（上接 D339 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	002466	天齐锂业	127,305	6,773,899.05	9.50
2	300450	先导智能	107,300	6,112,881.00	8.57
3	000063	中兴通讯	167,500	6,090,300.00	8.54
4	002008	大族激光	120,920	5,973,448.00	8.37
5	300274	阳光电源	193,900	3,639,503.00	5.10
6	002236	大华股份	146,400	3,380,376.00	4.74
7	300316	晶盛机电	160,800	3,362,328.00	4.71
8	300323	华灿光电	204,300	3,330,090.00	4.67
9	600183	生益科技	191,000	3,296,660.00	4.62
10	300373	扬杰科技	105,300	3,155,841.00	4.42
11	002405	四维图新	112,500	2,968,875.00	4.16
12	600563	法拉电子	57,200	2,906,332.00	4.07
13	000988	华工科技	157,000	2,603,060.00	3.65
14	002475	立讯精密	110,000	2,578,400.00	3.61
15	002371	北方华创	45,700	1,893,808.00	2.65
16	600885	宏发股份	40,097	1,658,812.89	2.33
17	300577	开润股份	25,900	1,594,663.00	2.24
18	002156	通富微电	108,500	1,434,370.00	2.01
19	600438	通威股份	118,300	1,432,613.00	2.01
20	603833	欧派家居	8,500	1,003,425.00	1.41
21	300124	汇川技术	24,700	716,794.00	1.00
22	600487	亨通光电	17,600	711,392.00	1.00

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

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	占期末基金资产净值比例(%)
1	300450	先导智能	15,363,894.00	21.54
2	300113	顺网科技	11,042,031.96	15.48
3	600477	杭萧钢构	10,834,220.58	15.19
4	002466	天齐锂业	10,817,122.30	15.16
5	300577	开润股份	8,674,712.00	12.16
6	002635	安洁科技	8,618,501.10	12.08
7	002405	四维图新	8,218,287.00	11.52
8	300323	华灿光电	7,989,577.00	11.20
9	600990	四创电子	7,971,568.00	11.17
10	002460	赣锋锂业	7,943,870.00	11.14
11	002008	大族激光	7,515,442.81	10.54
12	300310	宜通世纪	7,126,027.00	9.99
13	600763	通策医疗	6,669,023.00	9.35
14	002766	索菱股份	5,937,099.00	8.32
15	002497	雅化集团	5,834,310.38	8.18
16	002236	大华股份	5,500,684.65	7.71
17	002475	立讯精密	5,408,535.34	7.58
18	000063	中兴通讯	5,401,454.80	7.57
19	300078	思创医惠	5,279,021.56	7.40
20	300552	万集科技	5,137,374.00	7.20
21	300061	康旗股份	4,939,708.30	6.92
22	300567	精测电子	4,934,281.40	6.92
23	300408	三环集团	4,860,477.00	6.81
24	600884	杉杉股份	4,814,938.00	6.75
25	002368	太极股份	4,778,530.00	6.70
26	300458	全志科技	4,597,054.64	6.44
27	300456	耐威科技	4,552,130.00	6.38
28	603228	景旺电子	4,516,729.90	6.33
29	000681	视觉中国	4,408,976.37	6.18
30	002230	科大讯飞	4,395,248.12	6.16
31	300115	长盈精密	4,392,897.25	6.16
32	000050	深天马 A	4,303,219.00	6.03
33	000921	海信科龙	4,290,334.92	6.01
34	300183	东软载波	4,224,961.00	5.92
35	600563	法拉电子	4,060,689.00	5.69
36	600110	诺德股份	4,025,045.00	5.64
37	000423	东阿阿胶	4,022,203.00	5.64
38	300613	富瀚微	3,937,482.00	5.52
39	300274	阳光电源	3,829,350.08	5.37
40	300595	欧普康视	3,732,537.00	5.23
41	000801	四川九洲	3,496,117.00	4.90
42	600183	生益科技	3,412,883.00	4.78
43	002383	合众思壮	3,389,985.00	4.75
44	000970	中科三环	3,379,873.00	4.74
45	000818	方大化工	3,372,664.00	4.73
46	300579	数字认证	3,316,405.00	4.65
47	002017	东信和平	3,312,497.00	4.64
48	300609	汇纳科技	3,308,455.00	4.64
49	300600	瑞特股份	3,307,071.62	4.64
50	300568	星源材质	3,195,508.50	4.48
51	300590	移为通信	3,161,018.00	4.43
52	002310	东方园林	3,124,517.50	4.38
53	300316	晶盛机电	3,095,896.00	4.34
54	300457	赢合科技	3,078,727.00	4.32
55	000988	华工科技	2,996,254.00	4.20
56	300373	扬杰科技	2,939,824.00	4.12
57	300014	亿纬锂能	2,754,820.00	3.86
58	300083	劲胜智能	2,717,560.00	3.81
59	600436	片仔癀	2,688,632.00	3.77
60	000049	德赛电池	2,647,355.64	3.71
61	002241	歌尔股份	2,646,545.37	3.71
62	002829	星网宇达	2,597,852.10	3.64
63	002176	江特电机	2,524,787.00	3.54
64	002571	*ST 德力	2,509,180.00	3.52
65	300306	远方信息	2,498,405.52	3.50
66	300170	汉得信息	2,490,749.00	3.49
67	600885	宏发股份	2,411,354.56	3.38
68	002045	国光电器	2,342,189.44	3.28
69	300104	乐视网	2,309,037.00	3.24
70	600416	湘电股份	2,295,971.00	3.22
71	600745	闻泰科技	2,266,036.00	3.18
72	300099	精准信息	2,265,915.00	3.18
73	300098	高新兴	2,251,842.32	3.16
74	002242	九阳股份	2,212,348.42	3.10
75	600525	长园集团	2,202,293.00	3.09
76	300312	邦讯技术	2,147,740.00	3.01
77	300340	科恒股份	2,105,447.00	2.95
78	300393	中来股份	2,078,154.72	2.91
79	300073	当升科技	2,063,945.00	2.89
80	603338	浙江鼎力	2,010,642.00	2.82
81	300433	蓝思科技	1,987,452.00	2.79
82	603005	晶方科技	1,903,502.00	2.67
83	002174	游族网络	1,786,985.00	2.51
84	002371	北方华创	1,756,441.33	2.46
85	300681	英搏尔	1,679,727.00	2.35
86	000980	众泰汽车	1,619,319.00	2.27
87	300258	精锻科技	1,614,658.00	2.26
88	002583	海能达	1,610,412.00	2.26
89	300496	中科创达	1,585,080.07	2.22
90	002080	中材科技	1,463,072.00	2.05
91	600438	通威股份	1,427,473.00	2.00
92	300203	聚光科技	1,426,758.00	2.00

“买入金额”按买入成交金额(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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	300450	先导智能	11,856,977.00	16.62
2	600477	杭萧钢构	11,618,278.40	16.29
3	002460	赣锋锂业	10,179,290.02	14.27
4	300113	顺网科技	10,056,814.00	14.10
5	002635	安洁科技	8,571,095.06	12.02
6	300577	开润股份	7,585,059.00	10.63
7	600990	四创电子	7,525,883.80	10.55
8	002497	雅化集团	6,490,996.00	9.10
9	600763	通策医疗	6,224,714.47	8.73
10	300323	华灿光电	5,992,360.00	8.40
11	300310	宜通世纪	5,971,040.03	8.37
12	002766	索菱股份	5,422,830.43	7.60
13	300408	三环集团	5,390,265.00	7.56
14	300078	思创医惠	5,195,378.82	7.28
15	002405	四维图新	4,768,459.86	6.68
16	000921	海信科龙	4,450,742.22	6.24
17	002368	太极股份	4,450,630.76	6.24
18	000050	深天马 A	4,426,192.00	6.20
19	300061	康旗股份	4,410,000.00	6.18
20	300115	长盈精密	4,339,463.05	6.08
21	300567	精测电子	4,336,411.13	6.08
22	000681	视觉中国	4,325,458.00	6.06
23	600110	诺德股份	4,234,731.00	5.94
24	300456	耐威科技	4,232,177.04	5.93
25	002230	科大讯飞	4,190,597.21	5.87
26	300458	全志科技	4,137,526.00	5.80
27	300552	万集科技	4,124,258.00	5.78
28	600884	杉杉股份	4,090,253.24	5.73
29	002008	大族激光	4,086,972.40	5.73
30	300183	东软载波	4,054,434.00	5.68
31	603228	景旺电子	4,048,535.00	5.68
32	000423	东阿阿胶	4,032,970.00	5.65
33	002466	天齐锂业	3,983,611.00	5.58
34	002236	大华股份	3,619,758.00	5.07
35	000801	四川九洲	3,409,323.00	4.78
36	300613	富瀚微	3,371,216.00	4.73
37	000970	中科三环	3,343,558.00	4.69
38	300595	欧普康视	3,260,666.00	4.57
39	300600	瑞特股份	3,255,051.08	4.56
40	002017	东信和平	3,242,007.00	4.54
41	000063	中兴通讯	3,200,905.00	4.49
42	002475	立讯精密	3,186,298.11	4.47
43	300579	数字认证	2,936,900.00	4.12
44	300568	星源材质	2,907,049.20	4.08
45	002310	东方园林	2,900,020.00	4.07
46	600436	片仔癀	2,894,083.00	4.06
47	002383	合众思壮	2,835,767.00	3.98
48	000818	方大化工	2,823,804.00	3.96
49	300590	移为通信	2,799,968.00	3.93
50	300014	亿纬锂能	2,761,057.00	3.87
51	002241	歌尔股份	2,760,652.00	3.87
52	300609	汇纳科技	2,716,403.90	3.81
53	002829	星网宇达	2,685,553.00	3.76
54	300457	赢合科技	2,675,591.00	3.75
55	000049	德赛电池	2,660,561.00	3.73
56	300083	劲胜智能	2,618,566.00	3.67
57	300170	汉得信息	2,532,800.00	3.55
58	002045	国光电器	2,445,595.00	3.43
59	300104	乐视网	2,382,855.40	3.34
60	300099	精准信息	2,375,180.00	3.33
61	300306	远方信息	2,351,853.55	3.30
62	002176	江特电机	2,299,750.00	3.22
63	600416	湘电股份	2,275,311.00	3.19
64	603338	浙江鼎力	2,231,519.00	3.13
65	002242	九阳股份	2,218,050.00	3.11
66	300098	高新兴	2,148,758.84	3.01
67	300073	当升科技	2,129,183.00	2.98
68	300433	蓝思科技	2,019,318.18	2.83
69	600525	长园集团	1,992,313.00	2.79
70	002571	*ST 德力	1,979,338.00	2.77
71	300312	邦讯技术	1,978,542.99	2.77
72	300393	中来股份	1,973,081.00	2.77
73	600745	闻泰科技	1,922,267.00	2.69
74	603005	晶方科技	1,818,440.00	2.55
75	002174	游族网络	1,809,743.00	2.54
76	300340	科恒股份	1,717,711.00	2.41
77	002583	海能达	1,632,469.36	2.29
78	300681	英搏尔	1,556,864.00	2.18
79	300496	中科创达	1,446,445.00	2.03
80	300203	聚光科技	1,443,210.00	2.02

“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	408,739,553.82
卖出股票收入(成交)总额	342,982,676.80

"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

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

8.10.1 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	公允价值变动	风险说明
–	–	–	–	–	–
公允价值变动总额合计(元)				–	
股指期货投资本期收益(元)				7,680.00	
股指期货投资本期公允价值变动(元)				–	

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

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 基金投资的前十名股票未超过基金合同规定的备选股票库。

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	45,774.93
2	应收证券清算款	3,333,658.59
3	应收股利	–
4	应收利息	1,114.46
5	应收申购款	935,098.07
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	4,315,646.05

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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002466	天齐锂业	883,552.05	1.24	配股未上市

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。

§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
3,197	20,832.93	13,141,309.72	19.73%	53,461,566.90	80.27%

分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中,对下属分级基金,比例的分母采用各自级别的份额,对合计数,比例的分母采用下属分级基金份额的合计数(即期末基金份额总额)。

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	99,100.33	0.15%

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

1、本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金;

2、本基金基金经理未持有本开放式基金。

§10 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2017 年 02 月 27 日)基金份额总额	225,967,114.24
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	82,548,508.59
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	241,912,746.21
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	66,602,876.62

申购含红利再投、转换入份额及金额,赎回含转换出份额及金额。

§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

(1)基金管理人的重大人事变动情况

本基金管理人于 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

本基金本报告期内选聘上会会计师事务所(特殊普通合伙)提供首年审计服务。本基金本报告期应支付给上会会计师事务所(特殊普通合伙)的报酬为 25,000.00 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

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

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	
网信证券	2	41,940,718.17	5.58%	39,059.37	7.00%	–
华泰证券	2	–	–	–	–	–
长城证券	2	42,688,305.43	5.68%	31,218.09	5.59%	–
中信证券(山东)	2	552,894,516.61	73.57%	404,332.02	72.46%	–
中信证券	2	114,015,039.11	15.17%	83,379.39	14.94%	–

①为了贯彻中国证监会的有关规定,我公司制定了选择券商的标准,即:

ⅰ经营行为规范,在近一年内无重大违规行为。

ⅱ公司财务状况良好。

ⅲ有良好的内控制度,在业内有良好的声誉。

ⅳ有较强的研究能力,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。

ⅴ建立了广泛的信息网络,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:

ⅰ对交易单元候选券商的研究服务进行评估

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。

ⅱ协议签署及通知托管人

本基金管理人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 2 月 27 日生效,以上交易单元均为本报告期新增交易单元。

中融基金管理有限公司

二〇一八年三月三十日

（上接 D341 版）

7.4.4.2.3 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 01 月 01 日至 2017 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中融恒泰纯债 A	中融恒泰纯债 C	合计
中融基金管理有限公司	–	1,721.20	1,721.20
合计	–	1,721.20	1,721.20
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2016 年 12 月 27 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中融恒泰纯债 A	中融恒泰纯债 C	合计
中融基金管理有限公司	–	0.28	0.28
合计	–	0.28	0.28

注:

①支付基金销售机构的 C 类基金份额销售服务费按前一日 C 类基金资产净值 0.30%的年费率计提,每日计提,逐日累计至每月月底,按月支付给注册登记机构,再由注册登记机构代付给销售机构。A 类基金份额不收取销售服务费。C 类基金销售服务费的计算公式为:

②C 类基金份额的日销售服务费=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 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

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

无。

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 12 月 27 日(基金合同生效日)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
中国邮政储蓄银行股份有限公司	2,615,031.51	106,077.39	41,746.60	8,004.15

注:

本基金的活期存款由基金托管人保管,按银行同业利率计息。本基金用于证券交易结算的资金通过托管人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,按银行同业利率计息。

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

7.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 12 月 31 日止,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是 301,689,187.46 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
170205	17 国开 05	2018-01-02	98.10	1,030,000	101,043,000.00
170205	17 国开 05	2018-01-02	98.10	2,060,000	202,086,000.00
170205	17 国开 05	2018-01-02	98.10	20,000	1,962,000.00
合计				3,110,000	305,091,000.00

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,其账面价值接近于公允价值。

(2) 以公允价值计量的金融工具

① 金融工具公允价值计量的方法

本基金以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债,其公允价值计量基于公允价值的输入值的可观察程度以及该等输入值对公允价值计量整体的重要性,被划分为三个层次:

第一层次输入值是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。

第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。

② 各层级金融工具公允价值

于 2017 年 12 月 31 日,本基金持有的以公允价值计量的金融工具中无属于第一层次的余额,属于第二层次的余额为人民币 1,685,602,800.00 元,无属于第三层次的余额(2016 年 12 月 31 日:无属于第一层次、第二层次以及第三层次的余额)。

③ 公允价值所属层级间的重大变动

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应属第二层次还是第三层次。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换。

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 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	1,690,698,600.00	73.32
	其中:债券	1,685,602,800.00	73.10
	资产支持证券	5,095,800.00	0.22
4	贵金属投资	–	–
5	金融衍生品投资	–	–
6	买入返售金融资产	77,000,315.50	3.34
	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	502,615,031.51	21.80
8	其他各项资产	35,560,867.18	1.54
9	合计	2,305,874,814.19	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

本基金本报告期末未持有股票投资。

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

本基金本报告期末未持有股票投资。

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初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期内未持有股票投资。

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

本基金本报告期内未持有股票投资。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内未持有股票投资。

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

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	129,311,000.00	6.46
2	央行票据	–	–
3	金融债券	677,809,800.00	33.84
	其中:政策性金融债	677,809,800.00	33.84
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	878,482,000.00	43.86
9	其他	–	–
10	合计	1,685,602,800.00	84.16

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	170205	17 国开 05	6,560,000	643,536,000.00	32.13
2	150012	15 附息国债 12	1,300,000	129,311,000.00	6.46
3	111791856	17 重庆银行 CD025	1,000,000	95,650,000.00	4.78
4	111781025	17 湖北银行 CD090	700,000	68,383,000.00	3.41
5	111772186	17 哈尔滨银行 CD260	700,000	68,187,000.00	3.40

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

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	1789232	17 常星 1A1	570,000	5,095,800.00	0.25

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库。

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	53.27
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	35,560,713.91
5	应收申购款	100.00
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	35,560,867.18

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

本基金本报告期末未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。

§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
中融恒泰纯债 A	142	14,050,523.95	1,994,990,650.22	99.99%	183,750.84	0.01%
中融恒泰纯债 C	71	6,258.80	–	–	444,374.92	100.00%
合计	213	9,369,102.23	1,994,990,650.22	99.97%	628,125.76	0.03%

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	中融恒泰纯债 A	1,196.25	–
	中融恒泰纯债 C	1,300.50	0.29%
	合计	2,496.75	–

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	中融恒泰纯债 A	0~10
	中融恒泰纯债 C	–
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	中融恒泰纯债 A	–
	中融恒泰纯债 C	0
	合计	0

注:本基金的基金经理未持有本基金。

§10 开放式基金份额变动

单位:份

	中融恒泰纯债 A	中融恒泰纯债 C
基金合同生效日(2016 年 12 月 27 日)基金份额总额	200,033,046.60	8,700.00
本报告期期初基金份额总额	200,033,046.60	8,700.00
本报告期基金总申购份额	1,798,788,570.30	11,654,472.38
减:本报告期基金总赎回份额	3,647,215.84	11,218,797.46
本报告期基金拆分变动份额	–	–
本报告期期末基金份额总额	1,995,174,401.06	444,374.92

§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

(1)基金管理人的重大人事变动情况

本基金管理人于 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

本基金的审计机构是上会会计师事务所(特殊普通合伙),报告期内本基金应支付给聘任会计师事务所的报酬共计人民币 30,000.00 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

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	
银河证券	2	–	–	–	–	–

注:①为了贯彻中国证监会的有关规定,我公司制定了选择券商的标准,即:

ⅰ经营行为规范,在近一年内无重大违规行为。

ⅱ公司财务状况良好。

ⅲ有良好的内控制度,在业内有良好的声誉。

ⅳ有较强的研究能力,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。

ⅴ建立了广泛的信息网络,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:

ⅰ对交易单元候选券商的研究服务进行评估

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。

ⅱ协议签署及通知托管人

本基金管理人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。

11.7.2 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
银河证券	384,170.30	100.00%	1,489,000,000.00	100.00%	–	–	–	–

中融基金管理有限公司

二〇一八年三月三十日