（上接B107版）

法定代表人：李振
注册地址：北京市东城区建国门内大街18号15层办公楼一座1502室
办公地址：北京市东城区建国门内大街18号恒基中心办公楼一座2202室
客服电话：400-829-1218
公司网址：http://www.kstreasure.com/
141）佳泓（北京）基金销售有限公司
公司全称：佳泓（北京）基金销售有限公司
法定代表人：李招弟
注册地址：北京市怀柔区怀北镇怀北路308号
公司地址：北京市怀柔区怀北镇怀北路308号
客服电话：010-88580321
网站：www.jiahongfunds.com
142）上海万得投资顾问有限公司
名 称：上海万得投资顾问有限公司
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区福山路33号11楼B座
办公地址：中国（上海）自由贸易试验区福山路33号8楼
邮政编码：200120
注册资本：2千万元人民币
法定代表人：王廷富
电 话：021-5132 7185
传 真：021-5071 0161
143）凤凰金信(银川)投资管理有限公司
销售机构全称：凤凰金信(银川)投资管理有限公司
销售机构简称：凤凰金信
客服电话：400-800-5919
网站：www.fengfd.com
144）上海联泰资产管理有限公司
名 称：上海联泰资产管理有限公司
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区富特北路277号3层310室
办公地址：上海市长宁区金钟路658弄2号楼B座6楼
邮政编码：200335
注册资本：2000万人民币
法定代表人：燕斌
电 话：021-51507071
传 真：021-62990063
145）泰诚财富基金销售（大连）有限公司
公司全名：泰诚财富基金销售（大连）有限公司
法定代表人：林卓
注册地址：辽宁省大连市沙河口区星海中龙园3号
办公地址：辽宁省大连市沙河口区星海中龙园3号
客服电话：4006411999
网站：www.taichengcaifu.com
146）上海汇付金融服务有限公司
名 称：上海汇付金融服务有限公司
注册地址：上海市黄浦区西藏中路336号1807-5室
办公地址：上海市中山南路100号金外滩国际广场19楼
邮政编码：200010
注册资本：2000万人民币
法定代表人：张晶
电 话：021-33323998
传 真：021-33323993
147）上海基煜基金销售有限公司null148）上海凯石财富基金销售有限公司
上海凯石财富基金销售有限公司
注册地址：上海市黄浦区西藏南路765号602-115室
办公地址：上海市黄浦区延安东路1号凯石大厦4楼
法定代表人：陈继武
电话：021-63333389
传真：021-63333390
149）中正达广股份有限公司
公司名称：中正达广股份有限公司
公司地址：上海徐汇区龙腾大道2815号30
客服电话：400-6767-523
邮箱：zzwealth@zzwealth.cn
150）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
151）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
152）nullnull153）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
154）大泰金石基金销售有限公司
公司全称：大泰金石基金销售有限公司
法定代表人：袁顾明
注册地址：江苏省南京市建邺区江东中路222号南京奥体中心现代五项馆2105室
办公地址：江苏省南京市建邺区江东中路222号南京奥体中心现代五项馆2105室
客服电话：4009282266
网站：www.dtfunds.com
155）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
156）和耕传承基金销售有限公司
公司全称：和耕传承基金销售有限公司
法定代表人：李淑慧
注册地址：郑州市郑东新区东风东路东、康宁街北6号楼6楼602、603房间
办公地址：河南省郑州市郑东新区东风南路康宁街互联网金融大厦6楼
客服电话：4000-555-671
网址：www.hgccpb.com
157）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
158）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：钱晨昊
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
159）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：北京市亦庄经济开发区科创十一街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/
160）中民财富管理（上海）有限公司
公司全称：中民财富管理（上海）有限公司
法定代表人：贺洪军
注册地址：上海市黄浦区中山南路100号07层
办公地址：上海市黄浦区中山南路100号17层
客服电话：400-876-5716
公司网址：www.cmiwm.com
161）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6楼
162）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：钟美荣
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/
163）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：姜文德
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
164）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.citicf.com
165）徽商期货有限责任公司
公司全称：徽商期货有限责任公司
法定代表人：吴国华
注册地址：合肥市芜湖路258号3号楼4、6、7层，6号楼1、2层
办公地址：合肥市芜湖路258号3号楼4、6、7层，6号楼1、2层
客服电话：4008878707
网站：www.hsqh.net
166）上海东证期货有限公司
公司全称：上海东证期货有限公司
法定代表人：卢大印
注册地址：上海市浦东新区松林路300号上海期货大厦14层
办公地址：上海市浦东新区松林路300号上海期货大厦14层
客服电话：400-885-9999转1
公司网址：www.dzqh.com.cn
167）弘业期货股份有限公司
公司全称：弘业期货股份有限公司
法定代表人：周剑秋
注册地址：南京市中华路50号弘业大厦9楼
办公地址：南京市中华路50号弘业大厦9楼
客户服务电话：400-828-1288
网址：www.ftol.com.cn
168）深圳前海微众银行股份有限公司
公司全称：深圳前海微众银行股份有限公司
法定代表人：顾敏
注册地址：深圳市南山区桃园路田厦国际中心A36楼
办公地址：广东省深圳市南山区沙河西路1819号深圳湾科技生态园7栋A座
客服电话：400-999-8800
公司网址：www.webank.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、孙蕾
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：汇添富环保行业股票型证券投资基金。

第五部分 基金的类型

本基金为契约型开放式股票型基金。

第六部分 基金的投资目标

本基金采用自下而上的策略，以基本面分析为立足点，主要投资于环保行业的优质上市公司，在科学严格管理风险的前提下，谋求基金资产的持续稳健增值。

第七部分 基金的投资方向

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（含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（含国债、金融债、央行票据、公司债、企业债、地方政府债、可转换债券、可分离债券、短期融资券、中期票据、中小企业私募债券等）、债券回购、货币市场工具、股指期货、权证、资产支持证券、银行存款（含定期存款、协议存款、大额存单等）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相关规定）。

本基金将生产环保设备（含防大气污染设备、消除噪声设备、监测仪器设备、废水处理、废弃物管理和循环利用设备等）、提供环保服务（含控制大气污染、消除噪声、处理废弃物及处理废水等）、供应清洁生产技术和清洁产品（含清洁生产技术与设备，为能源节约与管理、能源转换及存储等活动提供生产设备和相应技术，新能源、清洁能源和可再生能源的开发及节能技术、设备，生态标志食品和绿色食品等）及供需结构因国家环保政策得到优化的上市公司定义为环保行业上市公司。

本基金的投资组合比例为：80%以上的基金资产投资于股票，其中投资于环保行业上市公司股票的资产不低于非现金基金资产的80%；其余资产投资于债券、货币市场工具、股指期货、权证、资产支持证券、银行存款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。其中，基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的3%；基金持有单只中小企业私募债，其市值不得超过基金资产净值的10%；每个交易日日终在扣除股指期货交易保证金以后，基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。

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、投资策略

本基金为股票型基金。股票投资的主要策略包括资产配置策略和个股精选策略。其中，资产配置策略用于确定大类资产配置比例以有效规避系统性风险；个股精选策略用于挖掘具有核心竞争优势和持续增长潜力且估值水平相对合理的环保行业优质上市公司，辅以严格的风险管理，以获得长期的较高投资收益。投资策略的重点是个股精选策略。

1、资产配置策略

本基金综合分析和持续跟踪基本面、政策面、市场面等多方面因素（其中，基本面因素包括国民生产总值、居民消费价格指数、工业增加值、失业率水平、固定资产投资总量、发电量等宏观经济统计数据；政策面因素包括存款准备金率、存贷款利率、再贴现率、公开市场操作等货币政策、政府购买总量、转移支付水平以及税收政策等财政政策；市场面因素包括市场参与者情绪、市场资金供求变化、市场P/E与历史平均水平的偏离程度等），结合全球宏观经济形势，研判国内经济的发展趋势，并在严格管理投资组合风险的前提下，确定或调整投资组合中股票、债券、货币市场工具、股指期货、权证、资产支持证券、银行存款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的投资比例。

2、个股精选策略

本基金股票投资采用自下而上的个股精选策略，选择具有核心竞争优势和持续增长潜力且估值水平相对合理的环保行业优质上市公司的股票进行重点投资。

首先，按照本基金管理人投资管理制度要求和股票投资限制，针对沪深两市环保行业上市公司，剔除其中不符合投资要求的股票（包括但不限于法律法规或基金管理人内部制度明确禁止投资的股票、涉及重大案件和诉讼的股票等）。

其次，在符合投资要求的股票中，本基金管理人主要采取定性分析结合定量分析的方法，通过扎实的案头研究和详尽紧密的实地调研，结合外部研究支持，分别从核心竞争优势和增长潜力等方面进行评估，挑选出环保行业优质上市公司股票。

具体如下：

（1）核心竞争优势评估：根据环保行业自身的特点（包括但不限于环境污染成因复杂、治理思路三化【减量化、无害化、资源化】并重、国家环保政策力度不断加大、环保投入逐年增加、新技术应用比例较高、多采用BOT【Build & Operate & Transfer】投资模式等），本基金管理人将从备选公司的研发能力、生产技术、终端产品或服务、销售渠道、融资能力及政府事务运作能力等方面进行综合评估，从中选择在技术、资源、政策等方面拥有核心竞争优势的环保行业上市公司。

（2）增长潜力评估：环保行业有其相对独特的盈利模式，例如上市公司通过开发环保新产品和环保新技术，以较低成本满足客户需求从而获得利润；或者利润来自于政府环保项目建设完成后特许经营期内收取的费用等。但是，业绩持续的增长性是企业永续的根本，也是优质公司的魅力所在。本基金管理人将分析备选公司的主营业务收入增长率和净利润增长率，同时考察主营业务利润率和净资产收益率，在研判增长质量的基础上，选择在较长期限内实现可持续增长的环保行业上市公司。

然后，针对筛选出的具有核心竞争优势和持续增长潜力的环保行业上市公司股票，本基金管理人主要采取定量分析的方法，考察市盈增长比率（PEG）、市盈率（P/E）、市净率（P/B）、企业价值/息税前利润（EV/EBIT）、企业价值/息税、折旧、摊销前利润（EV/EBITDA）、自由现金流贴现（DCF）等一系列估值指标，给出股票综合评级，从中选择估值水平相对合理的备选股票，组成本基金的股票库。

最后，基金经理按照本基金的投资决策程序，审慎精选，权衡风险收益特征后，根据二级市场波动情况构建股票组合并动态调整。

3、债券投资策略

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。

消极债券投资的目标是在满足现金管理需要的基础上为基金资产提供稳定的收益。本基金主要通过利率免疫策略来进行消极债券投资。利率免疫策略就是构造一个恰当的债券组合，使得利率变动导致的价格波动风险与再投资风险相互抵消。这样无论市场利率如何变化，债券组合都能获得一个比较确定的收益率。

积极债券投资的目标是利用市场定价的无效率来获得低风险甚至是无风险的超额收益。本基金的积极债券投资主要基于对利率期限结构的研究。利率期限结构描述了债券市场的平均收益率水平以及不同期限债券之间的收益率差别，它决定于三个要素：货币市场利率、均衡真实利率和预期通货膨胀率。在深入分析利率期限结构的基础上，本基金将运用利率预期策略、收益率曲线追踪策略进行积极投资。

本基金也将从债券市场的结构变化中寻求积极投资的机会。由于国内债券市场仍处于发展阶段，交易制度、债券品种体系和投资者结构也在逐步完善，这些结构变化会产生低风险甚至无风险的套利机会。本基金将借助经济理论和金融分析方法，努力把握市场结构变化所带来的影响，并在此基础上寻求低风险甚至无风险的套利机会，主要通过跨市场套利策略和跨品种套利策略来完成套利投资。

4、中小企业私募债券投资策略

本基金将在严格控制信用风险的基础上，通过严密的投资决策流程、投资授权审批机制、集中交易制度等保障审慎投资于中小企业私募债券，并通过组合管理、分散化投资、合理谨慎地评估、预测和控制相关风险，实现投资收益的最大化。

本基金依靠内部信用评级系统持续跟踪研究发债主体的经营状况、财务指标等情况，对其信用风险进行评估并作出及时反应。内部信用评级以深入的企业基本面分析为基础，结合定性和定量方法，注重对企业未来偿债能力的分析评估，对中小企业私募债券进行分类，以便准确地评估中小企业私募债券的信用风险程度，并及时跟踪其信用风险的变化。

本基金对中小企业私募债券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。

5、股指期货投资策略

本基金以套期保值为目的，参与股指期货交易。

本基金参与股指期货投资时机和数量的决策建立在对证券市场总体行情的判断和组合风险收益分析的基础上。基金管理人将根据宏观经济因素、政策及法规因素和资本市场因素，结合定性和定量方法，确定投资时机。基金管理人将结合股票投资的总体规模，以及中国证监会的相关限定和要求，确定参与股指期货交易的投资比例。

基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征，运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

基金管理人在进行股指期货投资前将建立股指期货投资决策小组，负责股指期货的投资管理的相关事项，同时针对股指期货投资管理制定投资决策流程和风险控制制度，并经基金管理人董事会批准后执行。

若相关法律法规发生变化时，基金管理人股指期货投资管理从其最新规定，以符合上述法律法规和监管要求的变化。

6、权证投资策略

本基金将权证看作是辅助性投资工具，其投资原则为优化基金资产的风险收益特征，有利于基金资产增值，有利于加强基金风险控制。本基金将在权证理论定价模型的基础上，综合考虑权证标的证券的基本面趋势、权证的市场供求关系以及交易制度设计等多种因素，对权证进行合理定价。本基金权证主要投资策略为低成本避险和合理杠杆操作。

7、资产支持证券投资策略

本基金将分析资产支持证券的资产特征，估计违约率和提前偿付比率，并利用收益率曲线和期权定价模型，对资产支持证券进行估值。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资，以降低流动性风险。

二、投资决策机制与流程

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，设立了投资研究部和金融工程部，策略分析师、行业分析师、金融工程分析师和基金经理分别立足本职工作，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持续稳健的较高投资回报。

本基金投资决策流程为：

1、策略分析师就宏观、政策、投资主题、市场环境提交策略报告并召开策略会议予以讨论；

2、行业分析师就行业发展趋势和行业组合的估值比较，召开会议讨论并确定行业评级；

3、基金经理在策略会议的基础之上提出资产配置的建议；

4、投资决策委员会审议基金经理提交的资产配置建议，确定资产配置比例的范围；

5、投资研究部提交备选股票库，在此基础上，基金经理、行业分析师决定本基金核心股票库名单；

6、基金经理在考虑资产配置的情况下，经过风险收益的权衡，决定投资组合方案；

7、投资总监审核投资组合方案后，交由基金经理实施；

8、集中交易室执行交易指令；

9、金融工程部进行全程风险评估和绩效分析。

4、中证全债指数是中证指数公司编制的综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的跨市场债券指数，也是中证指数公司编制并发布的首只债券类指数，该指数的样本由银行间市场和沪深交易所市场的国债、金融债券及企业债券组成；

5、基于本基金的投资范围和投资比例限制，选用上述业绩比较基准能够真实、客观地反映本基金的风险收益特征。

如果今后法律法规发生变化，或者指数编制单位停止计算编制上述指数或更改指数名称、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，或者是市场上出现更加适合用于本基金业绩比较基准的指数时，经与基金托管人协商一致，本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告，而无需召开基金份额持有人大会。

第十部分 基金的风险收益特征

本基金为股票型基金，属于证券投资基金中较高预期风险、较高预期收益的品种，其预期风险收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。

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。

基金托管人中国建设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	2,532,250,846.38	91.18
	其中：股票	2,532,250,846.38	91.18
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	99,700,000.00	3.59
	其中：债券	99,700,000.00	3.59
	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	140,490,796.76	5.06
8	其他资产	4,713,964.83	0.17
9	合计	2,777,155,607.97	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	82,392,811.03	2.99
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,513,236,919.53	54.93
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	280,936,143.20	10.20
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	32,080,176.44	1.16
G	交通运输、仓储和邮政业	17,942.76	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	44,711,551.47	1.62
J	金融业	-	-
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	109,600,000.00	3.98
N	水利、环境和公共设施管理业	469,275,301.95	17.03
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	2,532,250,846.38	91.91

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投资股票。

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	002672	东江环保	16,808,700	273,141,375.00	9.91
2	601222	林洋能源	26,000,031	263,640,314.34	9.57
3	000826	启迪桑德	7,661,800	252,992,636.00	9.18
4	300335	迪森股份	13,000,000	226,980,000.00	8.24
5	601200	上海环境	6,000,007	149,640,174.58	5.43
6	002001	新和成	3,300,000	125,598,000.00	4.56
7	002116	中国海诚	10,000,000	109,600,000.00	3.98
8	002009	天奇股份	5,600,000	94,416,000.00	3.43
9	000488	晨鸣纸业	5,500,097	91,686,616.99	3.33
10	000703	恒逸石化	4,000,021	86,280,452.97	3.13

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	99,700,000.00	3.62
	其中：政策性金融债	99,700,000.00	3.62
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	99,700,000.00	3.62

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	170408	17农发08	1,000,000	99,700,000.00	3.62

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

注：报告期末本基金无股指期货持仓。

1.10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期内未投资国债期货。

1.11投资组合报告附注

1.11.1

本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没有超出基金合同规定的备选股票库。

1.11.3其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	471,601.48
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,553,211.53
5	应收申购款	1,689,151.82
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,713,964.83

1.11.4报告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。

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不存在流通受限的情况。

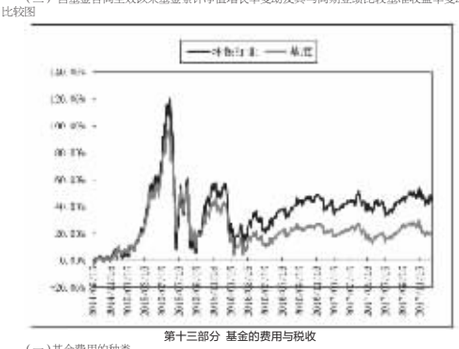
第十二部分 基金的业绩

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)
2014年9月16日（基金合同生效日）至2014年12月31日	2.20%	1.37%	5.78%	1.25%	-3.58%	0.12%
2015年1月1日至2015年12月31日	51.08%	3.04%	34.87%	2.28%	16.21%	0.76%
2016年1月1日至2016年12月31日	-9.00%	1.80%	-13.00%	1.53%	4.00%	0.27%
2017年1月1日至2017年12月31日	4.34%	0.97%	-0.71%	0.79%	5.05%	0.18%
2014年9月16日（基金合同生效日）至2017年12月31日	46.60%	2.06%	23.23%	1.62%	23.37%	0.44%

（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、期货交易费用；

7、基金的银行汇划费用；

8、基金的证券/期货开户费用、银行账户维护费用；

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1.50%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×1.50%÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月月初5个工作日内、按照指定的账户路径、从基金财产中一次性支付给基金管理人，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延至最近可支付日。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。费用自动初划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

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

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月月初5个工作日内、按照指定的账户路径、从基金财产中一次性支付给基金托管人，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延至最近可支付日。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。费用自动初划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

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：

增加了“风险收益特征”与“销售适当性风险评价”的区别说明，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、“四、基金托管人”部分：

更新了基金托管人的相关信息。

三、“五、相关服务机构”部分：

更新了基金相关服务机构的信息。

四、“九、基金的投资”部分：

更新了基金投资组合报告。

五、“十、基金的业绩”部分：

更新了基金业绩表现数据。

六、“二十二、其他应披露事项”部分：

更新了2017年9月17日至2018年3月16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

日月重工股份有限公司

2018 第一季度报告

公司代码：603218　　公司简称：日月股份

一、重要提示

1.1 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。

1.2 公司全体董事出席董事会审议季度报告。

1.3 公司负责人傅明康、主管会计工作负责人王烨及会计机构负责人（会计主管人员）庄启逸保证季度报告中财务报表的真实、准确、完整。

1.4 本公司第一季度报告未经审计。

二、公司主要财务数据和股东变化

2.1主要财务数据

单位：元　币种：人民币

	本报告期末	上年度末	本报告期末比上年度末增减(%)
总资产	3,767,036,381.10	3,718,046,749.40	1.32
归属于上市公司股东的净资产	2,815,347,589.47	2,766,580,744.10	1.76
	年初至报告期末	上年初至上年报告期末	比上年同期增减(%)
经营活动产生的现金流量净额	28,558,817.91	65,376,933.70	-56.32
	年初至报告期末	上年初至上年报告期末	比上年同期增减（%）
营业收入	449,394,386.98	331,574,599.48	35.53
归属于上市公司股东的净利润	48,766,845.37	56,124,897.58	-13.11
归属于上市公司股东的扣除非经常性损益的净利润	41,804,504.78	47,922,305.50	-12.77
加权平均净资产收益率（%）	1.75	2.14	减少0.39个百分点
基本每股收益（元/股）	0.12	0.14	-14.29
稀释每股收益（元/股）	0.12	0.14	-14.29

非经常性损益项目和金额

√适用 □不适用

单位：元　币种：人民币

项目	本期金额	说明
非流动资产处置损益		
越权审批，或无正式批准文件，或偶发性的税收返还、减免		
计入当期损益的政府补助，但与公司正常经营业务密切相关，符合国家政策规定，按照一定标准定额或定量持续享受的政府补助除外	4,358,569.48	
计入当期损益的对非金融企业收取的资金占用费		
企业取得子公司、联营企业及合营企业的投资成本小于取得投资时应享有被投资单位可辨认净资产公允价值产生的收益		
非货币性资产交换损益		
委托他人投资或管理资产的损益		
因不可抗力因素，如遭受自然灾害而计提的各项资产减值准备		
债务重组损益		
企业重组费用，如安置职工的支出、整合费用等		
交易价格显失公允的交易产生的超过公允价值部分的损益		
同一控制下企业合并产生的子公司期初至合并日的当期净损益		
与公司正常经营业务无关的或有事项产生的损益		
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	3,007,195.66	
单独进行减值测试的应收款项减值准备转回		
对外委托贷款取得的损益		
采用公允价值模式进行后续计量的投资性房地产公允价值变动产生的损益		
根据税收、会计等法律、法规的要求对当期损益进行一次性调整对当期损益的影响		
受托经营取得的托管费收入		
除上述各项之外的其他营业外收入和支出	825,657.01	
其他符合非经常性损益定义的损益项目		
少数股东权益影响额（税后）		
所得税影响额	-1,229,081.56	
合计	6,962,340.59	

2.2截止报告期末的股东总数、前十名股东、前十名流通股东（或无限售条件股东）持股情况表

单位：股

股东总数（户）						19,907