（上接B398版）

7.2 利润表
会计主体：华富安享保本混合型证券投资基金
本报告期：2018年1月1日至2018年1月29日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2018年1月1日至2018年1月29日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
一、收入		2,264,367.56	53,577,215.19
1.利息收入		3,175,288.01	49,183,557.26
其中：存款利息收入		138,011.21	1,014,527.44
债券利息收入		2,135,437.85	46,780,357.98
资产支持证券利息收入		–	–
买入返售金融资产收入		901,838.95	1,388,671.84
其他利息收入		–	–
2.投资收益（损失以“-”填列）		-1,530,712.28	-19,817,260.89
其中：股票投资收益		117,573.76	4,173,948.82
基金投资收益		–	–
债券投资收益		-1,648,286.04	-24,361,278.63
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		–	370,068.92
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		503,293.02	23,234,349.09
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		–	–
5.其他收入（损失以“-”号填列）		116,498.81	976,569.73
减：二、费用		740,086.35	22,461,519.47
1. 管理人报酬		576,222.03	11,364,856.71
2. 托管费		96,037.01	1,894,142.79
3. 销售服务费		–	–
4. 交易费用		16,732.58	911,853.98
5. 利息支出		3,567.59	7,820,296.95
其中：卖出回购金融资产支出		3,567.59	7,820,296.95
6. 税金及附加		4,936.37	–
7. 其他费用		42,590.77	470,369.04
三、利润总额 （亏损总额以“-”号填列）		1,524,281.21	31,115,695.72
减：所得税费用		–	–
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,524,281.21	31,115,695.72

注：报告截止日2018年1月29日，华富安享保本混合型证券投资基金从2018年1月30日转型为华富安享债券型证券投资基金。后附报表附注为本财务报表的组成部分。

7.3 所有者权益（基金净值）变动表
会计主体：华富安享保本混合型证券投资基金
本报告期：2018年1月1日至2018年1月29日

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年1月29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）	790,829,352.68	32,640,376.58	823,469,729.26
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	–	1,524,281.21	1,524,281.21
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）	-660,250,907.21	-28,463,226.83	-688,714,134.04
其中：1.基金申购款	9,864.01	423.32	10,287.33
2.基金赎回款	-660,260,771.22	-28,463,650.15	-688,724,421.37
五、期末所有者权益（基金净值）	130,578,445.47	5,701,430.96	136,279,876.43
项目	上年度可比期间 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）	1,165,784,554.39	8,485,534.70	1,174,270,089.09
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	–	31,115,695.72	31,115,695.72
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）	-374,955,201.71	-6,960,853.84	-381,916,055.55
其中：1.基金申购款	339,848.21	8,607.38	348,455.59
2.基金赎回款	-375,295,049.92	-6,969,461.22	-382,264,511.14
五、期末所有者权益（基金净值）	790,829,352.68	32,640,376.58	823,469,729.26

注：报告截止日2018年1月29日，华富安享保本混合型证券投资基金从2018年1月30日转型为华富安享债券型证券投资基金。后附报表附注为本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：
_____章宏韬_____ _____余海春_____ _____潘伟_____
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.4 报表附注
7.4.1 基金基本情况
华富安享保本混合型证券投资基金从2018年1月30日转型为华富安享债券型证券投资基金。华富安享保本混合型证券投资基金（以下简称本基金或基金）经中国证券监督管理委员会（以下简称中国证监会）（[2015]2908号）核准。基金合同于2016年1月21日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定期。设立时募集资金到位情况经天健会计师事务所（特殊普通合伙）验资并出具《验资报告》（天健验（2016）6-9号）。有关基金设立文件已按规定向中国证监会备案。本基金的管理人和基金份额登记机构为华富基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《华富安享保本混合型证券投资基金》的规定，本基金的资产配置范围为：股票、权证等风险资产占基金资产的比例不高于40%，其中基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的3%；债券、货币市场工具等保本资产占基金资产的比例不低于60%，其中现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的5%。其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

华富安享保本型证券投资基金从2018年1月30日转型为华富安享债券型证券投资基金。

7.4.2 会计报表的编制基础
本基金财务报表以持续经营为编制基础。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明
本财务报表符合企业会计准则的要求，同时参照中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》和中国证监会允许的基金行业实务操作，真实、完整地反映了基金的财务状况、经营成果和净值变动等有关信息。

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。

7.4.4.1 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。本期会计报表的实际编制期间为2018年1月1日至2018年1月29日。

7.4.4.2 记账本位币
本基金以人民币为记账本位币；记账本位币单位为元。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类
(1) 金融资产在初始确认时划分为以下四类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、持有至到期投资、贷款和应收款项、可供出售金融资产。

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。本基金目前持有的股票投资、债券投资和衍生工具（主要为权证投资）划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，其他金融资产划分为贷款和应收款项，暂无金融资产划分为可供出售金融资产或持有至到期投资。

(2) 金融负债在初始确认时划分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（包括交易性金融负债和在初始确认时指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债）、其他金融负债。

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
本基金成为金融工具合同的一方时，确认一项金融资产或金融负债。初始确认金融资产或金融负债时，按照公允价值计量；对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入初始确认金额。

本基金按照公允价值对金融资产进行后续计量，且不扣除将来处置该金融资产时可能发生的交易费用，但下列情况除外：(1) 持有至到期投资以及贷款和应收款项采用实际利率法，按摊余成本计量；(2) 在活跃市场中没有报价且其公允价值不能可靠计量的权益工具投资，以及与该权益工具挂钩并须通过交付该权益工具结算的衍生金融资产，按照成本计量。

本基金采用实际利率法，按摊余成本对金融负债进行后续计量，但下列情况除外：(1) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，按照公允价值计量，且不扣除将来结清金融负债时可能发生的交易费用；(2) 与在活跃市场中没有报价、公允价值不能可靠计量的权益工具挂钩并须通过交付该权益工具结算的衍生金融负债，按照成本计量；(3) 不属于指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债的财务担保合同，或没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益并将以低于市场利率贷款的贷款承诺，在初始确认后按照下列两项金额之中的较高者进行后续计量：1）按照《企业会计准则第13号——或有事项》确定的金额；2）初始确认金额扣除按照《企业会计准则第14号——收入》的原则确定的累积摊销额后的余额。

金融资产或金融负债公允价值变动形成的利得或损失，除与套期保值有关外，按照如下方法处理：(1) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债公允价值变动形成的利得或损失，计入公允价值变动收益；在资产持有期间所取得的利息或现金股利，确认为投资收益；处置时，将实际收到的金额与初始入账金额之间的差额确入为投资收益，同时调整公允价值变动收益。(2) 可供出售金融资产的公允价值变动计入其他综合收益；持有期间按实际利率法计算的利息，计入投资收益；可供出售权益工具投资的现金股利，于被投资单位宣告发放股利时计入投资收益；处置时，将实际收到的金额与账面价值扣除原直接计入其他综合收益的公允价值变动累计额之后的差额确认为投资收益。

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；当金融负债的现时义务全部或部分解除时，相应终止确认该金融负债或其一部分。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则
(1) 估值原则
本基金持有的股票投资、债券投资和衍生金融工具，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相关金融资产和金融负债的公允价值。公司将估值技术使用的输入值分以下层级，并依次使用：

1) 第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

2) 第二层次输入值是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，包括：活跃市场中类似资产或负债的报价；非活跃市场中相同或类似资产或负债的报价；除报价以外的其他可观察输入值，如在正常报价间隔期间可观察的利率和收益率曲线等；市场验证的输入值等；

3) 第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值，包括不能直接观察或无法由可观察市场数据验证的利率、股票波动率、企业合并中承担的弃置义务的未来现金流量、使用自身数据做出的财务预测等。

(2) 估值方法及关键假设
1) 根据《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》（中国证券监督管理委员会公告（2017）13号）规定，在下列情况下本基金采用的估值方法及关键假设如下：

① 对存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的投资品种，在估值日有报价的，除会计准则规定的例外情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量。估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，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。

② 对不存在活跃市场的投资品种，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。采用估值技术确定公允价值时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

③ 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响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，对估值进行调整并确定公允价值。

2) 对于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），根据中国证券投资基金业协会《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》（中基协发（2017）6号），估值处理如下：

① 流通受限股票按以下公式确定估值日该流通受限股票的价值：$FV=S\times(1-LoMD)$

其中：FV：估值日该流通受限股票的价值；S：估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值；LoMD：该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣。

② 引入看跌期权计算该流通受限股票对应的流动性折扣。$LoMD=P/S$，P是估值日看跌期权的价值。

③ 证券投资基金持有的流通受限股票在估值日按平均价格亚式期权模型确定估值日看跌期权的价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销
本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表列示。

7.4.4.7 实收基金
实收基金为对外发行的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
股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

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

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

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；

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；

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
每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式及红利再投资形式分配。 期末可供分配利润指期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从持有人权益转出。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计
无。

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
本报告期本基金会计政策无变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明
本报告期本基金会计估计无变更。

7.4.5.3 差错更正的说明
本报告期本基金无重大会计差错。

7.4.6 税项
根据财政部、国家税务总局《关于企业所得税若干优惠政策的通知》（财税〔2008〕1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〔2012〕85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〔2015〕101号）、《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》（财税〔2016〕36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〕46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》（财税〔2016〕140号）、《关于资管产品增值税有关问题的通知》（财税〔2017〕56号）、《关于金融机构同业往来等增值税补充政策的通知》（财税〔2017〕70号）、《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》（财税〔2017〕90号）及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(一) 自2018年1月1日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征税率缴纳增值税。

(二) 对基金买卖股票、债券的差价收入，暂免征收企业所得税；

(三) 证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂减按25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

主要税种及税率列示如下：

税 种	计 税 依 据	税 率
增值税	金融服务销售额	3%
城市维护建设税	应缴流转税税额	7%
教育费附加	应缴流转税税额	3%
地方教育附加[注]	应缴流转税税额	2%、1%

[注]：按地方税务局通知，自2018年7月起下调地方教育附加税税率，由原来的2%下调为1%。

7.4.8 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
华富基金管理有限公司	基金发起人、管理人、注册登记人、销售机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、代销机构
华安证券股份有限公司（“华安证券”）	基金管理人的股东、代销机构

7.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
7.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易
7.4.9.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年1月29日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
华安证券	2,512,121.00	27.03%	78,714,285.43	13.45%

7.4.9.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年1月29日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
华安证券	–	–	452,261,406.17	59.57%

7.4.9.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年1月29日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日	
	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
华安证券	–	–	9,833,900,000.00	32.26%

7.4.9.1.4 权证交易
注：本基金本报告期内及上年度可比期间内未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.9.1.5 应支付关联方的佣金
金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年1月29日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
华安证券	2,339.54	27.20%	2,339.54	27.20%
关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
华安证券	72,941.82	13.54%	19,309.54	6.86%

注：上述佣金按市场佣金率计算。以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费和适用期间内由券商承担的证券风险结算基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

7.4.9.2 关联方报酬
7.4.9.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年1月29日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	576,222.03	11,364,856.71
其中：支付销售机构的客户维护费	220,108.81	3,662,593.86

注：基金管理费按前一日基金资产净值1.2%的年费率逐日计提，按月支付。计算方法 $H=E\times$ 年管理费率 ÷ 当年天数（H 为每日应计提的基金管理费，E 为前一日基金资产净值）。

7.4.9.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年1月29日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	96,037.01	1,894,142.79

注：基金托管费按前一日基金资产净值0.2%的年费率逐日计提，按月支付。计算方法 $H=E\times$ 年托管费率 ÷ 当年天数（H 为每日应计提的基金托管费，E 为前一日基金资产净值）。

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

7.4.9.4 各关联方投资本基金的情况
7.4.9.4.1 报告期内本基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
注：本报告期内和上年度可比期间本基金管理人没有运用固有资金投资本基金。

7.4.9.4.2 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
注：本基金本报告期和上年度可比期基金管理人之外的其他关联方没有投资本基金。

7.4.9.5 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 2018年1月1日至2018年1月29日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017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
中国工商银行股份有限公司	196,874,315.53	137,554.45	10,006,257.60	86,698.00

注：本表仅列示活期存款余额及产生利息。

7.4.9.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况
注：本基金在本报告期内和上年度可比期间未参与关联方承销证券。

7.4.9.7 其他关联交易事项的说明
无。7.4.8 期末（2018年1月29日）本基金持有的流通受限证券

7.4.8.1 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	说明
601838	成都银行	2018年1月22日	2018年1月31日	新股流通受限	6.99	6.99	1,000	6,990.00	6,990.00	–

注：实际可流通日以该证券公告为准。

7.4.8.2 期末持有的暂时停牌股票
注：本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.8.3 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债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.9 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项
—根据“财政部关于执行企业会计准则的上市公司和非上市企业做好2010年年报工作的通知（财会〔2010〕25号）”（以下简称“通知”）要求，本基金对年末持有的以公允价值计量的金融资产按照公允价值的取得方式分为三层：第一层次是本基金在计量日能获得相同资产或负债在活跃市场上报价的，以该报价为依据确定公允价值；第二层次是本基金在计量日能获得类似资产或负债在活跃市场上的报价，或相同或类似资产或负债在非活跃市场上的报价的，以该报价为依据做必要调整确定公允价值；第三层次是本基金无法获得相同或类似资产可比市场交易价格的，以其他反映市场参与者对资产或负债定价时所使用的参数为依据确定公允价值。根据通知要求，年末本基金持有的以公允价值计量的资产分层列示如下：

	类别2018年1月29日公允价值	2017年12月31日公允价值
第一层次		
第二层次	6,990.00	490,829,000.00
第三层次		
合计	6,990.00	490,829,000.00

根据《关于发布（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）的通知》（中基协发[2014]24号）的要求，本基金自2015年3月30日起，对交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种采用第三方估值机构中证指数有限公司提供的价格数据进行估值（估值标准另有规定的除外），本报告期末本基金持有的以公允价值计量的上述资产计入第二层次。

§1 投资组合报告（转型后）

1.1 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	8,462,900.00	13.40
	其中：股票	8,462,900.00	13.40
2	固定收益投资	52,267,215.52	82.77
	其中：债券	52,267,215.52	82.77
3	银行存款和结算备付金合计	1,544,794.79	2.45
4	其他各项资产	871,718.56	1.38
5	合计	63,146,628.87	100.00

注：本表列示的其他各项资产详见8.12.3 其他各项资产构成。

1.2 期末按行业分类的股票投资组合
1.2.1 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	680,680.00	1.44
C	制造业	7,057,840.00	14.89
G	交通运输、仓储和邮政业	493,800.00	1.04
J	金融业	230,580.00	0.49
	合计	8,462,900.00	17.85

1.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合
注：本基金本报告期末未持有沪港通投资股票。

1.2.3 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	002157	正邦科技	200,000	1,062,000.00	2.24
2	600271	航天信息	43,000	984,270.00	2.08
3	002223	鱼跃医疗	50,000	980,500.00	2.07
4	002376	新北洋	60,000	920,400.00	1.94
5	600885	宏发股份	37,000	834,720.00	1.76
6	300498	温氏股份	26,000	680,680.00	1.44
7	603986	兆易创新	10,000	623,200.00	1.31
8	000581	威孚高科	30,000	529,800.00	1.12
9	601006	大秦铁路	60,000	493,800.00	1.04
10	002236	大华股份	40,000	458,400.00	0.97

1.3 报告期内股票投资组合的重大变动
1.3.1 累计买入金额超出期末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例（%）
1	002236	大华股份	3,272,582.22	6.90
2	603986	兆易创新	3,187,837.00	6.73
3	002120	韵达股份	2,114,846.00	4.46
4	601818	光大银行	2,097,000.00	4.42
5	601601	中国太保	2,093,341.00	4.42
6	002223	鱼跃医疗	1,783,568.50	3.76
7	600196	复星医药	1,668,438.70	3.52
8	002468	申通快递	1,634,057.99	3.45
9	000998	隆平高科	1,571,854.00	3.32
10	000725	京东方A	1,304,000.00	2.75
11	600028	中国石化	1,260,940.00	2.66
12	600183	生益科技	1,211,236.00	2.56
13	300037	新宙邦	1,203,299.00	2.54
14	000039	中集集团	1,202,268.00	2.54
15	600885	宏发股份	1,191,902.00	2.51
16	600271	航天信息	1,187,359.00	2.50
17	603816	顾家家居	1,099,693.00	2.32
18	002157	正邦科技	1,091,795.00	2.30
19	600525	长园集团	1,083,509.00	2.29
20	000063	中兴通讯	1,040,080.00	2.19
21	601688	华泰证券	1,037,036.00	2.19
22	002376	新北洋	955,770.00	2.02

注：本表列示“买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，未考虑相关交易费用。

1.3.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例（%）
1	002120	韵达股份	2,309,023.00	4.87
2	601818	光大银行	1,889,500.00	3.99
3	002236	大华股份	1,804,569.00	3.81
4	603986	兆易创新	1,695,932.34	3.58
5	601601	中国太保	1,610,827.00	3.40
6	002468	申通快递	1,581,735.00	3.34
7	600196	复星医药	1,515,851.84	3.20
8	000998	隆平高科	1,459,675.01	3.08
9	600028	中国石化	1,214,600.00	2.56
10	300037	新宙邦	1,208,285.00	2.55
11	000725	京东方A	1,197,450.00	2.53
12	600525	长园集团	1,131,413.00	2.39
13	000039	中集集团	1,122,687.00	2.37
14	603816	顾家家居	1,106,118.68	2.33
15	600183	生益科技	950,509.00	2.01
16	601688	华泰证券	945,450.00	1.99
17	000338	潍柴动力	868,756.00	1.83
18	002223	鱼跃医疗	786,100.00	1.66
19	002045	国光电器	777,407.00	1.64
20	600038	中直股份	773,603.00	1.63

注：本表列示“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，未考虑相关交易费用。

1.3.3 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	48,175,724.21
卖出股票收入（成交）总额	35,690,414.03

注：本表列示“买入股票成本（成交）总额”及“卖出股票收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，未考虑相关交易费用。买入包括新股、债转股及行权等获得的股票。

1.4 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	金融债券	13,507,440.00	28.50
	其中：政策性金融债	13,507,440.00	28.50
2	企业债券	22,612,559.00	47.71
3	可转债（可交换债）	16,147,216.52	34.07
4	合计	52,267,215.52	110.27

1.5 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	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	180205	18国开05	100,000	10,896,000.00	22.99
2	132007	16凤凰EB	46,000	4,429,800.00	9.35
3	132011	17浙报EB	45,000	4,153,500.00	8.76
4	122866	10航空投	40,000	4,069,600.00	8.59
5	136473	16中化债	40,000	3,962,800.00	8.36

1.6 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
注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

1.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细
注：本基金本报告期末未持有贵金属投资

1.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
注：本基金本报告期末未持有权证。

1.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
注：本基金本报告期末未投资国债期货。

1.10 投资组合报告附注
1.10.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明
本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现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。

1.10.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明
基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

1.10.3 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	8,891.23
2	应收利息	862,827.33
3	合计	871,718.56

1.10.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	132007	16凤凰EB	4,429,800.00	9.35
2	132011	17浙报EB	4,153,500.00	8.76
3	127006	敖东转债	1,060,602.08	2.24
4	113507	天马转债	943,284.30	1.99
5	120001	16以岭EB	890,356.00	1.88
6	113011	光大转债	578,160.00	1.22
7	113015	隆基转债	503,950.00	1.06
8	113018	常熟转债	327,510.00	0.69
9	128024	宁行转债	317,940.00	0.67
10	127005	长证转债	60,595.92	0.13

1.10.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

1.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分
由于计算中四舍五入的原因，本报告分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§8 投资组合报告（转型前）

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	6,990.00	0.00
	其中：股票	6,990.00	0.00
2	银行存款和结算备付金合计	197,101,794.32	99.87
3	其他资产	241,281.12	0.12
4	合计	197,350,065.44	100.00

注：本表列示的其他各项资产详见8.12