汇添富策略回报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：汇添富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

送出日期：2018 年 3 月 28 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 26 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
1.2 目录 3
§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 7
3.1 主要会计数据和财务指标 7
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 10
4.1 基金管理人及基金经理情况 10
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 13
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 14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 16
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 17
§5 托管人报告 18
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 18
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 18
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 18
§6 审计报告 19
6.1 审计报告基本信息 19
6.2 审计报告的基本内容 19
§7 年度财务报表 22
7.1 资产负债表 22
7.2 利润表 23
7.3 所有者权益（基金净值）变动表 24
7.4 报表附注 25
§8 投资组合报告 52
8.1 期末基金资产组合情况 52
8.2 期末按行业分类的股票投资组合 52
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 53
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 54
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 57
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 57
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 57

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 58
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 58
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 58
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 58
8.12 投资组合报告附注 58
§9 基金份额持有人信息 60
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 60
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 60
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 60
§10 开放式基金份额变动 61
§11 重大事件揭示 62
11.1 基金份额持有人大会决议 62
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 62
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 为基金进行审计的会计师事务所情况 65
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 65
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 65
11.8 其他重大事件 69
§12 影响投资者决策的其他重要信息 76
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 76
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 76
§13 备查文件目录 77
13.1 备查文件目录 77
13.2 存放地点 77
13.3 查阅方式 77

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富策略回报混合型证券投资基金
基金简称	汇添富策略回报混合
基金主代码	470008
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009 年 12 月 22 日
基金管理人	汇添富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	763,358,154.36 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用“自上而下”的投资方式，灵活运用资产配置策略、行业轮动策略和个股精选策略，构建有效的投资组合，并在科学严格的投资风险管理前提下，力求为基金份额持有人实现持续稳健的较高投资回报。
投资策略	本基金为混合型基金,以股票投资为主。 股票投资的主要策略包括资产配置策略、行业轮动策略和个股精选策略。其中,资产配置策略用于确定大类资产配置比例以有效规避系统性风险,行业轮动策略用于把握行业基本面变化以精选优势行业,个股精选策略用于挖掘各行业中的优质股票以获取超额收益。
业绩比较基准	沪深 300 指数×80%+上证国债指数×20%
风险收益特征	本基金是混合型基金，本基金的风险和预期收益比较均衡，在证券投资基金中属于风险适中的基金品种。

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		汇添富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	李鹏	郭明
	联系电话	021-28932888	010-66105799
	电子邮箱	service@99fund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-888-9918	95588
传真		021-28932998	010-66105798

注册地址	上海市黄浦区大沽路 288 号 6 栋 538 室	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址	上海市富城路 99 号震旦国际大楼 21-23 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	200120	100140
法定代表人	李文	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》和《证券时报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.99fund.com
基金年度报告备置地点	上海市富城路 99 号震旦国际大楼 21-23 楼 汇添富基金管理股份有限公司

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)	北京市东城区东长安街 1 号东方广场东方经贸城安永大楼 16 层
注册登记机构	汇添富基金管理股份有限公司	上海市富城路 99 号震旦国际大楼 21-23 层

§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	-50,916,593.61	-623,288,766.90	-601,836,078.11
本期利润	202,829,673.98	-460,557,738.73	-915,887,693.25
加权平均基金份额本期利润	0.2365	-0.4346	-1.1360
本期加权平均净值利润率	15.20%	-29.00%	-60.46%
本期基金份额净值增长率	16.64%	-21.29%	62.52%
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	-154,724,786.49	-146,917,815.29	529,125,521.36
期末可供分配基金份额利润	-0.2027	-0.1570	0.4766
期末基金资产净值	1,321,426,059.93	1,389,265,233.39	2,177,990,903.71
期末基金份额净值	1.731	1.484	1.962
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	91.39%	64.08%	108.46%

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、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(例如：基金的申购赎回费等)，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、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。

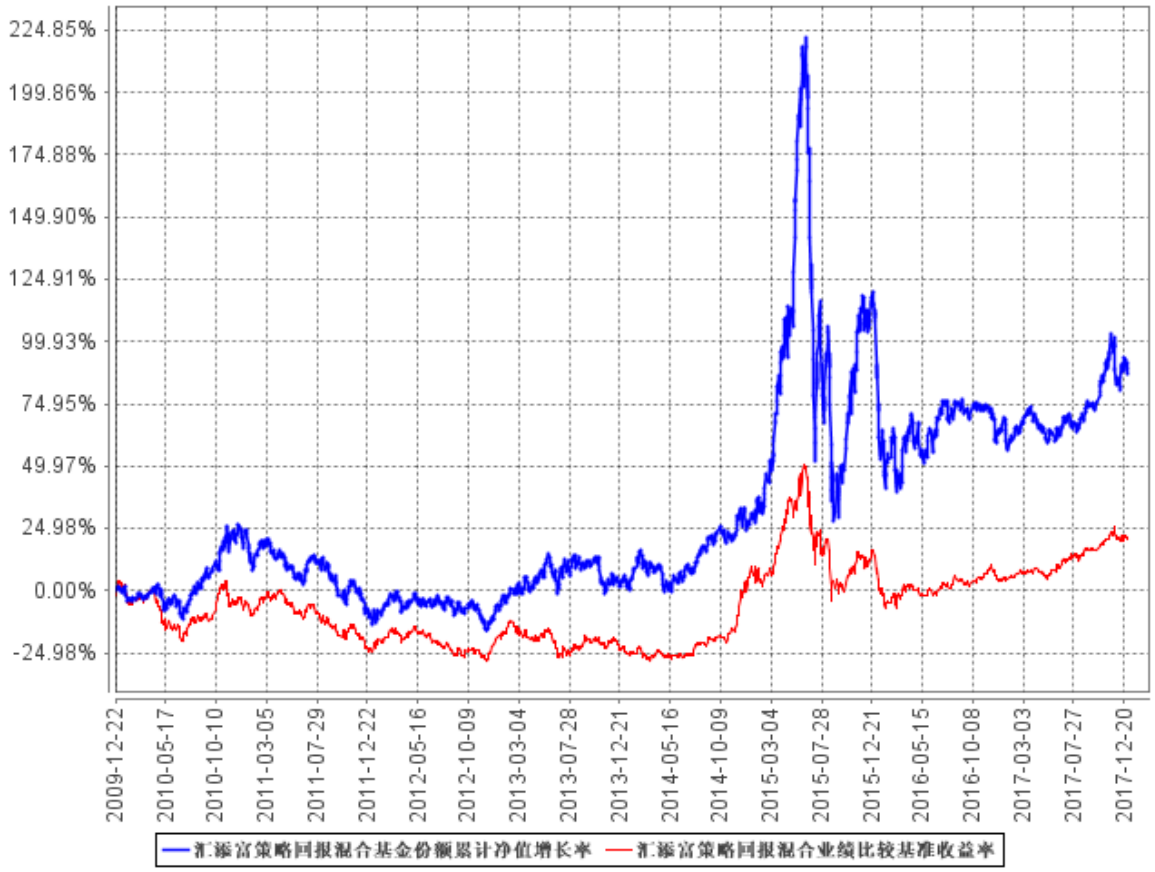
3.2 基金净值表现

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	9.01%	1.38%	4.07%	0.64%	4.94%	0.74%
过去六个月	12.70%	1.08%	8.00%	0.56%	4.70%	0.52%
过去一年	16.64%	0.96%	17.55%	0.51%	-0.91%	0.45%
过去三年	49.21%	2.40%	13.34%	1.35%	35.87%	1.05%
过去五年	103.08%	2.02%	51.50%	1.24%	51.58%	0.78%
自基金合同生效日起至今	91.39%	1.74%	21.19%	1.19%	70.20%	0.55%

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

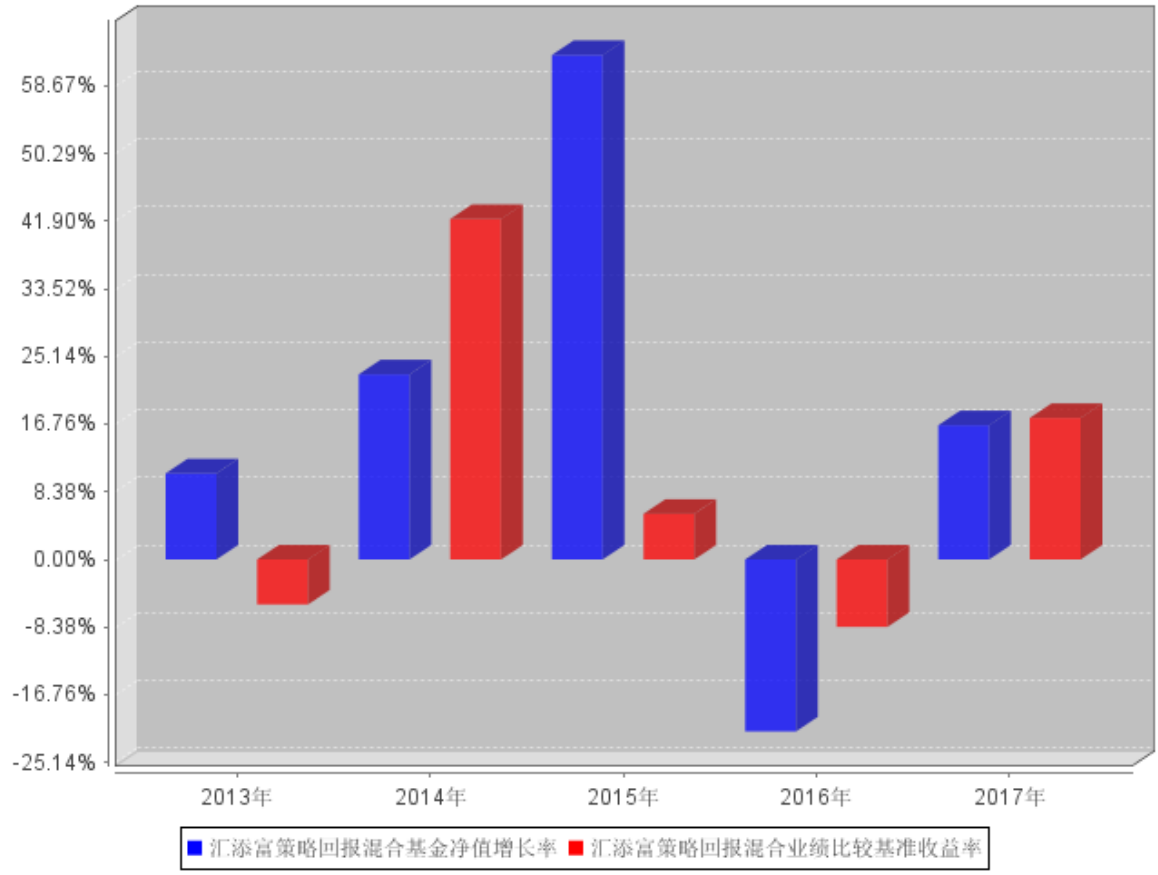
汇添富策略回报混合基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2009 年 12 月 22 日）起 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同规定。

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

汇添富策略回报混合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对比图



注：1、本基金的《基金合同》生效日为 2009 年 12 月 22 日。

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

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	-	-	-	-	
2016	0.600	46,697,337.41	20,170,635.34	66,867,972.75	
2015	0.300	3,470,280.25	3,405,445.38	6,875,725.63	
合计	0.900	50,167,617.66	23,576,080.72	73,743,698.38	

注：本基金 2017 年度未进行利润分配。

§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

汇添富基金成立于 2005 年 2 月，是中国一流的综合性资产管理公司之一。公司总部设在上海，在北京、上海、广州、成都等地设有分公司，在香港及上海设有子公司——汇添富资产管理(香港)有限公司和汇添富资本管理有限公司。公司及旗下子公司业务牌照齐全，拥有全国社保基金境内委托投资管理人、全国社保基金境外配售策略方案投资管理人、基本养老保险基金投资管理人、保险资金投资管理人、专户资产管理人、特定客户资产管理子公司、QDII 基金管理人、RQFII 基金管理人及 QFII 基金管理人等业务资格。

汇添富基金自成立以来，始终将投资业绩放在首位，形成了独树一帜的品牌优势，被誉为“选股专家”，并以优秀的长期投资业绩和一流的客户服务，赢得了广大基金持有人和海内外机构的认可和信赖。

目前，汇添富基金已经发展成为长期业绩优异、产品布局完善、业务领域全面、资产管理规模居前的大型基金公司。截至 2017 年 12 月 31 日，汇添富资产管理总规模超过 5500 亿元，其中公募资产管理规模（剔除货基口径）1892 亿元，位居行业第 7；服务客户超过 6000 万人。根据银河证券基金研究中心数据，汇添富旗下股票基金最近 3 年、5 年的股票投资主动管理平均收益率分别达到 89.86%、184.98%，在公募规模（不含货基）前十大基金公司中均排名第一。优秀的业绩赢得了行业与市场的高度认可。2017 年，汇添富基金荣获“金基金•TOP 公司奖”、“三年持续回报明星基金公司”、“优秀资产管理机构”等奖项，汇添富价值精选、汇添富民营活力荣获“五年期开放式混合型持续优胜金牛基金”，汇添富上海国企 ETF 荣获“上海金融创新成果奖”，“添富智投”荣登“2017 中国智能投顾新锐榜”。

2017 年，汇添富基金新发行 22 只公募基金，包括 11 只混合型基金，5 只指数基金，3 只债券基金以及 3 只 QDII 基金。其中，上证上海改革发展主题 ETF 为助力国企改革的创新产品，汇添富全球移动互联混合基金和汇添富全球医疗保健混合基金布局海外市场，进一步丰富完善了公司的国际产品线。全年，公司管理公募基金产品达到 97 只，涵盖股票型、混合型、债券型、理财、QFII、指数、商品、货币基金等风险程度和预期收益从高到低的各类产品，为投资者提供更加全面的资产配置选择。

2017 年，汇添富基金大力发展自有平台建设，不断引领行业创新。全年推出多款树立行业标

杆的拳头功能：添富智投、添富养老、汇闪付、工资宝、理财日历、在线客服机器人等。规模稳定在千亿级别，服务客户数量超 5000 万，处于行业领先水平。与此同时，互联网金融对外合作业务取得重大突破。截至年底，对外合作伙伴数量已超 80 家，成为业内对外合作最多的公司之一。

2017 年，汇添富基金稳步推行大机构战略，截至年底，公司机构理财总部保有规模达 2900 亿元；获得全国社保基金及基本养老保险基金投资管理人资格，社保基金和基本养老保险基金业务规模快速增长，受托管理组合账户数量持续增加。

2017 年，公司积极开展渠道销售和培训工作，专业的投顾服务以及良好的渠道维护口碑不断提升汇添富品牌在渠道影响力和认可度。同时公司持续大力开展定投、投资者教育、添富论坛等系列客户活动，营销培训活动拓展到银行和券商的网点、营业部。

2017 年，汇添富基金继续提升客户服务能力，全方位优化客户服务体系。公司通过完善大客户平台建设，搭建了囊括投顾式服务、基金理财、高端客户、现金宝的全新客服体系，为公司各项销售业务提供全方位支持。同时，持续优化电话、在线客服、短信系统等服务通道建设，丰富服务渠道，提高客服体验。

2017 年，香港子公司在加强母公司投研一体化基础上，深入发掘港股价值洼地，港股投资及海外债券投资业绩持续优异，汇添富中港策略基金获得晨星三年五星评级，在最近一年、三年、五年同类港股基金中业绩均位列第一；汇添富港币债券基金获得晨星三年四星评级，在同类型基金中持续名列第一。社保海外组合业绩在所有社保管理人中排名第一。

2017 年，公司公益事业蓬勃发展，公益活动精彩纷呈，公益品牌建设更上一个台阶。一是依托公司旗下上海汇添富公益基金会的专业平台，连续第十年开展“河流•孩子”公益助学计划，并成立“河流•孩子”公益助学联盟，将项目的平台化建设推向新的高度。二是将公益事业与公司党建结合，催生出新活力和亮点。公司党委下属的八个党支部分别与各地“添富小学”建立结对关系，党员们通过实地探访，了解学校实际困难和发展需求，积极寻求社会公益资源给予帮助。三是持续开展“河流•孩子”相关品牌活动，延续爱心传递温暖。持续开展“河流•孩子”公益助学计划，组织 100 名添富小学乡村一线教师分赴上海苏州参加专业教师培训；继续组织西部助学公益活动，邀请公司员工、客户和合作伙伴前往公司援建的 “添富小学”参加公益服务；继续举办海外留学志愿者支教，帮助山区孩子打开的视野。其余员工公益活动持续精彩纷呈，向公司员工发售筹款台历、参加沪上知名的群众性公益活动——一个鸡蛋的暴走筹款 4 万多元，作为“添富小学”多媒体教室建设费用等。

2018 年，资产管理行业面临重大行业变革期：混业竞争格局下严格依法从严监管；资管业务回归本源，短期业务失去快速扩张的土壤；互联网与金融的融合与碰撞将重构现有行业发展格局；

港股通、沪伦通的发展，带动了 A 股国际化也进一步带来新的机遇与挑战。汇添富基金将始终坚信长期的力量，开拓进取、奋勇前行，为筑造中国梦添砖加瓦，为成为中国最优秀的资产管理公司的梦想努力奋斗！

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		
顾耀强	汇添富策略回报混合基金、汇添富逆向投资混合基金、汇添富沪港深新价值股票基金、汇添富绝对收益定开混合基金的基金经理。	2009 年 12 月 22 日	-	13 年	国籍：中国。学历：清华大学管理学硕士。相关业务资格：证券投资基金从业资格。从业经历：曾任杭州永磁集团公司技术员、海通证券股份有限公司行业分析师、中海基金管理有限公司高级分析师、基金经理助理。2009 年 3 月加入汇添富基金管理股份有限公司，历任高级行业分析师、基金经理助理，2009 年 12 月 22 日至今任汇添富策略回报混合基金的基金经理，2012 年 3 月 9 日至今任汇添富逆向投资混合基金的基金经理，2014 年 4 月 8 日至 2016 年 8 月 24 日任汇添富均衡增长混合基金的基金经理，2016 年 7 月 27 日至今任汇添富沪港深新价值股票基金的基金经理，2017 年 3 月 15 日至今任汇添富绝对收益定开混合基金的基金经理。

注：1、基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，其“离职日期”为根据公司决议确定的解聘日期；

2、非首任基金经理，其“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决议确定的聘任日期和解聘日期；

3、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遵规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和本基金合同的约定，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，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金持有人利益的行为。本基金无重大违法、违规行为，本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

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《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，本基金管理人制定了《汇添富基金管理有限公司公平交易制度》，建立了健全、有效的公平交易制度体系，覆盖了全部开放式基金、特定客户资产管理组合和社保组合；涵盖了境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动；贯穿了授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估、监督检查等投资管理活动的各个环节。具体控制措施包括：（1）在研究环节，公司建立了统一的投研平台信息管理系统，公司内外部研究成果对所有基金经理和投资经理开放分享。同时，通过投研团队例会、投资研究联席会议等投资研究交流机制来确保各类投资组合经理可以公平享有信息获取机会。（2）在投资环节，公司针对基金、专户、社保、境外投资分别设立了投资决策委员会，各委员会根据各自议事规则分别召开会议，在其职责范围内独立行使投资决策权。各投资组合经理在授权范围内根据投资组合的风格和投资策略，独立制定资产配置计划和组合调整方案，并严格执行交易决策规则，以保证各投资组合交易决策的客观性和独立性。（3）在交易环节，公司实行集中交易，所有交易执行由集中交易室负责完成。投资交易系统参数设置为公平交易模式，按照“时间优先、价格优先、比例分配”的原则执行交易指令。所有场外交易执行亦由集中交易室处理，严格按照各组合事先提交的价格、数量进行分配，确保交易的公平性。（4）在交易监控环节，公司通过日常监控分析、投资交易监控报告、专项稽核等形式，对投资交易全过程实施监督，对包括利益输送在内的各类异常交易行为进行核查。核查的范围包括不同时间窗口下的同向交易、反向交易、交易价差、收益率差异、场外交易分配、场外议价公允性等等。（5）在报告分析方面，公司按季度和年度编制公平交易分析报告，并由投资组合经理、督察长、总经理审核签署。同时，投资组合的定期报告还将就公平交易执行情况做专项说明。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本基金管理人高度重视投资者利益保护。报告期内，本基金管理人持续完善公司投资交易业务流程和公平交易制度，进一步实现了流程化、体系化和系统化。公司投资交易风险控制体系由投资、研究、交易、清算，以及稽核监察等相关部门组成，各部门各司其职，对投资交易行为进行事前、事中和事后全程嵌入式的风险管控，确保公平交易制度的执行和实现。

报告期内，公司对旗下所有投资组合之间的收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行了分析，并采集连续四个季度期间内、不同时间窗口下（日内、3 日、5 日）同向交易的样本，根据 95%置信区间下差价率的 T 检验显著程度、差价率均值是否小于 1%、同向交易占优比等方面进行综合分析，未发现旗下投资组合之间存在利益输送情况。

通过投资交易监控、交易数据分析以及专项稽核检查，本基金管理人未发现任何违反公平交易的行为。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内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总成交量 5%的交易次数为 11 次，均是因为投资策略原因，并经过公司内部风控审核。经检查和分析未发现异常情况。

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 A 股市场呈现极其明显的分化行情。全年来看，上证 50 指数上涨 25.1%，沪深 300 指数上涨 21.8%，中小板指上涨 16.7%，创业板指下跌 10.7%。从行业来看，食品饮料和家电全年分别上涨 53.9%和 43%，表现最为优秀，而以传媒、计算机、轻工等代表的中小股票为主的板块，下跌普遍超过 10%。全年来看，以新能源为代表的成长股，以钢铁煤炭为代表的周期股，以家电白酒保险为代表的绩优白马股，阶段性都曾有很好的表现。市场明显偏好各个行业竞争能力最强的龙头股，而竞争优势不明显的小股票逐渐被边缘化。

本基金去年表现尚可，全年净值上涨 33.37%。我们前瞻性的判断市场风格变化，年初较早的布局以家电保险消费为代表的白马股，全年基本没有参与小股票的超跌反弹。我们坚持挑选高质量证券，强调自下而上选股思路，构建组合非常谨慎，因此组合出现重大亏损的股票相对较少。当然，我们遗憾的错过了新能源汽车的阶段性投资机会。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末汇添富策略回报混合基金份额净值为 1.731 元，本报告期基金份额净值增长率为 16.64%；同期业绩比较基准收益率为 17.55%。

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，我们认为市场仍将维持结构分化格局。宏观经济方面：全球主要经济体有望维持复苏态势；中国经济内生增长动力仍然较为强劲，虽然房地产调控存在一定变数，但整体经济保持稳定较快增长问题不大。市场环境方面：全球流动性环境边际上趋紧大势所趋；中国金融防风险去杠杆仍然箭在弦上，但优质上市公司股权的回报率仍然具备吸引力；此外，市场投资者结构和偏好这两年都发生了巨大变化，预计这一趋势亦将保持。投资方向上，我们继续看好消费升级、科技创新和供给侧改革等投资主题。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，公司以维护基金份额持人利益为宗旨，有效地组织开展对基金运作的内部监察稽核。督察长和稽核监察部门根据独立、客观、公正的原则，认真履行职责，通过常规稽核、专项检查和系统监控等方式方法积极开展工作，强化对基金运作和公司运营的合规性监察，促进内部控制和风险管理的不断改进，并依照规定定期向监管机关、董事会报送监察稽核报告。

本报告期内，本基金管理人内部监察工作主要包括以下几个方面：

（一）完善规章制度，健全内部控制体系

在本报告期内，督察长和稽核监察部门积极督促公司各部门按照法律法规和监管机构规定对相关制度的合法性、规范性、有效性和时效性进行了评估，并根据各项业务特点、业务发展实际，建立和健全了业务规章、岗位手册和业务操作流程，进一步明确了内部控制和风险管理责任，公司内部控制体系和风险管理体系更加成熟和完善，为切实维护基金持有人利益奠定了坚实的基础。

（二）加强稽核监察，确保基金运作和公司经营合法合规

本报告期内，督察长和稽核监察部门坚持以法律法规和公司各项制度为依据，按照监管机构的要求对基金运作和公司经营所涉及的各个环节实施了严格的稽核监察，包括对基金投资交易行为、投资指标的监控，对投资组合的风险度量、评估和建议，对基金信息披露的审核、监督，对基金投资、销售、营销的稽核、控制，对基金营运、技术系统的稽核、评估，切实保证了基金运作和公司经营的合法合规。

（三）强化培训教育，提高全员合规意识

本报告期内，督察长和稽核监察部门积极推动公司强化内部控制和风险管理的教育培训。公司及相关部门通过及时、有序和针对性的法律法规、制度规章、风险案例的研讨、培训和交流，提升了员工的风险意识、合规意识，提高了员工内部控制、风险管理的技能和水平，公司内部控制和风险管理基础得到夯实和优化。

通过上述工作，本报告期内，本基金管理人所管理的基金运作合法合规，充分维护和保障了基金份额持有人的合法权益。本基金管理人将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资产，继续加强内部控制和风险管理，进一步提高稽核监察工作的科学性和有效性，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

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证券监督管理委员会颁布的《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》、《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》以及 2017 年 9 月 5 日发布的《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》（2017 年 9 月 5 日《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》、《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》同时废止）等相关规定和基金合同的约定，日常估值由本基金管理人同本基金托管人一同进行，基金份额净值由本基金管理人完成估值后，经本基金托管人复核无误后由本基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账务的核对同时进行。

报告期内，公司制定了证券投资基金的估值政策和程序，并由投资研究部、固定收益部、集中交易室、基金营运部和稽核监察部人员及基金经理等组成了估值委员会，负责研究、指导基金估值业务。估值委员会成员均为公司各部门人员，均具有基金从业资格、专业胜任能力和相关工作经历，且之间不存在任何重大利益冲突。基金经理作为公司估值委员会的成员，不介入基金日常估值业务，但应参加估值小组会议，可以提议测算某一投资品种的估值调整影响，并有权表决有关议案但仅享有一票表决权，从而将其影响程度进行适当限制，保证基金估值的公平、合理，保持估值政策和程序的一贯性。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》约定：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 6 次，最少一次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配。基金红利发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截

止日）的时间不得超过 15 个工作日。

本基金本报告期未进行利润分配。

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

无。

§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，本基金托管人在对汇添富策略回报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，汇添富策略回报混合型证券投资基金的管理人——汇添富基金管理股份有限公司在汇添富策略回报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，汇添富策略回报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

本托管人依法对汇添富基金管理股份有限公司编制和披露的汇添富策略回报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

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2018）审字第 60466941_B10 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	汇添富策略回报混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了后附的汇添富策略回报混合型证券投资基金的财务报表，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。 我们认为，后附的汇添富策略回报混合型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了汇添富策略回报混合型证券投资基金 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年度的经营成果和净值变动情况。
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，我们独立于汇添富策略回报混合型证券投资基金，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。
强调事项	不适用
其他事项	不适用
其他信息	汇添富策略回报混合型证券投资基金管理层（以下简称“管理层”）对其他信息负责。其他信息包括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。
管理层和治理层对财务报表的责任	管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，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，管理层负责评估汇添富策略回报混合型证券投资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，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。 治理层负责监督汇添富策略回报混合型证券投资基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	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工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作： （1）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。 （2）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。 （3）评价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。 （4）对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，就可能导致对汇添富策略回报混合型证券投资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汇添富策略回报混合型证券投资基金不能持续经营。 （5）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。	
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	陈　露	陈　军
会计师事务所的地址	中国 北京	
审计报告日期	2018 年 3 月 27 日	

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：汇添富策略回报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	78,614,380.61	65,140,859.20
结算备付金		2,085,848.15	3,610,030.55
存出保证金		428,787.45	382,959.50
交易性金融资产	7.4.7.2	1,182,587,870.77	1,267,922,312.81
其中：股票投资		1,178,406,499.42	1,247,932,312.81
基金投资		-	-
债券投资		4,181,371.35	19,990,000.00
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	50,000,000.00	50,000,000.00
应收证券清算款		28,660,422.87	6,207,963.61
应收利息	7.4.7.5	95,928.63	464,552.77
应收股利		-	-
应收申购款		193,583.17	193,131.09
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		1,342,666,821.65	1,393,921,809.53
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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		16,846,624.63	-
应付赎回款		763,088.59	592,300.46
应付管理人报酬		1,661,904.65	1,818,637.80
应付托管费		276,984.09	303,106.29
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	1,301,826.33	1,531,006.24
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	390,333.43	411,525.35
负债合计		21,240,761.72	4,656,576.14
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	763,358,154.36	936,021,005.09
未分配利润	7.4.7.10	558,067,905.57	453,244,228.30
所有者权益合计		1,321,426,059.93	1,389,265,233.39
负债和所有者权益总计		1,342,666,821.65	1,393,921,809.53

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.731 元，基金份额总额 763,358,154.36 份。

7.2 利润表

会计主体：汇添富策略回报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 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
一、收入		234,970,811.63	-423,397,749.39
1.利息收入		998,137.26	1,657,980.11
其中：存款利息收入	7.4.7.11	820,188.78	1,025,454.35
债券利息收入		47,072.15	611,411.09
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		130,876.33	21,114.67
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-19,970,968.64	-588,710,449.62
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-32,804,031.30	-592,872,427.57
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	255,542.59	-46,650.00
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	12,577,520.07	4,208,627.95
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	253,746,267.59	162,731,028.17
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	197,375.42	923,691.95
减：二、费用		32,141,137.65	37,159,989.34
1．管理人报酬	7.4.10.2.1	20,005,775.05	23,854,547.44
2．托管费	7.4.10.2.2	3,334,295.84	3,975,757.91

3．销售服务费		-	-
4．交易费用	7.4.7.19	8,392,174.76	8,900,345.99
5．利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6．其他费用	7.4.7.20	408,892.00	429,338.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		202,829,673.98	-460,557,738.73

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汇添富策略回报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）	936,021,005.09	453,244,228.30	1,389,265,233.39
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	202,829,673.98	202,829,673.98
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）	-172,662,850.73	-98,005,996.71	-270,668,847.44
其中：1.基金申购款	71,575,855.72	42,252,522.85	113,828,378.57
2.基金赎回款	-244,238,706.45	-140,258,519.56	-384,497,226.01
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（基金净值）	763,358,154.36	558,067,905.57	1,321,426,059.93
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）	1,110,140,768.25	1,067,850,135.46	2,177,990,903.71
二、本期经营活动产生的	-	-460,557,738.73	-460,557,738.73

基金净值变动数（本期利润）			
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）	-174,119,763.16	-87,180,195.68	-261,299,958.84
其中：1.基金申购款	382,175,801.13	182,182,784.05	564,358,585.18
2.基金赎回款	-556,295,564.29	-269,362,979.73	-825,658,544.02
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）	-	-66,867,972.75	-66,867,972.75
五、期末所有者权益（基金净值）	936,021,005.09	453,244,228.30	1,389,265,233.39

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：

张晖	李骁	雷青松
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

汇添富策略回报混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），原汇添富策略回报股票型证券投资基金，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]1116 号文《关于核准汇添富策略回报股票型证券投资基金募集的批复》的核准，由基金管理人汇添富基金管理有限公司（现汇添富基金管理股份有限公司）向社会公开发行募集，基金合同于 2009 年 12 月 22 日正式生效，首次设立募集规模为 3,215,774,652.07 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人与注册登记机构均为汇添富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。

根据中国证券监督管理委员会于 2014 年 8 月 8 日实行的《公开募集证券投资基金运作管理办法》及相关基金合同的有关规定，经与基金托管人协商一致，汇添富基金管理股份有限公司决定自 2015 年 8 月 5 日起将本基金变更为混合基金，并相应修改本基金的《基金合同》。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券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。本基金采用“自上而下”的投资方式，灵活运用资产配置策略、行业轮动策略和个股精选策略，构

建有效的投资组合，并在科学严格的投资风险管理前提下，力求为基金份额持有人实现持续稳健的较高投资回报。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数×80%+上证国债指数×20%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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>》、其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

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，真实、完整地反映了本基金于 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息根据下列依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年自 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1)金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

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主要包括股票投资、债券投资和买入返售金融资产等；

(2)金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归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。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

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

本基金于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。

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的股票、债券及买入返售金融资产，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将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的公允价值变动计入当期损益；

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；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

本基金已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的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；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的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

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

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

卖出股票于成交日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(2)债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

(3)权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(4)股指/国债期货投资

买入或卖出股指/国债期货投资于成交日确认为股指/国债期货投资。股指/国债期货初始合约价值按成交金额确认；

股指/国债期货平仓于成交日确认衍生工具投资收益，股指/国债期货的初始合约价值按移动加权平均法于成交日结转；

(5)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；

(6)回购协议

本基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要

意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，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；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的金融工具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，按照估值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作为公允价值；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，应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，应对报价进行调整，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。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)不存在活跃市场的金融工具，应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，应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，才使用不可观察输入值；

(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的，基金管理人可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方法估值；

(4)如有新增事项，按国家最新规定估值。

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的基金份额总额所对应的金额。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确认。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损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益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收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益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确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，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)存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2)债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3)资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4)买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率（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；

(5)股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6)债券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7)资产支持证券投资收益/(损失)于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(8)股指/国债期货投资收益/(损失)于平仓日确认，并按平仓成交金额与其初始合约价值的差额入账；

(9)权证收益/（损失）于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(10)股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(11)公允价值变动收益/（损失）系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、以公允价值计量且其变动计入当期损益的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；

(12)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的时候确认。

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等在费用涵盖期间按基金合同或相关公告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

(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 6 次，最少一次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%，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按红利发放日的基金份额净值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；

(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)基金红利发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）的时间不得超过 15 个工作日；

(6)法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

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

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

7.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

7.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《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、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，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（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税，资管产品管理

人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人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，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

7.4.6.3 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

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。

7.4.6.4 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《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》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，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；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《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，自 2015 年 9 月 8 日起，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，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

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 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
活期存款	78,614,380.61	65,140,859.20
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 3 个月~1 年	-	-
其他存款	-	-
合计：	78,614,380.61	65,140,859.20

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		1,059,620,824.67	1,178,406,499.42	118,785,674.75
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	4,271,500.00	4,181,371.35	-90,128.65
	银行间市场	-	-	-
	合计	4,271,500.00	4,181,371.35	-90,128.65
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-

合计		1,063,892,324.67	1,182,587,870.77	118,695,546.10
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		1,383,000,284.30	1,247,932,312.81	-135,067,971.49
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	19,972,750.00	19,990,000.00	17,250.00
	合计	19,972,750.00	19,990,000.00	17,250.00
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		1,402,973,034.30	1,267,922,312.81	-135,050,721.49

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末及上年度末均无衍生金融资产/负债余额。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	50,000,000.00	-
合计	50,000,000.00	-
项目	上年度末 2016 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	50,000,000.00	-
合计	50,000,000.00	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

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	24,820.77	18,017.91
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	938.60	1,624.50
应收债券利息	1,263.90	430,590.06
应收买入返售证券利息	68,712.36	14,148.00
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	193.00	172.30
合计	95,928.63	464,552.77

注："其他"为应收结算保证金利息。

7.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末及上年度末均无其他资产余额。

7.4.7.7 应付交易费用

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
交易所市场应付交易费用	1,301,826.33	1,531,006.24
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	1,301,826.33	1,531,006.24

7.4.7.8 其他负债

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
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	333.43	1,525.35
应付信息披露费	300,000.00	320,000.00
应付审计费	90,000.00	90,000.00
合计	390,333.43	411,525.35

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	936,021,005.09	936,021,005.09

本期申购	71,575,855.72	71,575,855.72
本期赎回（以“-”号填列）	-244,238,706.45	-244,238,706.45
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	763,358,154.36	763,358,154.36

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

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	-146,917,815.29	600,162,043.59	453,244,228.30
本期利润	-50,916,593.61	253,746,267.59	202,829,673.98
本期基金份额交易产生的变动数	43,109,622.41	-141,115,619.12	-98,005,996.71
其中：基金申购款	-15,980,496.98	58,233,019.83	42,252,522.85
基金赎回款	59,090,119.39	-199,348,638.95	-140,258,519.56
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-154,724,786.49	712,792,692.06	558,067,905.57

7.4.7.11 存款利息收入

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
活期存款利息收入	778,723.79	968,000.86
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	34,516.74	42,989.58
其他	6,948.25	14,463.91
合计	820,188.78	1,025,454.35

注：其他包括结算保证金利息收入和直销申购款利息收入。

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	2,878,004,636.65	3,060,948,559.07
减：卖出股票成本总额	2,910,808,667.95	3,653,820,986.64
买卖股票差价收入	-32,804,031.30	-592,872,427.57

7.4.7.13 债券投资收益

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
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	21,966,690.90	41,113,000.00
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	21,234,750.00	40,046,650.00
减：应收利息总额	476,398.31	1,113,000.00
买卖债券差价收入	255,542.59	-46,650.00

7.4.7.14 贵金属投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益。

7.4.7.16 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	12,577,520.07	4,208,627.95
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	12,577,520.07	4,208,627.95

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	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

1.交易性金融资产	253,746,267.59	162,731,028.17
——股票投资	253,853,646.24	162,713,778.17
——债券投资	-107,378.65	17,250.00
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3.其他	-	-
合计	253,746,267.59	162,731,028.17

7.4.7.18 其他收入

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
基金赎回费收入	197,375.42	923,691.95
其他收入	-	-
合计	197,375.42	923,691.95

7.4.7.19 交易费用

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
交易所市场交易费用	8,392,174.76	8,899,595.99
银行间市场交易费用	-	750.00
合计	8,392,174.76	8,900,345.99

7.4.7.20 其他费用

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
审计费用	90,000.00	90,000.00
信息披露费	300,000.00	320,000.00
账户维护费	18,000.00	18,000.00
银行划款费	892.00	1,338.00
合计	408,892.00	429,338.00

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

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表审批日，除 7.4.6.2 增值税中披露的事项外，本基金无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
汇添富基金管理股份有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“工商银行”）	基金托管人、基金代销机构
东方证券股份有限公司（“东方证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构
东航金控有限责任公司	基金管理人的股东
上海上报资产管理有限公司	基金管理人的股东
上海菁聚金投资管理合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
汇添富资产管理（香港）有限公司	基金管理人的子公司
汇添富资本管理有限公司	基金管理人的子公司
上海汇添富公益基金会	与基金管理人同一批关键管理人员

注：以上关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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
东方证券股份有限公司	405,068,134.28	7.42%	1,188,394,331.63	20.48%

7.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方单元进行债券交易。

7.4.10.1.3 债券回购交易

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	
	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
东方证券股份有限公司	-	-	50,000,000.00	50.00%

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.10.1.4 权证交易

注：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。

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
东方证券股份有限公司	372,502.01	7.41%	108,253.50	8.32%
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
东方证券股份有限公司	1,089,874.58	20.46%	245,773.50	16.05%

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证管费、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。

7.4.10.2 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	20,005,775.05	23,854,547.44

其中：支付销售机构的客户维护费	4,270,558.55	4,801,730.99

注：基金管理费按前一日基金资产净值的 1.50％年费率计提。计算方法如下：

H＝E×1.50％÷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

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据基金管理人的授权委托书，于次月前 2 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、公休假等,支付日期顺延。

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	3,334,295.84	3,975,757.91

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25%的年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.25%÷当年天数

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据基金管理人的授权委托书，于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

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

注：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。

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

注：本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

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

注：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末均未投资本基金。

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
中国工商银行股份有限公司	78,614,380.61	778,723.79	65,140,859.20	968,000.86

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

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 年 12 月 28 日	2018 年 1 月 5 日	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	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	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	新股流通受限	13.60	13.60	1,187	16,143.20	16,143.20	-

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	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
000034	神州数码	2017 年 9 月 29 日	重大资产重组停牌	21.60	-	-	13,207	358,620.21	285,271.20	-
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	-
002919	名臣健康	2017 年 12 月 28 日	重大事项停牌	35.26	2018 年 1 月 2 日	38.79	821	10,311.76	28,948.46	-

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

截至本报告期末 2017 年 12 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证券款余额。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 12 月 31 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

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董事会、经营管理层、风险管理部门、各职能部门四级风险管理组织架构，并明确了相应的风险管理职能。

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发行的证券，不得超过该证券的 10%。

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，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；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。

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。

7.4.13.3.1 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。本基金的基金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。并于开放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。

本基金所持证券均在证券交易所上市；因此，除在附注 7.4.12 中列示的本基金于期末持有的流通受限证券外，本期末本基金的其他资产均能及时变现。此外，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。

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。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、债券投资、存出保证金、买入返售金融资产及部分应收申购款等。

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 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	78,614,380.61	-	-	-	-	-	78,614,380.61
结算备付金	2,085,848.15	-	-	-	-	-	2,085,848.15
存出保证金	428,787.45	-	-	-	-	-	428,787.45
交易性金融资产	-	-	4,181,371.35	-	-	1,178,406,499.42	1,182,587,870.77
买入返售金融资产	50,000,000.00	-	-	-	-	-	50,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	28,660,422.87	28,660,422.87
应收利息	-	-	-	-	-	95,928.63	95,928.63
应收申购款	7,069.15	-	-	-	-	186,514.02	193,583.17
资产总计	131,136,085.36	-	4,181,371.35	-	-	1,207,349,364.94	1,342,666,821.65
负债							

应付证券清算款	-	-	-	-	-	16,846,624.63	16,846,624.63
应付赎回款	-	-	-	-	-	763,088.59	763,088.59
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,661,904.65	1,661,904.65
应付托管费	-	-	-	-	-	276,984.09	276,984.09
应付交易费用	-	-	-	-	-	1,301,826.33	1,301,826.33
其他负债	-	-	-	-	-	390,333.43	390,333.43
负债总计	-	-	-	-	-	21,240,761.72	21,240,761.72
利率敏感度缺口	131,136,085.36	-	4,181,371.35	-	-	1,186,108,603.22	1,321,426,059.93
上年度末 2016 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	65,140,859.20	-	-	-	-	-	65,140,859.20
结算备付金	3,610,030.55	-	-	-	-	-	3,610,030.55
存出保证金	382,959.50	-	-	-	-	-	382,959.50
交易性金融资产	10,000,000.00	9,990,000.00	-	-	-	1,247,932,312.81	1,267,922,312.81

买入返售金融资产	50,000,000.00	-	-	-	-	-	50,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	6,207,963.61	6,207,963.61
应收利息	-	-	-	-	-	464,552.77	464,552.77
应收申购款	29,735.82	-	-	-	-	163,395.27	193,131.09
其他资产	-	-	-	-	-	-	0.00
资产总计	129,163,585.07	9,990,000.00	-	0.00	-	1,254,768,224.46	1,393,921,809.53
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	592,300.46	592,300.46
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,818,637.80	1,818,637.80
应付托管费	-	-	-	-	-	303,106.29	303,106.29
应付交易费用	-	-	-	-	-	1,531,006.24	1,531,006.24
其他负债	-	-	-	-	-	411,525.35	411,525.35
负债总计	-	-	-	-	-	4,656,576.14	4,656,576.14
利率敏感度缺口	129,163,585.07	9,990,000.00	-	0.00	-	1,250,111,648.32	1,389,265,233.39

注：上表统计了本基金资产及负债的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	该利率敏感性分析基于本基金于资产负债表日的利率风险状况；		
	该利率敏感性分析假定所有期限利率均以相同幅度变动 25 个基点，且除利率之外的其他市场变量保持不变；		
	该利率敏感性分析并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动；		
	银行存款、结算备付金、存出保证金和部分应收申购款均以活期存款利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响；买入返售金融资产利息收益在交易时已确定，不受利率变化影响；		
	该利率敏感性分析不包括在交易所交易的可转换债券与可交换债券。		
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 ）
	基准利率增加 25 个基点	-	-5,170.57
	基准利率减少 25 个基点	-	5,175.03

7.4.13.4.2 外汇风险

本基金所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

本基金所面临的其他价格风险主要系市场价格风险。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及债券，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。

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	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产-股票投资	1,178,406,499.42	89.18	1,247,932,312.81	89.83

交易性金融资产－基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产－债券投资	4,181,371.35	0.32	19,990,000.00	1.44
交易性金融资产－贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产－权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,182,587,870.77	89.50	1,267,922,312.81	91.27

注：本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的 60%—95%；债券资产、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的 5%—40%，其中，基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%，基金保留的现金以及投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。于资产负债表日，本基金面临的整体市场价格风险列示如上。

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

<table>
<tr><td rowspan="2">假设</td><td colspan="3">本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即从长期来看，本基金所投资的证券与业绩比较基准的变动呈线性相关，且报告期内的相关系数在资产负债表日后短期内保持不变；</td></tr>
<tr><td colspan="3">以下分析中，除市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。</td></tr>
<tr><td rowspan="4">分析</td><td rowspan="2">相关风险变量的变动</td><td colspan="2">对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）</td></tr>
<tr><td>本期末（ 2017 年 12 月 31 日 ）</td><td>上年度末（ 2016 年 12 月 31 日 ）</td></tr>
<tr><td>沪深 300 指数上涨 5%</td><td>74,218,750.99</td><td>88,469,538.91</td></tr>
<tr><td>沪深 300 指数下跌 5%</td><td>-74,218,750.99</td><td>-88,469,538.91</td></tr>
</table>

注：本基金管理人运用资本—资产定价模型方法对本基金的市场价格风险进行分析。下表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券市场组合的价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1 公允价值

7.4.14.1.1 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贷款和应收款项以及其他金融负债，其因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

7.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

7.4.14.1.2.1 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人民币 1,182,154,091.37 元，属于第二层次的余额为人民币 433,779.40 元，无划分为三层次余额（于 2016 年 12 月 31 日，属于第一层次的余额为人民币 1,181,876,189.13 元，属于第二层次的余额为人民币 86,046,123.68 元，无划分为三层次余额）。

7.4.14.1.2.2 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可转换债券等，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别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不将相关股票和可转换债券等的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的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，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。

7.4.14.1.2.3 第三层次公允价值余额和本期变动金额

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工具第三层次公允价值本期未发生变动。

7.4.14.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大承诺事项。

7.4.14.3 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的其他重要事项。

7.4.14.4 财务报表的批准

本财务报表已于 2018 年 3 月 21 日经本基金的基金管理人批准。

§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	1,178,406,499.42	87.77
	其中：股票	1,178,406,499.42	87.77
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	4,181,371.35	0.31
	其中：债券	4,181,371.35	0.31
	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	50,000,000.00	3.72
	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	80,700,228.76	6.01
8	其他各项资产	29,378,722.12	2.19
9	合计	1,342,666,821.65	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	744,765,403.08	56.36
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	210,694,460.28	15.94
G	交通运输、仓储和邮政业	17,942.76	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	34,112.55	0.00
J	金融业	66,338,291.26	5.02
K	房地产业	177,094.35	0.01

L	租赁和商务服务业	111,934,825.54	8.47
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	34,265,041.20	2.59
R	文化、体育和娱乐业	10,130,862.00	0.77
S	综合	-	-
	合计	1,178,406,499.42	89.18

8.2.2 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	601888	中国国旅	2,277,086	98,802,761.54	7.48
2	002236	大华股份	3,152,171	72,783,628.39	5.51
3	603939	益丰药房	1,585,526	72,109,722.48	5.46
4	601933	永辉超市	6,999,935	70,699,343.50	5.35
5	000568	泸州老窖	999,899	65,993,334.00	4.99
6	601012	隆基股份	1,699,874	61,943,408.56	4.69
7	002773	康弘药业	988,203	60,952,361.04	4.61
8	000651	格力电器	1,299,863	56,804,013.10	4.30
9	002273	水晶光电	2,399,745	56,609,984.55	4.28
10	601318	中国平安	800,000	55,984,000.00	4.24
11	000538	云南白药	510,000	51,912,900.00	3.93
12	002589	瑞康医药	3,586,998	48,245,123.10	3.65
13	600887	伊利股份	1,218,100	39,210,639.00	2.97
14	600305	恒顺醋业	3,099,866	36,547,420.14	2.77
15	000590	启迪古汉	2,263,939	35,385,366.57	2.68
16	002044	美年健康	1,566,760	34,265,041.20	2.59
17	601233	桐昆股份	1,500,000	33,735,000.00	2.55
18	000915	山大华特	800,000	24,112,000.00	1.82
19	002035	华帝股份	699,920	21,095,588.80	1.60
20	603658	安图生物	390,883	20,802,793.26	1.57

21	603108	润达医疗	1,580,000	19,355,000.00	1.46
22	000661	长春高新	100,000	18,300,000.00	1.38
23	002027	分众传媒	932,675	13,132,064.00	0.99
24	600985	雷鸣科化	1,000,000	12,980,000.00	0.98
25	601222	林洋能源	1,192,300	12,089,922.00	0.91
26	603019	中科曙光	300,000	12,072,000.00	0.91
27	002094	青岛金王	629,663	11,075,772.17	0.84
28	300601	康泰生物	222,600	10,517,850.00	0.80
29	601688	华泰证券	599,901	10,354,291.26	0.78
30	603096	新经典	150,600	10,130,862.00	0.77
31	000977	浪潮信息	500,000	9,940,000.00	0.75
32	600521	华海药业	299,982	9,035,457.84	0.68
33	300003	乐普医疗	348,000	8,407,680.00	0.64
34	300308	中际旭创	30,000	1,755,000.00	0.13
35	000034	神州数码	13,207	285,271.20	0.02
36	002916	深南电路	3,068	267,621.64	0.02
37	002920	德赛西威	4,569	178,784.97	0.01
38	600622	光大嘉宝	9,855	177,094.35	0.01
39	300735	光弘科技	3,764	54,163.96	0.00
40	002915	中欣氟材	1,085	38,181.15	0.00
41	603477	振静股份	1,955	37,027.70	0.00
42	300730	科创信息	821	34,112.55	0.00
43	300664	鹏鹞环保	3,640	32,323.20	0.00
44	002919	名臣健康	821	28,948.46	0.00
45	002922	伊戈尔	1,245	22,248.15	0.00
46	603161	科华控股	1,239	20,753.25	0.00
47	603283	赛腾股份	1,349	19,614.46	0.00
48	603329	上海雅仕	1,182	17,942.76	0.00
49	002923	润都股份	954	16,227.54	0.00
50	603080	新疆火炬	1,187	16,143.20	0.00
51	300684	中石科技	827	11,528.38	0.00
52	603655	朗博科技	880	8,184.00	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	000568	泸州老窖	150,855,374.56	10.86
2	000983	西山煤电	107,203,407.10	7.72
3	601601	中国太保	99,562,529.94	7.17
4	600702	沱牌舍得	94,310,643.36	6.79
5	000651	格力电器	93,986,445.26	6.77
6	601318	中国平安	67,307,889.81	4.84
7	601888	中国国旅	63,909,823.92	4.60
8	600036	招商银行	63,473,721.99	4.57
9	000538	云南白药	62,648,221.71	4.51
10	002456	欧菲科技	61,650,214.30	4.44
11	002773	康弘药业	58,597,093.20	4.22
12	601012	隆基股份	58,064,947.60	4.18
13	601933	永辉超市	57,733,034.35	4.16
14	002236	大华股份	57,542,759.59	4.14
15	600305	恒顺醋业	57,424,517.54	4.13
16	002273	水晶光电	56,666,523.40	4.08
17	000858	五粮液	53,604,068.10	3.86
18	000002	万科 A	52,930,990.75	3.81
19	600867	通化东宝	52,888,981.52	3.81
20	600009	上海机场	51,553,503.06	3.71
21	600887	伊利股份	51,093,697.93	3.68
22	601233	桐昆股份	49,233,103.98	3.54
23	603008	喜临门	46,908,447.73	3.38
24	600872	中炬高新	45,773,852.57	3.29
25	601009	南京银行	45,378,547.66	3.27
26	000921	海信科龙	43,969,040.19	3.16
27	000915	山大华特	35,825,464.77	2.58
28	300335	迪森股份	32,861,854.08	2.37
29	601222	林洋能源	30,320,201.73	2.18
30	601668	中国建筑	29,476,013.00	2.12
31	603939	益丰药房	28,562,892.60	2.06
32	600196	复星医药	28,274,311.00	2.04

注：本项“买入金额”按买入成交金额填列，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	000906	浙商中拓	128,516,904.16	9.25
2	601601	中国太保	110,540,712.20	7.96
3	600702	沱牌舍得	108,245,750.73	7.79
4	000983	西山煤电	108,131,299.46	7.78
5	600172	黄河旋风	104,869,681.89	7.55
6	000568	泸州老窖	97,743,699.92	7.04
7	002589	瑞康医药	79,994,676.11	5.76
8	600036	招商银行	76,274,574.98	5.49
9	603898	好莱客	74,180,867.94	5.34
10	600487	亨通光电	71,949,433.90	5.18
11	000915	山大华特	71,161,787.60	5.12
12	600867	通化东宝	65,900,093.65	4.74
13	002456	欧菲科技	65,563,897.41	4.72
14	600305	恒顺醋业	61,577,550.55	4.43
15	600009	上海机场	58,526,008.34	4.21
16	000002	万科 A	56,458,555.65	4.06
17	002584	西陇科学	55,378,573.53	3.99
18	000858	五粮液	51,392,678.57	3.70
19	000921	海信科龙	51,109,910.25	3.68
20	600872	中炬高新	50,636,652.66	3.64
21	600527	江南高纤	49,402,243.58	3.56
22	600079	人福医药	47,732,852.85	3.44
23	000651	格力电器	45,622,550.58	3.28
24	601009	南京银行	44,869,304.35	3.23
25	300009	安科生物	43,663,283.67	3.14
26	601318	中国平安	37,731,362.04	2.72
27	002350	北京科锐	37,137,540.00	2.67
28	603008	喜临门	35,855,039.77	2.58
29	002094	青岛金王	33,016,382.41	2.38
30	600196	复星医药	31,916,862.20	2.30
31	300335	迪森股份	31,376,680.75	2.26
32	603818	曲美家居	31,009,721.84	2.23
33	000034	神州数码	30,717,191.85	2.21
34	000807	云铝股份	30,674,891.60	2.21

35	300265	通光线缆	30,384,546.74	2.19
36	002556	辉隆股份	30,185,898.00	2.17
37	603108	润达医疗	29,901,447.36	2.15
38	601668	中国建筑	27,993,790.00	2.02

注：本项“卖出金额”按卖出成交金额填列，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	2,587,429,208.32
卖出股票收入（成交）总额	2,878,004,636.65

注：本项“买入股票成本”和“卖出股票收入”均按买卖成交金额填列，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	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	4,181,371.35	0.32
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	4,181,371.35	0.32

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	128020	水晶转债	42,715	4,181,371.35	0.32

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

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

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

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

注：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

注：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

注：本基金本报告期内未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体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。

8.12.2

本基金投资的前十名股票没有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	428,787.45
2	应收证券清算款	28,660,422.87
3	应收股利	-
4	应收利息	95,928.63
5	应收申购款	193,583.17
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	29,378,722.12

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：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

注：本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限的情况。

§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
47,336	16,126.38	19,141.59	0.00%	763,339,012.77	100.00%

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	8,582.77	0.00%

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
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（ 2009 年 12 月 22 日 ）基金份额总额	3,215,774,652.07
本报告期期初基金份额总额	936,021,005.09
本报告期基金总申购份额	71,575,855.72
减:本报告期基金总赎回份额	244,238,706.45
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	763,358,154.36

注：表内“总申购份额”含红利再投、转换入份额；“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

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

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.《汇添富全球移动互联灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 1 月 25 日正式生效，韩贤旺先生任该基金的基金经理。

2.基金管理人于 2017 年 2 月 4 日公告，增聘欧阳沁春先生和杨瑨先生担任汇添富全球移动互联灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，与韩贤旺先生共同管理该基金。

3.《汇添富鑫利债券型证券投资基金基金合同》于 2017 年 3 月 13 日正式生效，吴江宏先生任该基金的基金经理。

4.基金管理人于 2017 年 3 月 10 日公告，李骁先生任基金管理人副总经理。

5.《汇添富绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》于 2017 年 3 月 15 日正式生效，顾耀强先生和吴江宏先生任该基金的基金经理。

6.基金管理人于 2017 年 3 月 16 日公告，增聘吴江宏先生担任汇添富绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金的基金经理，与顾耀强先生共同管理该基金。

7.《汇添富中国高端制造股票型证券投资基金基金合同》于 2017 年 3 月 20 日正式生效，赵鹏飞先生任该基金的基金经理。

8.《汇添富年年泰定期开放混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 4 月 14 日正式生效，李怀定先生和陆文磊先生任该基金的基金经理。

9.《汇添富精选美元债债券型证券投资基金基金合同》于 2017 年 4 月 20 日正式生效，何旻先生和高欣先生任该基金的基金经理。

10.《汇添富年年丰定期开放混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 4 月 20 日正式生效，陈加荣先生任该基金的基金经理。

11.《汇添富鑫益定期开放债券型证券投资基金基金合同》于 2017 年 4 月 20 日正式生效，吴江宏先生和蒋文玲女士任该基金的基金经理。

12.《汇添富年年益定期开放混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 5 月 15 日正式生效，曾刚先生和蒋文玲女士任该基金的基金经理。

13.基金管理人于 2017 年 5 月 20 日公告，聘任郑慧莲女士为汇添富年年丰定期开放混合型

证券投资基金、汇添富年年益定期开放混合型证券投资基金和汇添富 6 月红添利定期开放债券型证券投资基金的基金经理助理，协助上述基金的基金经理开展投资管理工作。

14.基金管理人于 2017 年 5 月 20 日公告，增聘赖中立先生担任汇添富优选回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，与蒋文玲女士共同管理该基金。

15.基金管理人 2017 年 6 月 21 日公告，雷鸣先生不再担任汇添富新兴消费股票型证券投资基金的基金经理，由刘伟林先生单独管理该基金。

16.《汇添富鑫汇定期开放债券型证券投资基金基金合同》于 2017 年 6 月 23 日正式生效，吴江宏先生和蒋文玲女士任该基金的基金经理。

17.《汇添富添福吉祥混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 7 月 24 日正式生效，何旻先生任该基金的基金经理。

18.基金管理人于 2017 年 7 月 29 日公告，增聘胡昕炜先生担任汇添富添福吉祥混合型证券投资基金的基金经理，与何旻先生共同管理该基金。

19.《汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金（LOF）基金合同》于 2017 年 8 月 10 日正式生效，吴振翔先生任该基金的基金经理。

20.《汇添富全球医疗保健混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 8 月 16 日正式生效，刘江先生担任该基金的基金经理。

21.《汇添富盈润混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 9 月 6 日正式生效，何旻先生任该基金的基金经理。

22.《汇添富沪深 300 指数型发起式证券投资基金（LOF）基金合同》于 2017 年 9 月 6 日正式生效，楚天舒女士任该基金的基金经理。

23.基金管理人于 2017 年 9 月 8 日公告，增聘陶然先生为汇添富现金宝货币市场基金、汇添富添富通货币市场基金的基金经理，与蒋文玲女士共同管理上述基金。

24.基金管理人于 2017 年 9 月 21 日公告，增聘胡昕炜先生为汇添富盈润混合型证券投资基金的基金经理，与何旻先生共同管理该基金。

25.《汇添富民丰回报混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 9 月 27 日正式生效，吴江宏先生任该基金的基金经理。

26.基金管理人于 2017 年 9 月 28 日公告，增聘赵鹏飞先生为汇添富民丰回报混合型证券投资基金的基金经理，与吴江宏先生共同管理该基金。

27.《汇添富弘安混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 9 月 29 日正式生效，何旻先生和赵鹏飞先生任该基金的基金经理。

28. 《汇添富睿丰混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 9 月 29 日正式生效，李怀定先生任该基金的基金经理。

29. 基金管理人于 2017 年 9 月 30 日公告，增聘赵鹏飞先生为汇添富睿丰混合型证券投资基金的基金经理，与李怀定先生共同管理该基金。

30.《汇添富港股通专注成长混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 11 月 10 日正式生效，佘中强先生和倪健先生任该基金的基金经理。

31.《汇添富中证港股通高股息投资指数发起式证券投资基金（LOF）基金合同》于 2017 年 11 月 24 日正式生效，赖中立先生任该基金的基金经理。

32.《上证上海改革发展主题交易型开放式指数发起式证券投资基金基金合同》于 2017 年 12 月 1 日正式生效，楚天舒女士任该基金的基金经理。

33. 《汇添富中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金（LOF）基金合同》于 2017 年 12 月 4 日正式生效，楚天舒女士任该基金的基金经理。

34. 基金管理人于 2017 年 12 月 14 日公告，增聘董瑾女士为中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金联接基金、上证上海改革发展主题交易型开放式指数发起式证券投资基金、汇添富沪深 300 指数型发起式证券投资基金（LOF）和汇添富中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金（LOF）的基金经理助理，协助上述基金的基金经理开展投资管理工作。

35. 基金管理人于 2017 年 12 月 14 日公告，增聘郑慧莲女士为汇添富 6 月红添利定期开放债券型证券投资基金的基金经理，与何旻先生、曾刚先生共同管理该基金。

36. 基金管理人于 2017 年 12 月 14 日公告，增聘郑慧莲女士为汇添富年年丰定期开放混合型证券投资基金的基金经理，与陈加荣先生共同管理该基金。

37. 基金管理人于 2017 年 12 月 14 日公告，增聘郑慧莲女士为汇添富年年泰定期开放混合型证券投资基金的基金经理，与李怀定先生、陆文磊先生、胡娜女士共同管理该基金。

38. 基金管理人于 2017 年 12 月 14 日公告，增聘郑慧莲女士为汇添富双利增强债券型证券投资基金的基金经理，与曾刚先生共同管理该基金。

39. 基金管理人于 2017 年 12 月 14 日公告，增聘郑慧莲女士为汇添富双利债券型证券投资基金的基金经理，与陈加荣先生共同管理该基金。

40. 基金管理人于 2017 年 12 月 27 日公告，增聘郑慧莲女士为汇添富多元收益债券型证券投资基金的基金经理，与曾刚先生共同管理该基金。

41. 基金管理人于 2017 年 12 月 27 日公告，增聘郑慧莲女士为汇添富年年益定期开放混合型证券投资基金的基金经理，与曾刚先生、蒋文玲女士共同管理该基金。

42. 本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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，未发生影响公司经营或基金运营业务的诉讼。

本报告期内，无涉及本基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

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

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）自本基金合同生效日（2009 年 12 月 22 日）起至本报告期末，为本基金进行审计。本报告期内应付未付的审计费用为人民币玖万元整。

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

本报告期内未发生基金管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情形。

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关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	
中泰证券	2	1,193,440,261.59	21.86%	1,096,266.16	21.79%	-
中信建投	1	546,921,169.52	10.02%	509,347.89	10.13%	-
东方证券	2	405,068,134.28	7.42%	372,502.01	7.41%	-
西南证券	1	404,528,072.45	7.41%	368,646.78	7.33%	-
长江证券	1	316,783,517.85	5.80%	295,020.77	5.87%	-
方正证券	1	310,157,623.42	5.68%	282,646.29	5.62%	-

华泰联合证券	1	247,412,972.03	4.53%	225,467.75	4.48%	-
国都证券	1	244,500,175.77	4.48%	227,703.83	4.53%	-
上海证券	1	208,875,711.26	3.83%	194,525.55	3.87%	-
东吴证券	2	208,377,524.62	3.82%	190,266.62	3.78%	-
国金证券	2	206,370,285.43	3.78%	188,065.75	3.74%	-
东兴证券	1	160,812,289.34	2.95%	149,765.06	2.98%	-
中银国际	1	121,131,845.60	2.22%	112,810.39	2.24%	-
兴业证券	2	117,685,862.75	2.16%	107,294.25	2.13%	-
申万宏源证券	1	116,441,197.02	2.13%	108,441.04	2.16%	-
安信证券	2	113,737,181.20	2.08%	104,418.64	2.08%	-
广发证券	1	91,377,352.97	1.67%	85,098.73	1.69%	-
中信证券	1	75,236,412.38	1.38%	70,068.19	1.39%	-
中金公司	2	65,484,853.08	1.20%	60,986.37	1.21%	-
中投证券	1	59,348,753.79	1.09%	55,271.54	1.10%	-
海通证券	2	52,278,651.92	0.96%	47,641.43	0.95%	-
高华证券	1	45,653,554.79	0.84%	42,516.28	0.85%	-
国泰君安	2	44,322,350.56	0.81%	40,649.21	0.81%	-
国信证券	2	43,300,099.34	0.79%	39,459.53	0.78%	-
招商证券	2	41,448,517.65	0.76%	38,601.34	0.77%	-
民族证券	1	17,709,008.56	0.32%	16,492.40	0.33%	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
财富证券	1	-	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
华鑫证券	1	-	-	-	-	-

华融证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-

注：此处的佣金指通过单一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。

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
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	100,000,000.00	52.63%	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	1,490,690.90	100.00%	40,000,000.00	21.05%	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
华泰联合证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-

安信证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
民族证券	-	-	50,000,000.00	26.32%	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
财富证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-

注：1、专用交易单元的选择标准和程序：

（1）基金交易交易单元选择和成交量的分配工作由投资研究部统一负责组织、协调和监督。

（2）交易单元分配的目标是按照证监会的有关规定和对券商服务的评价控制交易单元的分配比例。

（3）投资研究部根据评分的结果决定本月的交易单元分配比例。其标准是按照上个月券商评分决定本月的交易单元拟分配比例，并在综合考察年度券商的综合排名及累计的交易分配量的基础上进行调整，使得总的交易量的分配符合综合排名，同时每个交易单元的分配量不超过总成交量的30%。

（4）每半年综合考虑近半年及最新的评分情况，作为增加或更换券商交易单元的依据。

（5）调整租用交易单元的选择及决定交易单元成交量的分布情况由投资研究部决定，投资总监审批。

（6）成交量分布的决定应于每月第一个工作日完成；更换券商交易单元的决定于合同到期前一个月完成。

（7）调整和更换交易单元所涉及到的交易单元运行费及其他相关费用，基金会计应负责协助及时催缴。

（8）按照《关于基金管理公司向会员租用交易单元有关事项的通知》规定，同一基金管理公司托管在同一托管银行的基金可以共用同一交易单元进行交易。

2、 报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

本基金本报告期内新增 1 家证券公司的 1 个交易单元：东吴证券（深交所单元），退租 1 家证券公司的 1 个交易单元：海通证券（上交所单元）。

11.8 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	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下基金 2016 年年度资产净值的公告	公司网站	2017 年 1 月 3 日
2	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下 QDII 基金 2016 年年度资产净值的公告	公司网站	2017 年 1 月 4 日
3	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加奕丰金融为代销机构的公告	中证报，证券时报，上证报，公司网站	2017 年 1 月 11 日
4	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加凤凰金信为代销机构的公告	中证报，证券时报，上证报，公司网站	2017 年 1 月 13 日
5	汇添富旗下公募基金 2016 年第 4 季度报告	中证报，上交所，证券时报，上证报，公司网站，深交所	2017 年 1 月 19 日

6	汇添富策略回报混合型证券投资基金更新招募说明书（2016 年第 2 号）	中证报，证券时报，上证报，公司网站	2017 年 1 月 23 日
7	汇添富基金管理股份有限公司关于调整旗下部分基金通过盈米财富申购金额下限的公告	中证报，证券时报，上证报，公司网站	2017 年 2 月 21 日
8	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加交通银行开展的电子渠道申购、定投基金费率优惠活动的公告	中证报，证券时报，上证报，公司网站	2017 年 2 月 23 日
9	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加联储证券为代销机构的公告	中证报，证券时报，上证报，公司网站	2017 年 2 月 24 日
10	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加泉州银行为代销机构的公告	中证报，证券时报，上证报，公司网站	2017 年 2 月 27 日
11	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加苏宁基金为代销机构的公告	中证报，证券时报，上证报，公司网站	2017 年 3 月 2 日
12	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加龙江银行为代销机构并参与费率优惠活动的公告	中证报，证券时报，上证报，公司网站	2017 年 3 月 7 日
13	汇添富基金管理股份有限公司关于高级管理人员变更的公告（副总经理）	中证报，证券时报，上证报，公司网站	2017 年 3 月 10 日
14	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加国都证券开展的定投基金费率优惠活动的公	中证报，证券时报，上证报，公司网站	2017 年 3 月 13 日

	告		
15	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金在财通证券开通定投业务并参加定投费率优惠活动的公告	中证报,证券时报,上证报,公司网站	2017 年 3 月 16 日
16	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参与财通证券申购费率优惠活动的公告	中证报,证券时报,上证报,公司网站	2017 年 3 月 16 日
17	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加好买基金开展的定投费率优惠活动的公告	中证报,证券时报,上证报,公司网站	2017 年 3 月 20 日
18	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加申万宏源开展的申购基金费率优惠活动的公告	中证报,证券时报,上证报,公司网站	2017 年 3 月 23 日
19	汇添富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代销机构并参与费率优惠活动的公告	中证报,证券时报,上证报,公司网站	2017 年 3 月 23 日
20	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加申万宏源西部开展的申购基金费率优惠活动的公告	中证报,证券时报,上证报,公司网站	2017 年 3 月 23 日
21	汇添富旗下公募基金 2016 年年度报告及摘要	中证报,上交所,证券时报,上证报,公司网站,深交所	2017 年 3 月 29 日
22	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金继续参与中国工商银行申购基金费率优惠活动的	中证报,证券时报,上证报,公司网站	2017 年 3 月 30 日

	公告		
23	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加首创证券开展的申购费率优惠活动的公告	中证报,证券时报,上证报,公司网站	2017 年 4 月 11 日
24	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加首创证券开展的定投费率优惠活动的公告	中证报,证券时报,上证报,公司网站	2017 年 4 月 11 日
25	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加中信建投证券开展的定投费率优惠活动的公告	中证报,证券时报,上证报,公司网站	2017 年 4 月 14 日
26	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加交通银行开展的电子渠道申购、定投基金费率优惠活动的公告	中证报,证券时报,上证报,公司网站	2017 年 4 月 22 日
27	汇添富旗下公募基金 2017 年一季报	中证报,上交所,证券时报,上证报,公司网站,深交所	2017 年 4 月 24 日
28	汇添富基金管理股份有限公司关于调整旗下基金场外申购、定投单笔金额下限及场外最低赎回、转换、保留份额的公告	中证报,证券时报,上证报,公司网站	2017 年 4 月 26 日
29	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加中银国际证券为代销机构的公告	中证报,证券时报,上证报,公司网站	2017 年 5 月 3 日
30	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金在中银国际证券开通定投业务的公告	中证报,证券时报,上证报,公司网站	2017 年 5 月 5 日
31	汇添富基金管理股份有限公司关	中证报,证券时报,	2017 年 5 月 5 日

	于旗下部分基金在中银国际证券开通转换业务的公告	上证报,公司网站	
32	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金调整停牌股票估值方法的公告	中证报,证券时报,上证报,公司网站	2017 年 5 月 11 日
33	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加江苏银行开展的费率优惠活动的公告	中证报,证券时报,上证报,公司网站	2017 年 6 月 9 日
34	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加长量基金开展的定投基金费率优惠活动的公告	中证报,证券时报,上证报,公司网站	2017 年 6 月 17 日
35	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加交通银行开展的手机银行申购、定投基金费率优惠活动的公告	中证报,证券时报,上证报,公司网站	2017 年 7 月 1 日
36	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加交通银行开展的网上银行申购基金费率优惠活动的公告	中证报,证券时报,上证报,公司网站	2017 年 7 月 1 日
37	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下基金 2017 年上半年年度资产净值的公告	公司网站	2017 年 7 月 3 日
38	汇添富旗下公募基金 2017 年二季报	中证报,上交所,证券时报,上证报,公司网站,深交所	2017 年 7 月 20 日
39	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加华泰证券开展的申购费率优惠活动的公告	中证报,证券时报,上证报,公司网站	2017 年 8 月 1 日

40	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加华泰证券开展的定投费率优惠活动的公告	中证报，证券时报，上证报，公司网站	2017 年 8 月 1 日
41	汇添富策略回报混合型证券投资基金更新招募说明书（2017 年第 1 号）	中证报，证券时报，上证报，公司网站	2017 年 8 月 1 日
42	汇添富旗下公募基金 2017 年半年报	中证报，上交所，证券时报，上证报，公司网站，深交所	2017 年 8 月 26 日
43	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加广发银行开展的申购费率优惠活动的公告	中证报，证券时报，上证报，公司网站	2017 年 9 月 13 日
44	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加平安银行开展的费率优惠活动的公告	中证报，证券时报，上证报，公司网站	2017 年 9 月 26 日
45	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加江苏银行开展的费率优惠活动的公告	中证报，证券时报，上证报，公司网站	2017 年 10 月 19 日
46	2017 年汇添富旗下基金第 3 季度报告（86 只）	中证报，上交所，证券时报，上证报，公司网站，深交所	2017 年 10 月 25 日
47	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加基煜基金为代销机构的公告	中证报，证券时报，上证报，公司网站	2017 年 10 月 26 日
48	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加伯嘉基金为代销机构并参与费率优惠活动的公告	中证报，证券时报，上证报，公司网站	2017 年 11 月 9 日
49	汇添富基金管理股份有限公司关	中证报，证券时报，	2017 年 11 月 9 日

	于旗下部分基金增加四川天府银行为代销机构的公告	上证报,公司网站	
50	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加苏州银行开展的费率优惠活动的公告	中证报,证券时报,上证报,公司网站	2017 年 12 月 28 日
51	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加邮储银行开展的费率优惠活动的公告	中证报,证券时报,上证报,公司网站	2017 年 12 月 28 日
52	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加交通银行开展的手机银行申购、定投基金费率优惠活动的公告	中证报,证券时报,上证报,公司网站	2017 年 12 月 29 日
53	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加工商银行开展的定投基金费率优惠活动的公告	中证报,证券时报,上证报,公司网站	2017 年 12 月 29 日

§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

注：无。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

1、中国证监会批准汇添富策略回报股票型证券投资基金募集的文件；

2、《汇添富策略回报混合型证券投资基金基金合同》；

3、《汇添富策略回报混合型证券投资基金托管协议》；

4、基金管理人业务资格批件、营业执照；

5、报告期内汇添富策略回报混合型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告；

6、中国证监会要求的其他文件。

13.2 存放地点

上海市富城路 99 号震旦国际大楼 21-23 楼　汇添富基金管理股份有限公司

13.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅，或登录基金管理人网站 www.99fund.com 查阅，还可拨打基金管理人客户服务中心电话：400-888-9918 查询相关信息。

汇添富基金管理股份有限公司

2018 年 3 月 28 日