

（上接 D381 版）

C 类基金份额的日销售服务费=前一日 C 类基金资产净值 X 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无。

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

Table with columns: 关联方名称, 2017年01月01日至2017年12月31日, 2016年01月01日至2016年12月31日. Rows include 中国光大银行活期存款, 中国光大银行定期存款.

本基金的银行存款由基金托管人保管,按银行同期利率计息。本基金会用于证券交易结算的资金通过托管人托管专用存款账户存于中国证券投资基金业协会具有相应资质的银行。

7.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

Table with columns: 关联方名称, 证券代码, 证券名称, 发行方式, 基金在承销期内买入金额, 总金额.

注:本基金在上年度可比期间未发生承销期内参与关联方承销证券的情况。

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

Table with columns: 证券代码, 证券名称, 停牌日期, 停牌原因, 复牌日期, 数量(股), 期末成本, 期末估值.

Table with columns: 证券代码, 证券名称, 停牌日期, 停牌原因, 复牌日期, 数量(股), 期末成本, 期末估值.

Table with columns: 证券代码, 证券名称, 停牌日期, 停牌原因, 复牌日期, 数量(股), 期末成本, 期末估值.

Table with columns: 证券代码, 证券名称, 停牌日期, 停牌原因, 复牌日期, 数量(股), 期末成本, 期末估值.

Table with columns: 证券代码, 证券名称, 停牌日期, 停牌原因, 复牌日期, 数量(股), 期末成本, 期末估值.

Table with columns: 证券代码, 证券名称, 停牌日期, 停牌原因, 复牌日期, 数量(股), 期末成本, 期末估值.

Table with columns: 证券代码, 证券名称, 停牌日期, 停牌原因, 复牌日期, 数量(股), 期末成本, 期末估值.

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 (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 ② 公允价值所属层级的重大变动

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,本基金不会于停牌首日交易恢复后首个交易日及交易不活跃期间对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变动影响程度,确定相关股票和债券公允价值所属第二层次或是第三层次。

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

Table with columns: 序号, 项目, 金额, 占基金总资产的比例(%). Rows include 权益投资, 其中:股票, 基金投资, 固定收益投资, 其中:债券, 资产支持证券, 贵金属投资, 金融衍生品投资, 买入返售金融资产.

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with columns: 序号, 代码, 行业名称, 数量(只), 公允价值, 占基金资产净值比例(%).

Table with columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%).

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组合

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(%).

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组合 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(%).

产支持证券投资明细

本基金本报告期末持有资产支持证券。

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组合

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

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

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、处罚的情况。

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

Table with columns: 序号, 名称, 金额. Rows include 1. 存出保证金, 2. 应收证券清算款, 3. 应收股利, 4. 应收利息, 5. 应收申购款, 6. 其他应收款, 7. 待摊费用, 8. 其他.

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(%).

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

Table with columns: 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(%).

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

Table with columns: 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(%).

“卖出金额”按卖出成交金额(成交单价乘以成交数量)填写,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

Table with columns: 买入股票成本(成交金额), 609,899,939.35

卖出股票收入(成交总额) 517,563,234.01

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

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(%).

§ 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

份数单位:份

Table with columns: 份额级别, 持有人户数(户), 户均持有的基金份额, 机构投资者持有份额, 个人投资者持有份额.

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

§ 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03月27日, 基金份额, 225,186,066.74.

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

Table with columns: 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(%).

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

Table with columns: 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(%).

“卖出金额”按卖出成交金额(成交单价乘以成交数量)填写,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

Table with columns: 买入股票成本(成交金额), 609,899,939.35

卖出股票收入(成交总额) 517,563,234.01

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

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(%).

§ 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03月27日, 基金份额, 225,186,066.74.

金额单位:人民币元

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 期末持仓份额, 占基金资产净值比例(%), 流通受限情况说明.

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数之间可能存在尾差。

§ 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

Table with columns: 份额级别, 持有人户数(户), 户均持有的基金份额, 机构投资者持有份额, 个人投资者持有份额.

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

§ 9.2 期末基金管理人持有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, 持有基金份额的数量(份), 占基金总份额比例(%).

9.3 期末基金管理人持有的从业人员持有本基金的情况

本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人、基金经理未持有本基金。

§ 10 开放式基金份额变动

单位:份

Table with columns: 基金合同生效日, 2015年06月12日, 基金份额, 3,118,694.26.

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

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

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

11.4 基金投资策略的改变

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

Table with columns: 券商名称, 交易单元数量, 股票交易, 债券交易, 其他.

①为了贯彻中国证监会的有关要求,我公司制定了选择券商的标准,即:

1. 经营行为规范,在近一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、定期提供高质量的宏观、行业、公司和证券市场研究报告,并能根据基金投资的要求,提供专有的研究报告。

5. 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。

6. 券商专用交易单元选择程序: 1. 对交易单元候选券商的研究服务进行评估 2. 本基金管理人组织相关人员在交易所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。

7. 协议签署及通知托管人 本基金管理人及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

Table with columns: 券商名称, 交易单元数量, 股票交易, 债券交易, 其他.

①为了贯彻中国证监会的有关要求,我公司制定了选择券商的标准,即:

1. 经营行为规范,在近一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、定期提供高质量的宏观、行业、公司和证券市场研究报告,并能根据基金投资的要求,提供专有的研究报告。

5. 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。

6. 券商专用交易单元选择程序: 1. 对交易单元候选券商的研究服务进行评估 2. 本基金管理人组织相关人员在交易所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。

7. 协议签署及通知托管人 本基金管理人及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

Table with columns: 券商名称, 交易单元数量, 股票交易, 债券交易, 其他.

中融基金管理有限公司

二〇一八年三月三十日