

富国天丰强化收益债券型证券投资基金
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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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

场内简称	富国天丰
基金简称	富国天丰强化债券（LOF）
基金主代码	161010
交易代码	前端交易代码：161010 后端交易代码：161018
基金运作方式	契约型，本基金合同生效后三年内封闭运作，在交易所上市交易，基金合同生效满三年后转为上市开放式。
基金合同生效日	2008年10月24日
基金管理人	富国基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	424,021,860.60份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2008年12月8日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金投资目标是在追求本金长期安全的基础上，力争为基金份额持有人创造较高的当期收益。
投资策略	本基金按照自上而下的方法对基金资产进行动态的整体资产配置和类属资产配置。一方面根据整体资产配置要求通过积极的投资策略主动寻找风险中蕴藏的投资机会，发掘价格被低估的且符合流动性要求的合适投资品种；另一方面通过风险预算管理、平均剩余期限控制和个券信用等级限定等方式有效控制投资风险，从而在一定的风险限制范围内达到风险收益最佳配比。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为中央国债登记结算有限责任公司编制并发布的中债综合指数。
风险收益特征	本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的低风险品种，其预期风险与收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	赵瑛	田青

	联系电话	021-20361818	010-67595096
	电子邮箱	public@fullgoal.com.cn	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		95105686、4008880688	010-67595096
传真		021-20361616	010-66275853

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 中国建设银行股份有限公司 北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

§ 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	-36,142,006.95	76,565,997.20	162,025,415.85
本期利润	-32,199,736.51	5,519,897.67	207,739,610.59
加权平均基金份额本期利润	-0.0401	0.0031	0.1735
本期基金份额净值增长率	-2.09%	-0.04%	18.53%
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	-0.0689	0.0054	0.0072
期末基金资产净值	431,546,991.03	1,458,547,221.53	1,797,675,495.81
期末基金份额净值	1.018	1.066	1.110

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。

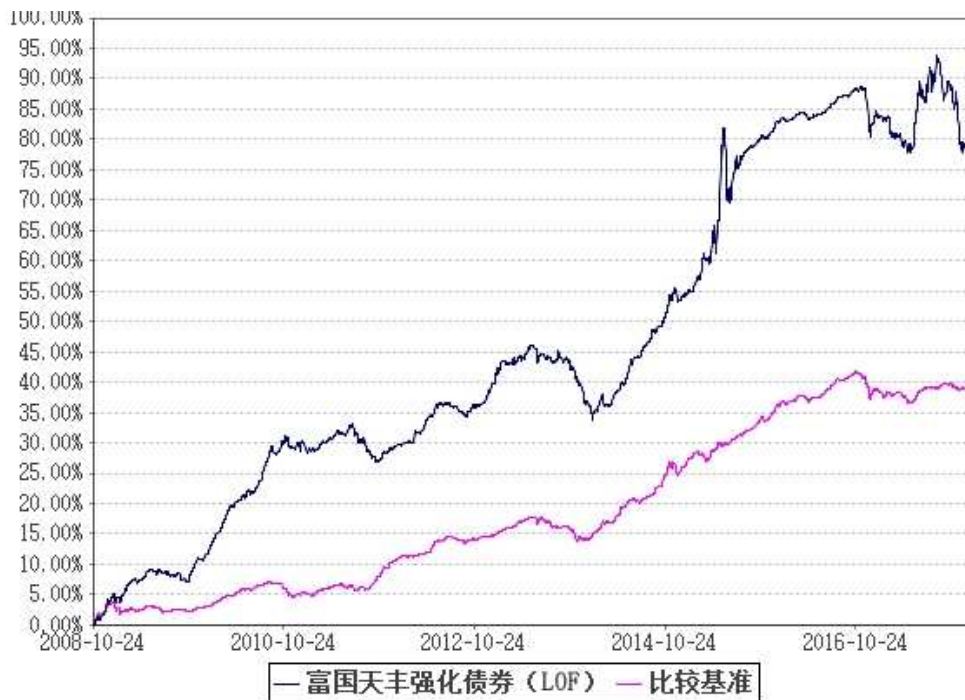
3.2 基金净值表现

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	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	①—③	②—④
----	----------	-----------	-----------	--------------	-----	-----

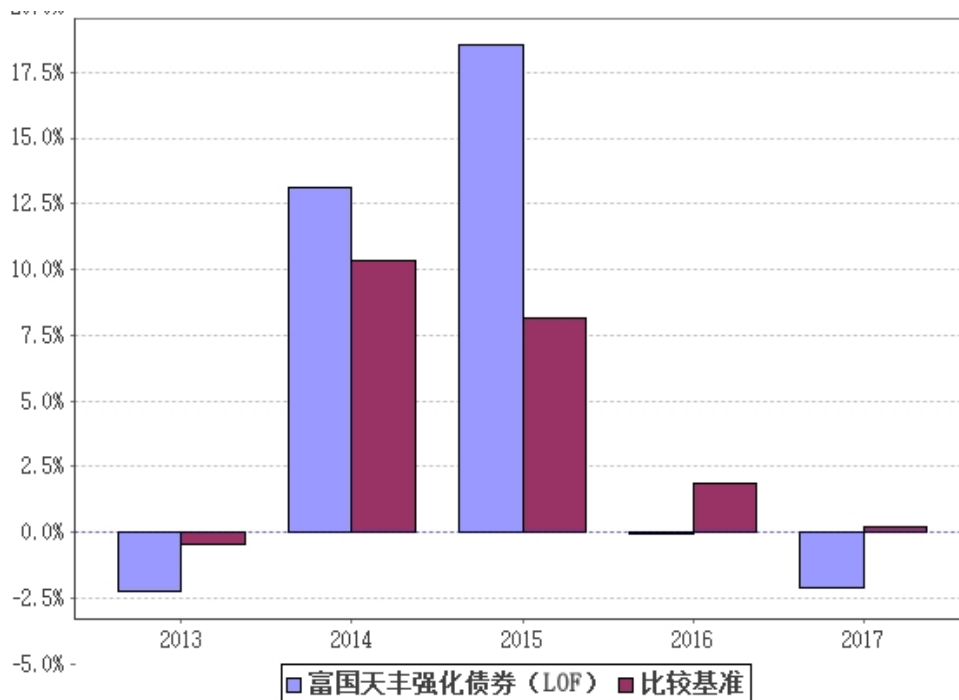
		差②	③	④		
过去三个月	-4.50%	0.37%	-0.43%	0.06%	-4.07%	0.31%
过去六个月	-4.26%	0.38%	0.36%	0.05%	-4.62%	0.33%
过去一年	-2.09%	0.34%	0.24%	0.06%	-2.33%	0.28%
过去三年	16.00%	0.35%	10.42%	0.08%	5.58%	0.27%
过去五年	28.24%	0.30%	21.26%	0.09%	6.98%	0.21%
自基金合同生效日起至今	79.11%	0.25%	39.13%	0.08%	39.98%	0.17%

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2008年10月24日成立，建仓期6个月，从2008年10月24日起至2009年4月23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 过去五年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：本基金合同生效日为 2008 年 10 月 24 日。

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年	0.270	16,714,087.05	7,181,311.41	23,895,398.46	5次分红
2016年	0.440	54,608,249.03	24,079,976.38	78,688,225.41	9次分红
2015年	1.770	176,917,743.30	12,112,270.02	189,030,013.32	10次分红
合计	2.480	248,240,079.38	43,373,557.81	291,613,637.19	—

§ 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		
钟智伦	本基金基金经理兼固定收益投资部总经理、富国目标收益一年期纯债债券型证券投资基金、富国目标收益两年期纯债债券型证券投资基金、富国纯债债券型发起式证券投资基金、富国新收益灵活配置混合型证券投资基金、富国两年期理财债券型证券投资基金、富国新回报灵活配置混合型	2008-10-24	—	24	硕士，曾任平安证券有限责任公司部门经理；上海新世纪投资服务有限公司研究员；海通证券股份有限公司投资经理；2005年5月任富国基金管理有限公司债券研究员；2006年6月至2009年3月任富国天时货币市场基金基金经理；2008年10月至今任富国天丰强化收益债券型证券投资基金基金经理；2009年6月至2012年12月任富国优化增强债券型证券投资基金基金经理；2011年12月至2014年6月任富国产业债债券型证券投资基金基金经理；2015年3月起任富国目标收益一年期纯债债券型证券投资基金、富国目标收益两年期纯债债券型证券投资基金、富国纯债债券型发起式证券投资基金基金经理；2015年5月起任富国新收益灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2016年12月起任富国新回报灵活配置混合型证券投资基金、富国两年期理财债券型证券投资基金基金经理；2017年3月起任富国收益增强债券型证券投资基金基金经理；2017年6月起任富国新活力灵活配置混合型发起式证券投资基金、富国鼎利纯债债券型发起式证券投资基金基金经理；

	<p>证券投资基金、富国收益增强债券型证券投资基金、富国新活力灵活配置混合型发起式证券投资基金、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、富国祥利定期开放债券型发起式证券投资基金、富国富利稳健配置混合型证券投资基金、富国泰利定期开放债券型发起式证券投资基金、富国景利纯债债券型发起式证券投资基金、富国新机遇</p>				<p>2017年7月起任富国泓利纯债债券型发起式证券投资基金基金经理；2017年8月起任富国新优享灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2017年9月起任富国祥利定期开放债券型发起式证券投资基金、富国富利稳健配置混合型证券投资基金、富国嘉利稳健配置定期开放混合型证券投资基金基金经理；2017年11月起任富国泰利定期开放债券型发起式证券投资基金、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基金经理；兼任固定收益投资部总经理。具有基金从业资格。</p>
--	---	--	--	--	---

	灵活配置 混合型发 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 金基金经 理				
--	--	--	--	--	--

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，富国基金管理有限公司作为富国天丰强化收益债券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》、《富国天丰强化收益债券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，以为投资者减少和分散风险，确保基金资产的安全并谋求基金长期稳定收益为目标，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未出现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，中国经济运行平稳。全年GDP增速前高后低，在6.9-6.8之间窄幅波动。国内固定资产投资增速缓慢下降，受益于海外市场回暖，出口增速回升，抵消了部分负面影响，使得经济保持平稳。人民币兑美元汇率全年升值6.3%，美元指数贬值9.89%，弱美元背景下的被动升值是主因。在金融去杠杆的强监管政策下，货币政策稳中偏紧，月末、季末流动性紧张，资金利率高企。美联储的加息以及缩表政策，也使得国内的货币政策承压。债券市场全年收益率基本呈现震荡上行的态势，延续着2016年11月以来的熊市。10年国债收益率从3%上行至3.9%，10年国开债收益率从3.8%上行至4.8%，幅度达到100bp。目前各类债券收益率已达历史70-90%分位，有很明显的配置价值，特别在短端。债券投资策略以票息为主，少做波段，加配短久期、中高等资质国企债券。超额收益机会更多来自转债，关注有基本面支持的品种。

整个报告期，本基金的纯债策略以降低配置比例和降低组合久期为主，主要持有短久期中高评级的城投债、公司债，同时增加可转债的配置比例。随着可转债仓位的提升，基金净值的波动相比以往显著增加。

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1.018元；份额累计净值为1.625元；本报告期，本基金份额净值增长率为-2.09%，同期业绩比较基准收益率为0.24%

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，我们判断经济韧性仍在，中性偏紧的货币政策和去杠杆仍在路上。预计出口表现较好，能够抵销投资端继续小幅回落的影响。CPI前高后低，

中枢抬升，在国际原油价格不断上涨的背景下，存在输入型通胀的隐患。

我们保持对债券市场谨慎的判断。美联储预计在 2018 年加息 3-4 次，债券市场维持短久期、中高收益债的策略。股票市场方面，2018 年 6 月份 A 股纳入 MSCI 指数，海外资金对 A 股估值定价的影响将进一步显著增加，预计相对低估值、业绩确定性强的白马股仍将受益，有基本面支持的估值合理的可转债品种将会受益。

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

本基金对本报告期内利润共进行 4 次收益分配。于 2017 年 3 月 6 日公告每 10 份基金份额派发红利 0.04 元；2017 年 7 月 6 日公告每 10 份基金份额派发红利 0.09 元；2017 年 8 月 4 日公告每 10 份基金份额派发红利 0.05 元；2017 年 9 月 6 日公告每 10 份基金份额派发红利 0.05 元；共计派发红利 18448980.94 元。

本基金本期分红已符合相关法律法规及《基金合同》约定。

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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金实施利润分配的金额是 23895398.46 元。

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

本托管人复核审查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。

§ 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：富国天丰强化收益债券型证券投资基金

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	398,964.23	83,064,636.61
结算备付金	5,803,139.61	11,651,191.26
存出保证金	87,658.73	19,251.38
交易性金融资产	487,447,670.00	1,944,565,266.87
其中：股票投资	21,126,770.00	—
基金投资	—	—
债券投资	466,320,900.00	1,944,565,266.87
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	—	—
应收证券清算款	—	—
应收利息	6,249,408.74	28,292,650.20
应收股利	—	—
应收申购款	38,653.88	48,576.87
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	—
资产总计	500,025,495.19	2,067,641,573.19
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	64,800,000.00	561,700,000.00
应付证券清算款	—	13,815,026.84
应付赎回款	465,512.38	29,706,011.25
应付管理人报酬	234,042.63	789,385.45
应付托管费	78,014.21	263,128.48
应付销售服务费	—	—
应付交易费用	39.04	1,875.00
应交税费	2,568,949.59	2,568,949.59
应付利息	51,023.34	68,506.03
应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	280,922.97	181,469.02
负债合计	68,478,504.16	609,094,351.66
所有者权益：		
实收基金	424,021,860.60	1,368,872,676.02
未分配利润	7,525,130.43	89,674,545.51
所有者权益合计	431,546,991.03	1,458,547,221.53
负债和所有者权益总计	500,025,495.19	2,067,641,573.19

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.018 元，基金份额总额 424,021,860.60 份。

7.2 利润表

会计主体：富国天丰强化收益债券型证券投资基金

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	-18,618,598.77	26,940,906.94
1. 利息收入	30,183,567.64	86,852,657.82
其中：存款利息收入	346,494.83	768,541.24
债券利息收入	29,344,337.65	85,276,417.50
资产支持证券利息收入	—	—
买入返售金融资产收入	492,735.16	807,699.08
其他利息收入	—	—
2. 投资收益（损失以“-”填列）	-52,968,269.59	10,764,732.00
其中：股票投资收益	7,202,221.90	—
基金投资收益	—	—
债券投资收益	-60,170,491.49	10,764,732.00

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	—	—
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	3,942,270.44	-71,046,099.53
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	—	—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	223,832.74	369,616.65
减：二、费用	13,581,137.74	21,421,009.27
1. 管理人报酬	5,167,697.95	11,729,772.76
2. 托管费	1,722,565.99	3,909,924.30
3. 销售服务费	—	—
4. 交易费用	346,620.87	20,315.67
5. 利息支出	5,959,636.20	5,373,123.87
其中：卖出回购金融资产支出	5,959,636.20	5,373,123.87
6. 其他费用	384,616.73	387,872.67
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-32,199,736.51	5,519,897.67
减：所得税费用	—	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-32,199,736.51	5,519,897.67

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：富国天丰强化收益债券型证券投资基金

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）	1,368,872,676.02	89,674,545.51	1,458,547,221.53
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	-32,199,736.51	-32,199,736.51
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）	-944,850,815.42	-26,054,280.11	-970,905,095.53
其中：1. 基金申购款	361,332,183.39	32,914,936.11	394,247,119.50
2. 基金赎回款	-1,306,182,998.81	-58,969,216.22	-1,365,152,215.03
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）	—	-23,895,398.46	-23,895,398.46
五、期末所有者权益（基金净值）	424,021,860.60	7,525,130.43	431,546,991.03
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）	1,620,001,727.43	177,673,768.38	1,797,675,495.81
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	5,519,897.67	5,519,897.67
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）	-251,129,051.41	-14,830,895.13	-265,959,946.54
其中：1. 基金申购款	1,181,332,558.50	124,415,271.25	1,305,747,829.75
2. 基金赎回款	-1,432,461,609.91	-139,246,166.38	-1,571,707,776.29
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）	—	-78,688,225.41	-78,688,225.41
五、期末所有者权益（基金净值）	1,368,872,676.02	89,674,545.51	1,458,547,221.53

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、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
中国建设银行股份有限公司（“建设银行”）	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

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01月01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(%)
海通证券	97,072,450.48	29.58	—	—
申万宏源	16,060,291.00	4.89	—	—

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

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01月01日至2016年12月31日)	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)
海通证券	194,528,633.43	7.24	178,117,475.63	24.30
申万宏源	39,361,587.51	1.47	6,761,400.60	0.92

7.4.4.1.4 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01月01日至2016年12月31日)	
	成交金额	占当期回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期回购成交总额的比例(%)
海通证券	941,601,000.00	5.20	270,000,000.00	1.45
申万宏源	944,000,000.00	5.21	2,342,600,000.00	12.62

7.4.4.1.5 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01月01日至2017年12月31日）			
	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（%）
海通证券	12,772.83	8.83	0.00	0.00
申万宏源	14,956.96	10.34	0.00	0.00

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。本基金上年度可比期间无应付关联方佣金。

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	5,167,697.95	11,729,772.76
其中：支付销售机构的客户维护费	453,332.19	817,611.82

注：在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的0.6%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.6\% / \text{当年天数}$$

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。

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	1,722,565.99	3,909,924.30

注：在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的0.2%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.2\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

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自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自有资金投资本基金。

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
中国建设银行股份有限公司	398,964.23	170,707.97	83,064,636.61	602,020.76

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

注：本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.5.2期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 64,800,000.00 元，于 2018 年 1 月 22 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

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 212,864,785.60 元，属于第二层次的余额为人民币 274,582,884.40 元，属于第三层次余额为人民币 0.00 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 338,584,490.47 元，属于第二层次的余额为人民币 1,605,980,776.40 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	21,126,770.00	4.23
	其中：股票	21,126,770.00	4.23
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	466,320,900.00	93.26
	其中：债券	466,320,900.00	93.26
	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	6,202,103.84	1.24
8	其他各项资产	6,375,721.35	1.28
9	合计	500,025,495.19	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	4,535,000.00	1.05
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	16,591,770.00	3.84
K	房地产业	—	—
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	—	—
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	—	—
	合计	21,126,770.00	4.90

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	601336	新华保险	236,350	16,591,770.00	3.84
2	600031	三一重工	500,000	4,535,000.00	1.05

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	002241	歌尔股份	82,655,966.70	5.67
2	600004	白云机场	46,848,000.00	3.21
3	601336	新华保险	22,726,176.83	1.56
4	600755	厦门国贸	13,018,621.87	0.89
5	600031	三一重工	4,540,000.00	0.31
6	002510	天汽模	609,074.80	0.04
7	603882	金域医学	6,930.00	0.00
8	601949	中国出版	3,340.00	0.00

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	002241	歌尔股份	86,781,031.59	5.95
2	600004	白云机场	50,372,177.94	3.45
3	600755	厦门国贸	12,620,437.87	0.87
4	601336	新华保险	7,299,989.00	0.50
5	002510	天汽模	656,195.20	0.04
6	603882	金域医学	42,846.00	0.00
7	601949	中国出版	12,900.00	0.00

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	170,408,110.20
卖出股票收入（成交）总额	157,785,577.60

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	—	—
2	央行票据	—	—
3	金融债券	80,043,545.00	18.55
	其中：政策性金融债	39,968,000.00	9.26
4	企业债券	163,012,873.40	37.77
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	可转债（可交换债）	223,264,481.60	51.74
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	466,320,900.00	108.06

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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	136146	16 东兴债	409,980	40,075,545.00	9.29
2	170301	17 进出 01	400,000	39,968,000.00	9.26
3	110033	国贸转债	345,000	39,857,850.00	9.24
4	128010	顺昌转债	320,000	37,443,200.00	8.68
5	110034	九州转债	340,000	37,165,400.00	8.61

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

本基金根据基金合同的约定，不允许投资股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金根据基金合同的约定，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	87,658.73
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	6,249,408.74
5	应收申购款	38,653.88
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	6,375,721.35

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
----	------	------	------	--------------

1	110033	国贸转债	39,857,850.00	9.24
2	128010	顺昌转债	37,443,200.00	8.68
3	110034	九州转债	37,165,400.00	8.61
4	110032	三一转债	35,528,562.00	8.23
5	113009	广汽转债	26,532,273.30	6.15
6	120001	16以岭EB	9,676,366.00	2.24
7	113012	骆驼转债	7,625,600.00	1.77
8	128014	永东转债	6,480,858.30	1.50

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持有流通受限的股票。

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(%)
10,394	40,794.87	193,284,327.67	45.58	230,737,532.93	54.42

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例(%)
1	中国财产再保险有限责任公司	49,437,180	22.24
2	中意人寿保险有限公司—分红—团体年金	30,015,208	13.50
3	中意人寿保险有限公司	28,011,029	12.60
4	中意人寿保险有限公司—中石油年金产品—股票账户	17,624,572	7.93
5	方正东亚信托有限责任公司—凯旋1号证券投资集合资金信托计划	5,885,305	2.65
6	中国财产再保险有限责任公司—传统—普通保险产品	5,842,200	2.63
7	蔡仁芳	5,400,000	2.43
8	应惠君	3,809,200	1.71

9	胜利油田相关企业企业年金计划— 中国工商银行股份有限公司	2,997,901	1.35
10	王秀琴	2,750,200	1.24

9.3 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	176,419.21	0.0416

9.4 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(2008年10月24日)基金份额总额	1,998,141,990.50
报告期期初基金份额总额	1,368,872,676.02
本报告期基金总申购份额	361,332,183.39
减：本报告期基金总赎回份额	1,306,182,998.81
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	424,021,860.60

§ 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

本报告期内本基金托管人于2017年9月1日发布公告，聘任纪伟为中国建设银行资产托管业务部总经理。

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8万元人民币，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 (%)	
安信证券	2	—	—	35,519,916.42	1.32	1,250,000,000.00	6.90	—	—	—	—	
渤海证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
长城证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
长江证券	2	43,845,010.55	13.36	604,507,164.06	22.51	4,241,800,000.00	23.41	—	—	3,071.80	2.12	
东北证券	2	—	—	70,139,269.09	2.61	425,000,000.00	2.35	—	—	—	—	
东财证券	2	446,580.75	0.14	198,743,695.55	7.40	1,906,200,000.00	10.52	—	—	406.95	0.28	
高华证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
光大证券	2	11,370,568.00	3.46	51,083,132.83	1.90	521,000,000.00	2.88	—	—	10,361.88	7.16	
广发证券	2	6,973,423.40	2.12	145,705,400.65	5.42	530,000,000.00	2.92	—	—	6,354.73	4.39	
国海证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	
国泰君安	2	20,731,949.00	6.32	107,960,230.00	4.02	1,376,800,000.00	7.60	—	—	19,307.70	13.34	
国信证券	1	45,209,405.87	13.78	70,607,210.89	2.63	84,550,000.00	0.47	—	—	41,199.27	28.47	
海通证券	2	97,072,450.48	29.58	194,528,633.43	7.24	941,601,000.00	5.20	—	—	12,772.83	8.83	
华泰证券	1	37,273,573.72	11.36	27,712,400.71	1.03	—	—	—	—	33,967.42	23.47	
华信证券	2	45,906,195.20	13.99	392,407,936.72	14.61	1,552,900,000.00	8.57	—	—	598.01	0.41	

平安证券	2	—	—	156,781,975.80	5.84	228,790,000.00	1.26	—	—	—	—
瑞银证券	2	—	—	23,948,392.88	0.89	345,000,000.00	1.90	—	—	—	—
上海证券	1	—	—	3,588,149.62	0.13	173,000,000.00	0.95	—	—	—	—
申万宏源	1	16,060,291.00	4.89	39,361,587.51	1.47	944,000,000.00	5.21	—	—	14,956.96	10.34
太平洋证券	2	—	—	9,211,985.38	0.34	70,180,000.00	0.39	—	—	—	—
天风证券	2	3,293,964.54	1.00	97,014,496.55	3.61	1,291,300,000.00	7.13	—	—	1,718.10	1.19
西南证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
湘财证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
信达证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
兴业证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
招商证券	1	—	—	35,031,773.32	1.30	—	—	—	—	—	—
中金公司	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
中泰证券	2	—	—	—	—	90,000,000.00	0.50	—	—	—	—
中信建投	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
中信山东	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
中信证券	1	—	—	421,988,786.30	15.71	2,148,400,000.00	11.86	—	—	—	—
中银国际	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—

注：我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。本报告期本基金退租券商交易单元：中投证券（22347），德邦证券（24228）。本报告期本基金新增券商交易单元：天风证券（003793、38652），瑞银证券（38166、004183），平安证券（002294、38173）。其余租用券商交易单元未发生变动。

§ 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2017-05-08 至 2017-08-17	166,599,495.00	-	-90,948,686.00	75,650,809.00	17.84%
	2	2017-01-01 至 2017-03-09	467,988,180.94	3,572,370.87	-469,736,035.95	1,824,515.86	0.43%
	3	2017-08-30 至 2017-12-03	-	181,655,128.81	-181,655,128.81	-	-
产品特有风险							
<p>本基金于本报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情形，本基金管理人已经采取措施，审慎确认大额申购与大额赎回，防控产品流动性风险并公平对待投资者。本基金管理人提请投资者注意因单一投资者持有基金份额集中导致的产品流动性风险、大额赎回风险以及净值波动风险等特有风险。</p>							