

(上接 D338 版) ②C类基金份额的销售服务费=前一日C类基金资产净值×0.30%/当年天数。 7.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易无。 7.4.4.4 各关联方投资本基金的情况。 7.4.4.4.1 报告期内本基金管理人运用固有资金投资本基金的情况无。

Table with columns: 关联方名称, 本期 (2017年04月07日至2017年12月31日) 期末余额, 当期利息收入. Includes 中国邮政储蓄银行股份有限公司.

注:①本基金的活期存款由基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司提供保管,按银行同业利率计息。 ②本基金用于证券交易结算的资金通过“中国邮政储蓄银行股份有限公司基金托管结算资金专用存款账户”转入中国证券登记结算有限责任公司,按银行同业利率计息。 ③本基金基金合同自2017年4月1日起生效,上年可比较期间无。

7.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况无。 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无。 7.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票无。 7.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券无。 7.4.5.3.1 银行间市场债券正回购无。 7.4.5.3.2 交易所市场债券正回购无。

7.4.6 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 (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应收款项和其他金融负债,其账面价值接近公允价值。

③公允价值所属层级的重大变动 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)等情况,本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间及交易不活跃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所属第二层次还是第三层次。 ④公允价值所属层级的重大变动 本基金报告期内根据中国基金业协会《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉(试行)》(中基协发〔2017〕6号)的规定对流通受限股票的估值方法进行了调整,调整前流通受限股票列入第一层次,调整后采用了《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称《指引》)提供的估值技术进行估值,应属第二层次。上述第一层次与第二层次之间的转移公允价值金额均为880,801.20元,对当期损益的影响金额为-53,892.45元。

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。 8.1 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 11,427,227.85 4.18 其中:股票 11,427,227.85 4.18 2 基金投资 -- -- 3 固定收益投资 100,298,600.00 36.59 其中:债券 100,298,600.00 36.59 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 73,040,610.06 26.64 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 86,205,519.35 31.45 8 其他各项资产 3,124,397.00 1.14 9 合计 274,141,354.26 100.00

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 金额单位:人民币元

Table with columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金总资产比例(%). Lists various industries like 农林牧渔, 采矿业, 制造业, etc.

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

Table with columns: 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(%). Lists individual stock holdings.

值应属第二层次还是在第三层次。本基金本报告期持有的以公允价值计量的金融工具,在第一层次和第二层次之间无重大转移。

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。 8.1 期末基金资产组合情况 金额单位:人民币元

Table with columns: 序号, 项目, 金额, 占基金总资产的比例(%). Similar to page 1 but for a different fund.

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 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 39,259,000.00 77.59 其中:债券 39,259,000.00 77.59 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 10,408,007.41 20.57 8 其他各项资产 933,419.15 1.84 9 合计 50,600,426.56 100.00

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 本基金本报告期末未持有股票投资。 8.4 报告期末按行业分类的境内股票投资组合 8.4.1 买入金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票投资明细 本基金本报告期末未持有股票投资。 8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票投资明细 本基金本报告期末未持有股票投资。 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额 本基金本报告期末未持有股票投资。 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

Table with columns: 序号, 债券品种, 公允价值, 占基金资产净值比例(%). Lists bond holdings.

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

Table with columns: 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(%). Lists top 5 stock holdings.

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名的股票投资明细 金额单位:人民币元

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期末基金资产净值比例(%). Lists top 30 stock purchases.

债券投资组合 金额单位:人民币元

Table with columns: 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(%). Lists bond holdings.

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投资。 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 本基金本报告期末未持有权证投资。 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 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,本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求,未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期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。 8.12.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票目录。 8.12.3 期末其他各项资产构成 单位:人民币元

8.12.3 期末其他各项资产构成 单位:人民币元

Table with columns: 序号, 名称, 金额. Lists other assets.

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 本基金本报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限的情况。 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,各比例的分项之和与合计项之间可能存在尾差。 8.9 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 金额单位:人民币元

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 金额单位:人民币元

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期末基金资产净值比例(%). Lists top 30 stock purchases.

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 债券投资组合明细 金额单位:人民币元

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(张), 公允价值, 占基金资产净值比例(%). Lists bond holdings.

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 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,本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求,未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期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。 8.12.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票目录。 8.12.3 期末其他各项资产构成 单位:人民币元

8.12.3 期末其他各项资产构成 单位:人民币元

Table with columns: 序号, 名称, 金额. Lists other assets.

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

Table with columns: 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(%). Lists top 30 stock purchases.

“卖出金额”按卖出成交金额(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 542,348,367.29 卖出股票收入(成交)总额 539,402,834.04

“买入股票成本总额”和“卖出股票收入总额”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

Table with columns: 份额级别, 持有人结构. Lists shareholders and their stakes.

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

Table with columns: 项目, 份额级别, 持有份额总占比(份), 占基金总份额比例. Lists fund manager holdings.

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 金额单位:人民币元

Table with columns: 项目, 份额级别, 持有基金份额总量的数量区间(万份). Lists fund manager holdings.

注:本基金的基金经理未持有本基金。 8.10 开放式基金份额变动 单位:份

Table with columns: 基金合同生效日(2017年04月07日)基金份额总额, 基金合同生效日至报告期末基金份额变动, 报告期末基金份额总额. Lists fund share changes.

8.11 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事件变动

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事件变动

金额单位:人民币元

Table with columns: 序号, 债券品种, 公允价值, 占基金资产净值比例(%). Lists bond holdings.

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 债券投资组合明细 金额单位:人民币元

Table with columns: 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(%). Lists bond holdings.

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 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,本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求,未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期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。 8.12.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票目录。 8.12.3 期末其他各项资产构成 单位:人民币元

8.12.3 期末其他各项资产构成 单位:人民币元

Table with columns: 序号, 名称, 金额. Lists other assets.

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

Table with columns: 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(%). Lists top 30 stock purchases.

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

Table with columns: 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(%). Lists top 30 stock purchases.

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

Table with columns: 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(%). Lists top 30 stock purchases.

“卖出金额”按卖出成交金额(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 542,348,367.29 卖出股票收入(成交)总额 539,402,834.04

“买入股票成本总额”和“卖出股票收入总额”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

(1)基金管理人于2017年11月9日发布公告,易海波先生担任中融基金管理有限公司副总经理。 本基金管理人于2017年12月21日发布公告,侯利鹏先生不再担任中融基金管理有限公司副总经理。 公司其他高管人员未变动。 (2)基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况 本报告期内,本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 本报告期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 本基金本报告期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 本基金聘请毕马威会计师事务所(特殊普通合伙),本报告期为本基金应支付给聘任会计师事务所的报酬共计人民币22,000.00元。 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 本报告期无管理人、托管人及其高级管理人员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

Table with columns: 券商名称, 交易单元数量, 股票交易, 佣金. Lists brokerage usage.

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

Table with columns: 券商名称, 债券交易, 债券回购交易, 权证交易, 基金交易. Lists brokerage usage.

注:①为了贯彻中国证监会的有关规,我公司制定了选择券商的标准,即: 1.经营行为规范,在近三年内无重大违规行为。 2.公司财务状况良好。 3.有良好的内部控制,在业内有良好的声誉。 4.有较雄厚的研究能力,能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告,并能根据基金投资的特殊要求,提供专门的研究报告。 5.建立了广泛的行业信息网络,能及时提供准确的信息资讯和服务。 ②券商专用交易单元选择程序: 1.对交易所筛选券商的研究报告进行评估 2.本基金管理人组织相关人员依据交易单元选择标准对交易所单元候选券商的服务质量和研究实力进行评估,确定选用交易单元的券商。 3.协议签署及通知托管人 本基金管理人将与被选择的券商签订交易单元租用协议,并通知基金托管人。

注:①为了贯彻中国证监会的有关规,我公司制定了选择券商的标准,即:

1.经营行为规范,在近三年内无重大违规行为。 2.公司财务状况良好。 3.有良好的内部控制,在业内有良好的声誉。 4.有较雄厚的研究能力,能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告,并能根据基金投资的特殊要求,提供专门的研究报告。 5.建立了广泛的行业信息网络,能及时提供准确的信息资讯和服务。 ②券商专用交易单元选择程序: 1.对交易所筛选券商的研究报告进行评估 2.本基金管理人组织相关人员依据交易单元选择标准对交易所单元候选券商的服务质量和研究实力进行评估,确定选用交易单元的券商。 3.协议签署及通知托管人 本基金管理人将与被选择的券商签订交易单元租用协议,并通知基金托管人。

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

Table with columns: 券商名称, 交易单元数量, 股票交易, 佣金. Lists brokerage usage.

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

Table with columns: 券商名称, 债券交易, 债券回购交易, 权证交易, 基金交易. Lists brokerage usage.

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 金额单位:人民币元

Table with columns: 项目, 份额级别, 持有份额总占比(份), 占基金总份额比例. Lists fund manager holdings.

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 金额单位:人民币元

Table with columns: 项目, 份额级别, 持有基金份额总量的数量区间(万份). Lists fund manager holdings.

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事件变动

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事件变动

金额单位:人民币元

Table with columns: 券商名称, 交易单元数量, 股票交易, 佣金. Lists brokerage usage.

①为了贯彻中国证监会的有关规,我公司制定了选择券商的标准,即: 1.经营行为规范,在近三年内无重大违规行为。 2.公司财务状况良好。 3.有良好的内部控制,在业内有良好的声誉。 4.有较雄厚的研究能力,能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告,并能根据基金投资的特殊要求,提供专门的研究报告。 5.建立了广泛的行业信息网络,能及时提供准确的信息资讯和服务。 ②券商专用交易单元选择程序: 1.对交易所筛选券商的研究报告进行评估 2.本基金管理人组织相关人员依据交易单元选择标准对交易所单元候选券商的服务质量和研究实力进行评估,确定选用交易单元的券商。 3.协议签署及通知托管人 本基金管理人将与被选择的券商签订交易单元租用协议,并通知基金托管人。 ③本基金合同于2017年1月16日生效,以上交易单元均为本报告期新增交易单元。 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

①为了贯彻中国证监会的有关规,我公司制定了选择券商的标准,即:

Table with columns: 券商名称, 债券交易, 债券回购交易, 权证交易, 基金交易. Lists brokerage usage.

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事件变动

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事件变动

金额单位:人民币元

Table with columns: 券商名称, 交易单元数量, 股票交易, 佣金. Lists brokerage usage.

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