	155,345,871.80	218,034,097.60
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	-	90,000,255.00
应收证券清算款	2,580,475.34	-
应收利息	4,826,059.23	1,273,346.86
应收股利	-	-
应收申购款	194,699.45	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	854,594,899.32	366,520,102.03
负债和所有者权益	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	11,924,122.11	14,898,457.65
应付证券清算款	9,486,165.36	3,753,400.91
应付赎回款	4,228.97	-
应付管理人报酬	1,044,518.38	439,817.77
应付托管费	174,086.38	73,302.95
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	300,815.66	11,218.57
应交税费	-	-
应付利息	13,940.80	3,398.43

应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	180,503.16	22,200.00
负债合计	23,128,380.82	19,201,796.28
所有者权益：		
实收基金	745,592,565.30	345,734,777.22
未分配利润	85,873,953.20	1,583,528.53
所有者权益合计	831,466,518.50	347,318,305.75
负债和所有者权益总计	854,594,899.32	366,520,102.03

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.1152 元，基金份额总额 745,592,565.30 份。

7.2 利润表

会计主体：泰康策略优选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	上年度可比期间 2016 年 11 月 28 日(基金 合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日
一、收入	140,350,920.68	2,211,409.60
1. 利息收入	22,719,903.81	1,535,798.55
其中：存款利息收入	894,091.37	143,131.14
债券利息收入	20,753,355.47	498,886.91
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	1,072,456.97	893,780.50
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	50,479,293.09	116,691.89
其中：股票投资收益	45,114,368.03	-29,258.00
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-1,652,728.65	145,949.89
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-280,350.00	-
股利收益	7,298,003.71	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	66,870,094.53	558,919.16
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	281,629.25	-
减：二、费用	22,200,093.06	627,881.07
1. 管理人报酬	12,163,853.66	468,158.42
2. 托管费	2,027,308.92	78,026.39

3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	2,343,262.08	11,801.91
5. 利息支出	5,214,899.78	34,541.35
其中：卖出回购金融资产支出	5,214,899.78	34,541.35
6. 其他费用	450,768.62	35,353.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	118,150,827.62	1,583,528.53
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	118,150,827.62	1,583,528.53

注：本基金合同生效日为 2016 年 11 月 28 日，上年度可比期间是指自基金合同生效日 2016 年 11 月 28 日至 2016 年 12 月 31 日止期间。

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：泰康策略优选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）	345,734,777.22	1,583,528.53	347,318,305.75
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	118,150,827.62	118,150,827.62
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）	399,857,788.08	-3,496,551.41	396,361,236.67
其中：1. 基金申购款	671,191,923.00	19,773,854.24	690,965,777.24
2. 基金赎回款	-271,334,134.92	-23,270,405.65	-294,604,540.57
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）	-	-30,363,851.54	-30,363,851.54
五、期末所有者权益（基金净值）	745,592,565.30	85,873,953.20	831,466,518.50
项目	上年度可比期间 2016 年 11 月 28 日(基金合同生效日)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）	345,734,777.22	-	345,734,777.22
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,583,528.53	1,583,528.53
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）	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
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）	345,734,777.22	1,583,528.53	347,318,305.75

注：本基金合同生效日为 2016 年 11 月 28 日，上年度可比期间是指自基金合同生效日 2016 年 11 月 28 日至 2016 年 12 月 31 日止期间。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>段国圣</u>	<u>魏宇</u>	<u>李俊佑</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

泰康策略优选灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2016]2044 号《关于准予泰康策略优选灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》核准，由泰康资产管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰康策略优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 345,628,317.48 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(2016)第 1543 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《泰康策略优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2016 年 11 月 28 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 345,734,777.22 份基金份额，其中认购资金利息折合 106,459.74 份基金份额。本基金的基金管理人为泰康资产管理有限责任公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司(以下简称“工商银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰康策略优选灵活配置混合型证券投资基金基

金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行上市交易的股票（包括中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票）、权证、股指期货、国债期货、债券（包括但不限于国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、证券公司短期公司债券、短期融资券、超短期融资券、中小企业私募债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款、其他银行存款）、同业存单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。

本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产比例为 0%-95%；基金持有全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%；每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持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%；其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；权证、股指期货、国债期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为：60%*沪深 300 指数收益率+35%*中债新综合财富（总值）指数收益率+5%*金融机构人民币活期存款利率（税后）

本财务报表由本基金的基金管理人泰康资产管理有限责任公司于 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》、《泰康策略优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2017 年度和 2016 年 11 月 28 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日止期间 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 日和 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年度和 2016 年 11 月 28 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日止期间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。本财务报表的实际编制期间为 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日 和 2016 年 11 月 28 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日止期

间。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

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

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具(主要为期货投资)等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，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

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

(2) 金融负债的分类

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具(主要为期货投资)按如下原则确定公允价值并进行估值：

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

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

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

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。

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

7.4.4.7 实收基金

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

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的

金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分确认为利息收入。

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

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益分配方式分两种：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。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。法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

（2）于 2017 年 12 月 28 日前，对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。自 2017 年 12 月 28 日起，对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）》，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

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

指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中央国债登记结算有限责任公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”),对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票,本基金自2017年12月28日起改为按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

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

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

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

(3)对基金取得的企业债券利息收入,应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%

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

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

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
泰康资产管理有限责任公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
泰康保险集团股份有限公司	基金管理人控股股东

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

本报告期及上年度可比期间 2016 年 11 月 28 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日，本基金无通过关联方交易单元进行的交易。

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 11 月 28 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	12,163,853.66	468,158.42
其中：支付销售机构的客户维护费	2,289,016.54	276,416.67

注：支付基金管理人泰康资产管理有限责任公司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 11 月 28 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日
----	--	--

	月 31 日	日)至 2016 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	2,027,308.92	78,026.39

注：支付基金托管人工商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

本报告期及上年度可比期间 2016 年 11 月 28 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日，本基金未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期及上年度可比期间 2016 年 11 月 28 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日，本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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

本报告期末及上年度末，除基金管理人之外的其他关联方未持有本基金份额。

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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2016 年 11 月 28 日(基金合同生效日)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
工商银行	9,566,475.70	40,735.22	11,243,643.68	43,534.48

注：本基金的银行存款由基金托管人工商银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期及上年度可比期间 2016 年 11 月 28 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日，本基金未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本报告期及上年度可比期间 2016 年 11 月 28 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日，本基金无须作说明的其他关联交易事项。

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

7.4.12.1.1 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 年 12 月 28 日	2018 年 1 月 5 日	网下新股流通受限	8.88	8.88	3,640	32,323.20	32,323.20	-
603161	科华控股	2017 年 12 月 28 日	2018 年 1 月 5 日	网下新股流通受限	16.75	16.75	1,239	20,753.25	20,753.25	-
002923	润都股份	2017 年 12 月 28 日	2018 年 1 月 5 日	网下新股流通受限	17.01	17.01	954	16,227.54	16,227.54	-
603080	新疆火炬	2017 年 12 月 25 日	2018 年 1 月 3 日	网下新股流通受限	13.60	13.60	1,187	16,143.20	16,143.20	-
002892	科力尔	2017 年 8 月 10 日	2018 年 8 月 17 日	老股转让流通受限	17.56	32.16	11,000	193,160.00	353,760.00	-
002859	洁美科技	2017 年 3 月 24 日	2018 年 4 月 9 日	老股转让流通受限	11.93	33.80	11,455	136,635.24	387,179.00	-
002860	星帅尔	2017 年 3 月 31 日	2018 年 4 月 12 日	老股转让流通受限	19.81	39.79	7,382	146,237.42	293,729.78	-

注：（1）基金可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。根据《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》，本基金持有的上市公司非公开发行股份，自股份解除限售之日起 12 个月内，通过集中竞价交易减持的数量不得超过其持有该次非公开发行股份数量的 50%；采取大宗交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 2%。此外，本基金通过大宗交易方式受让的原上市公司大股东减持或者特定股东减持的股份，在受让后 6 个月内，不得转让所受让的股份。

（2）基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

（3）截至本报告期末 2017 年 12 月 31 日止，本基金未持有因认购新发/增发证券而流通受限的债

券。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002507	涪陵榨菜	2017年12月4日	重大事项停牌	16.77	-	-	108,600	1,705,730.00	1,821,222.00	-
300383	光环新网	2017年11月7日	重大事项停牌	13.19	2018年3月19日	14.51	82,500	1,092,869.00	1,088,175.00	-
300730	科创信息	2017年12月25日	重大事项停牌	41.55	2018年1月2日	45.71	821	6,863.56	34,112.55	-

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 12 月 31 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 11924122.11 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量(张)	期末估值总额
120326	12进出26	2018年1月2日	100.00	75,000	7,500,000.00
120326	12进出26	2018年1月3日	100.00	46,000	4,600,000.00
合计				121,000	12,100,000.00

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 12 月 31 日止，本基金未持有在交易所市场债券正回购交易中作为质押的债券。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

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

低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b)持续的以公允价值计量的金融工具

(i)各层次金融工具公允价值

于 2017 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 671,794,003.22 元，属于第二层次的余额为 159,409,497.32 元，无属于第三层次的余额。(2016 年 12 月 31 日：第一层次 14,415,700.00 元，第二层次 218,034,097.6 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：(1) 金融商品持有期间(含到期)取得的非保本收益(合同中未明确承诺到期本金可全部收回的投资收益)，不征收增值税；(2) 纳税人购入基金、信托、理财产品等各类资产管理产品持有至到期，不属于金融商品转让；(3) 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。上述政策自 2016 年 5 月 1 日起执行。

此外，根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 10 日颁布的财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》及 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。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	675,857,628.74	79.09
	其中：股票	675,857,628.74	79.09
2	固定收益投资	155,345,871.80	18.18
	其中：债券	155,345,871.80	18.18
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	15,577,750.27	1.82
7	其他各项资产	7,813,648.51	0.91
8	合计	854,594,899.32	100.00

注：本基金本报告期内未通过港股通交易机制投资港股。

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	16,152,900.00	1.94
B	采矿业	3,209,971.00	0.39
C	制造业	386,342,267.07	46.47
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,383,112.20	0.29
E	建筑业	14,772,872.00	1.78
F	批发和零售业	25,145,462.54	3.02
G	交通运输、仓储和邮政业	8,003,412.76	0.96
H	住宿和餐饮业	2,641,484.31	0.32
I	信息传输、软件和信息技术服务业	16,493,013.87	1.98
J	金融业	108,198,735.28	13.01
K	房地产业	51,635,726.69	6.21
L	租赁和商务服务业	6,203,204.86	0.75
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	12,694,516.88	1.53
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	21,059,829.28	2.53
R	文化、体育和娱乐业	921,120.00	0.11
S	综合	-	-
	合计	675,857,628.74	81.29

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期内未通过港股通交易机制投资港股。

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	600036	招商银行	1,182,290	34,310,055.80	4.13
2	600585	海螺水泥	902,710	26,476,484.30	3.18
3	601318	中国平安	357,916	25,046,961.68	3.01
4	000651	格力电器	554,660	24,238,642.00	2.92
5	000333	美的集团	366,600	20,320,638.00	2.44
6	002048	宁波华翔	792,300	18,856,740.00	2.27
7	601939	建设银行	2,276,600	17,484,288.00	2.10
8	600622	光大嘉宝	927,500	16,667,175.00	2.00
9	002044	美年健康	721,344	15,775,793.28	1.90
10	601336	新华保险	200,579	14,080,645.80	1.69

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于基金管理人网站的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600585	海螺水泥	38,669,200.82	11.13
2	600036	招商银行	36,356,001.70	10.47
3	601318	中国平安	31,718,547.65	9.13
4	601336	新华保险	30,106,019.72	8.67
5	601939	建设银行	30,102,124.00	8.67
6	601668	中国建筑	25,117,786.00	7.23
7	000651	格力电器	24,954,308.26	7.18
8	000338	潍柴动力	23,965,142.97	6.90
9	001979	招商蛇口	23,567,955.27	6.79

10	000333	美的集团	21,136,007.66	6.09
11	000069	华侨城A	19,711,065.92	5.68
12	600068	葛洲坝	19,686,642.68	5.67
13	002048	宁波华翔	19,541,809.74	5.63
14	600584	长电科技	17,894,782.13	5.15
15	600690	青岛海尔	16,958,234.24	4.88
16	000895	双汇发展	16,881,642.50	4.86
17	600622	光大嘉宝	16,756,052.07	4.82
18	600519	贵州茅台	16,732,832.13	4.82
19	600196	复星医药	16,710,850.25	4.81
20	600208	新潮中宝	16,385,945.00	4.72
21	601288	农业银行	16,281,988.00	4.69
22	600887	伊利股份	16,092,527.44	4.63
23	600963	岳阳林纸	15,532,688.00	4.47
24	601988	中国银行	15,391,547.00	4.43
25	000858	五粮液	14,545,974.28	4.19
26	002043	兔宝宝	13,517,543.59	3.89
27	600276	恒瑞医药	13,404,206.00	3.86
28	002044	美年健康	12,744,091.16	3.67
29	601601	中国太保	12,403,834.45	3.57
30	000002	万科A	12,216,001.17	3.52
31	000402	金融街	11,570,382.83	3.33
32	600019	宝钢股份	11,412,560.83	3.29
33	600031	三一重工	10,729,739.00	3.09
34	002415	海康威视	10,630,675.87	3.06
35	002222	福晶科技	10,602,819.29	3.05
36	300228	富瑞特装	10,205,232.04	2.94
37	300630	普利制药	10,016,966.98	2.88
38	601607	上海医药	10,004,178.00	2.88
39	002798	帝王洁具	9,991,212.88	2.88
40	600388	龙净环保	9,584,083.00	2.76
41	002410	广联达	9,257,571.45	2.67
42	600104	上汽集团	9,170,367.96	2.64
43	002595	豪迈科技	9,121,213.00	2.63
44	000998	隆平高科	9,114,633.00	2.62
45	600521	华海药业	9,087,435.36	2.62

46	603816	顾家家居	8,433,061.62	2.43
47	601111	中国国航	8,084,088.00	2.33
48	600138	中青旅	8,028,869.80	2.31
49	601877	正泰电器	8,024,395.96	2.31
50	002221	东华能源	7,970,168.00	2.29
51	600029	南方航空	7,856,666.35	2.26
52	300124	汇川技术	7,773,952.10	2.24
53	601888	中国国旅	7,773,785.50	2.24
54	601233	桐昆股份	7,753,919.35	2.23
55	300121	阳谷华泰	7,745,597.00	2.23
56	000789	万年青	7,719,189.46	2.22
57	300456	耐威科技	7,586,625.12	2.18
58	002051	中工国际	7,471,007.00	2.15
59	601989	中国重工	7,456,224.00	2.15
60	002737	葵花药业	7,405,671.32	2.13
61	000902	新洋丰	7,259,599.87	2.09
62	002304	洋河股份	7,235,934.00	2.08
63	002493	荣盛石化	7,123,267.32	2.05
64	601933	永辉超市	6,978,548.00	2.01

注：（1）买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票。

（2）“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	601318	中国平安	26,230,122.01	7.55
2	000338	潍柴动力	22,206,333.50	6.39
3	601336	新华保险	19,514,342.12	5.62
4	600068	葛洲坝	17,544,674.74	5.05
5	600690	青岛海尔	16,472,843.38	4.74
6	601939	建设银行	16,449,081.44	4.74
7	600585	海螺水泥	16,236,799.75	4.67
8	601988	中国银行	15,940,623.00	4.59
9	001979	招商蛇口	14,918,366.87	4.30
10	601601	中国太保	14,342,796.56	4.13

11	600196	复星医药	14,232,292.07	4.10
12	000858	五 粮 液	13,701,445.44	3.94
13	600036	招商银行	12,464,741.61	3.59
14	000402	金 融 街	11,922,269.88	3.43
15	601668	中国建筑	11,825,347.19	3.40
16	600019	宝钢股份	10,761,705.97	3.10
17	601288	农业银行	10,616,593.00	3.06
18	600519	贵州茅台	9,436,337.09	2.72
19	002415	海康威视	9,162,591.10	2.64
20	600104	上汽集团	8,466,610.32	2.44
21	000069	华侨城 A	8,356,539.88	2.41
22	300228	富瑞特装	8,341,220.05	2.40
23	601233	桐昆股份	8,318,090.52	2.39
24	600031	三一重工	8,219,304.74	2.37
25	000333	美的集团	7,836,630.97	2.26
26	600276	恒瑞医药	7,622,415.65	2.19
27	002304	洋河股份	7,504,701.96	2.16
28	300630	普利制药	7,391,083.47	2.13
29	600887	伊利股份	7,296,456.69	2.10
30	000895	双汇发展	7,215,030.00	2.08
31	002493	荣盛石化	7,020,375.37	2.02
32	601111	中国国航	6,969,093.47	2.01

注：（1）卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票。

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

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,772,065,300.25
卖出股票收入（成交）总额	1,223,971,469.59

注：（1）买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票。

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

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	1,994,600.00	0.24

2	央行票据	-	-
3	金融债券	40,000,000.00	4.81
	其中：政策性金融债	40,000,000.00	4.81
4	企业债券	24,507,000.00	2.95
5	企业短期融资券	10,006,000.00	1.20
6	中期票据	78,478,000.00	9.44
7	可转债（可交换债）	360,271.80	0.04
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	155,345,871.80	18.68

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	120326	12 进出 26	400,000	40,000,000.00	4.81
2	1480037	14 普湾债	300,000	24,507,000.00	2.95
3	101663008	16 阳煤股份 MTN001	200,000	20,062,000.00	2.41
4	101761041	17 南山集 MTN002	200,000	19,796,000.00	2.38
5	101754002	17 鲁宏桥 MTN002	200,000	18,678,000.00	2.25

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

本基金本报告期内未投资股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

根据风险管理原则，本基金以套期保值为主要目的进行国债期货投资。通过对宏观经济和债券市场运行趋势的研究，结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现券资产进行匹配，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险性特征，运用国债期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险指标说明
公允价值变动总额合计（元）					-
国债期货投资本期收益（元）					-280,350.00
国债期货投资本期公允价值变动（元）					-

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期以套期保值为主要目的进行了国债期货投资。通过对宏观经济和债券市场运行趋势的研究，结合国债期货的定价模型，并与现券资产进行匹配，适度参与了国债期货，较好地对冲了利率风险、流动性风险对基金的影响，降低了基金净值的波动。

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发行主体未出现被监管部门立案调查的情况，在报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

8.12.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	212,414.49
2	应收证券清算款	2,580,475.34
3	应收股利	-
4	应收利息	4,826,059.23
5	应收申购款	194,699.45
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,813,648.51

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

- 1、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。
- 2、报告期内没有需说明的证券投资决策程序。

§ 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
1,325	562,711.37	623,394,885.77	83.61%	122,197,679.53	16.39%

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	122,586.72	0.0164%

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	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（ 2016 年 11 月 28 日 ）基金份额总额	345,734,777.22
本报告期期初基金份额总额	345,734,777.22
本报告期基金总申购份额	671,191,923.00
减:本报告期基金总赎回份额	271,334,134.92
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	745,592,565.30

注：报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额；基金总赎回份额含转换出份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期本基金未召开份额持有人大会。

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

本报告期本基金管理人于 2017 年 12 月 27 日发布公告，自 2017 年 12 月 25 日起新任陈玮光先生为公募合规负责人，周峰女士不再担任公募合规负责人。

本报告期本基金托管人的专门基金托管部门未出现重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、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

本报告期本基金无投资策略的变化。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任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，本年度应支付给普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）报酬为 71,500.00 元；截至 2017 年 12 月 31 日，该审计机构向本基金提供审计服务不满 2 年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，本基金管理人、托管人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元 数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票 成交总额的比 例	佣金	占当期佣金 总量的比例	
华创证券股 份有限公司		2909,472,128.24	30.49%	247,430.76	30.47%	-
兴业证券股		2905,983,786.59	30.37%	244,607.77	30.05%	-

份有限公司						
方正证券股 份有限公司	2	527,848,019.88	17.70%	143,398.83	17.65%	—
招商证券股 份有限公司	2	263,808,125.89	8.84%	75,524.94	9.28%	—
广发证券股 份有限公司	2	156,974,467.46	5.26%	42,473.67	5.22%	—
东方证券股 份有限公司	2	114,832,080.45	3.85%	32,302.54	3.97%	—
光大证券股 份有限公司	2	103,949,601.99	3.48%	28,256.17	3.47%	—
中国国际金 融股份有限 公司	2	—	—	—	—	—

注：1、此处的佣金指本基金通过券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计，不单指股票交易佣金。

2、交易单元的选择标准和程序

券商选择标准：协议券商选择的首要标准为符合监管机构相关规定，即参选券商应满足以下条件：

（1）经营业务比较全面，能够覆盖证券经纪、证券研究、投资银行、股指期货和融资融券等领域；（2）拥有独立的研究部门及 20 人以上的研究团队，研究范围覆盖宏观经济、金融市场和相关行业，并且已建立完善的研究报告质量保障机制；（3）投资银行实力较强，能够提供优质服务；（4）建立相关业务利益冲突防范机制，完善隔离墙制度，确保研究、投行服务客观公正；（5）承诺接受中国证监会、保监会有关保险机构证券交易情况的监督，并履行本通知规定的相关要求和报告义务；（6）经评估符合向基金机构和保险机构投资提供交易单元的条件并经获准；（7）符合中国证监会、保监会规定的其他条件。除以上首要基本标准外，参选的券商还应当满足以下三个方面的要求：（1）公司财务状况良好，近一年内无重大违规事项；（2）在国内及海外市场拥有较高的市场声誉；（3）能够提供全方位的业务支持，包括但不限于、股指期货、融资融券、海外投资、QFII 等业务方面的咨询意见。

券商选择程序：（1）公募集中交易室负责组织定期比选工作，根据公募事业部制定的规则和需求选择券商，并对符合规定的券商发出邀请函；（2）券商有权决定是否参选，参选的券商应在规定

时间内回复邀请函，未在规定时间内回复邀请函的券商视为放弃参选；（3）参选券商应根据邀请函的要求提供参选方案，并根据公募事业部安排完成现场评述、现场答疑等基本程序；（4）公募事业部应本着公平客观的原则，从承担投资、研究等职能的相关岗位中抽取相关专业人员形成评审小组，评审小组根据评价要素、分工范围，对参选券商进行评分。公募集中交易室负责汇总打分，并根据各项权重计算评价结果；评审小组成员包括以下业务骨干：基金经理、研究员、信评研究员、股票交易员等承担投资、研究职能的相关专业人员。（5）为保证评选的客观性、公正性，公募合规岗应全程参加现场评选，并监督评选全过程。公募合规岗有权对妨碍客观、公正原则的行为予以制止和纠正；（6）公募集中交易室将协议券商的评选结果和拟定的协议券商的交易单元租用计划在办公系统中以呈批件的形式，报送参评人员会签，部门负责人审批；（7）待呈批件审批通过后，运营管理部负责与协议券商签订《证券交易单元租用协议》、办理交易单元联通及相关账户报备等工作；（8）公募集中交易室负责与协议券商签订《证券研究综合服务协议》；（9）信息管理部负责对交易单元进行测试；（10）定期比选方式选择的协议券商将纳入公募事业部佣金分配体系，根据公募事业部对其的定期评价打分结果，在租用的交易单元上实现交易佣金的合理分配；（11）定期比选原则上三年一次。

3、本报告期内本基金新增租用 10 个交易单元，分别为光大证券股份有限公司上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，广发证券股份有限公司上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，招商证券股份有限公司上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，东方证券股份有限公司上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，中国国际金融股份有限公司上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个；华创证券股份有限公司上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，方正证券股份有限公司上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个，兴业证券股份有限公司上海、深圳证券交易所交易单元各 1 个为上年度新增。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
华创证券股份有限公司	339,893,357.97	96.84%	561,000,000.00	26.16%	-	-

兴业证券股 份有限公司	769,527.90	0.22%	523,200,000.00	24.40%	-	-
方正证券股 份有限公司	280,536.32	0.08%	289,400,000.00	13.49%	-	-
招商证券股 份有限公司	10,048,602.74	2.86%	530,600,000.00	24.74%	-	-
广发证券股 份有限公司	-	-	15,900,000.00	0.74%	-	-
东方证券股 份有限公司	-	-	221,900,000.00	10.35%	-	-
光大证券股 份有限公司	-	-	2,600,000.00	0.12%	-	-
中国国际金 融股份有限 公司	-	-	-	-	-	-

§ 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	20170224-20171231	-	319,244,855.03	-	319,244,855.03	42.82%
	2	20171023-20171231	-	165,721,281.80	-	165,721,281.80	22.23%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
当本基金出现单一持有者持有基金份额比例达到或者超过 20%时，基金管理人将审慎确认大额申购与大额赎回，投资者将面对管理人拒绝或暂停申购的风险、暂停赎回或延缓支付赎回款项的风险、巨额赎回的风险，以及当管理人确认大额申购与大额赎回时，可能会对基金份额净值造成一定影响等特有风险。							

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

泰康资产管理有限责任公司

2018 年 3 月 29 日