

**(上接 D369 版)**  
**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 22 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
中国工商银行股份有限公司	1,531,934.52	6,408.05	24,884.99	1,205.97

本基金的银行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**  
 金额单位:人民币元

**7.4.12.1.1 受限证券类别:债券**

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值价格	数量(单位:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
123006	东财转债	2017-12-25	2018-01-29	新债未流通	100.00	100.00	40	4,000.00	4,000.00	

**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**  
 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属于第二层次的余额为人民币 4,000.00 元,无属于第一层次和第三层次的余额。(2016 年 12 月 31 日:无属于第一层次、第二层次和第三层次的余额。  
 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。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 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	4,000.00	0.04
	其中:债券	4,000.00	0.04
	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	9,500,000.00	84.07
	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	1,742,289.07	15.42
8	其他各项资产	53,511.88	0.47
9	合计	11,299,900.95	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**

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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	7,931,049.12	17.04
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	518,035.00	1.11
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术、软件和信息技术服务业	-	-
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	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	745,544.00	1.60
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	9,194,628.12	19.75

**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 名的股票投资明细**  
 本基金本报告期无股票累计买入金额。  
**8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票投资明细**  
 本基金本报告期无股票累计卖出金额。  
**8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额**  
 本基金本报告期无股票累计买入、卖出金额。  
**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	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	4,000.00	0.04
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	4,000.00	0.04

**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	123006	东财转债	40	4,000.00	0.04

**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库。**  
**8.12.3 期末其他各项资产构成**  
 单位:人民币元

**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

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	002573	清新环境	32,800	745,544.00	1.60
2	600760	中航光电	21,100	736,179.00	1.58
3	002371	北方华创	17,700	733,488.00	1.58
4	002422	科伦药业	28,992	721,900.80	1.55
5	002611	东方精工	53,200	698,516.00	1.50
6	600388	龙净环保	40,000	692,000.00	1.49
7	002156	通富微电	50,500	667,610.00	1.43
8	000768	中航飞机	39,200	662,088.00	1.42
9	603005	晶方科技	17,344	611,896.32	1.31
10	600332	白云山	17,700	568,878.00	1.22
11	002251	步步高	28,700	518,035.00	1.11
12	300203	聚光科技	13,100	465,705.00	1.00
13	600060	海信电器	31,000	465,620.00	1.00
14	300340	科恒电器	8,000	464,480.00	1.00
15	300666	江丰电子	6,400	442,688.00	0.95

**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 名的股票投资明细**  
 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	600884	杉杉股份	2,777,969.30	3.43
2	300032	同有科技	2,749,576.50	3.40
3	300010	立思辰	2,664,473.90	3.29
4	002422	科伦药业	2,489,945.00	3.08
5	603005	晶方科技	2,452,342.00	3.03
6	300613	富瀚微	2,354,080.00	2.91
7	300699	汇纳科技	2,190,713.25	2.71
8	002279	久其软件	2,067,680.36	2.55
9	600801	华新水泥	2,068,457.64	2.48
10	002285	世联行	1,991,154.20	2.46
11	002813	路畅科技	1,977,330.00	2.44
12	002251	步步高	1,918,071.00	2.37
13	002156	通富微电	1,888,596.00	2.33
14	300295	三六五网	1,871,335.00	2.31
15	603160	汇顶科技	1,842,033.00	2.28
16	002475	立讯精密	1,715,903.00	2.12
17	000050	深天马 A	1,687,494.12	2.08
18	002405	四维图新	1,684,680.00	2.08
19	300324	旋极信息	1,683,884.96	2.08
20	002466	天齐锂业	1,657,596.00	2.05

**“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初基金资产净值 2%或前 20 名的股票投资明细**  
 金额单位:人民币元

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	600884	杉杉股份	2,881,775.24	3.56
2	002368	太极股份	2,786,486.47	3.44
3	300410	正业科技	2,785,037.50	3.44
4	300010	立思辰	2,645,230.96	3.27
5	300032	同有科技	2,481,298.00	3.06
6	000829	天吉控股	2,428,500.00	3.00
7	002439	启明星辰	2,306,768.00	2.85
8	300613	富瀚微	2,284,950.00	2.82
9	002279	久其软件	2,145,826.37	2.65
10	600801	华新水泥	2,136,993.48	2.64
11	300295	三六五网	2,125,797.00	2.63
12	002285	世联行	1,906,622.91	2.35
13	300310	宜通世纪	1,904,088.00	2.35
14	002422	科伦药业	1,890,964.08	2.34
15	603005	晶方科技	1,883,750.40	2.33
16	002195	二三四五	1,862,049.49	2.30
17	600571	信达地产	1,855,528.96	2.29
18	300699	汇纳科技	1,849,531.60	2.28
19	300457	赢合科技	1,818,288.35	2.25
20	603160	汇顶科技	1,808,001.00	2.23

**“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	131,967,937.06
卖出股票收入(成交)总额	137,083,591.48

**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	2,789,809.00	5.99
2	央行票据	-	-
3	金融债券	9,647,000.00	20.72
	其中:政策性金融债	9,647,000.00	20.72
4	企业债券	8,889,800.00	19.10
5	企业短期融资券	16,044,800.00	34.46
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	6,096.57	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	37,377,505.57	80.29

**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	160215	16国开 15	100,000	9,647,000.00	20.72
2	011772009	17国开 03	40,000	4,025,200.00	8.65
3	011752024	17 国开 04	40,000	4,024,400.00	8.64
4	071721011	17 国债 01	40,000	4,001,600.00	8.60
5	011763024	17 国债 03	40,000	3,993,600.00	8.58

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	12,482.74
3	应收股利	-
4	应收利息	-1,145.56
5	应收申购款	42,174.70
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	53,511.88

根据交易所实施的债券质押式回购新规,质押式回购计息天数采用资金实际占款天数,故回购到期日为节假日前一日的交易所回购利息余额可能出现负值,未提利息将于节假日期间完成计提。

**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

份额类别	持有人户数(户)	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	
中融银行间 1-3 年高等级信用债指数 A	117	81,068.68	9,000,350.03	94.89%	484,686.03	5.11%
中融银行间 1-3 年高等级信用债指数 C	6	168,847.28	1,000,038.88	98.71%	13,044.82	1.29%
合计	123	85,350.57	10,000,388.91	95.20%	497,730.85	4.74%

**9.2 期末基金管理人持有的基金份额及基金持有人持有的基金份额**

项目	份额类别	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	中融银行间 1-3 年高等级信用债指数 A	199.14	0.0021%
	中融银行间 1-3 年高等级信用债指数 C	-	-
合计		199.14	0.0019%

**对于分级基金,比例的分母采用各自级别的份额,对于合计数,比例的分母采用期末基金份额总额。**

**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、基金投资和研究人员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。  
**9.4 发起式基金发起资金持有份额情况**

项目	持有基金份额		发起份额		发起份额承诺持有期限
	持有份额总数				