

(上接 B823 版)

项目	本期 2017 年 01 月 01 日至 2017 年 12 月 31 日	上期 2016 年 01 月 01 日至 2016 年 12 月 31 日
基金净值(份)	20,622,293.51	20,622,293.51
上期期末	20,622,293.51	20,622,293.51
本期新增	1,559,625.74	1,559,625.74
本期赎回(含“净赎回”)	-4,266,207.74	-4,266,207.74
期末	17,915,712.09	17,915,712.09

注:

申购含红利再投、转换入份额、赎回含转换出份额。

**7470** 未分配利润  
单位:人民币元

项目	已实现收益	未实现收益	未分配利润合计
上期期末	5,550,422.23	-6,723,033.69	-1,172,611.46
本期新增	-223,097.74	2,686,907.27	2,463,809.53
本期基金赎回产生的变动额	-695,975.12	631,762.15	-64,212.97
其中:中户赎回	396,190.74	-372,207.59	23,983.15
基金赎回费	-1,092,165.86	1,094,059.74	-88,106.12
本期已分配利润	—	—	—
期末	4,632,429.37	-3,405,443.37	1,222,986.00

**7471** 存款利息收入  
单位:人民币元

项目	本期 2017 年 01 月 01 日至 2017 年 12 月 31 日	上期 2016 年 01 月 01 日至 2016 年 12 月 31 日
定期存款利息收入	42,291.63	54,620.97
活期存款利息收入	—	—
其他存款利息收入	—	—
拆借资金利息收入	346.79	1,005.84
其他	151.94	831.52
合计	42,990.34	56,528.33

**7472** 股票投资收益  
单位:人民币元

项目	本期 2017 年 01 月 01 日至 2017 年 12 月 31 日	上期 2016 年 01 月 01 日至 2016 年 12 月 31 日
卖出股票投资收益	39,207,272.87	43,434,358.08
持有期间股票公允价值变动	30,262,566.55	68,962,287.18
买卖股票差价收入	140,106.82	-5,827,123.18

**7473** 债券投资收益  
**7473.1** 债券投资收益——买卖债券价差收入  
单位:人民币元

项目	本期 2017 年 01 月 01 日至 2017 年 12 月 31 日	上期 2016 年 01 月 01 日至 2016 年 12 月 31 日
卖出债券(债券利息及债券赎回收入)成交总额	4,994,640.09	3,266,772.90
买入债券(债券利息及债券申购支出)成交总额	4,881,680.00	3,291,343.60
持有期间利息收入	104,640.00	71,772.60
买卖债券差价收入	-1,680.00	3,956.00

**7473.2** 资产支持证券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。  
**7473.3** 贵金属投资收益  
本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

**7473.4** 衍生工具收益  
本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具投资收益。

**7473.5** 其他收入  
单位:人民币元

项目	本期 2017 年 01 月 01 日至 2017 年 12 月 31 日	上期 2016 年 01 月 01 日至 2016 年 12 月 31 日
股票赎回产生的股利收益	94,923.97	41,823.30
基金投资产生的股利收益	—	—
合计	94,923.97	41,823.30

**7473.6** 公允价值变动收益  
单位:人民币元

项目	本期 2017 年 01 月 01 日至 2017 年 12 月 31 日	上期 2016 年 01 月 01 日至 2016 年 12 月 31 日
1.交易性金融资产	2,686,907.27	-709,053.63
—公允价值变动	2,686,907.27	-709,053.63
—净损益	-12,785.96	-34,902.20
—资产支持证券投资	—	—
—基金投资	—	—
—贵金属投资	—	—
—其他	—	—
2.衍生工具	—	—
—公允价值	—	—
—其他	—	—
合计	2,686,907.27	-709,053.63

**7473.7** 其他收入  
单位:人民币元

项目	本期 2017 年 01 月 01 日至 2017 年 12 月 31 日	上期 2016 年 01 月 01 日至 2016 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	1,532.21	6,477.06
申购费收入	72.62	21.42
合计	1,604.83	6,498.48

**7473.8** 交易费用  
单位:人民币元

项目	本期 2017 年 01 月 01 日至 2017 年 12 月 31 日	上期 2016 年 01 月 01 日至 2016 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	121,607.26	199,258.64
银行间市场交易费用	—	—
合计	121,607.26	199,258.64

**7473.9** 其他费用  
单位:人民币元

项目	本期 2017 年 01 月 01 日至 2017 年 12 月 31 日	上期 2016 年 01 月 01 日至 2016 年 12 月 31 日
审计费用	55,000.00	60,000.00
信息披露费	90,000.00	80,000.00
银行手续费	909.51	1,095.20
账户维护费	18,360.00	18,360.00
合计	164,269.51	159,455.20

**748** 或有事项、资产负债表日后事项的说明

**748.1** 或有事项

截至资产负债表日,本基金无需要披露的重大或有事项。

**748.2** 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日,除**7462** 增值税中披露的事项外,本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

**749** 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
基金管理人:基金管理人:中国工商银行股份有限公司	基金管理人、基金托管机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司	基金管理人、基金托管机构
基金托管人:中国工商银行股份有限公司	基金管理人、基金托管机构
上海富友基金销售有限公司	基金管理人、基金销售机构
上海富友基金销售有限公司	基金管理人、基金销售机构
上海富友基金销售有限公司	基金管理人、基金销售机构

**740** 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

**740.1** 通过关联方交易单元进行的交易  
**740.1.1** 股票交易  
金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2017 年 01 月 01 日至 2017 年 12 月 31 日	上期 2016 年 01 月 01 日至 2016 年 12 月 31 日
基金买入股票成交金额	14,651,944.72	18,206.00
基金卖出股票成交金额	—	—

**740.1.2** 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。  
**740.1.3** 应支付关联方的佣金  
金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2017 年 01 月 01 日至 2017 年 12 月 31 日	上期 2016 年 01 月 01 日至 2016 年 12 月 31 日
基金买入权证成交金额	—	—
基金卖出权证成交金额	—	—

关联方名称	本期 2017 年 01 月 01 日至 2017 年 12 月 31 日	上期 2016 年 01 月 01 日至 2016 年 12 月 31 日
基金买入权证成交金额	13,645.44	18,206.00
基金卖出权证成交金额	—	—

注:  
上述佣金按市场佣金率计算,以扣除中国证券登记结算有限责任公司收取的证券费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示,该等佣金收取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。  
**740.1.4** 债券交易  
本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。  
**740.1.5** 债券回购交易  
本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

**740.2** 关联方交易  
**740.2.1** 基金投资管理  
单位:人民币元

项目	本期 2017 年 01 月 01 日至 2017 年 12 月 31 日	上期 2016 年 01 月 01 日至 2016 年 12 月 31 日
当期基金资产净值变动对管理费的影响	291,295.56	326,877.80
其中:支付销售机构的客户维护费	65,650.47	74,129.63

注:

基金管理费按前一日基金资产净值的**150%**的年费率计提。计算方法如下:**H= E×150%**÷当年天数,  
E 为每日应计提的基金管理费,  
H 为前一日的基金资产净值。

基金管理费每日计提,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令,经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人,若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。

**740.2.2** 基金托管费  
单位:人民币元

项目	本期 2017 年 01 月 01 日至 2017 年 12 月 31 日	上期 2016 年 01 月 01 日至 2016 年 12 月 31 日
当期基金资产净值变动对托管费的影响	46,564.04	54,604.63

注:

基金托管费按前一日基金资产净值的**0.25%**的年费率计提。计算方法如下:**H= E×0.25%**÷当年天数,  
E 为每日应计提的基金托管费,  
H 为前一日的基金资产净值。

基金托管费每日计提,按月支付;由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令,经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人,若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。

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

**740.4** 各关联方投资本基金的情况  
**740.4.1** 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况  
本基金本报告期及上年度可比期间均未有基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

**740.4.2** 报告期末除基金管理人以外的其他关联方投资本基金的情况  
本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度均未投资本基金。

**740.5** 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 01 月 01 日至 2017 年 12 月 31 日	上期 2016 年 01 月 01 日至 2016 年 12 月 31 日
中国工商银行股份有限公司	244,638.09	42,291.63
基金托管人:中国工商银行股份有限公司	—	—

注:

本基金的证券交易结算资金通过托管银行备付金账户存存于中国证券登记结算有限责任公司,2017 年度获得的利息收入为人民币**567.9**元;2016 年度获得的利息收入为人民币**1055.94**元,2017 年末结算备付金余额为人民币**8958.70**元,(2016 年末结算备付金余额为人民币**8829.88**元)。

**740.6** 本基金在承销期间内参与关联方承销证券的情况  
本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期间内直接购入关联方承销的证券。

**741** 利润分配情况——非货币市场基金  
本基金报告期内未进行利润分配。  
**742** 期末(2017 年 2 月 31 日)本基金持有的流通受限证券  
**742.1** 因认购新发、增发证券而于期末持有的流通受限证券  
本基金本报告期末未持有因认购新发/增发而流通受限的证券。  
**742.2** 期末持有的暂时停牌等流通受限股票  
金额单位:人民币元

代码	名称	停牌日期	停牌前收盘价(元)	数量(股)	停牌日期前收盘价(元)	期末成本总额(元)	期末公允价值(元)	备注
600393	华鲁恒升	2017-12-08	37.94	—	19.00	803,780.18	755,066.00	—

**742.3** 期末债券正回购交易作为抵押的债券  
**742.3.1** 银行间市场债券正回购  
截至本报告期末 2017 年 2 月 31 日止,本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

**742.3.2** 交易所市场债券正回购  
截至本报告期末 2017 年 2 月 31 日止,本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

**743** 金融工具风险及管理  
**743.1** 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系统,通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人将风险管理融入公司各个业务层面的全面控制过程之中,并建立了三道防线,以各岗位职责任为基础,形成第一道防线;通过相关岗位之间、相关部门之间相互监督制衡,形成第二道防线;由督察长、风险控制委员会、监察稽核部对公司各机构、各部门、各岗位、各项业务进行监督、检查、评价,形成的第三道防线。  
**743.2** 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。

本基金投资于一家上市公司发行的股票市值不超过基金资产净值的**0%**,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上市公司发行的证券,不得超过该证券的**0%**。

本基金的银行存款均存放于信用良好的银行,申购交易均通过具有基金销售资格的金融机构进行。另外,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款项清结,因此违约风险发生的可能性很小;基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估,以控制相应的信用风险。  
**743.2.1** 按信用评级进行评级列示的债券投资组合  
单位:人民币元

短期信用评级	基金资产净值	2016 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
A+以上	—	—	—
A+以下	—	—	—
未评级	2,993,400.00	2,400,000.00	—
合计	2,993,400.00	2,400,000.00	—

注:  
未评级债券包括国债、同业存单、中央银行票据、政策性金融债和超短期融资券。

**748.22** 按长期信用评级列示的债券投资组合  
单位:人民币元

长期信用评级	基金资产净值	2016 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
AAA 以上	—	—	—
AAA 以下	—	—	—
未评级	—	—	—
合计	1,045,159.90	1,021,509.70	—

**748.3** 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。

**748.3.1** 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析  
本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系,审慎评估各类资产的流动性,针对性制定流动性风险管理措施,对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基础管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日内可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险,并开放于日对本基金的申购赎回情况进行监控,保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配,确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人已在基金合同中设计了巨额赎回条款,约定在非常情况下赎回申请的处理方式,控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险,有效保障基金持有人利益。

本基金所持有的证券均在证券交易所上市,因此,除附注**742** 中列示的期末持有的流通受限证券外,本基金未基金的资产均能及时变现。此外,本基金可通过卖出国债金融资产方式偿还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。

本报告期内,本基金未发生重大流动性风险事件。

**748.4** 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。

**748.4.1** 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。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。

利率风险敞口单位:人民币元	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	244,638.09	—	—	—	—	244,638.09
结算备付金	81,858.70	—	—	—	—	81,858.70
存出保证金	15,719.81	—	—	—	—	15,719.81
买入返售金融资产	3,993,600.00	6,759.90	—	—	—	3,993,600.00
应收利息	—	83,249.95	9,324.05	—	—	92,574.00
应收申购款	—	—	2,152.79	2,152.79	—	4,305.58
资产总计	4,344,016.59	6,759.90	—	—	—	4,344,016.59
负债						
应付赎回款	—	7,101.42	7,101.42	—	—	14,202.84
应付管理人报酬	—	24,263.13	32,826.15	—	—	57,089.28
应付托管费	—	4,043.83	4,043.83	—	—	8,087.66
应付交易费	—	20,589.95	20,589.95	—	—	41,179.90
应付税费	—	194,821.76	194,821.76	—	—	389,643.52
预提费用	—	85,000.00	85,000.00	—	—	170,000.00
应付利息	—	62.21	18.25	—	—	80.46
负债总计	—	315,865.34	518,505.34	—	—	834,370.68
利率敏感敞口	4,344,016.59	6,759.90	—	—	—	4,344,016.59
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	5,549,499.65	—	—	—	—	5,549,499.65
结算备付金	58,239.54	—	—	—	—	58,239.54
存出保证金	9,115.45	—	—	—	—	9,115.45
买入返售金融资产	3,400,000.00	1,021,309.70	—	—	—	4,421,309.70
应收利息	—	10,885.02	17,585.52	—	—	28,470.54
应收申购款	—	—	39.95	39.95	—	79.90
资产总计	9,016,853.08	1,021,309.70	—	—	—	10,027,424.47
负债						
应付赎回款	—	—	145.27	545.37	—	690.64
应付管理人报酬	—	24,015.54	24,015.54	—	—	48,031.08
应付托管费	—	4,125.61	4,125.61	—	—	8,25