

# 山西证券策略精选灵活配置混合型证券投资基金

## 2017 年年度报告摘要

2017 年 12 月 31 日

基金管理人:山西证券股份有限公司

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

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。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

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

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告中的财务资料已经审计，中喜会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自 2017 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	山证策略精选
基金主代码	003659
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年12月29日
基金管理人	山西证券股份有限公司
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	99,876,882.90份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金积极通过大类资产的轮动配置，综合运用多种策略，精选具有估值优势和成长潜力的公司进行投资，在把风险控制到较低水平的前提下，力争为基金份额持有人创造持续而稳健的超额回报。
投资策略	本基金将采取积极的大类资产配置策略，注重风险与收益的平衡。本基金将精选具有较高投资价值的股票和债券，力求实现基金资产的长期稳定增长。其中：股票投资策略主要采用事件驱动策略和红利投资策略作为核心的投资策略；固定收益类投资工具投资策略将密切关注国内外宏观经济走势与我国财政、货币政策动向，预测未来利率变动走势，自上而下地确定投资组合久期，并结合信用分析等自下而上的个券选择方法构建债券投资组合。
业绩比较基准	沪深300指数收益率*50%+中证综合债券指数收益率*50%
风险收益特征	本基金是一只主动投资的混合型基金，其长期平均预期风险和预期收益率低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金，属于证券投资基金中的中高风险和中高预期收益产品。

### 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		山西证券股份有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	薛永红	王永民
	联系电话	0351-8686699	010-66594896
	电子邮箱	xueyonghong@sxzq.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		95573	95566
传真		0351-8686693	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	<a href="http://publiclyfund.sxzq.com:8000">http://publiclyfund.sxzq.com:8000</a>
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

## § 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12月29日（基金合同生效日）-2016年12月31日
本期已实现收益	13,214,934.99	21,704.13
本期利润	14,894,738.27	-79,965.97
加权平均基金份额本期利润	0.0484	-0.0002
本期基金份额净值增长率	4.66%	-0.02%
3.1.2 期末数据和指标	2017年末	2016年末
期末可供分配基金份额利润	0.0464	-0.0002
期末基金资产净值	104,511,367.59	499,841,669.65
期末基金份额净值	1.0464	0.9998

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、所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，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（为期末余额，不是当期发生数）。

### 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	0.41%	0.75%	2.31%	0.41%	-1.90%	0.34%
过去六个月	4.55%	0.67%	5.01%	0.35%	-0.46%	0.32%
过去一年	4.66%	0.64%	10.65%	0.32%	-5.99%	0.32%
自基金合同生效起至今	4.64%	0.63%	10.95%	0.32%	-6.31%	0.31%

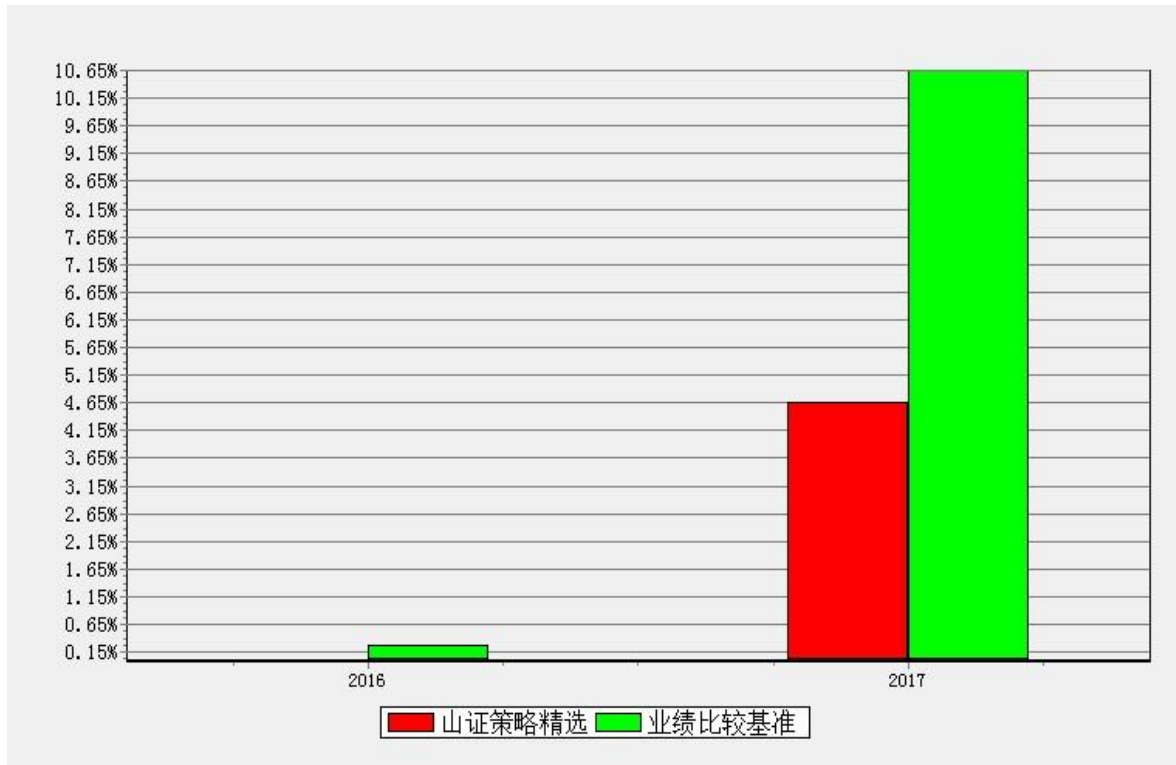
注：1、本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率\*50%+中证综合债券指数收益率\*50%。

#### 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

山西证券策略精选灵活配置混合型证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2016年12月29日-2017年12月31日)



- 注：1、本基金基金合同生效日为2016年12月29日；
- 2、按基金合同和招募说明书的约定，基金管理人自基金合同生效之日起六个月内使基金的各项资产配置比例符合基金合同的有关约定。建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同的有关约定。
- 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



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金于2016年12月29日成立。本基金自基金合同生效以来无利润分配情况，符合相关法规及基金合同的规定。

## § 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

山西证券股份有限公司最早成立于1988年7月，是全国首批证券公司之一，属国有控股性质。经过二十多年的发展，已成为作风稳健、经营稳定、管理规范、业绩良好的创新类证券公司。2010年9月，公司上市首发申请获中国证监会发审委审核通过，11月15日正式在深圳证券交易所挂牌上市，股票代码002500，注册资本28.2873亿元。

公司股东资金实力雄厚，经营风格稳健，资产质量优良，盈利能力良好，其构成集中体现多种优质资源、多家优势企业的强强联合。公司控股股东为山西金融投资控股集团有限公司。

经过近三十年的发展，山西证券的经营范围基本涵盖了所有的证券领域，分布于财富管理、资产管理、投资管理、投融资、研究、期货、国际业务等板块，具体包括：证券经纪；证券自营；证券资产管理；证券投资咨询；与证券交易、证券投资活动有关的财务顾问；证券投资基金代销；为期货公司提供中间介绍业务；融资融券；代销金融产品等。同时，公司具备公开募集证券投资基金管理业务资格，并获批开展债券质押式报

价回购交易、股票质押式回购交易、约定购回式证券交易、转融通、上市公司股权激励行权融资、直接投资、柜台市场等业务。

公司控股中德证券有限责任公司，致力于提供广泛的股票、债券的承销与保荐，以及并购重组等顾问服务；全资控股格林大华期货有限公司，致力于提供期货经纪、投资咨询业务及财富管理、资产管理、风险管理、中间业务等全方位、全产业链的金融服务；全资控股龙华启富投资有限责任公司，致力于为具备风险承受能力的高净值个人和机构提供财富管理服务，同时向优质企业提供资金支持，协助被投资企业通过并购重组、IPO上市等途径做优做强；全资控股并在香港设立山证国际金融控股有限公司，致力于为客户提供专业、优质、多元化、一站式的环球证券、期货及期权产品投资，环球资产配置、企业海外融资及并购服务。

公司设有分公司14家，营业部108家，期货营业网点27家，以上网点分布于山西各地市、主要县区及北京、上海、天津、深圳、黑龙江、新疆、大连、河北、山东、陕西、河南、江苏、四川、重庆、两湖、浙江、福建、两广、海南等地，形成了以国内主要城市为前沿，重点城市为中心，覆盖山西、面向全国的业务发展框架，为近160万客户提供全面、优质的综合金融专业服务。

2014年3月19日，经中国证监会批准，山西证券股份有限公司成为首批获得公募业务资格的证券公司。截至报告期末，山西证券股份有限公司（不含子公司）管理公募基金资产规模36.7亿元，旗下管理4只开放式基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
蔡文	本基金的基金经理	2016-12-29	-	9年	蔡文先生，复旦大学管理学硕士。2006年12月至2008年11月在毕马威财务咨询担任财务咨询师；2008年11月至2009年12月在美国Cowen Group投资银行担任行业分析师；2010年2月至2012年6月在汇丰晋信基金管理有限公司担任研究员；2012年7月，在华宸未来基金管理有限公司担任高级研究员、投资决策委员会委员。2014年10月至2015年12月任华宸未来



					<p>沪深300指数增强型发起式证券投资基金(LOF)基金经理。2016年2月加盟山西证券公募基金部,目前担任权益投资总监。2016年7月起任山西证券保本混合型证券投资基金基金经理。2016年12月起担任山西证券策略精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2018年1月任山西证券改革精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理。</p>
--	--	--	--	--	--

1、对基金的首任基金经理,其“任职日期”为基金合同生效日,“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期,除首任基金经理外,“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期;

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券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,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司开展投资、研究活动防控内幕交易指导意见》、基金合同和其他有关法律法规,本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产,在严格控制投资风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,没有损害基金份额持有人利益的行为。

#### 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

为了公平对待各类投资人,保护各类投资人利益,避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为,公司根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规和公司内部规章,拟定了《公募基金管理业务公平交易管理细则》,公司通过科学、制衡的投资决策体系,加强交易分配环节的内部控制,并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时,通过监察稽核、事后分析和信息披露来保证公平交易过程和结果的监督。

##### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

公司公募基金管理业务建立了投资对象备选库，制定明确的备选库建立、维护程序。公司公募基金管理业务拥有健全的投资授权制度，明确投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体的职责和权限划分，投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。

本报告期，按照时间优先、价格优先的原则，对满足限价条件且对同一证券有相同交易需求的基金等投资组合，均采用了系统中的公平交易模块进行操作，实现了公平交易，未出现清算不到位的情况，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

本报告期内，本基金各项交易均严格按照相关法律法规、基金合同的有关要求执行。报告期内未发现有可能导致不公平交易和利益输送的重大异常交易行为。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金将采取积极的大类资产配置策略，注重风险与收益的平衡。本基金将精选具有较高投资价值的股票和债券，力求实现基金资产的长期稳定增长。其中：股票投资策略主要采用事件驱动策略和红利投资策略作为核心的投资策略；固定收益类投资工具投资策略将密切关注国内外宏观经济走势与我国财政、货币政策动向，预测未来利率变动走势，自上而下地确定投资组合久期，并结合信用分析等自下而上的个券选择方法构建债券投资组合。

本基金今年一季度大部分时间处在封闭期，在封闭期内基金配满打新所需要的市值之后，基金的总仓位处于较低水平，没有充分享受到一季度前两月市场赚钱效应最好的阶段。4月中旬，市场在金融去杠杆的大背景下出现大幅下跌，上证综指最高跌幅近7%，创业板最高跌幅8.5%，本基金在大盘杀跌中回撤明显。在六月份开始的反弹中，本基金及时调整持仓结构，增配估值较低且成长性较好的板块个股，如白酒、家电、水泥，净值逐步回升，最高增至1.0803。未来的配置思路仍然坚持配置低估值的价值成长股，优选跌破定向增发价格、股东增持价格等被低估的股票。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末山证策略精选基金份额净值为1.0464元；本报告期内，基金份额净值增长率为4.66%，同期业绩比较基准收益率为10.65%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从宏观经济看，2018年经济增长预计在6.7%左右。从需求端看，全球复苏带动贸易维持较快增长；基建投资大概率走弱，但是制造业投资是亮点，特别是先进制造；房地产市场将差异化调控，比去年有所放松，地产投资预计维持低位，但是需要大力关注租赁市场发展所带来房地产投资的超预期可能；通胀中枢将有所上行，预计在2.5左右，预计会出现两个高点，二或三月份和七或八月份，推动CPI向上的力量来自食品价格的上行、服务价格的高位以及PPI向CPI的传导。供给侧结构性改革力度维持的情况下，预计2018年PPI仍能维持正增长；利率中枢将较2017年上移，金融监管力度不减，但政策同时强调金融服务实体经济，监管节奏相对缓和。

从证券市场来看，2018年不会像去年那样“一九分化”，而是更加均衡，淡化风格。2018年流动性环境仍然是中性偏紧的，期间还有金融监管强化带来的风险溢价提升，因此市场仍会是结构性机会，预计会出现在中盘蓝筹，尤其是那些Roe出现持续改善的中盘股。而对于成长股而言，分化是显而易见的，受益于政策支持和产业逻辑清晰的成长板块龙头，将具备投资机会。

#### 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，基金管理人持续加强合规管理、风险控制和监察稽核工作。在合规管理方面，公司完善通信工具管理制度、员工投资行为管理制度、权限管理制度等多项制度，进一步完善合规制度建设；开展多种形式的合规培训，定期进行合规考试，不断提升员工的合规守法意识；积极参与各项业务的合规性管理，对信息披露文件、各类宣传推介材料进行合规性审查，防范各类合规风险。在风险管理方面，公司加强风险控制制度建设，特别是投资风险控制，完善控制机制，提高员工的风险管理意识。在监察稽核方面，公司定期和不定期开展内部稽核，对投资研究等关键业务和重点岗位进行检查监督，促进公司业务合规运作、稳健经营。

报告期内，本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规。本基金管理人将继续以风险控制为核心，坚持基金份额持有人利益优先的原则，提高监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金安全、合规运作。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定和基金合同约定，本基金管理人应严格按照新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

同时，由具备丰富专业知识、两年以上相关领域工作经历、熟悉基金投资品种定价及基金估值法律法规、具备较强专业胜任能力的基金会计负责估值工作。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值价格的最终决策。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金收益分配原则：（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12次，每份基金份额每次收益分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的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。

根据相关法律法规和基金合同的要求以及本基金的实际运作情况，本报告期内本基金未进行收益分配。

#### 4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

#### 4.10 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

报告期内，本基金未发生连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在山西证券策略精选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

### 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	中喜审字【2018】第0544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	山西证券策略精选灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了山西证券策略精选灵活配置混合型证券投资基金财务报表，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）变动表以及财务报表附注。我们认为，后附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，公允反映了山西证券策略精选灵活配置混合型证券投资基金2017年12月31日的财务状况以及2017年度的经营成果和所有者权益（基金净值）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，我们独立于山西证券策略精选灵活配置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	无
其他事项	无
其他信息	无

<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>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，管理层负责评估山西证券策略精选灵活配置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，除非管理层计划清算山西证券策略精选灵活配置混合型证券投资基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>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，就可能导致对山西证券策略精选灵活配置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</p>

	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山西证券策略精选灵活配置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。
会计师事务所的名称	中喜会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	白银泉 武丹
会计师事务所的地址	北京市东城区崇文门外大街11号新成文化大厦A座11层
审计报告日期	2018-02-26

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：山西证券策略精选灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2017年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	10,049,398.71	486,157,939.77
结算备付金		1,406,506.05	-
存出保证金		232,218.10	-
交易性金融资产	7.4.7.2	65,848,402.50	22,011,000.00
其中：股票投资		65,848,402.50	22,011,000.00
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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		32,979,351.80	-
应收利息	7.4.7.5	-5,127.90	89,435.33
应收股利		-	-
应收申购款		1,294.07	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		110,512,043.33	508,258,375.10
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2017年12月31日</b>	<b>上年度末 2016年12月31日</b>
<b>负 债:</b>			
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		-	8,351,210.81
应付赎回款		1,866,723.01	-
应付管理人报酬		144,790.83	40,975.29
应付托管费		24,131.79	6,829.22
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	3,843,409.75	17,690.13
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	121,620.36	-
负债合计		6,000,675.74	8,416,705.45
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	7.4.7.9	99,876,882.90	499,921,635.62



未分配利润	7.4.7.1 0	4,634,484.69	-79,965.97
所有者权益合计		104,511,367.59	499,841,669.65
负债和所有者权益总计		110,512,043.33	508,258,375.10

注：报告截止日2017年12月31日，基金份额净值1.0464元，基金份额总额99,876,882.90份。

## 7.2 利润表

会计主体：山西证券策略精选灵活配置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	附注号	本期2017年01月01日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年12月29日（基金合同生效日）至2016年12月31日
一、收入		27,168,851.38	-12,234.77
1. 利息收入		1,703,388.20	89,435.33
其中：存款利息收入	7.4.7.1 1	1,032,899.70	89,435.33
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		670,488.50	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		22,944,056.70	-
其中：股票投资收益	7.4.7.1 2	21,659,655.02	-
基金投资收益	7.4.7.1 3	-	-
债券投资收益	7.4.7.1	-	-

	4		
资产支持证券投资收益	7.4.7.1 4.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.1 5	-	-
衍生工具收益	7.4.7.1 6	-	-
股利收益	7.4.7.1 7	1,284,401.68	-
3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	7.4.7.1 8	1,679,803.28	-101,670.10
4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5. 其他收入(损失以“-”号填列)	7.4.7.1 9	841,603.20	-
<b>减：二、费用</b>		12,274,113.11	67,731.20
1. 管理人报酬	7.4.10. 2.1	4,706,356.77	40,975.29
2. 托管费	7.4.10. 2.2	784,392.80	6,829.22
3. 销售服务费	7.4.10. 2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.2 0	6,632,673.38	19,651.42
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.2 1	150,690.16	275.27
<b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>		14,894,738.27	-79,965.97
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润(净亏损以“-”</b>		14,894,738.27	-79,965.97

号填列)			
------	--	--	--

注：本基金合同自2016年12月29日起生效。

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：山西证券策略精选灵活配置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)	499,921,635.62	-79,965.97	499,841,669.65
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	14,894,738.27	14,894,738.27
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)	-400,044,752.72	-10,180,287.61	-410,225,040.33
其中：1. 基金申购款	3,435,446.50	144,195.60	3,579,642.10
2. 基金赎回款	-403,480,199.22	-10,324,483.21	-413,804,682.43
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)	99,876,882.90	4,634,484.69	104,511,367.59
项 目	上年度可比期间 2016年12月29日(基金合同生效日)至2016年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	499,921,635.62	-	499,921,635.62
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-79,965.97	-79,965.97

三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	499,921,635.62	-79,965.97	499,841,669.65

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：

侯巍

汤建雄

张立德

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

山西证券策略精选灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）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[2016]2343号《关于准予山西证券策略精选灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》核准募集，由山西证券股份有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律法规以及《山西证券策略精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》、《山西证券策略精选灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》和《山西证券策略精选灵活配置混合型证券投资基金份额发售公告》发起，并于2016年12月29日募集成立。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次发售募集的有效认购资金人民币499,548,762.79元，折合499,548,762.79份基金份额；孳生利息人民币372,872.83元，折合372,872.83份基金份额；以上收到的实收基金共计人民币499,921,635.62元，折合499,921,635.62份基金份额。业经中喜会计师事务所（特殊普通合伙）中喜验字【2016】第0477号验资报告予以验证。本基金的基金管理人为山西证券股份有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《山西证券策略精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板和其他经中国证监会核准上市的股

票)、债券(包括国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、股指期货、权证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(但须符合中国证监会相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为:本基金将基金资产的0%~95%投资于股票资产,每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

本基金参与股指期货交易,应符合法律法规规定、基金合同和《托管协议》约定的投资限制并遵守相关期货交易所的业务规则。

本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率\*50%+中证综合债券指数收益率\*50%。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表以持续经营为基础编制。

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)进行编制。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的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《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XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》及其他中国证监会颁布的相关规定,并按照《山西证券策略精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

#### 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2017年12月31日的财务状况以及2017年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

##### (1) 金融资产的分类

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

本基金目前以交易目的持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

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

##### (2) 金融负债的分类

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

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

金融资产满足下列条件之一的，终止确认：

- (1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止。
- (2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方。

(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，终止确认该金融负债或其一部分。

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。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

##### (1) 证券交易所上市的有价证券的估值

交易所上市的有价证券（包括股票等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

##### (2) 交易所市场交易的固定收益品种的估值

(a) 对在交易所市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（另有规定的除外），选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值；

(b) 对在交易所市场上市交易的可转换债券，按估值日收盘价减去可转换债券收盘价中所含债券应收利息后得到的净价进行估值；

(c) 对在交易所市场挂牌转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；

(d) 对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的固定收益品种，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

##### (3) 银行间市场交易的固定收益品种的估值

(a) 银行间市场交易的固定收益品种，选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值；

(b) 对银行间市场未上市，且第三方估值机构未提供估值价格的固定收益品种，按成本估值。

##### (4) 处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

(a) 送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；

(b) 首次公开发行未上市的股票，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；

(c) 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的估值方法估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

(5) 同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

(6) 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价格估值。

(7) 相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。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

金融资产和金融负债应当在资产负债表内分别列示，不得相互抵销。但是，同时满足下列条件的，应当以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- (1) 企业具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的；
- (2) 交易双方计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

不满足终止确认条件的金融资产转移，转出方不得将已转移的金融资产和相关负债进行抵销。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额。每份基金份额面值为1.00元。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现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

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确



认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

基金利润指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额，基金已实现收益指基金利润减去公允价值变动收益后的余额。

基金可供分配利润指截至收益分配基准日基金未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

本基金收益分配原则：

(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12次，每份基金份额每次收益分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的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) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1)该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2)本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3)本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或

多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

(1) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用中国证券投资基金业协会《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2) 在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]70号《关于金融同业往来等增值税补充政策的通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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、债券免征营业税和增值税；2018年1月1日起，公开募集证券投资基金运营过程中发生的其他增值税应税行为，以基金管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

(2) 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，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不缴纳企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按0.10%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

#### 7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
山西证券股份有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	基金托管人、基金代销机构
山西金融投资控股集团有限公司	基金管理人的股东
太原钢铁(集团)有限公司	基金管理人的股东
山西国际电力集团有限公司	基金管理人的股东
格林大华期货有限公司	基金管理人的全资子公司
龙华启富投资有限责任公司	基金管理人的全资子公司
山证国际金融控股有限公司	基金管理人的全资子公司
中德证券有限责任公司	基金管理人的全资子公司

注：所列股东为持股5%以上股东。

#### 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

注：所述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

##### 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

## 7.4.8.1.1 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1 2月31日		上年度可比期间 2016年12月29日（基金合同生 效日）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
山西证券股份有限公司	4,781,97 9,006.58	100.00%	22,112,6 70.10	100.00%

## 7.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

## 7.4.8.1.3 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			
	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
山西证券股份有限公司	3,825,7 19.62	100.00%	3,843,409. 75	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2016年12月29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
山西证券股份有限公司	17,690. 13	100.00%	17,690.13	100.00%

## 7.4.8.1.4 债券交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。

## 7.4.8.1.5 债券回购交易

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		上年度可比期间 2016年12月29日（基金合同生 效日）至2016年12月31日	
	成交金额	占当期债券回 购成交总额的 比例	成交 金额	占当期债券回购成 交总额的比例
山西证券股份有限公司	1,494,00 0,000.00	100.00%	-	-

#### 7.4.8.2 关联方报酬

##### 7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年01月01日 至2017年12月31 日	上年度可比期间 2016年12月29日（基金合同 生效日）至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	4,706,356.77	40,975.29
其中：支付销售机构的客户维护费	1,032,578.21	35,848.42

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，经基金管理人和基金托管人双方核对后，由基金托管人于次月前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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

##### 7.4.8.2.2 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12月29日（基金合同生 效日）至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	784,392.80	6,829.22

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

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人和基金托管人双方核对后，由基金托管人于次月前3个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

#### 7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本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过债券（含回购）交易。

#### 7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金管理人在本报告期与上年度可比期间无运用固有资金投资本基金的情况。

##### 7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期及上年度可比期间末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

#### 7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年01月01日至20 17年12月31日		上年度可比期间 2016年12月29日（基金合同生效日） 至2016年12月31日	
	期末余额	当期利息 收入	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司	10,049,398.71	989,902.60	486,157,939.77	89,435.33

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

#### 7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

#### 7.4.9 期末（2017年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

##### 7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601003	柳钢股份	2017-10-17	重大事项	7.72	2018-01-18	7.79	640,000	4,903,386.00	4,940,800.00	-

##### 7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本年末未持有因银行间市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

###### 7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本年末未持有因交易所市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

#### 7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

###### (a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

###### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

###### (i) 各层次金融工具公允价值

于2017年12月31日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 60,907,602.50元，属于第二层次的余额为人民币 4,940,800.00元，无属于第三层次的余额。

###### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根

据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2017年12月31日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	65,848,402.50	59.58
	其中：股票	65,848,402.50	59.58
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	-	-
	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	11,455,904.76	10.37
8	其他各项资产	33,207,736.07	30.05
9	合计	110,512,043.33	100.00

### 8.2 报告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

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	51,123,262.50	48.92
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
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	-	-
J	金融业	4,256,000.00	4.07
K	房地产业	3,106,000.00	2.97
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	4,091,400.00	3.91
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	3,271,740.00	3.13
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	65,848,402.50	63.01

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

### 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	600801	华新水泥	640,000	9,043,200.00	8.65
2	600585	海螺水泥	220,000	6,452,600.00	6.17

				0	
3	601003	柳钢股份	640,000	4,940,800.00	4.73
4	300316	晶盛机电	210,000	4,391,100.00	4.20
5	000001	平安银行	320,000	4,256,000.00	4.07
6	600702	沱牌舍得	90,000	4,199,400.00	4.02
7	002573	清新环境	180,000	4,091,400.00	3.91
8	600720	祁连山	379,950	3,932,482.50	3.76
9	601766	中国中车	280,000	3,390,800.00	3.24
10	300347	泰格医药	93,000	3,271,740.00	3.13
11	000789	万年青	300,000	3,153,000.00	3.02
12	000002	万科A	100,000	3,106,000.00	2.97
13	002371	北方华创	72,000	2,983,680.00	2.85
14	002304	洋河股份	25,000	2,875,000.00	2.75
15	000596	古井贡酒	40,000	2,626,800.00	2.51
16	600176	中国巨石	140,000	2,280,600.00	2.18
17	002384	东山精密	30,000	853,800.00	0.82

#### 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	601668	中国建筑	57,441,162.00	11.49
2	601377	兴业证券	42,847,078.60	8.57
3	600110	诺德股份	40,712,466.20	8.15
4	002456	欧菲科技	32,860,126.52	6.57
5	603799	华友钴业	31,431,381.20	6.29
6	000063	中兴通讯	30,707,344.88	6.14
7	000001	平安银行	29,335,125.14	5.87
8	002310	东方园林	26,949,059.56	5.39
9	600720	祁连山	26,896,975.90	5.38
10	600029	南方航空	25,855,538.92	5.17
11	002555	三七互娱	25,023,296.12	5.01
12	000807	云铝股份	24,370,513.40	4.88
13	601601	中国太保	24,176,292.24	4.84
14	000002	万科A	24,112,772.33	4.82
15	600585	海螺水泥	23,908,039.15	4.78
16	600909	华安证券	23,641,102.94	4.73
17	300418	昆仑万维	23,010,719.57	4.60
18	000728	国元证券	22,068,390.48	4.42
19	601600	中国铝业	21,237,812.65	4.25
20	300070	碧水源	20,029,707.78	4.01
21	600030	中信证券	20,003,253.04	4.00
22	000789	万年青	19,970,893.10	4.00
23	000018	神州长城	19,610,576.31	3.92
24	002185	华天科技	19,388,684.08	3.88
25	002174	游族网络	19,130,348.00	3.83
26	600068	葛洲坝	18,965,710.60	3.79
27	600109	国金证券	18,695,739.11	3.74
28	601390	中国中铁	18,601,720.94	3.72
29	600362	江西铜业	18,521,322.38	3.71

30	300370	安控科技	18,274,504.36	3.66
31	000783	长江证券	18,047,035.34	3.61
32	002304	洋河股份	17,936,417.80	3.59
33	601766	中国中车	17,910,179.40	3.58
34	600528	中铁工业	17,339,034.00	3.47
35	300495	美尚生态	17,059,413.00	3.41
36	600963	岳阳林纸	16,559,246.00	3.31
37	601318	中国平安	16,397,918.00	3.28
38	601800	中国交建	15,967,283.78	3.19
39	000050	深天马 A	15,889,601.59	3.18
40	601628	中国人寿	15,811,929.64	3.16
41	600702	沱牌舍得	15,794,765.16	3.16
42	600183	生益科技	15,498,374.48	3.10
43	300197	铁汉生态	15,473,109.55	3.10
44	600801	华新水泥	15,364,494.00	3.07
45	001979	招商蛇口	15,047,388.80	3.01
46	300323	华灿光电	14,975,973.50	3.00
47	000709	河钢股份	14,827,000.00	2.97
48	300310	宜通世纪	14,805,272.20	2.96
49	601166	兴业银行	14,792,959.98	2.96
50	601009	南京银行	14,779,064.00	2.96
51	300207	欣旺达	14,715,147.47	2.94
52	600856	中天能源	14,533,660.00	2.91
53	002797	第一创业	14,076,912.00	2.82
54	600015	华夏银行	13,741,524.44	2.75
55	600507	方大特钢	13,607,914.00	2.72
56	000786	北新建材	13,499,338.13	2.70
57	603993	洛阳钼业	13,251,157.00	2.65
58	002717	岭南园林	13,163,658.72	2.63
59	600977	中国电影	12,926,198.88	2.59
60	002027	分众传媒	12,856,551.00	2.57

61	000858	五 粮 液	12,853,992.07	2.57
62	300059	东方财富	12,632,075.77	2.53
63	600919	江苏银行	12,543,955.53	2.51
64	300237	美晨生态	12,535,907.29	2.51
65	601088	中国神华	12,490,040.72	2.50
66	002241	歌尔股份	12,134,389.00	2.43
67	002019	亿帆医药	12,025,947.26	2.41
68	002589	瑞康医药	11,978,608.96	2.40
69	601899	紫金矿业	11,943,420.00	2.39
70	600176	中国巨石	11,927,004.79	2.39
71	601186	中国铁建	11,914,247.00	2.38
72	601003	柳钢股份	11,900,535.00	2.38
73	600266	北京城建	11,839,606.00	2.37
74	002285	世联行	11,803,523.00	2.36
75	300188	美亚柏科	11,727,363.04	2.35
76	000915	山大华特	11,630,027.01	2.33
77	002008	大族激光	11,512,846.18	2.30
78	300115	长盈精密	11,479,072.45	2.30
79	600383	金地集团	11,443,257.19	2.29
80	002142	宁波银行	11,238,200.00	2.25
81	000596	古井贡酒	11,135,180.47	2.23
82	600038	中直股份	10,916,063.97	2.18
83	002092	中泰化学	10,901,091.00	2.18
84	000768	中航飞机	10,553,321.00	2.11
85	600231	凌钢股份	10,536,646.00	2.11
86	000937	冀中能源	10,525,801.00	2.11
87	002013	中航机电	10,476,958.64	2.10
88	600879	航天电子	10,405,158.00	2.08
89	002146	荣盛发展	10,358,149.02	2.07

注：本项“买入金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

## 8.4.2 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	601668	中国建筑	56,000,400.00	11.20
2	600110	诺德股份	43,141,692.96	8.63
3	601377	兴业证券	42,521,575.70	8.51
4	002456	欧菲科技	37,720,336.64	7.55
5	000063	中兴通讯	32,421,575.59	6.49
6	603799	华友钴业	31,858,074.00	6.37
7	600029	南方航空	27,424,235.24	5.49
8	002310	东方园林	25,592,525.79	5.12
9	000001	平安银行	25,222,353.00	5.05
10	002555	三七互娱	24,831,240.42	4.97
11	601601	中国太保	24,652,880.42	4.93
12	000807	云铝股份	24,024,583.00	4.81
13	300418	昆仑万维	23,400,620.76	4.68
14	600720	祁连山	22,718,328.51	4.55
15	600909	华安证券	21,915,316.40	4.38
16	000728	国元证券	21,255,301.66	4.25
17	300070	碧水源	21,004,821.90	4.20
18	600030	中信证券	20,957,105.00	4.19
19	300370	安控科技	20,808,255.40	4.16
20	601600	中国铝业	20,601,587.58	4.12
21	000002	万科A	20,183,338.48	4.04
22	600362	江西铜业	19,897,883.04	3.98
23	002185	华天科技	19,729,719.50	3.95
24	600585	海螺水泥	19,261,921.60	3.85
25	000789	万年青	19,250,629.00	3.85
26	002174	游族网络	19,125,441.90	3.83
27	000630	铜陵有色	18,837,455.54	3.77

28	600068	葛洲坝	18,543,748.32	3.71
29	000401	冀东水泥	18,193,066.00	3.64
30	601899	紫金矿业	18,021,040.00	3.61
31	000783	长江证券	17,586,975.44	3.52
32	601390	中国中铁	17,535,764.00	3.51
33	000018	神州长城	17,460,230.30	3.49
34	600109	国金证券	17,252,348.10	3.45
35	600528	中铁工业	17,240,959.00	3.45
36	000050	深天马 A	17,127,421.96	3.43
37	601318	中国平安	16,498,157.00	3.30
38	300197	铁汉生态	16,088,894.74	3.22
39	300495	美尚生态	16,004,238.65	3.20
40	002304	洋河股份	15,957,443.58	3.19
41	601628	中国人寿	15,741,000.82	3.15
42	601166	兴业银行	15,722,400.00	3.15
43	000709	河钢股份	15,721,067.00	3.15
44	300323	华灿光电	15,464,892.50	3.09
45	600183	生益科技	15,350,496.44	3.07
46	600507	方大特钢	15,132,401.65	3.03
47	601009	南京银行	15,037,637.19	3.01
48	001979	招商蛇口	14,687,036.62	2.94
49	601766	中国中车	14,625,478.99	2.93
50	600266	北京城建	14,490,000.00	2.90
51	300207	欣旺达	14,467,920.09	2.89
52	601800	中国交建	14,387,274.16	2.88
53	600963	岳阳林纸	14,294,832.82	2.86
54	600015	华夏银行	14,283,000.00	2.86
55	600856	中天能源	14,187,902.00	2.84
56	000858	五粮液	14,031,035.00	2.81
57	300310	宜通世纪	13,850,411.00	2.77
58	000786	北新建材	13,628,148.42	2.73

59	002797	第一创业	13,481,398.45	2.70
60	300059	东方财富	13,419,661.40	2.68
61	300115	长盈精密	13,234,019.00	2.65
62	002285	世联行	13,174,873.20	2.64
63	002027	分众传媒	13,144,056.20	2.63
64	603993	洛阳钼业	13,110,122.00	2.62
65	002008	大族激光	12,769,810.65	2.55
66	600919	江苏银行	12,752,000.00	2.55
67	002717	岭南园林	12,423,636.99	2.49
68	601088	中国神华	12,394,358.09	2.48
69	600383	金地集团	12,288,507.00	2.46
70	600977	中国电影	12,278,192.00	2.46
71	002019	亿帆医药	12,050,381.00	2.41
72	300188	美亚柏科	11,948,413.46	2.39
73	600702	沱牌舍得	11,894,622.49	2.38
74	002241	歌尔股份	11,846,025.00	2.37
75	300237	美晨生态	11,624,442.00	2.33
76	601186	中国铁建	11,377,000.00	2.28
77	002142	宁波银行	11,349,859.00	2.27
78	002589	瑞康医药	11,337,207.15	2.27
79	000915	山大华特	11,033,686.00	2.21
80	600176	中国巨石	10,714,229.60	2.14
81	600231	凌钢股份	10,674,412.00	2.14
82	600038	中直股份	10,637,029.00	2.13
83	600879	航天电子	10,536,157.00	2.11
84	002146	荣盛发展	10,500,070.00	2.10
85	002092	中泰化学	10,447,987.41	2.09
86	000937	冀中能源	10,303,486.53	2.06
87	002013	中航机电	10,194,528.50	2.04
88	000921	海信科龙	10,134,751.00	2.03
89	000768	中航飞机	10,124,757.12	2.03



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

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	2,403,239,348.90
卖出股票收入（成交）总额	2,382,741,404.70

注：本项“买入股票的成本（成交）总额”和“卖出股票的收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，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

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

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所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未投资股指期货。

##### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

#### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

##### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未投资国债期货。

##### 8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 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本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内收到公开谴责、处罚的情形。

8.12.2 本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

### 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	232,218.10
2	应收证券清算款	32,979,351.80
3	应收股利	-
4	应收利息	-5,127.90
5	应收申购款	1,294.07
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	33,207,736.07

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	601003	柳钢股份	4,940,800.00	4.73	重大事项

### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基 金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
1,773	56,332.14	17,461,618.94	17.48%	82,415,263.96	82.52%

注：机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 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	0.00	0.0000%

注：本报告期末，本基金管理人的从业人员未持有本基金。

### 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(2016年12月29日)基金份额总额	499,921,635.62
本报告期期初基金份额总额	499,921,635.62

本报告期基金总申购份额	3,435,446.50
减：本报告期基金总赎回份额	403,480,199.22
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	99,876,882.90

## § 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) 基金管理人的重大人事变动

公司第三届董事会第二十一次会议审议通过《关于聘任公司高级管理人员的议案》，聘任高晓峰先生担任公司副总经理、合规总监，任期与公司第三届董事会任期一致。待高晓峰先生取得相关任职资格，公司按照监管要求履行相关程序后，合规总监方可正式履职。

2017年6月7日公司收到中国证监会山西监管局《关于核准高晓峰证券公司经理层高级管理人员任职资格的批复》（晋证监许可字[2017]6号），核准高晓峰证券公司经理层高级管理人员任职资格，高晓峰先生自2017年6月7日起正式履行公司副总经理职责，任期与公司第三届董事会任期一致。

2017年6月27日，公司收到中国证监会山西监管局《关于高晓峰担任山西证券股份有限公司合规总监的无异议函》（晋证监函[2017]313号），对高晓峰担任公司合规总监无异议。高晓峰先生自2017年6月27日起正式担任公司合规总监，任期与公司第三届董事会任期一致。同时，汤建雄先生辞去公司合规总监职务，在公司继续担任副总经理职务。

公司第三届董事会第二十二次会议审议通过《关于聘任公司首席风险官的议案》，聘任汤建雄先生担任公司首席风险官，任期与公司第三届董事会任期一致。

#### (2) 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。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

(1) 本报告期内本基金管理人无重大诉讼、仲裁事项。

(2) 本报告期内无涉及本基金财产的诉讼。

(3) 本报告期内无涉及本基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内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

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。本报告期应支付给中喜会计师事务所（特殊普通合伙）审计费用15,000元。截至报告期末，该审计机构向本基金提供审计服务的连续年限：自基金合同生效日起至今。

### 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，本基金管理人及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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	
山西证券	2	4,781,979,006.58	100.00%	3,825,719.62	100.00%	-

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

#### 2、交易单元的选择标准和程序

券商选择标准：财务状况良好、经营行为规范、研究实力较强的证券公司。其中财务状况良好、经营行为规范以最近一年证券公司分类评介在C类或C类以上，且近一年内无重大违法违规事件为主要判断依据。研究实力较强以公司基金业务部投研团队的评价意见为主要判断依据。

券商选择程序：①对符合选择标准的券商的服务进行评价；②拟定租用对象：由投研部门根据以上评价结果拟定备选的券商；③签约：拟定备选的券商后，按公司签约程序与备选券商签约。签约时，要明确签定协议双方的公司名称、委托代理期限、佣金率、双方的权利义务等。

3、由于交易所系统限制，本基金管理人作为上海和深圳证券交易所的会员单位目前尚不能租赁其他证券公司的交易单元，只能使用本基金管理人自有的交易单元。

4、本基金本报告期内未新增交易单元。

#### 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		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
山西证券	-	-	1,494,000,000.00	100.00%	-	-	-	-

## § 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

本基金在报告期内不存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额20%的情形。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

山西证券股份有限公司  
二〇一八年三月三十一日