

富国改革动力混合型证券投资基金

二〇一七年年度报告

(摘要)

2017年12月31日

基金管理人：富国基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2018年03月31日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

富国基金管理有限公司的董事会、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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 3 月 29 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。

富国基金管理有限公司承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

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

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

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

1.2

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	富国改革动力混合
基金主代码	001349
交易代码	前端交易代码：001349 后端交易代码：001350
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年05月20日
基金管理人	富国基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	6,536,220,558.42份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于具备改革动力的相关股票，通过精选个股和风险控制，力求为基金份额持有人获取超过业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金采取“自上而下”的方式进行大类资产配置，根据对宏观经济、市场面、政策面等因素进行定量与定性相结合的分析研究，确定组合中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例。
业绩比较基准	中证800指数收益率×60%+中债综合指数收益率×40%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金，属于较高预期收益和预期风险水平的投资品种。

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	富国基金管理有限公司	中国银行股份有限公司	
信息披露负责人	姓名	赵瑛	王永民
	联系电话	021-20361818	010-66594896
	电子邮箱	public@fullgoal.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话	95105686、4008880688	95566	
传真	021-20361616	010-66594942	

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.fullgoal.com.cn
基金年度报告备置地点	富国基金管理有限公司 上海市浦东新区世纪大道8号

	上海国金中心二期 16-17 楼 托管人住所
--	---------------------------

§ 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	2015 年 5 月 20 日 (基金合同生效日) 至 2015 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-657,086,690.23	-1,518,097,595.85	-1,181,585,836.41
本期利润	-862,907,269.36	-1,935,211,033.17	-1,093,349,736.61
加权平均基金份额本期利润	-0.1045	-0.1850	-0.0890
本期基金份额净值增长率	-14.19%	-18.96%	-6.10%
3.1.2 期末数据和指标	2017 年 12 月 31 日	2016 年 12 月 31 日	2015 年 12 月 31 日
期末可供分配基金份额利润	-0.3472	-0.2398	-0.0976
期末基金资产净值	4,267,102,635.33	7,292,620,690.29	10,256,076,921.29
期末基金份额净值	0.653	0.761	0.939

注：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，开放式基金的申购赎回费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。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。

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	-10.06%	1.10%	1.13%	0.46%	-11.19%	0.64%
过去六个月	-8.16%	0.96%	4.77%	0.41%	-12.93%	0.55%
过去一年	-14.19%	0.89%	9.08%	0.39%	-23.27%	0.50%
自基金合同生效日起至今	-34.70%	1.92%	-7.81%	1.04%	-26.89%	0.88%

注：本基金业绩比较基准为：本基金的业绩比较基准为：中证 800 指数收益率 × 60% + 中债综合指数收益率 × 40%。

中证 800 指数是由中证指数有限公司编制的综合反映沪深证券市场内大中小市值公司的整体状况的指数。中证 800 指数的成份股由中证 500 指数和沪深 300 指数成份股一起构成。本基金管理人认为，该业绩比较基准目前能够忠实地反映本基金的风险收益特征。

本基金每个交易日对业绩比较基准进行再平衡处理，1 日收益率（benchmark）按下列公式计算：

$$\text{benchmark}_t = 60\% * [\text{中证 800 指数 } t / (\text{中证 800 指数 } t-1) - 1] + 40\% * [\text{中债综合指数 } t / (\text{中债综合指数 } t-1) - 1];$$

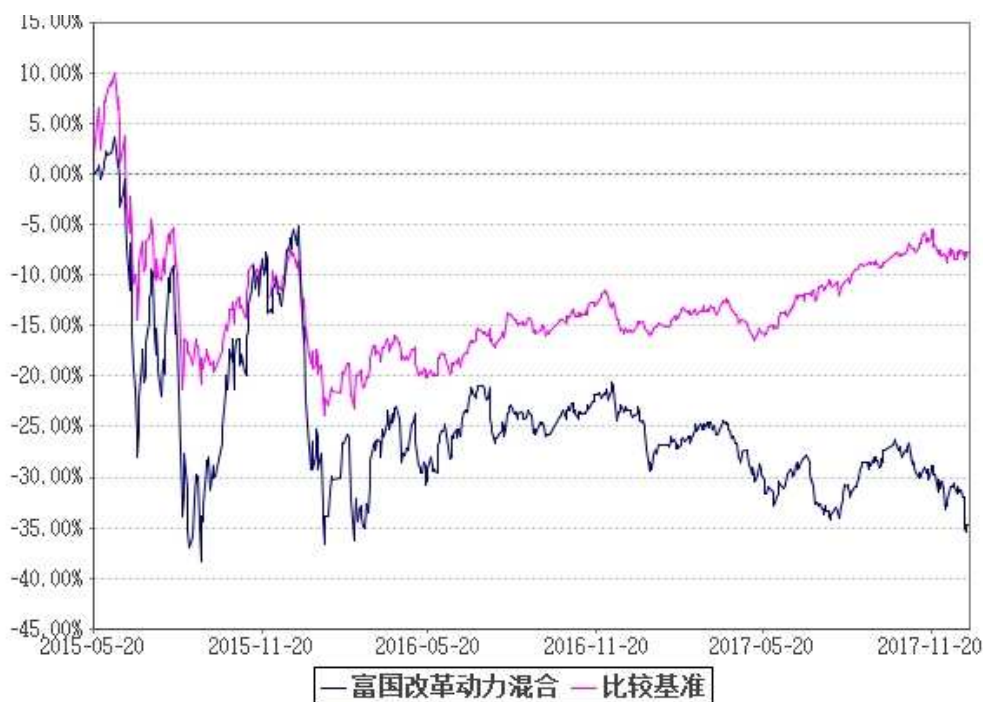
其中， $t=1, 2, 3, \dots, T$ ， T 表示时间截至日；

期间 T 日收益率（ benchmark_T ）按下列公式计算：

$$\text{benchmark}_T = [\prod_{t=1}^T (1 + \text{benchmark}_t)] - 1$$

其中， $T=2, 3, 4, \dots$ ； $\prod_{t=1}^T (1 + \text{benchmark}_t)$ 表示 t 日至 T 日的 $(1 + \text{benchmark}_t)$ 数学连乘。

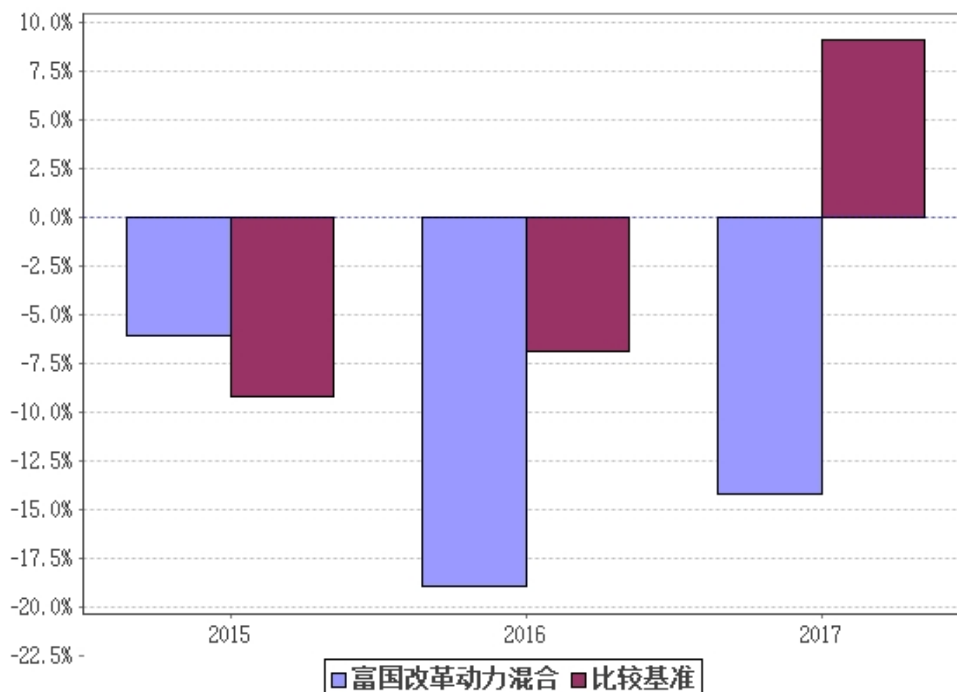
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、截止日期为 2017 年 12 月 31 日。

2、本基金于 2015 年 5 月 20 日成立，建仓期 6 个月，从 2015 年 5 月 20 日起至 2015 年 11 月 19 日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

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



注：2015 年按实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金 2015 年 5 月 20 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日未进行利润分配

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

富国基金管理有限公司于 1999 年 4 月 13 日获国家工商行政管理局登记注册成立，是经中国证监会批准设立的首批十家基金管理公司之一，公司于 2001 年 3 月从北京迁址上海。2003 年 9 月加拿大蒙特利尔银行（BMO）参股富国基金管理有限公司的工商变更登记办理完毕，富国基金管理有限公司成为国内首批成立的十家基金公司中，第一家中外合资的基金管理公司。截至 2017 年 12 月 31 日，本基金管理人共管理富国天盛灵活配置混合型证券投资基金、富国消费主题混合型证券投资基金、富国天源沪港深平衡混合型证券投资基金、富国天利增长债券投资基金、富国天益价值混合型证券投资基金、富国天瑞强势地区精选混合型证券投资基金、富国天惠精选成长混合型证券投资基金（LOF）、富国天时货币市场基金、富国天合稳健优选混合型证券投资基金、富国天博创新主题混合型证券

投资基金、富国天成红利灵活配置混合型证券投资基金、富国天丰强化收益债券型证券投资基金（LOF）、富国中证红利指数增强型证券投资基金、富国优化增强债券型证券投资基金、富国沪深 300 增强证券投资基金、富国通胀通缩主题轮动混合型证券投资基金、富国汇利回报两年定期开放债券型证券投资基金、富国全球债券证券投资基金、富国可转换债券证券投资基金、上证综指交易型开放式指数证券投资基金、富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金、富国天盈债券型证券投资基金（LOF）、富国全球顶级消费品混合型证券投资基金、富国低碳环保混合型证券投资基金、富国中证 500 指数增强型证券投资基金（LOF）、富国产业债债券型证券投资基金、富国新天锋定期开放债券型证券投资基金、富国高新技术产业混合型证券投资基金、富国中国中小盘（香港上市）混合型证券投资基金、富国纯债债券型发起式证券投资基金、富国强回报定期开放债券型证券投资基金、富国宏观策略灵活配置混合型证券投资基金、富国稳健增强债券型证券投资基金、富国信用债债券型证券投资基金、富国目标收益一年期纯债债券型证券投资基金、富国医疗保健行业混合型证券投资基金、富国创业板指数分级证券投资基金、富国目标收益两年期纯债债券型证券投资基金、富国国有企业债债券型证券投资基金、富国城镇发展股票型证券投资基金、富国高端制造行业股票型证券投资基金、富国收益增强债券型证券投资基金、富国新回报灵活配置混合型证券投资基金、富国研究精选灵活配置混合型证券投资基金、富国中证军工指数分级证券投资基金、富国中证移动互联网指数分级证券投资基金、富国中证国有企业改革指数分级证券投资基金、富国目标齐利一年期纯债债券型证券投资基金、富国富钱包货币市场基金、富国安益货币市场基金、富国中小盘精选混合型证券投资基金、富国新兴产业股票型证券投资基金、富国中证新能源汽车指数分级证券投资基金、富国中证全指证券公司指数分级证券投资基金、富国中证银行指数分级证券投资基金、富国文体健康股票型证券投资基金、富国国家安全主题混合型证券投资基金、富国改革动力混合型证券投资基金、富国新收益灵活配置混合型证券投资基金、富国中证工业 4.0 指数分级证券投资基金、富国沪港深价值精选灵活配置混合型证券投资基金、富国中证煤炭指数分级证券投资基金、富国中证体育产业指数分级证券投资基金、富国绝对收益多策略定期开放混合型发起式证券投资基金、富国新动力灵活配置混合型证券投资基金、富国收益宝交易型货币市场基金、富国低碳新经济混合型证券投资基金、富国中证智能汽车指数证券投资基金（LOF）、富国研究优选沪港深灵活配置混合型证券投资基金、富国价值优势混合型证券投资基金、富国泰利定期开放债券型发起式证券投资基金、富国祥利定期开放债券型发起式证券投资基金、富国美丽中国混合型证券投资基金、富国创新科技混合型证券投资基金、富国睿利定期开放混合型发起式证券投资基金、富国中证医药主题指数增强型证券投资基金（LOF）、富国两年期理财债券型证券投资基金、富国久利稳健配置混合型证券投资基金、富国富利稳健配置混合型证券投资基金、富国中证娱乐主题指数增强型证券投资基金（LOF）、富国中证高端制造指数增强型证券投资基金（LOF）、富国新活力灵活配置混合型发起式证券投资基金、富国产业升级混合型证券投资基金、富国鼎利纯债债券型发起式证券投资基金、富国新兴成长量化精选混合型证券投资基金（LOF）、富国泓利纯债债券型发起式证券投资基金、富国新优享灵活配置混合型证券投资基金、富国聚利纯债定期开放债券型发起式证券投资基金、富国祥利一年期定期开放债券型证券投资基金、富国丰利增强债券型发起式证券投资基金、富国兴利增强债券型发起式证券投资基金、富国嘉利稳健配置定

期开放混合型证券投资基金、富国景利纯债债券型发起式证券投资基金、富国新机遇灵活配置混合型发起式证券投资基金、富国精准医疗灵活配置混合型证券投资基金、富国研究量化精选混合型证券投资基金、富国沪港深行业精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、富国金利定期开放混合型证券投资基金等九十八只证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李晓铭	本基金基金经理兼任权益研究部总经理、富国研究精选灵活配置混合型证券投资基金、富国新动力灵活配置混合型证券投资基金、富国天益价值混合型证券投资基金、富国研究优选沪港深灵活配置混合型证券投资基金基金经理	2016-02-05	—	13	硕士研究生，曾任华富基金管理有限公司行业研究员，2006年4月至2009年10月任富国基金管理有限公司行业研究部行业研究员，富国天博创新主题混合型证券投资基金基金经理助理，2009年10月至2014年10月任富国天源平衡混合型证券投资基金基金经理，2011年8月至2014年7月任富国低碳环保混合型证券投资基金基金经理，2014年4月起任富国天益价值混合型证券投资基金基金经理，2015年2月起兼任富国研究精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2016年2月起兼任富国改革动力混合型证券投资基金基金经理，2016年3月起兼任富国研究优选沪港深灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2016年4月起兼任富国新动力灵活配置混合型证券投资基金基金经理，兼任权益研究部总经理。具有基金从业资格。
汪鸣	本基金前任基金经理	2015-05-20	2017-12-29	11	硕士，自2007年4月至2014年1月历任富国基金管理有限公司助理行业研究员、行业研究员、高级行业研究员。2014年1月起任富国城镇发展股票型证券投资基金基金经理；2015年4月至2017年12月兼任富国天合稳健优选混合型证券投资基金基金经理；2015年5月至2017年12月兼任富国改革动力混合型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。
张啸伟	本基金基	2015-08-18	—	8	硕士，自2009年7月至2010年4

	金 经 理 兼 富 国 天 合 稳 健 优 选 混 合 型 证 券 投 资 基 金、富国美 丽 中 国 混 合 型 证 券 投 资 基 金 基 金 经 理			月 在 湘 财 证 券 任 基 础 化 工 研 究 员；自 2010 年 4 月 至 2011 年 6 月 在 招 商 证 券 任 化 工 研 究 员；自 2011 年 6 月 至 2015 年 8 月 在 富 国 基 金 管 理 有 限 公 司 任 行 业 研 究 员；自 2015 年 8 月 起 任 富 国 改 革 动 力 混 合 型 证 券 投 资 基 金 基 金 经 理；自 2015 年 11 月 起 兼 任 富 国 天 合 稳 健 优 选 混 合 型 证 券 投 资 基 金 基 金 经 理，自 2016 年 5 月 兼 任 富 国 美 丽 中 国 混 合 型 证 券 投 资 基 金 基 金 经 理。具 有 基 金 从 业 资 格。
--	--	--	--	--

注：1、上述任职日期为根据公司确定的聘任日期，离任日期为根据公司确定的解聘日期；首任基金经理任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的涵义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，富国基金管理有限公司作为富国改革动力混合型证券投资基金的管理人严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券法》、《富国改革动力混合型证券投资基金基金合同》以及其它有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，以尽可能减少和分散投资风险，力保基金资产的安全并谋求基金资产长期稳定的增长为目标，管理和运用基金资产，基金投资组合符合有关法规及基金合同的规定。

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

本基金管理人根据相关法规要求，结合实际情况，制定了内部的《公平交易管理办法》，对证券的一级市场申购、二级市场交易相关的研究分析、投资决策、授权、交易执行、业绩评估等投资管理环节，实行事前控制、事中监控、事后评估及反馈的流程化管理。在制度、操作层面确保各组合享有同等信息知情权、均等交易机会，并保持各组合的独立投资决策权。

事前控制主要包括：1、一级市场，通过标准化的办公流程，对关联方审核、价格公允性判断及证券公平分配等相关环节进行控制；2、二级市场，通过交易系统的投资备选库、交易对手库及授权管理，对投资标的、交易对手和操作权限进行自动化控制。

事中监控主要包括组合间相同投资标的的交易方向、市场冲击的控制，银行间市场交易价格的公允性评估等。1、将主动投资组合的同日反向交易列为限制行为，非经特别控制流程审核同意，不得进行；对于同日同向交易，通过交易系统对组合间的交易公平性进行自动化处理。2、同一基金经理管理的不同组合，对同一投资标的采用相同投资策略的，必须通过交易系统采取同时、同价下达投资指令，确保公平对待其所管理的组合。

事后评估及反馈主要包括组合间同一投资标的的临近交易日的同向交易和

反向交易的合理性分析评估，以及不同时间窗口下（1日、3日、5日）的季度公平性交易分析评估等。1、通过公平性交易的事后分析评估系统，对涉及公平性交易的投资行为进行分析评估，分析对象涵盖公募、年金、社保及专户产品，并重点分析同类组合（股票型、混合型、债券型）间、不同产品间以及同一基金经理管理不同组合间的交易行为，若发现异常交易行为，风险管理部视情况要求相关当事人做出合理性解释，并按法规要求上报辖区监管机构。2、季度公平性交易分析报告按规定经基金经理或投资经理签字，并经督察长、总经理审阅签字后，归档保存，以备后查。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期，在同向交易价差分析方面，公司采集连续四个季度，不同时间窗口（1日内、3日内、5日内）的同向交易样本，在假设同向交易价差为零及95%的置信水平下，对同向交易价差进行t分布假设检验并对检验结果进行跟踪分析。分析结果显示本投资组合与公司管理的其他投资组合在同向交易价差方面未出现异常。

本报告期内公司旗下基金严格遵守公司的相关公平交易制度，未出现违反公平交易制度的情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现异常交易行为。

公司旗下管理的各投资组合在交易所公开竞价同日反向交易的控制方面，报告期内本组合与其他投资组合之间，因组合流动性管理或投资策略调整需要，出现2次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。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2017年，实体经济延续去年以来的反弹，各季度经济增速保持在6.90%左右波动。伴随环保趋严和供给侧改革在各个细分行业逐步得到落实，17年大量周期品价格依然保持高位，PPI在去年下半年转正后17年呈现前高后低态势。经济好转带动较多传统行业盈利大幅改善，周期性行业在盈利大幅改善背景下2017年涨幅较大。沪港通深港通成为A股最大的增量资金，北上资金更多偏好金融、消费、医药，对这些行业边际影响较大。这也助推了2017年整体市场风格突出，虽然指数上涨但大部分股票是下跌的。全年上证指数上涨6.56%，而创业板指数大跌10.67%。

本基金是成长型风格，2017年在错误的时间强化了成长风格，跑输行业。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2017年12月31日，本基金份额净值为0.653元；份额累计净值为0.653元；本报告期，本基金份额净值增长率为-14.19%，同期业绩比较基准收益率为9.08%

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2018年的中国实体经济仍面临诸多不确定性。楼市在调控方向转变后能否走出去年下半年以来的颓势、国际贸易环境不确定背景下对出口的影响等。市场上行的机会可能在于流动性预期的边际改善及市场资金成本的见顶回落，风险在于汇率预期波动对北上资金预期的改变。

中期看经济调结构的方向已明确，转型势必催生新的行业投资机会，部分从无到有或进入加速成长的新兴行业将是我们持续寻找的目标。而在转型的同时仍将兼顾经济增长，部分领域的刺激政策将持续出台。

基金未来仍将重点精选竞争力强、可中长期投资的公司，并积极研究未来受益改革的方向和经济转型方向，在控制风险的基础上，不断优化组合。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、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》等法律法规、估值指引的相关规定，以及基金合同对估值程序的相关约定，对基金所持有的投资品种进行估值。日常估值的账务处理、基金份额净值的计算由基金管理人独立完成，并与基金托管人进行账务核对，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规、本基金《基金合同》的约定以及基金的实际运作情况，本报告期内本基金未进行收益分配。本基金将严格按照法律法规及基金合同约定进行收益分配。

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

本基金本报告期无需要说明的相关情形。

§ 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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在富国改革动力混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合

报告等数据真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

本基金审计的注册会计师出具的是无保留意见的审计报告。
投资者可通过本基金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：富国改革动力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	326,996,620.17	850,532,618.28
结算备付金	3,066,273.11	6,749,379.96
存出保证金	642,990.20	2,169,236.76
交易性金融资产	3,919,461,801.55	6,170,890,510.18
其中：股票投资	3,919,461,801.55	6,170,890,510.18
基金投资	—	—
债券投资	—	—
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	100,036,350.05	542,600,000.00
应收证券清算款	—	—
应收利息	298,419.63	490,960.78
应收股利	—	—
应收申购款	455,524.76	106,949.27
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	—
资产总计	4,350,957,979.47	7,573,539,655.23
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	—	—
应付证券清算款	54,015,244.44	259,837,188.06

应付赎回款	20,560,637.67	5,563,276.72
应付管理人报酬	5,767,949.70	9,478,892.53
应付托管费	961,324.97	1,579,815.40
应付销售服务费	—	—
应付交易费用	2,249,824.73	4,247,706.19
应交税费	—	—
应付利息	—	—
应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	300,362.63	212,086.04
负债合计	83,855,344.14	280,918,964.94
所有者权益：		
实收基金	6,536,220,558.42	9,582,167,258.03
未分配利润	-2,269,117,923.09	-2,289,546,567.74
所有者权益合计	4,267,102,635.33	7,292,620,690.29
负债和所有者权益总计	4,350,957,979.47	7,573,539,655.23

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.653 元，基金份额总额 6,536,220,558.42 份。

7.2 利润表

会计主体：富国改革动力混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 01 月 01 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 (2017 年 01 月 01 日至 2017 年 12 月 31 日)	上年度可比期间 (2016 年 01 月 01 日至 2016 年 12 月 31 日)
一、收入	-746,408,257.63	-1,763,160,302.20
1. 利息收入	5,152,070.68	7,781,589.68
其中：存款利息收入	4,245,404.99	6,169,057.08
债券利息收入	—	818.44
资产支持证券利息收入	—	—
买入返售金融资产收入	906,665.69	1,611,714.16
其他利息收入	—	—
2. 投资收益（损失以“-”填列）	-546,379,050.70	-1,355,451,120.23
其中：股票投资收益	-558,240,108.76	-1,394,060,852.08
基金投资收益	—	—
债券投资收益	—	1,382,085.76
资产支持证券投资收益	—	—
贵金属投资收益	—	—
衍生工具投资收益	—	—
股利收益	11,861,058.06	37,227,646.09

3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-205,820,579.13	-417,113,437.32
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	—	—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	639,301.52	1,622,665.67
减：二、费用	116,499,011.73	172,050,730.97
1. 管理人报酬	88,786,044.91	116,983,316.07
2. 托管费	14,797,674.13	19,497,219.27
3. 销售服务费	—	—
4. 交易费用	12,552,557.12	35,227,684.97
5. 利息支出	—	—
其中：卖出回购金融资产支出	—	—
6. 其他费用	362,735.57	342,510.66
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-862,907,269.36	-1,935,211,033.17
减：所得税费用	—	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-862,907,269.36	-1,935,211,033.17

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：富国改革动力混合型证券投资基金

本报告期：2017年01月01日至2017年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 (2017年01月01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）	9,582,167,258.03	-2,289,546,567.74	7,292,620,690.29
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	-862,907,269.36	-862,907,269.36
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）	-3,045,946,699.61	883,335,914.01	-2,162,610,785.60
其中：1. 基金申购款	85,791,016.24	-25,270,930.38	60,520,085.86
2. 基金赎回款	-3,131,737,715.85	908,606,844.39	-2,223,130,871.46
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）	6,536,220,558.42	-2,269,117,923.09	4,267,102,635.33
项目	上年度可比期间 (2016年01月01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）	10,925,391,025.73	-669,314,104.44	10,256,076,921.29
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	-1,935,211,033.17	-1,935,211,033.17

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）	-1,343,223,767.70	314,978,569.87	-1,028,245,197.83
其中：1. 基金申购款	392,320,374.80	-106,356,569.86	285,963,804.94
2. 基金赎回款	-1,735,544,142.50	421,335,139.73	-1,314,209,002.77
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）	9,582,167,258.03	-2,289,546,567.74	7,292,620,690.29

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：

陈 戈	林志松	徐 慧
_____	_____	_____
基金管理公司负责人	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 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

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《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。

7.4.2 会计差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.3 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
富国基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
海通证券股份有限公司（“海通证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构
申万宏源证券有限公司（“申万宏源”）	基金管理人的股东、基金代销机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人、基金代销机构
山东省国际信托股份有限公司	基金管理人的股东
蒙特利尔银行	基金管理人的股东

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.4.1.1 股票交易

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股票交易。

7.4.4.1.2 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。

7.4.4.1.3 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交易单元进行债券交易。

7.4.4.1.4 回购交易

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回购交易。

7.4.4.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

7.4.4.2 关联方报酬

7.4.4.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期（2017年01月01日至 2017年12月31日）	上年度可比期间（2016年01月 01日至2016年12月31日）
当期发生的基金应支付的管理费	88,786,044.91	116,983,316.07
其中：支付销售机构的客户维护费	45,576,803.16	62,735,433.34

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

7.4.4.2.2 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）	上年度可比期间（2016年01 月01日至2016年12月31日）
当期发生的基金应支付的 托管费	14,797,674.13	19,497,219.27

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

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。

7.4.4.3 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未与关联方通过银行间同业市场进行债券（含回购）交易。

7.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本报告期内及上年度可比期间内本基金的基金管理人均未运用固有资金投资本基金。

7.4.4.4.2 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本报告期末及上年度末均未投资本基金。

7.4.4.5 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）		上年度可比期间（2016年01月01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
中国银行股份有限公司	326,996,620.17	4,142,958.57	850,532,618.28	5,615,688.58

7.4.4.6 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。

7.4.4.7 其他关联交易事项的说明

7.4.4.7.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间均无其他关联方交易事项。

7.4.5 期末（2017年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

7.4.5.1.1 受限证券类别：股票

金额单位：人民币元

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
002027	分众传媒	2017-09-13	2018-03-13	大宗交易	8.86	13.47	4,510,000	39,958,600.00	60,749,700.00	—
300310	宜通世纪	2016-04-18	2018-04-18	非公开发行	32.85	11.04	1,506,849	49,516,262.25	16,635,612.96	—
603080	新疆火炬	2017-12-25	2018-01-03	新股认购	13.60	13.60	1,187	16,143.20	16,143.20	—
300310	宜通世纪	2016-05-26	2018-04-18	非公开发行证券-转增	—	11.04	904,109	—	9,981,363.36	—
300310	宜通世纪	2017-04-26	2018-04-18	非公开发行证券-转增	—	11.04	1,928,767	—	21,293,587.68	—

注：1. 300310 宜通世纪“可流通日”是根据上市公司公告估算的流通日期，最终日期以上市公司公告为准。

2. 本基金持有的非公开发行股票宜通世纪于2016年5月26日实施2015年年度权益分派方案，以资本公积金向全体股东每10股转增6股，因转增所获取的股份的可流通日与原限售股份的可流通日一致。

3. 本基金持有的非公开发行股票宜通世纪于2017年4月26日实施2016年年度权益分派方案，以资本公积金向全体股东每10股转增8股，因转增所获取的股份的可流通日与原限售股份的可流通日一致。

7.4.5.2 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 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000034	神州数码	2017-09-29	重大事项停牌	20.29	—	—	7,004,700	195,440,443.62	142,125,363.00	—
002103	广博股份	2017-11-15	重大事项停牌	8.74	—	—	26,000,000	411,968,236.94	227,240,000.00	—
002260	德奥通航	2017-12-05	重大事项停牌	11.96	—	—	9,999,998	385,360,752.79	119,599,976.08	—
002366	台海核电	2017-12-06	重大事项停牌	26.45	—	—	15,747,554	465,734,999.81	416,522,803.30	—
002694	顾地科技	2017-05-25	重大事项停牌	15.36	2018-02-12	19.63	27,950,904	416,308,937.37	429,325,885.44	—
002919	名臣健康	2017-12-28	股票交易异常波动	35.26	2018-01-02	38.79	821	10,311.76	28,948.46	—
300225	金力泰	2017-12-26	重大事项停牌	16.70	2018-01-24	16.90	21,000,000	291,763,793.06	350,700,000.00	—
600146	商赢环球	2017-09-05	重大事项停牌	25.42	2018-	22.88	2,000,000	52,382,849.00	50,840,000.00	—

					01-16					
603429	集友股份	2017-11-27	重大事项停牌	41.85	2018-02-05	37.67	986,850	42,093,213.00	41,299,672.50	-

7.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

注：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。

7.4.5.3.2 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。

7.4.6 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 2,033,102,745.57 元，属于第二层次的余额为人民币 1,348,372,906.54 元，属于第三层次余额为人民币 537,986,149.44 元（于 2016 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 5,426,994,813.29 元，属于第二层次的余额为人民币 743,895,696.89 元，属于第三层次余额为人民币 0.00 元）。

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，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，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。

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变动情况如下：

上年度末余额 0.00 元，2017 年度转入第三层次 677,561,882.41 元，转出第三层次 0.00 元，当期计入损益的利得或损失总额-139,575,732.97 元，购买 0.00 元，卖出 0.00 元，本期末 537,986,149.44 元，本期末持有的资产计入损益的当

期末实现利得或损失的变动-139,575,732.97元。

7.4.14.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

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	3,919,461,801.55	90.08
	其中：股票	3,919,461,801.55	90.08
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	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	100,036,350.05	2.30
	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	330,062,893.28	7.59
8	其他各项资产	1,396,934.59	0.03
9	合计	4,350,957,979.47	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	2,430,917,538.38	56.97
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	480,574,332.54	11.26
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	421,154,701.63	9.87
J	金融业	—	—
K	房地产业	470,548,427.50	11.03

L	租赁和商务服务业	60,749,700.00	1.42
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	55,500,958.30	1.30
	合计	3,919,461,801.55	91.85

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	002694	顾地科技	27,950,904	429,325,885.44	10.06
2	002366	台海核电	15,747,554	416,522,803.30	9.76
3	002153	石基信息	14,000,000	373,240,000.00	8.75
4	300225	金力泰	21,000,000	350,700,000.00	8.22
5	600693	东百集团	32,987,229	338,448,969.54	7.93
6	600208	新湖中宝	46,809,787	244,347,088.14	5.73
7	002103	广博股份	26,000,000	227,240,000.00	5.33
8	300285	国瓷材料	10,290,074	205,801,480.00	4.82
9	000537	广宇发展	11,366,327	145,147,995.79	3.40
10	000034	神州数码	7,004,700	142,125,363.00	3.33

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于富国基金管理有限公司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	300225	金力泰	283,756,162.37	3.89
2	600208	新湖中宝	242,921,394.07	3.33
3	600622	光大嘉宝	158,318,829.47	2.17
4	600693	东百集团	150,225,296.76	2.06
5	002694	顾地科技	146,825,655.20	2.01
6	002001	新和成	143,357,308.36	1.97
7	002383	合众思壮	137,335,034.18	1.88
8	000537	广宇发展	134,952,552.76	1.85
9	600226	瀚叶股份	129,252,734.91	1.77
10	002355	兴民智通	121,247,836.78	1.66
11	300408	三环集团	90,238,520.53	1.24

12	300130	新国都	85,488,400.38	1.17
13	600803	新奥股份	80,193,479.14	1.10
14	002366	台海核电	78,138,735.44	1.07
15	002573	清新环境	76,424,477.25	1.05
16	002369	卓翼科技	70,904,538.23	0.97
17	300038	梅泰诺	67,707,831.93	0.93
18	603986	兆易创新	64,797,952.80	0.89
19	600346	恒力股份	62,035,556.40	0.85
20	603678	火炬电子	58,307,756.39	0.80

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	002366	台海核电	386,733,801.20	5.30
2	002153	石基信息	291,373,249.31	4.00
3	300159	新研股份	291,057,360.26	3.99
4	002464	众应互联	266,832,555.44	3.66
5	300050	世纪鼎利	227,326,892.42	3.12
6	002001	新和成	222,751,826.21	3.05
7	600990	四创电子	205,922,732.61	2.82
8	000501	鄂武商 A	180,789,994.62	2.48
9	000034	神州数码	156,258,484.86	2.14
10	600622	光大嘉宝	152,632,875.56	2.09
11	002383	合众思壮	148,611,258.35	2.04
12	002318	久立特材	147,097,242.60	2.02
13	600693	东百集团	122,570,392.51	1.68
14	000920	南方汇通	111,383,772.94	1.53
15	600226	瀚叶股份	103,828,617.06	1.42
16	300429	强力新材	97,839,631.88	1.34
17	002355	兴民智通	95,994,793.49	1.32
18	300121	阳谷华泰	87,233,137.34	1.20
19	002573	清新环境	85,175,717.70	1.17
20	300136	信维通信	76,335,443.69	1.05

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	3,193,560,678.45
卖出股票收入（成交）总额	4,680,928,699.19

注：“买入股票成本（成交）总额”和“卖出股票收入（成交）总额”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。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

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

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

公允价值变动总额合计(元)	—
股指期货投资本期收益(元)	—
股指期货投资本期公允价值变动(元)	—

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本。

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

根据基金合同，本基金不允许投资国债期货。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

公允价值变动总额合计（元）	—
国债期货投资本期收益（元）	—
国债期货投资本期公允价值变动（元）	—

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 申明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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。

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 申明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在备选股票库之外的股票。

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	642,990.20
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	298,419.63
5	应收申购款	455,524.76
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	1,396,934.59

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

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(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002694	顾地科技	429,325,885.44	10.06	筹划重大事项
2	002366	台海核电	416,522,803.30	9.76	筹划重大事项
3	300225	金力泰	350,700,000.00	8.22	筹划重大事项
4	002103	广博股份	227,240,000.00	5.33	筹划重大事项
5	000034	神州数码	142,125,363.00	3.33	筹划重大事项

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分。

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可

能存在尾差。

§ 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(%)
81,013	80,681.13	2,973,053.51	0.05	6,533,247,504.91	99.95

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(%)
基金管理公司所有从业人员持有本基金	242,303.01	0.0037

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 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2015年05月20日)基金份额总额	13,254,788,203.29
报告期期初基金份额总额	9,582,167,258.03
本报告期基金总申购份额	85,791,016.24
减：本报告期基金总赎回份额	3,131,737,715.85
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期末基金份额总额	6,536,220,558.42

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金没有召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2017年8月，陈四清先生担任中国银行股份有限公司董事长、执行董事、董事会战略发展委员会主席及委员等职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

本报告期本基金管理人于2017年4月20日在中国证券报、上海证券报、证券时报及公司网站上做公告，范伟隽先生不再担任本公司督察长，由赵瑛女士出任公司督察长。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金资产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略无改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内基金管理人没有改聘为其审计的会计师事务所。本基金本年度支付给审计机构安永华明会计师事务所的报酬为10万元人民币，其已提供审计服务的连续年限为15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

本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

11.7 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		债券交易		债券回购交易		权证交易		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 (%)	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 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
东方证券	2	377,389,616.04	4.79	—	—	—	—	—	—	343,913.52	4.79	
广发证券	2	1,538,018,680.74	19.54	—	—	1,171,400,000.00	73.62	—	—	1,401,597.63	19.54	
太平洋证券	2	1,381,608,251.32	17.55	—	—	40,000,000.00	2.51	—	—	1,259,056.69	17.55	
新时代证券	2	470,341,680.16	5.98	—	—	—	—	—	—	428,626.43	5.97	
银河证券	2	1,659,782,210.61	21.09	—	—	179,700,000.00	11.29	—	—	1,513,992.54	21.10	
浙商证券	2	228,988,152.28	2.91	—	—	200,000,000.00	12.57	—	—	208,676.25	2.91	
中金公司	2	2,215,420,472.15	28.14	—	—	—	—	—	—	2,018,913.87	28.14	

注：我公司对基金交易单元的选择是综合考虑券商的研究能力及其它相关因素后决定的。本报告期内本基金租用券商交易单元无变更。

§ 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：本基金本报告期无单一投资者持有基金份额达到或超过 20%的情况。