（上接 D387 版）

8.3.1 期末指数投资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	002075	沙钢股份	6,579,428	147,773,952.88	26.57
2	600019	宝钢股份	10,493,225	90,661,464.00	16.30
3	600010	包钢股份	15,289,554	37,612,302.84	6.76
4	000709	河钢股份	5,572,385	21,732,301.50	3.91
5	000778	新兴铸管	2,757,815	14,395,794.30	2.59
6	000825	太钢不锈	2,882,225	14,295,836.00	2.57
7	600808	马钢股份	3,411,194	14,088,231.22	2.53
8	000717	韶钢松山	1,563,800	13,855,268.00	2.49
9	600282	南钢股份	2,715,353	13,142,308.52	2.36
10	600022	山东钢铁	5,984,412	12,806,641.68	2.30
11	000898	鞍钢股份	1,774,579	11,268,576.65	2.03
12	600307	酒钢宏兴	3,924,581	11,224,301.66	2.02
13	600782	新钢股份	1,406,362	9,253,861.96	1.66
14	600507	方大特钢	670,649	8,510,535.81	1.53
15	600165	新日恒力	498,772	8,010,278.32	1.44
16	600399	抚顺特钢	1,113,088	6,233,292.80	1.12
17	600569	安阳钢铁	1,322,320	6,214,904.00	1.12
18	002443	金洲管道	624,085	5,616,765.00	1.01
19	601003	柳钢股份	676,894	5,401,614.12	0.97
20	000959	首钢股份	877,202	5,245,667.96	0.94
21	600231	凌钢股份	1,021,600	5,210,160.00	0.94
22	600558	大西洋	831,850	5,024,374.00	0.90
23	601028	玉龙股份	542,636	4,916,282.16	0.88
24	002318	久立特材	675,604	4,790,032.36	0.86
25	002132	恒星科技	835,466	4,553,289.70	0.82
26	002110	三钢闽光	230,500	4,457,870.00	0.80
27	600126	杭钢股份	523,141	3,593,978.67	0.65
28	002478	常宝股份	644,267	3,511,255.15	0.63
29	600784	鲁银投资	627,470	3,369,513.90	0.61
30	000708	大冶特钢	260,800	2,980,944.00	0.54
31	600117	西宁特钢	514,901	2,929,786.69	0.53
32	000655	金岭矿业	343,218	2,690,829.12	0.48
33	600992	贵绳股份	242,194	2,656,868.18	0.48
34	601969	海南矿业	284,600	2,518,710.00	0.45
35	603969	银龙股份	210,962	2,468,255.40	0.44
36	000890	法 尔 胜	336,355	2,233,397.20	0.40
37	603066	音飞储存	163,920	2,196,528.00	0.39
38	000761	本钢板材	407,004	2,116,420.80	0.38
39	603028	赛福天	117,300	1,211,709.00	0.22
40	603878	武进不锈	70,000	1,187,200.00	0.21

8.3.2 期末积极投资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积极投资股票。

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	600019	宝钢股份	458,574,204.96	23.08
2	600010	包钢股份	169,435,674.85	8.53
3	000709	河钢股份	93,246,263.34	4.69
4	600022	山东钢铁	86,227,208.20	4.34
5	000778	新兴铸管	74,223,020.52	3.74
6	000825	太钢不锈	59,182,091.36	2.98
7	600808	马钢股份	52,813,209.16	2.66
8	600307	酒钢宏兴	51,382,900.03	2.59
9	600507	方大特钢	50,596,439.71	2.55
10	600282	南钢股份	45,874,442.71	2.31
11	002352	顺丰控股	45,078,709.72	2.27
12	000898	鞍钢股份	44,645,802.07	2.25
13	600126	杭钢股份	34,489,878.79	1.74
14	000959	首钢股份	33,051,067.24	1.66
15	600399	抚顺特钢	32,648,640.42	1.64
16	603969	银龙股份	31,997,916.68	1.61
17	603066	音飞储存	27,778,484.21	1.40
18	000717	韶钢松山	27,541,006.00	1.39
19	600782	新钢股份	27,160,049.99	1.37
20	002318	久立特材	25,940,925.82	1.31

注:本项的"买入金额"均按买入成交金额(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	600019	宝钢股份	562,944,287.83	28.34
2	600010	包钢股份	338,109,127.08	17.02
3	000709	河钢股份	219,578,246.34	11.05
4	000778	新兴铸管	163,438,349.04	8.23
5	000825	太钢不锈	126,574,789.94	6.37
6	600307	酒钢宏兴	112,641,478.02	5.67
7	600808	马钢股份	111,476,946.26	5.61
8	600022	山东钢铁	111,096,077.15	5.59
9	600282	南钢股份	97,309,717.31	4.90
10	000898	鞍钢股份	94,670,441.61	4.77
11	000959	首钢股份	92,382,980.01	4.65
12	600399	抚顺特钢	73,259,215.98	3.69
13	002318	久立特材	57,944,057.54	2.92
14	600165	新日恒力	55,651,640.28	2.80
15	002756	永兴特钢	50,380,596.88	2.54
16	002352	顺丰控股	49,072,357.30	2.47
17	002445	中南文化	48,714,698.79	2.45
18	600507	方大特钢	48,540,160.62	2.44
19	600784	鲁银投资	47,666,024.17	2.40
20	601028	玉龙股份	46,345,699.26	2.33
21	600558	大西洋	46,314,163.53	2.33
22	600532	宏达矿业	44,866,297.13	2.26
23	600782	新钢股份	43,907,847.68	2.21
24	000409	山东地矿	43,334,841.19	2.18
25	002443	金洲管道	42,156,798.73	2.12

注:本项的"卖出金额"均按卖出成交金额(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	1,864,447,971.63
卖出股票收入(成交)总额	3,419,182,054.91

注:"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 报告期内本基金投资的前十名股票中没有在备选股票库之外的股票。

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	1,067,652.15
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	19,505.46
5	应收申购款	134,499.57
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	1,221,657.18

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

8.12.5.1 期末指数投资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	002075	沙钢股份	147,773,952.88	26.57	公告重大事项

8.12.5.2 期末积极投资前五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积极投资股票。

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
钢铁 A	265	524,843.68	108,134,452.00	77.75%	30,949,122.00	22.25%
钢铁 B	2,123	65,512.75	24,009,301.00	17.26%	115,074,273.00	82.74%
中融钢铁	4,932	71,076.07	282,831,134.22	80.68%	67,716,018.52	19.32%
合计	7,320	85,889.93	414,974,887.22	66.00%	213,739,413.52	34.00%

注:对于分级基金,下属分级份额比例的分母采用各自级别的份额,对于合计数,比例的分母采用下属分级基金份额的合计数。

9.2 期末上市基金前十名持有人

钢铁 A

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例(%)
1	中荷人寿保险有限公司-分红险	30,118,599.00	21.66
2	深圳快快资产管理有限公司	17,030,025.00	12.24
3	中国银河证券股份有限公司	16,755,099.00	12.05
4	鹏华基金-工商银行-银华财富资本管理(北京)有限公司	6,025,804.00	4.33
5	鹏华基金-民生银行-万家共赢资产管理有限公司	4,353,609.00	3.13
6	王雁波	4,014,900.00	2.89
7	瑞泰人寿保险有限公司-万能	3,435,664.00	2.47
8	鹏华基金-宁波银行-百年人寿保险-百年人寿保险股份有限公司-	3,368,803.00	2.42
9	富国基金-广发银行-中信证券股份有限公司	3,183,745.00	2.29
10	鹏华基金-农业银行-华龙证券股份有限公司	2,955,647.00	2.13

钢铁 B

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例(%)
1	宋伟铭	15,932,731.00	11.46
2	平安资产-工商银行-平安资产如意 21 号资产管理产品	7,749,770.00	5.57
3	江西省出版集团公司企业年金计划-中信银行股份有限公司	4,092,855.00	2.94
4	刘国明	3,692,700.00	2.66
5	张美芳	3,291,504.00	2.37
6	中国平安人寿保险股份有限公司-投连-团体退休金平衡	2,749,878.00	1.98
7	黄东生	1,909,600.00	1.37
8	彭茜	1,850,000.00	1.33
9	第一创业证券-工商银行-创聚量化 FOF 一号集合资产管理计划	1,800,000.00	1.29
10	潘建仁	1,729,393.00	1.24

以上信息中持有人名称及持有份额数量由中国证券登记结算有限责任公司提供。

9.3 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	钢铁 A	0.00	–
	钢铁 B	0.00	–
	中融钢铁	11.00	–
	合计	11.00	–

9.4 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、本基金的基金经理未持有本基金。

§10 开放式基金份额变动

单位:份

	钢铁 A	钢铁 B	中融钢铁
基金合同生效日(2015 年 06 月 19 日)基金份额总额	–	–	223,387,740.63
本报告期期初基金份额总额	844,773,796.00	844,773,796.00	757,525,359.93
本报告期基金总申购份额	–	–	2,203,313,879.62
减:本报告期基金总赎回份额	–	–	4,041,028,955.48
本报告期基金拆分变动份额	–705,690,222.00	–705,690,222.00	1,430,736,868.67
本报告期期末基金份额总额	139,083,574.00	139,083,574.00	350,547,152.74

注:拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换的变化份额及定期、不定期折算的变化份额。

§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 60,000.00 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	
长江证券	1	919,070,029.10	18.37%	672,104.89	18.30%	新增
国信证券	2	73,934,401.45	1.48%	68,854.56	1.87%	新增
中信建投	2	1,521,058,486.15	30.41%	1,112,355.70	30.29%	–
银河证券	2	790,307,127.18	15.80%	577,953.95	15.74%	–
宏信证券	2	–	–	–	–	–
西藏东方财富证券	2	269,313,940.14	5.38%	196,948.64	5.36%	新增
东兴证券	2	1,204,289,126.86	24.08%	880,698.75	23.98%	–
海通证券	4	224,263,132.84	4.48%	163,997.07	4.47%	新增 2 个交易单元

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
长江证券	88,889,869.90	100.00%	–	–	–	–	–	–
国信证券	–	–	–	–	–	–	–	–
中信建投	–	–	–	–	–	–	–	–
银河证券	–	–	–	–	–	–	–	–
宏信证券	–	–	–	–	–	–	–	–
西藏东方财富证券	–	–	–	–	–	–	–	–
东兴证券	–	–	–	–	–	–	–	–
海通证券	–	–	–	–	–	–	–	–

中融基金管理有限公司

二〇一八年三月三十日

（上接 D389 版）

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	151,266,509.35	92.37
	其中:股票	151,266,509.35	92.37
2	基金投资	–	–
3	固定收益投资	–	–
	其中:债券	–	–
	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	12,310,263.28	7.52
8	其他各项资产	179,462.04	0.11
9	合计	163,756,234.67	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(指数投资)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)	占基金资产净值的比例(%)
A	农、林、牧、渔业	–	–
B	采矿业	–	–
C	制造业	–	–
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	–	–
G	交通运输、仓储和邮政业	–	–
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	–	–
J	金融业	151,266,509.35	93.70
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	–	–
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	151,266,509.35	93.70

8.2.2 报告期末(积极投资)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积极投资股票。

8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有沪港通投资股票。

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

8.3.1 期末指数投资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	600036	招商银行	782,533	22,709,107.66	14.07
2	601166	兴业银行	945,662	16,066,797.38	9.95
3	600016	民生银行	1,793,631	15,048,564.09	9.32
4	601328	交通银行	2,084,519	12,944,862.99	8.02
5	600000	浦发银行	890,766	11,214,743.94	6.95
6	601288	农业银行	2,900,200	11,107,766.00	6.88
7	601398	工商银行	1,636,400	10,145,680.00	6.28
8	000001	平安银行	651,395	8,663,553.50	5.37
9	601169	北京银行	1,107,573	7,919,146.95	4.91
10	601988	中国银行	1,599,100	6,348,427.00	3.93
11	601818	光大银行	1,208,110	4,892,845.50	3.03
12	600015	华夏银行	486,493	4,378,437.00	2.71
13	601939	建设银行	509,500	3,912,960.00	2.42
14	600919	江苏银行	525,600	3,863,160.00	2.39
15	002142	宁波银行	192,314	3,425,112.34	2.12
16	601009	南京银行	386,200	2,989,188.00	1.85
17	601998	中信银行	232,600	1,442,120.00	0.89
18	601997	贵阳银行	104,700	1,398,792.00	0.87
19	601229	上海银行	65,230	924,961.40	0.57
20	002807	江阴银行	67,100	555,588.00	0.34
21	600908	无锡银行	70,200	552,474.00	0.34
22	600926	杭州银行	30,620	353,048.60	0.22
23	002839	张家港行	15,100	176,972.00	0.11
24	601128	常熟银行	18,600	132,618.00	0.08
25	603323	吴江银行	12,100	99,583.00	0.06

8.3.2 期末积极投资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

无。

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	600016	民生银行	10,894,196.00	3.76
2	601166	兴业银行	10,810,504.00	3.73
3	600036	招商银行	9,958,700.28	3.44
4	601328	交通银行	8,403,233.00	2.90
5	600000	浦发银行	7,336,016.48	2.53
6	601288	农业银行	6,346,683.00	2.19
7	601169	北京银行	5,793,775.80	2.00
8	600919	江苏银行	5,321,766.01	1.84
9	601398	工商银行	5,133,989.50	1.77
10	000001	平安银行	4,099,980.00	1.42
11	601988	中国银行	3,840,352.00	1.33
12	601818	光大银行	3,275,890.40	1.13
13	600015	华夏银行	3,067,748.00	1.06
14	601997	贵阳银行	2,220,405.00	0.77
15	601229	上海银行	2,131,836.00	0.74
16	601009	南京银行	2,120,650.00	0.73
17	601939	建设银行	1,962,186.00	0.68
18	002142	宁波银行	1,766,026.00	0.61
19	601998	中信银行	1,061,697.67	0.37
20	600926	杭州银行	806,441.00	0.28

“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	600036	招商银行	31,787,632.92	10.98
2	601166	兴业银行	30,589,946.47	10.56
3	600016	民生银行	26,745,745.80	9.24
4	601328	交通银行	22,816,502.00	7.88
5	600000	浦发银行	18,577,684.54	6.41
6	601288	农业银行	17,906,368.00	6.18
7	601398	工商银行	15,145,361.38	5.23
8	601169	北京银行	14,744,109.43	5.09
9	000001	平安银行	11,801,558.19	4.08
10	601988	中国银行	10,597,084.99	3.66
11	601818	光大银行	8,678,254.00	3.00
12	600015	华夏银行	7,960,648.81	2.75
13	601939	建设银行	5,729,653.00	1.98
14	601009	南京银行	5,489,011.46	1.90
15	002142	宁波银行	5,070,085.18	1.75
16	601998	中信银行	2,634,809.00	0.91
17	600919	江苏银行	932,835.00	0.32
18	601229	上海银行	801,945.00	0.28
19	601997	贵阳银行	606,980.00	0.21
20	600926	杭州银行	287,858.00	0.10

"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	98,450,041.14
卖出股票收入(成交)总额	239,288,658.17

"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投资。

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投资。

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 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	69,403.99
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	6,683.05
5	应收申购款	103,375.00
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	179,462.04

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

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中无流通受限股票。

8.12.5.2 期末积极投资前五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积极投资股票。

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差异。

§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
银行 A 份	147	569,070.21	47,967,563.00	57.34%	35,685,758.00	42.66%
银行 B 份	1,002	83,486.35	11,049,126.00	13.21%	72,604,196.00	86.79%
中融银行	599	21,665.37	3,734,579.00	28.78%	9,242,978.46	71.22%
合计	1,748	103,137.41	62,751,268.00	34.81%	117,532,932.46	65.19%

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 期末上市基金前十名持有人

银行 A 份

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例(%)
1	中国太平洋人寿保险股份有限公司-传统-普通保险产品	15,759,985.00	18.84
2	中国银河证券股份有限公司	12,501,443.00	14.94
3	朱刚	10,823,139.00	12.94
4	中信建投证券股份有限公司	7,613,001.00	9.10
5	王磊	6,337,420.00	7.58
6	北京快快网络技术有限公司	4,102,000.00	4.90
7	林全胜	3,150,000.00	3.77
8	工银瑞信基金-招商银行-招商财富资产管理有限公司	3,000,000.00	3.59
9	工银瑞信基金-农业银行-中油财务有限责任公司	2,923,070.00	3.49
10	郑云贵	1,919,307.00	2.29

银行 B 份

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例(%)
1	深圳市排排网投资管理股份有限公司-融智广发滚雪球 1 号基金	8,000,000.00	9.56
2	姚兰	2,984,197.00	3.57
3	蒋成美	2,980,000.00	3.56
4	张同茂	1,600,015.00	1.91
5	青岛新康健啤酒开发有限公司	1,500,000.00	1.79
6	刘健	1,497,531.00	1.79
7	陈阳	1,300,000.00	1.55
8	叶素青	1,068,800.00	1.28
9	宫国文	1,021,830.00	1.22
10	赵雪冬	1,010,000.00	1.21

9.3 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	银行 A 份	0.00	–
	银行 B 份	0.00	–
	中融银行	12.20	–
	合计	12.20	–

9.4 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

	银行 A 份	银行 B 份	中融银行
基金合同生效日(2015 年 06 月 05 日)基金份额总额	–	–	259,155,997.21
本报告期期初基金份额总额	167,322,349.00	167,322,350.00	27,259,625.85
本报告期基金总申购份额	–	–	98,662,124.18
减:本报告期基金总赎回份额	–	–	286,240,346.13
本报告期基金拆分变动份额	−83,669,028.00	−83,669,028.00	173,296,153.56
本报告期期末基金份额总额	83,653,321.00	83,653,322.00	12,977,557.46

注：拆分变动份额含本基金三级份额之间的配对转换份额和基金份额折算中的调整份额。

§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

本报告期内，未改聘会计师事务所。该审计机构已经连续 3 年为本基金提供审计服务。报告期内本基金应支付给会计师事务所的报酬为 30000 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	
长江证券	1	15,129,453.50	4.48%	11,064.34	4.35%	新增 1 个交易单元
国信证券	2	37,843,401.96	11.20%	35,243.42	13.84%	新增 2 个交易单元
中信建投	2	92,346,736.18	27.34%	67,532.46	26.53%	–
银河证券	2	70,597,959.80	20.90%	51,631.28	20.28%	–
宏信证券	2	–	–	–	–	–
西藏东方财富证券	2	15,720,858.73	4.65%	11,497.19	4.52%	新增 2 个交易单元
东兴证券	2	89,015,726.15	26.36%	65,105.94	25.58%	–
海通证券	4	17,084,562.99	5.06%	12,493.20	4.91%	新增 2 个交易单元

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
长江证券	–	–	–	–	–	–	–	–
国信证券	–	–	–	–	–	–	–	–
中信建投	2,994,600.00	100.00%	–	–	–	–	–	–
银河证券	–	–	–	–	–	–	–	–
宏信证券	–	–	–	–	–	–	–	–
西藏东方财富证券	–	–	–	–	–	–	–	–
东兴证券	–	–	–	–	–	–	–	–
海通证券	–	–	–	–	–	–	–	–

中融基金管理有限公司

二〇一八年三月三十日