（上接 D265 版）

无。

7.4.4.13 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。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据中国证监会公告[2017]13 号《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》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。

根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》，在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外)，采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

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

本基金在本期间未发生重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本期间未发生重大会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本期间未发生重大会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财税 [2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85 号文《财政部、国家税务总局、证监会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《财政部 国家税务总局 证监会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[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字[2008]16 号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税 [2008]1 号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号文《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]2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、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，本基金适用的主要税项列示如下：

(1)证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入暂免征收营业税和企业所得税。

(2)自 2016 年 5 月 1 日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税(以下称营改增)试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。

2018 年 1 月 1 日（含）以后，资管产品管理人（以下称管理人）运营基金过程中发生的增值税应税行为，以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。对基金在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券收入免征增值税。

(3) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(4)对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴 20%的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：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，股权登记日为自 2013 年 1 月 1 日起至 2015 年 9 月 7 日期间的，暂减按 25%计入应纳税所得额，股权登记日在 2015 年 9 月 8 日及以后的，暂免征收个人所得税。

(5)基金卖出股票按 0.1%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
中加基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构及基金销售机构
中国农业银行股份有限公司	基金托管人
北京银行股份有限公司	基金管理人的控股股东、基金销售机构

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

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

本基金自 2017 年 9 月 15 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日止期间没有通过关联方的交易单元进行过交易。

7.4.8.1.2 权证交易

本基金自 2017 年 9 月 15 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日止期间没有通过关联方的交易单元进行过交易。

7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

本基金自 2017 年 9 月 15 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日止期间没有应支付关联方的佣金。

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 09 月 15 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,091,351.39
其中：支付销售机构的客户维护费	285,177.43

注：支付基金管理人中加基金的基金管理费按前一日基金资产净值 0.60%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值×0.60%/当年天数。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 09 月 15 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	181,891.90

注：支付基金托管人农业银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.10%/当年天数。

7.4.8.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2017 年 09 月 15 日至 2017 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中加聚鑫纯债一年 A	中加聚鑫纯债一年 C	合计
中加基金管理有限公司	–	21.40	21.40
北京银行股份有限公司	–	38,091.89	38,091.89
中国农业银行股份有限公司	–	0.00	0.00
合计	–	38,113.29	38,113.29

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.30%。本基金销售服务费将专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务。销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.30%年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.30%/当年天数

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

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

本基金自 2017 年 9 月 15 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日止期间没有与关联方进行银行间同业市场的债券(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

本报告期内，本基金管理人未运用固有资金投资本基金。截至本报告期末，本基金管理人未持有本基金。

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

报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

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 09 月 15 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司	373,976.06	42,308.62

注：本基金通过"农业银行基金托管结算资金专用存款账户"转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金，于 2017 年 12 月 31 日的相关余额为零，当期产生的利息收入为人民币 994.51 元。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金自 2017 年 9 月 15 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日止期间未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

上述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.9 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

于 2017 年 12 月 31 日，本基金未持有因认购新发或增发证券而受上述规定约束的流通受限证券。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

于 2017 年 12 月 31 日，本基金未持有暂时停牌等流通受限证券。

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

于 2017 年 12 月 31 日，本基金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为人民币 206,127,170.81 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
011754105	17 海国鑫泰 SCP001	2018-01-05	100.14	600,000	60,084,000.00
011755040	17 云能投 SCP004	2018-01-05	100.06	5,000	500,300.00
011759048	17 北辰科技 SCP001	2018-01-05	100.45	261,000	26,217,450.00
011763026	17 首钢 SCP012	2018-01-05	99.70	500,000	49,850,000.00
011769038	17 京供销 SCP005	2018-01-05	99.81	500,000	49,905,000.00
041763011	17 连城投 CP002	2018-01-05	99.70	282,000	28,115,400.00
合计				2,148,000	214,672,150.00

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金于本年度末未进行交易所市场债券正回购。

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)以公允价值计量的资产和负债

以下描述了本基金在每个资产负债表日持续和非持续以公允价值计量的资产和负债于本报告期末的公允价值信息及其公允价值计量的层次。公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

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工具中属于第二层次的债券投资余额为 814,603,400.00 元，无属于第一层次和第三层次的余额。于 2017 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量的资产的三个层次之间没有发生其他重大转换。本基金是在发生转换当年的报告期末确认各层次之间的转换。

(a)第二层次及第三层次的公允价值计量

对于本基金投资的证券交易所上市的证券，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时，本基金不会于停牌期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次。本基金综合考虑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，确定相关证券公允价值的层次。

(b)非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2017 年 12 月 31 日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具。

(2)其他金融工具的公允价值 （年末非以公允价值计量的项目）

其他金融工具主要包括买入返售金融资产、应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

§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	–	–
	其中：股票	–	–
2	基金投资	–	–
3	固定收益投资	814,603,400.00	98.19
	其中：债券	814,603,400.00	98.19
	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	373,976.06	0.05
8	其他各项资产	14,615,810.87	1.76
9	合计	829,593,186.93	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

本基金本报告期内未进行境内股票投资。

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期内未通过港股通进行股票投资。

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

本基金本报告期内未进行股票投资。

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末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内未进行股票投资。

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	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	84,923,400.00	13.64
5	企业短期融资券	650,250,000.00	104.41
6	中期票据	79,430,000.00	12.75
7	可转债(可交换债)	–	–
8	同业存单	–	–
9	其他	–	–
10	合计	814,603,400.00	130.80

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	占基金资产净值比例(%)
1	011754105	17 海国鑫泰 SCP001	600,000	60,084,000.00	9.65
2	011755048	17 牧原食品 SCP002	600,000	59,970,000.00	9.63
3	1180132	11 厦门象屿债	540,000	54,599,400.00	8.77
4	011755041	17 中电熊猫 SCP003	500,000	50,040,000.00	8.03
5	011755040	17 云能投 SCP004	500,000	50,030,000.00	8.03

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

本基金本报告期末未投资股指期货。

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 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本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

8.12.2 本报告期内，本基金未投资于股票，相应的不存在投资的前十名股票超过基金合同规定的备选股票库的情况。

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	–
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	14,615,810.87
5	应收申购款	–
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	14,615,810.87

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

本基金本报告期内未进行股票投资。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§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

份额级别	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
中加聚鑫纯债一年 A	4,402	130,420.31	88,771,240.50	15.46%	485,338,982.17	84.54%
中加聚鑫纯债一年 C	792	54,717.94	–	–	43,336,611.30	100.00%
合计	5,194	118,876.94	88,771,240.50	14.38%	528,675,593.47	85.62%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	中加聚鑫纯债一年 A	99,562.23	0.02%
	中加聚鑫纯债一年 C	19,550.83	0.05%
	合计	119,113.06	0.02%

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	份额级别	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	中加聚鑫纯债一年 A	0~10
	中加聚鑫纯债一年 C	–
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	中加聚鑫纯债一年 A	–
	中加聚鑫纯债一年 C	–
	合计	0

§10 开放式基金份额变动

单位：份

	中加聚鑫纯债一年 A	中加聚鑫纯债一年 C
基金合同生效日(2017 年 09 月 15 日)基金份额总额	574,110,222.67	43,336,611.30
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	–	–
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	–	–
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	–	–
本报告期期末基金份额总额	574,110,222.67	43,336,611.30

§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，本基金未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

基金管理人本报告期内人事变动情况：2017 年 6 月 30 日，公司新任副总经理宗喆先生。2017 年 7 月 31 日，闫冰竹先生辞去董事长职务。

本报告期内，基金托管人托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

无。

11.4 基金投资策略的改变

无。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘请毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙），报告期内应支付审计费 50000 元，目前已提供审计服务的年限为 1 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

本基金管理人、基金托管人涉及托管业务的部门及其高级管理人员在本报告期内未受到任何处罚。

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	
方正证券	2	–	–	–	–	–

注：1.公司选择提供交易单元的券商时，考虑以下几方面：

（1）基本情况：公司资本充足、财务指标等符合监管要求且经营行为规范；

（2）公司治理：公司治理完善，内部管理规范，内控制度健全；

（3）研究服务实力。

2.券商及交易单元的选择流程如下：

（1）投资研究部经集体讨论后遵照《中加基金管理有限公司交易单元管理办法》标准填写《券商选择标准评分表》，并据此提出拟选券商名单以及相应的席位租用安排。挑选时应考虑在深沪两个市场都租用足够多的席位以保障交易安全，并符合监管要求；

（2）公司执行委员会负责审批、确定券商名单及相应的席位租用安排；

（3）券商名单及相应的席位租用安排确定后，由监察稽核门部负责审查相关协议内容，交易室负责协调办理正式协议签署等相关事宜。

3.投资研究部于每年第一季度内根据《券商选择标准评分表》对券商进行重新评估，拟定是否需要新增、续用或取消券商、调整相应席位安排，并报公司执行委员会审批、确定。

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
方正证券	–	–	117,400,000.00	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

本报告期内不存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

中加基金管理有限公司
二〇一八年三月三十日

（上接 D267 版）

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	000858	五 粮 液	2,306,266	184,224,528.08	9.55
2	601318	中国平安	2,497,716	174,790,165.68	9.06
3	600338	西藏珠峰	4,156,139	173,103,189.35	8.97
4	601939	建设银行	16,041,143	123,195,978.24	6.39
5	600887	伊利股份	2,540,500	81,778,695.00	4.24
6	600048	保利地产	5,315,882	75,219,730.30	3.90
7	000002	万 科 A	2,109,835	65,531,475.10	3.40
8	601088	中国神华	1,979,869	45,873,564.73	2.38
9	600031	三一重工	5,045,500	45,762,685.00	2.37
10	600176	中国巨石	2,807,220	45,729,613.80	2.37

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 www.zofund.com 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	600031	三一重工	270,329,859.19	10.58
2	601318	中国平安	237,105,456.53	9.28
3	600019	宝钢股份	206,000,106.92	8.06
4	000709	河钢股份	193,828,694.95	7.58
5	000651	格力电器	174,225,671.03	6.82
6	600028	中国石化	170,379,093.43	6.67
7	000858	五 粮 液	144,295,588.73	5.65
8	601166	兴业银行	132,360,552.70	5.18
9	600887	伊利股份	128,801,145.70	5.04
10	600048	保利地产	125,018,919.90	4.89
11	600338	西藏珠峰	121,529,997.41	4.76
12	001979	招商蛇口	117,262,374.68	4.59
13	601939	建设银行	115,455,424.83	4.52
14	000002	万 科 A	100,658,291.37	3.94
15	002709	天赐材料	94,649,762.35	3.70
16	601888	中国国旅	88,883,644.57	3.48
17	000895	双汇发展	87,357,566.41	3.42
18	002078	太阳纸业	84,753,463.11	3.32
19	601225	陕西煤业	82,568,543.55	3.23
20	600835	上海机电	78,862,908.43	3.09
21	600885	宏发股份	76,123,568.40	2.98
22	000878	云南铜业	75,944,709.10	2.97
23	002024	苏宁云商	74,605,584.05	2.92
24	601009	南京银行	71,943,418.80	2.82
25	601688	华泰证券	71,685,607.34	2.81
26	000049	德赛电池	71,656,980.18	2.80
27	002497	雅化集团	71,455,915.00	2.80
28	603589	口子窖	70,069,525.29	2.74
29	002304	洋河股份	69,882,172.83	2.73
30	600690	青岛海尔	67,445,098.04	2.64
31	601988	中国银行	66,776,188.73	2.61
32	600782	新钢股份	66,512,027.51	2.60
33	600535	天士力	65,766,740.20	2.57
34	600466	蓝光发展	65,269,839.40	2.55
35	000063	中兴通讯	63,975,420.02	2.50
36	600196	复星医药	60,382,243.65	2.36
37	000786	北新建材	58,783,048.29	2.30
38	603799	华友钴业	58,740,148.00	2.30
39	600030	中信证券	57,487,485.89	2.25
40	600872	中炬高新	54,742,777.54	2.14
41	000568	泸州老窖	54,097,870.83	2.12
42	002384	东山精密	53,905,387.84	2.11
43	300274	阳光电源	52,096,978.82	2.04

注：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	600028	中国石化	263,532,575.42	10.31
2	600019	宝钢股份	247,017,018.25	9.67
3	600031	三一重工	229,905,457.34	9.00
4	000709	河钢股份	197,287,617.78	7.72
5	002024	苏宁云商	191,262,129.17	7.48
6	000651	格力电器	186,344,363.70	7.29
7	601988	中国银行	177,820,924.21	6.96
8	002078	太阳纸业	158,124,750.17	6.19
9	601318	中国平安	153,468,926.60	6.01
10	601699	潞安环能	131,738,634.38	5.15
11	600518	康美药业	116,775,329.87	4.57
12	000401	冀东水泥	114,722,564.06	4.49
13	601225	陕西煤业	109,720,103.42	4.29
14	600155	宝硕股份	109,581,538.50	4.29
15	000937	冀中能源	108,945,732.67	4.26
16	601888	中国国旅	106,462,308.28	4.17
17	600643	爱建集团	105,791,224.59	4.14
18	601166	兴业银行	94,987,449.32	3.72
19	300156	神雾环保	87,107,729.13	3.41
20	001979	招商蛇口	86,230,061.42	3.37
21	600567	山鹰纸业	84,940,580.88	3.32
22	000895	双汇发展	83,809,785.91	3.28
23	601933	永辉超市	79,698,130.49	3.12
24	000739	普洛药业	79,354,253.98	3.11
25	002709	天赐材料	79,305,785.60	3.10
26	002640	跨境通	77,250,923.03	3.02
27	603589	口子窖	77,198,580.59	3.02
28	600782	新钢股份	76,729,453.95	3.00
29	600138	中青旅	72,219,304.86	2.83
30	600535	天士力	70,072,751.96	2.74
31	601009	南京银行	69,703,471.20	2.73
32	600690	青岛海尔	69,523,528.94	2.72
33	600681	百川能源	69,308,567.39	2.71
34	002497	雅化集团	68,665,947.21	2.69
35	000786	北新建材	68,589,636.00	2.68
36	000063	中兴通讯	68,415,390.63	2.68
37	601688	华泰证券	66,385,953.75	2.60
38	000049	德赛电池	66,262,303.64	2.59
39	603799	华友钴业	65,694,678.96	2.57
40	600068	葛洲坝	65,272,604.74	2.55
41	000878	云南铜业	63,909,041.30	2.50
42	603993	洛阳钼业	63,580,135.27	2.49
43	002466	天齐锂业	60,929,473.01	2.38
44	002215	诺 普 信	60,459,864.95	2.37
45	600466	蓝光发展	60,149,444.28	2.35
46	600195	中牧股份	59,507,129.54	2.33
47	600885	宏发股份	59,065,846.22	2.31
48	300203	聚光科技	58,923,098.22	2.31
49	000858	五 粮 液	58,372,179.62	2.28
50	600211	西藏药业	58,193,441.27	2.28
51	002384	东山精密	57,355,248.74	2.24
52	600048	保利地产	55,152,684.68	2.16
53	600872	中炬高新	55,135,862.77	2.16
54	600030	中信证券	53,941,172.04	2.11
55	600332	白云山	52,394,788.90	2.05
56	601919	中远海控	51,918,168.41	2.03
57	300136	信维通信	51,328,869.32	2.01

注：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	7,824,931,840.40
卖出股票收入（成交）总额	8,914,788,339.64

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（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前十名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

本基金本报告期末未投资股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

国债期货不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

国债期货不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

8.11.3 本期国债期货投资评价

国债期货不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本报告期内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 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	1,210,801.89
2	应收证券清算款	9,880,810.98
3	应收股利	–
4	应收利息	40,389.30
5	应收申购款	304,500.89
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	11,436,503.06

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本报告中因四舍五入的原因，投资组合报告中市值占总资产或净资产的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
54,715	31,411.73	68,626,513.04	3.99%	1,650,066,194.47	96.01%

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	161,839.73	0.01%

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	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2015 年 01 月 29 日)基金份额总额	4,976,750,390.34
本报告期期初基金份额总额	2,782,183,339.18
本报告期基金总申购份额	423,734,001.99
减：本报告期基金总赎回份额	1,487,224,633.66
本报告期基金拆分变动份额	–
本报告期期末基金份额总额	1,718,692,707.51

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

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

11.2.1 基金管理人的重大人事变动

本报告期内，基金管理人于 2017 年 3 月 30 日发布公告，顾伟先生自 2017 年 3 月 30 日起担任中欧基金管理有限公司副总经理职务。相关变更事项已按规定向中国基金业协会办理相关手续并向上海证监局报告。

11.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

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

本基金自合同生效日起聘请普华永道会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。报告期内本基金未改聘会计师事务所。本年度应支付给所聘任的会计师事务所审计费用为 120,000.00 元人民币。

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

报告期内本基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门的稽查或处罚。

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比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国金证券	1	–	–	–	–	–
安信证券	1	234,850,714.40	1.41%	218,715.79	1.41%	–
海通证券	1	323,338,051.59	1.94%	301,125.55	1.94%	–
中泰证券	1	2,348,253,186.65	14.09%	2,186,933.64	14.09%	–
浙商证券	1	–	–	–	–	–
兴业证券	1	1,897,143,058.96	11.39%	1,766,802.17	11.39%	–
中信建投	1	–	–	–	–	–
天风证券	1	1,220,541,023.47	7.33%	1,136,687.68	7.33%	–
申万宏源西部证券	1	–	–	–	–	–
东北证券	1	575,293,706.01	3.45%	535,771.46	3.45%	–
平安证券	1	–	–	–	–	–
西南证券	1	74,233,326.86	0.45%	69,133.47	0.45%	–
国信证券	1	2,014,979,685.14	12.09%	1,876,541.78	12.09%	–
西部证券	1	891,698,818.72	5.35%	830,444.89	5.35%	–
东兴证券	1	–	–	–	–	–
华泰证券	1	420,210,589.40	2.52%	391,342.07	2.52%	–
申银万国	1	587,415,700.75	3.53%	547,062.81	3.53%	–
光大证券	1	698,589,718.84	4.19%	650,597.96	4.19%	–
东吴证券	1	1,008,729,200.88	6.05%	939,431.72	6.05%	–
广州证券	1	154,810,361.61	0.93%	144,175.81	0.93%	–
中信证券	1	532,080,687.93	3.19%	495,526.92	3.19%	–
东方证券	1	217,231,878.44	1.30%	202,307.26	1.30%	–
国泰君安	1	146,871,153.92	0.88%	136,782.40	0.88%	–
中投证券	1	–	–	–	–	–
广发证券	2	1,154,339,941.86	6.93%	1,075,035.54	6.93%	–
国都证券	2	2,160,546,648.41	12.97%	2,012,115.89	12.97%	–

注：1.根据中国证监会的有关规定，我司在综合考量证券经营机构的财务状况、经营状况、研究能力的基础上，选择基金专用交易席位，并由公司董事会授权管理层批准。

2.本报告期内，本基金新增天风证券，西部证券上海交易单元。

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	占当期债券成交总量的比例	成交金额	占当期债券回购交易成交总额的比例	成交金额	占当期权证交易成交总额的比例	成交金额	占当期基金交易成交总额的比例
国金证券	–	–	–	–	–	–	–	–
安信证券	–	–	–	–	–	–	–	–
海通证券	–	–	–	–	–	–	–	–
中泰证券	–	–	–	–	–	–	–	–
浙商证券	–	–	–	–	–	–	–	–
兴业证券	–	–	550,000,000.00	70.51%	–	–	–	–
中信建投	–	–	–	–	–	–	–	–
天风证券	–	–	–	–	–	–	–	–
申万宏源西部证券	–	–	–	–	–	–	–	–
东北证券	–	–	–	–	–	–	–	–
平安证券	–	–	–	–	–	–	–	–
西南证券	–	–	–	–	–	–	–	–
国信证券	–	–	100,000,000.00	12.82%	–	–	–	–
西部证券	–	–	–	–	–	–	–	–
东兴证券	–	–	–	–	–	–	–	–
华泰证券	–	–	–	–	–	–	–	–
申银万国	–	–	–	–	–	–	–	–
光大证券	–	–	–	–	–	–	–	–
东吴证券	–	–	–	–	–	–	–	–
广州证券	–	–	–	–	–	–	–	–
中信证券	–	–	–	–	–	–	–	–
东方证券	–	–	–	–	–	–	–	–
国泰君安	–	–	–	–	–	–	–	–
中投证券	–	–	–	–	–	–	–	–
广发证券	–	–	130,000,000.00	16.67%	–	–	–	–
国都证券	–	–	–	–	–	–	–	–

中欧基金管理有限公司
二〇一八年三月三十日