(上接B105版)

电话:021-63333389
传真:021-63333390
101) 北京乐融多源投资咨询有限公司
名 称:北京乐融多源投资咨询有限公司
注册地址:北京市朝阳区西大望路1号1号楼16层1603
办公地址:北京市朝阳区西大望路1号1号楼16层1603
邮政编码:100022
注册资本:2000万元人民币
法定代表人:董浩
电 话:010-56409010
102) 深圳富济财富管理有限公司
公司名称:深圳富济财富管理有限公司Wealth Management Co.,Ltd.
英文名称:Shenzhen Fuji
办公地址:深圳市南山区科苑南路高新南七道惠恒大厦二期418室
公司注册地址:深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室
邮政编码:518000
注册资本:2000万元
公司网站:www.jinqianwo.cn
服务热线:0755-83999907
传真电话:0755-83999926
客服邮箱:fujiwealth@lefu8.com
103) nullnull104) 上海陆金所基金销售有限公司
注册地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼
法定代表人:郭坚
组织形式:有限责任公司
存续期间:持续经营
联系人:宁博宇
电 话:021-20665952
传 真:021-22066653
105) 珠海盈米财富管理有限公司
公司全称:珠海盈米财富管理有限公司
法定代表人:肖雯
注册地址:珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491
办公地址:广州市海珠区琶洲大道东路1号保利国际广场南塔1201-1203室
客服电话:020-89629066
网站:www.yingmi.cn
106) 奕丰金融服务(深圳)有限公司
公司全称:奕丰金融服务(深圳)有限公司
法定代表人:TEO WEE HOWE
注册地址:深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室(入住深圳市前海商务秘书有限公司)
办公地址:深圳市南山区海德三道航天科技广场A座17楼1704室
客服电话:400-684-0500
公司网址:www.ifastps.com.cn
107) 中证金牛(北京)投资咨询有限公司
公司全称:中证金牛(北京)投资咨询有限公司
法定代表人:钱晨旻
注册地址:北京市丰台区东管头1号2号楼2-45室
办公地址:北京市西城区宣武门外大街甲一号环球财讯中心A座5层
客服电话:4008-909-998
公司网址:www.jnlc.com
108) 北京肯特瑞财富投资管理有限公司
公司全称:北京肯特瑞财富投资管理有限公司
法定代表人:江卉
注册地址:北京市海淀区海淀东三街2号4层401-15
办公地址:北京市东城区东直门外大街11号一街18号院A座
客服电话:400 098 8511 (个人业务)、400 088 8816 (企业业务)
公司网址:http://kenterui.jd.com/
109) 上海云湾投资管理有限公司
公司全称:上海云湾投资管理有限公司
法定代表人:戴新装
注册地址:中国浦东新区新金桥路27号13号楼2层
办公地址:上海市锦康路308号6号楼
110) 北京蛋卷基金销售有限公司
公司全称:北京蛋卷基金销售有限公司
法定代表人:钟斐斐
注册地址:北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507
办公地址:北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507
客服电话:4000-618-518
公司网址:https://danjuanapp.com/
111) 中信建投期货有限公司
公司全称:中信建投期货有限公司
法定代表人:彭文德
注册地址:渝中区中山三路107号上站大楼平街11-B,名义层11-A,8-B4,9-B,C
办公地址:渝中区中山三路107号上站大楼平街11-B,名义层11-A,8-B4,9-B,C
客服电话:400-8877-780,023-63986030
网址:www.cfc108.com
112) 中信期货有限公司
公司全称:中信期货有限公司
法定代表人:张皓
注册地址:广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座13层1301-1305、14层
办公地址:广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座13层1301-1305、14层
客服电话:400-990-8826
网站:www.citicsf.com
基金管理人可根据有关法律法规的要求,选择其他符合要求的机构销售基金,并及时公告。
(二)登记机构
名称:汇添富基金管理股份有限公司
住所:上海市黄浦区大沽路288号6幢538室
办公地址:上海市浦东新区樱花路868号建工大唐国际广场A座7楼
法定代表人:李文
电话:(021)28932888
传真:(021)28932876
联系人:韩从慧
(三)出具法律意见书的律师事务所
名称:上海市通力律师事务所
住所:上海市银城中路68号时代金融中心19楼
办公地址:上海市银城中路68号时代金融中心19楼
负责人:俞卫锋
电话:(021)31358666
传真:(021)31358600
经办律师:黎明、孙睿
联系人:陈颖华
(四)审计基金财产的会计师事务所
名称:安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)
首席合伙人:吴港平
住所: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
办公地址: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
邮政编码:100738
公司电话:(010)58153000
公司传真:(010)85188298
签章会计师:陈露、陈军
业务联系人:陈露、陈军

第四部分、基金的名称

本基金名称: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。

第五部分、基金的类型

本基金为契约型开放式证券投资基金。

第六部分、基金的投资目标

基于基金管理人对市场机会的判断,灵活应用包括市场中性策略在内的多种绝对收益策略,在严格的风险管理下,追求基金资产长期持续稳定的绝对回报。

第七部分、基金的投资方向

本基金投资于依法发行或上市的股票、债券等金融工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。具体包括:股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票),股指期货、权证、债券(国债、金融债、企业(公司)债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、中小企业私募债、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、银行存款等,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的相关规定)。

本基金的投资组合比例为:本基金权益类空头头寸的价值占本基金权益类多头头寸的价值的比例范围在80%—120%之间。其中:权益类空头头寸的价值是指融券卖出的股票市值、卖出股指期货的合约价值及卖出其他权益类衍生工具的合约价值的合计值;权益类多头头寸的价值是指买入持有的股票市值、买入股指期货的合约价值及买入其他权益类衍生工具的合约价值的合计值。

开放期内的每个交易日日终,持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和,不得超过基金资产净值的95%,封闭期内的每个交易日日终,持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和,不得超过基金资产净值的100%。

开放期内,在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,基金保留的现金或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%。在封闭期内,本基金不受上述5%的限制。

本基金不受中国证监会《证券投资基金参与股指期货交易指引》第五条第(一)项、第(三)项、第(五)项及第(七)项的限制。

待基金参与融资融券和转融通业务的相关规定颁布后,基金管理人可以在不改变本基金既有投资策略和风险收益特征并在控制风险的前提下,经与基金托管人协商一致后,参与融资融券业务以及通过证券金融公司办理转融通业务,以提高投资效率及进行风险管理。届时基金参与融资融券、转融通等业务的风险控制原则、具体参与比例限制、费用收支、信息披露、估值方法及其他相关事项按照中国证监会的规定及其他相关法律法规的要求执行,无需召开基金份额持有人大会决定。

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。

第八部分、基金的投资策略

一、本基金采用包括市场中性投资策略在内的多种绝对收益策略,力争实现基金资产长期持续稳定的绝对回报。

1、绝对收益策略

(1)市场中性投资策略

本基金通过持续、系统、深入的基本面研究构建多头股票组合,并匹配合适的空头工具,对冲多头股票组合的系统性风险,从而实现较低风险的稳健回报。本策略主要包括两个方面:多头股票投资策略和空头工具投资策略。多头股票投资策略是市场中性策略的核心,在本基金管理人统一的价值投资理念基础上,立足于深入的基本面分析,精选高质量证券组合。空头工具投资策略,主要运用股指期货对冲策略,并根据对冲的需要,对多头股票组合进行贝塔、风格配置管理。

1)多头股票投资策略

本基金通过系统地分析中国证券市场的特点和运作规律,以深入的基本面研究为基础,自下而上地通过定量和定性相结合的方法,考察上市公司的治理结构、核心竞争优势、议价能力、市场占有率、成长性、盈利能力、运营效率、财务结构、现金流情况以及公司基本面变化等,并对上市公司的投资价值进行综合评价,精选具有较高投资价值的上市公司构建多头组合。

2)空头工具投资策略

本基金将主要利用股指期货对冲多头股票部分的系统性风险。本基金根据市场的变化、现货市场与期货市场的相关性等因素,计算需要用到的期货合约数量,对这个数量进行动态跟踪与测算,并进行适时灵活调整。同时,综合考虑各个月份期货合约之间的定价关系、套利机会、流动性以及保证金要求等因素,在各个月份期货合约之间进行动态配置,通过空头部分的优化创造额外收益。随着监管的放开及其他工具流动性增强,本基金会优选空头工具,采用最优的多头系统性风险对冲方式。

(2)、其他绝对收益策略

本基金采用股指期货套利的对冲策略寻找和发现市场中资产定价的偏差,捕捉绝对收益机会。同时,本基金根据市场情况的变化,灵活运用其他绝对收益策略(如统计套利策略、定向增发套利策略、大宗交易套利、并购套利策略等)提高资本的利用率,从而提高绝对收益,达到投资策略的多元化以进一步降低本基金收益的波动。

2、其他投资策略

(1)、债券投资策略

债券投资是本产品的有益补充。本基金投资于债券品种,包括国内依法公开发行和上市的国债、金融债、公司债、可转债、央行票据和资产支持证券等;此外,市场未来推出的各类债券及其衍生品也可能成为本基金的投资对象。本基金的债券投资综合考虑收益性、风险性和流动性,在深入分析宏观经济、货币政策以及市场结构的基础上,灵活运用各种消极和积极策略。

(2)、中小企业私募债投资策略

对于中小企业私募债券,本基金的投资策略以持有到期为主,在综合考虑债券信用资质、债券收益率和期限的前提下,重点选择资质较好、收益率较好、期限匹配的中小企业私募债券进行投资。

基金投资中小企业私募债券,基金管理人将根据审慎原则,制定严格的投资决策流程、风险控制制度和信用风险、流动性风险处置预案,并经董事会批准,以防范信用风险、流动性风险等各种风险。

(3)、衍生品投资策略

本基金的衍生品投资将严格遵守证监会及相关法律法规的约束,合理利用期货、期权、权证等衍生工具,利用数量方法发掘可能的套利机会。投资原则为有利于基金资产增值,控制下跌风险,实现保值和锁定收益。

二、投资决策依据和决策程序

1、投资决策依据

(1)国家有关法律、法规和基金合同的有关规定;

(2)国内外宏观经济形势及对中国证券市场的影响;

(3)国家货币政策、产业政策以及证券市场政策;

(4)行业发展现状及前景;

(5)上市公司基本面及成长前景;

2、投资决策机制

本基金实行投资决策团队制、强调团队合作,充分发挥集体智慧。本基金管理人将投资和研究职能整合,设立了投资研究总部,策略分析师、行业分析师、金融工程小组和基金经理立足本职工作,充分发挥主观能动性,渗透到投资研究的关键环节,群策群力,为基金份额持有人谋取长期持续稳健投资回报。

3、投资决策程序

本基金具体的投资决策机制与流程为:

(1)策略分析师就宏观、政策、投资主题以及市场环境等提交策略报告并讨论;行业研究员就行业发展趋势和行业组合的估值比较,召开会议讨论确定行业评级;

(2)行业分析师根据行业发展和公司微观经营情况,定期确定行业的股票买卖名单。

(3)基金经理根据策略报告,与策略分析师共同讨论投资主题和投资风格。

(4)基金经理根据行业评级和股票买卖名单,与行业分析师共同讨论股票投资标的。

(5)基于前面讨论的投资主题、风格和股票投资标的,基金经理经过产品风险管理策略管理,决定股票投资组合方案;

(6)投资总监审核投资组合方案后,交由基金经理实施,并进行相应的对冲操作;

(7)集中交易室执行交易指令;

(8)金融工程小组进行全程风险评估和绩效分析。

三、投资限制

1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制:

(1) 本基金权益类空头头寸的价值占本基金权益类多头头寸的价值的比例范围在80%—120之间。其中:权益类空头头寸的价值是指融券卖出的股票市值、卖出股指期货的合约价值及卖出其他权益类衍生工具的合约价值的合计值;权益类多头头寸的价值是指买入持有的股票市值、买入股指期货的合约价值及买入其他权益类衍生工具的合约价值的合计值;

(2)开放期内的每个交易日日终,持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和,不得超过基金资产净值的95%,封闭期内的每个交易日日终,持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和,不得超过基金资产净值的100%;

(3)开放期内,在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。在封闭期内,本基金不受上述5%的限制;

(4)本基金持有一家上市公司的股票,其市值不超过基金资产净值的10%;

(5)本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券,不超过该证券的10%;

(6)本基金持有的全部权证,其市值不得超过基金资产净值的3%;

(7)本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证,不得超过该权证的10%;

(8)本基金在任何交易日买入权证的总金额,不得超过上一交易日基金资产净值的0.5%;

(9) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例,不得超过基金资产净值的10%;

(10)本基金持有的全部资产支持证券,其市值不得超过基金资产净值的20%;

(11)本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例,不得超过该资产支持证券规模的10%;

(12)本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%;

(13)本基金应投资于信用级别评级为BBB以上(含BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间,如果其信用等级下降、不再符合投资标准,应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出;

(14)基金财产参与股票发行申购,本基金所申报的金额不超过本基金的总资产,本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量;

(15) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%;债券回购最长期限为1年,债券回购到期后不得展期;

(16)本基金持有的单只中小企业私募债券,其市值不得超过基金资产净值的10%;本基金投资中小企业私募债券的剩余期限,不得超过本基金的剩余封闭期;

(17)法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

因证券、期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的,基金管理人应当在10个交易日内进行调整。法律法规另有规定的,从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消或变更上述限制,如适用于本基金,基金管理人在履行适当程序后,则本基金投资不再受相关限制;如适用于本基金,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益,基金财产不得用于下列投资或者活动:

(1)承销证券;

(2)违反规定向他人贷款或者提供担保;

(3)从事承担无限责任的投资;

(4)买卖其他基金份额,但是中国证监会另有规定的除外;

(5)向其基金管理人、基金托管人出资;

(6)从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动;

(7)法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

法律、行政法规或监管部门取消上述限制,如适用于本基金,基金管理人在履行适当程序后,则本基金投资不再受相关限制。

第九部分、基金的业绩比较基准

一年期定期存款税后利率。

一年期定期存款利率是中国人民银行公布的金融机构一年期人民币存款基准利率。反映了居民闲置资金在银行存入一年定期存款所能获得的年收益率,扣除利率税后为实际可得收益率。该利率可反映本基金目标客户群体风险收益偏好,可以作为本基金的业绩比较基准。

如果今后法律法规发生变化,或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,本基金管理人可以与基金托管人协商一致并报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告,但不需要召开基金份额持有人大会。

第十部分、基金的风险收益特征

本基金为特殊的混合型基金,采用多种绝对收益策略,其中市场中性策略采用股指期货对冲市场风险,使得多空组合的收益波动与市场相关性较低。本基金属于中低风险水平追求绝对收益的投资品种,其预期风险低于股票型基金和一般的混合型基金。

第十一部分、基金的投资组合报告

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年1月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2017年10月1日起至12月31日止。

投资组合报告

1.1报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	152,064,229.39	47.54
	其中:股票	152,064,229.39	47.54
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	121,730,597.40	38.06
	其中:债券	121,730,597.40	38.06
	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	7,422,548.50	2.32
8	其他资产	38,658,540.70	12.09
9	合计	319,875,915.99	100.00

1.2报告期末按行业分类的股票投资组合

1.2.1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	9,036,300.00	2.84
C	制造业	54,740,297.68	17.18
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,143.20	0.01
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	17,942.76	0.01
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	0.01
J	金融业	57,174,833.20	17.94
K	房地产业	11,320,000.00	3.55
L	租赁和商务服务业	7,040,000.00	2.21
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	12,684,600.00	3.98
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	152,064,229.39	47.73

1.2.2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持有港股通股票投资。

1.3报告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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	300,000	20,994,000.00	6.59
2	000651	格力电器	380,000	16,606,000.00	5.21
3	002044	美年健康	580,000	12,684,600.00	3.98
4	601398	工商银行	2,000,000	12,400,000.00	3.89
5	601601	中国太保	289,910	12,008,072.20	3.77
6	000001	平安银行	885,170	11,772,761.00	3.69
7	600048	保利地产	800,000	11,320,000.00	3.55
8	601088	中国神华	390,000	9,036,300.00	2.84
9	002035	华帝股份	280,000	8,439,200.00	2.65
10	603658	安图生物	150,800	8,025,576.00	2.52

1.4报告期末按债券品种分类的债券投资组合

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	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	82,787,000.00	25.98
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	19,862,000.00	6.23
7	可转债(可交换债)	19,081,597.40	5.99
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	121,730,597.40	38.21

1.5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债券投资明细

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	136581	16外高02	300,000	28,998,000.00	9.10
2	122486	15旭辉01	200,000	19,830,000.00	6.22
3	136753	16大华02	150,000	14,316,000.00	4.49
4	110040	生益转债	120,000	12,993,600.00	4.08
5	101773022	17华远地产MTN002	100,000	9,985,000.00	3.13

1.6报告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。

1.7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。

1.8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权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

1.9报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

1.9.1报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
IF1801	IF1801	-66	-79,940,520.00	287,773.28	-
IH1801	IH1801	-72	-61,918,560.00	377,055.43	-
公允价值变动总额合计(元)					664,828.71
股指期货投资本期收益(元)					-8,474,695.64
股指期货投资本期公允价值变动(元)					45,835.64

1.9.2本基金投资股指期货的投资政策

本基金根据市场的变化、现货市场与期货市场的相关性等因素,计算需要用到的期货合约数量,对这个数量进行动态跟踪与测算,并进行适时灵活调整。同时,综合考虑各个月份期货合约之间的定价关系、套利机会、流动性以及保证金要求等因素,在各个月份期货合约之间进行动态配置,通过空头部分的优化创造额外收益。

1.10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:报告期末本基金无国债期货持仓。

1.11投资组合报告附注

1.11.1

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、处罚的情况。

1.11.2

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。

1.11.3其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	21,411,035.99
2	应收证券清算款	15,979,618.06
3	应收股利	-
4	应收利息	1,267,886.65
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	38,658,540.70

1.11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110031	航信转债	5,398,688.80	1.69

1.11.5报告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。

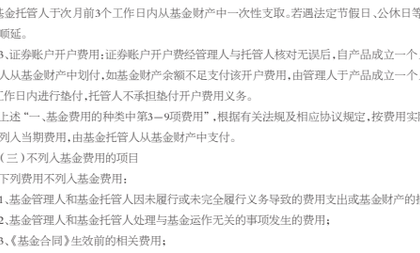
第十二部分 基金的业绩

本基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

(一)本基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表:

阶段	净值增长率(1)	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)
2017年3月15日(基金合同生效日)至2017年12月31日	8.60%	0.34%	1.20%	0.00%	7.40%	0.34%

(二)自基金合同生效以来基金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图



第十三部分、基金的费用与税收

(一)基金费用的种类

1、基金管理人的管理费;

2、基金托管人的托管费;

3、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;

4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费;

5、基金份额持有人大会费用;

6、基金的证券交易费用;

7、基金的银行汇划费用;

8、基金的相关账户的开户及维护费用;

9、按照国家有关规定和《基金合同》约定,可以在基金财产中列支的其他费用。

(二)基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

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×1.5%÷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,由基金管理人与基金托管人核对一致后,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、公休假等,支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

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×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,由基金管理人与基金托管人核对一致后,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、公休日等,支付日期顺延。

3、证券账户开户费用:证券账户开户费经管理人与托管人核对无误后,自产品成立一个月内由托管人从基金财产中划付,如基金财产余额不足支付该开户费用,由管理人于产品成立一个月后的5个工作日内进行垫付,托管人不承担垫付开户费用义务。

上述“一、基金费用的种类中第3—9项费用”,根据有关法规及相应协议规定,按费用实际支出金额列入当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。

(三)不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用:

1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失;

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;

3、《基金合同》生效前的相关费用;

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

(四)基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体,其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

第十四部分、对招募说明书更新部分的说明

一、“重要提示”部分:

更新了招募说明书所载内容截止日及有关财务数据和净值表现的截止日。

二、“三、基金管理人”部分:

更新了基金管理人的相关信息。

三、“四、基金托管人”部分:

更新了基金托管人的相关信息。

四、“五、相关服务机构”部分:

更新了相关服务机构的相关信息。

五、“八、基金份额的开放期、封闭期、申购和赎回”部分

增加了基金第二个开放期情况。

六、“九、基金的投资”部分:

更新了基金投资组合报告。

七、“十、基金的业绩”部分:

更新了基金业绩表现数据。

八、“二十三、其他应披露事项”部分:

更新了2017年9月16日至2018年3月15日期间涉及本基金的相关公告。

汇添富基金管理股份有限公司
2018年4月27日

福建南平太阳电缆股份有限公司

2018 第一季度报告

证券代码:002300 证券简称:太阳电缆 公告编号:2018-012

第一节 重要提示

公司董事会、监事会及董事、监事、高级管理人员保证季度报告内容的真实、准确、完整,不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,并承担个别和连带的法律责任。

所有董事均已出席了审议本次季报的董事会会议。

公司负责人李云孝、主管会计工作负责人石利民及会计机构负责人(会计主管人员)张益金声明:保证季度报告中财务报表的真实、准确、完整。

第二节 公司基本情况

一、主要会计数据和财务指标

公司是否需追溯调整或重述以前年度会计数据

□ 是 √ 否

	本报告期	上年同期	本报告期比上年同期增减
营业收入(元)	973,591,896.19	724,602,662.73	34.36%
归属于上市公司股东的净利润(元)	12,422,035.75	11,797,633.06	5.29%
归属于上市公司股东的扣除非经常性损益的净利润(元)	5,099,761.04	4,665,986.64	9.30%
经营活动产生的现金流量净额(元)	-256,661,197.10	-163,956,251.99	56.54%
基本每股收益(元/股)	0.0229	0.0217	5.53%
稀释每股收益(元/股)	0.0229	0.0217	5.53%
加权平均净资产收益率	0.93%	0.88%	0.05%
	本报告期末	上年度末	本报告期末比上年度末增减
总资产(元)	3,368,376,133.97	3,240,105,234.30	3.96%
归属于上市公司股东的净资产(元)	1,339,271,662.07	1,327,792,732.42	0.86%

非经常性损益项目和金额

√ 适用 □ 不适用

单位:元

项目	年初至报告期期末金额	说明
非流动资产处置损益(包括已计提资产减值准备的冲销部分)	30,540.35	
计入当期损益的政府补助(与企业业务密切相关,按照国家统一标准定额或定量享受的政府补助除外)	10,006,851.00	主要是计入“其他收益”的政府补助按期摊销
除同公司正常经营业务相关的有效套期保值业务外,持有交易性金融资产、交易性金融负债产生的公允价值变动损益,以及处置交易性金融资产、交易性金融负债和可供出售金融资产取得的投资收益	-127,483.37	
除上述各项之外的其他营业外收入和支出	-75,044.53	
减:所得税影响额	2,458,715.86	
少数股东权益影响额(税后)	53,872.88	
合计	7,322,274.71	--

对公司根据《公开发行证券的公司信息披露解释性公告第1号——非经常性损益》定义界定的非经常性损益项目,以及把《公开发行证券的公司信息披露解释性公告第1号——非经常性损益》中列举的非经常性损益项目界定为经常性损益的项目,应说明原因

□ 适用 √ 不适用

公司报告期不存在将根据《公开发行证券的公司信息披露解释性公告第1号——非经常性损益》定义、列举的非经常性损益项目界定为经常性损益的项目的情形。

二、报告期末股东总数及前十名股东持股情况表

1、普通股股东总数和表决权恢复的优先股股东数量及前10名股东持股情况表

单位:股

报告期末普通股股东总数	57,688	报告期末表决权恢复的优先股股东总数(如有)	0

前10名股东持股情况

股东名称	股东性质	持股比例	持股数量	持有有限售条件的股份数量	质押或冻结情况	
					股份状态	数量
福州太顺实业有限公司	境内非国有法人	22.31%	121,064,585			
福建亿力集团有限公司	境内非国有法人	19.30%	104,752,148			
厦门象屿集团有限公司	国有法人	17.18%	93,218,398			
南平实业集团有限公司	国有法人	3.35%	18,155,835			
中央汇金资产管理有限责任公司	国有法人	1.33%	7,192,920			
李宗彬	境内自然人	0.36%	1,965,281			
陈世珍	境内自然人	0.22%	1,174,500			
莆田市荔城区财政局	国有法人	0.20%	1,064,812			
许长虹	境内自然人	0.13%	718,700			
易承湘	境内自然人	0.11%	613,400			

前10名无限售条件股东持股情况

股东名称	持有无限售条件股份数量	股份种类	
		股份种类	数量
福州太顺实业有限公司	121,064,585	人民币普通股	121,064,585
福建亿力集团有限公司	104,752,148	人民币普通股	104,752,148
厦门象屿集团有限公司	93,218,398	人民币普通股	93,218,398
南平实业集团有限公司	18,155,835	人民币普通股	18,155,835
中央汇金资产管理有限责任公司	7,192,920	人民币普通股	7,192,920
李宗彬	1,965,281	人民币普通股	1,965,281
陈世珍	1,174,500	人民币普通股	1,174,500
莆田市荔城区财政局	1,064,812	人民币普通股	1,064,812
许长虹	718,700	人民币普通股	718,700
易承湘	613,400	人民币普通股	613,400
上述股东关联关系或一致行动的说明	公司不知前十名无限售条件股东是否存在关联关系和是否属于一致行动人。		
前10名普通股股东参与融资融券业务情况说明(如有)	无		

公司前10名普通股股东、前10名无限售条件普通股股东在报告期内是否进行约定购回交易

□ 是 √ 否

公司前10名普通股股东、前10名无限售条件普通股股东在报告期内未进行约定购回交易。

2、公司优先股股东总数及前10名优先股股东持股情况表

□ 适用 √ 不适用

第三节 重要事项

一、报告期主要财务数据、财务指标发生变动的情况及原因

√ 适用 □ 不适用

一、资产负债表项目大幅变动情况及原因:

1、本报告期末以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产较期初增加227.33万元,增长92.56% ,主要是本期增加了持仓的期铜合约。

2、本报告期末应收票据较期初增加3,756.17万元,增长124.88%,主要是用银行承兑票据结算的货款增加。

3、本报告期末预付账款较期初增加845.21万元,增长65.67%,主要是控股子公司上杭铜业销售增长,相应增加预付电解铜材料采购款。

4、本报告期末其他应收款较期初增加690.70万元,增长36.80%,主要是投标保证金的增长。

5、本报告期末其他流动资产较期初增加872.67万元,增长125.63%,主要是控股子公司上杭太阳铜业、包头满都拉的增值税留抵增加。

6、本报告期预收账款较年初减少16,168.53万元,下降50.75%,主要是报告期内履行2017年末的定单,使得预收账款相应减少。

7、应付职工薪酬较年初减少1,227.64万元,下降95.15%,主要是支付了计提的效益工资;

8、应付利息较年初减少174.27万元,下降99.19%,主要是支付了到期利息。

9、本报告期其他应付款较年初减少781.19万元,下降31.51%,主要是支付了预提的运费。

二、利润表项目大幅变动情况及原因:

1、本报告期营业收入较上年同期增加24,898.92万元,增长34.36%,其中电线电缆产品销售同比增加收入6,688.61万元,增长12.49%,主要原材料铜、铝平均采购价较上年同期分别增长10.76%、7.13%;同时铜杆销售收入增加17,351.51万元,增长134.26%。

2、本报告期营业成本较上年同期增加24,419.84万元,增长36.71%,主要原材料铜、铝平均采购