（上接 D81 版）

64)上海长量基金销售投资顾问有限公司
住所：上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室
办公地址：上海市浦东新区东方路 1267 号 11 层
法定代表人：张跃伟
电话：021-20691923
联系人：苗明
客服电话：400-820-2899
65)上海凯石财富基金销售有限公司
住所：上海市黄浦区西藏南路 765 号 602-115 室
办公地址：上海市黄浦区延安东路 1 号凯石大厦 4 楼
法定代表人：陈继武
电话：021-63333389
联系人：王哲宇
客服电话：400-643-3389
66)奕丰基金销售有限公司
住所：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室（入住深圳市前海商务秘书有限公司）
办公地址：深圳市南山区海德三道航天科技广场 A 座 17 楼 1704 室
法定代表人：TEO WEE HOWE
电话：0755-89460500
联系人：陈广浩
客服电话：400-684-0500
67)北京新浪仓石基金销售有限公司
住所：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2 地块新浪总部科研楼 5 层 518 室
办公地址：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期（西扩)N-1、N-2 地块新浪总部科研楼 5 层 518 室
法定代表人：李昭琛
电话：010-60619607
联系人：吴翠
客服电话：010-62675369
68)北京展恒基金销售股份有限公司
住所：北京市顺义区后沙峪镇安富街 6 号
办公地址：北京市朝阳区安苑路 15-1 号邮电新闻大厦 2 层
法定代表人：闫振杰
电话：010-59601366-7024
联系人：李露平
客服电话：400-818-8000
69)珠海盈米基金销售有限公司
住所：珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室 -3491
办公地址：广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 12 楼 B1201-1203
法定代表人：肖雯
电话：020-896290994
联系人：黄敏嫦
客服电话：020-89629066
70)北京懒猫金融信息服务有限公司
住所：北京市石景山区石景山路 31 号院盛景国际广场 3 号楼 1119
办公地址：北京市朝阳区四惠东通惠河畔产业园区 1111 号
法定代表人：许现良
客服电话：4008109580
71)一路财富(北京)基金销售股份有限公司
住所：北京市西城区阜成门外大街 2 号 1 幢 A2208 室
办公地址：北京市西城区阜成门外大街 2 号 1 幢 A2208 室
法定代表人：吴雪秀
电话：010-88312877-8028
联系人：段京璐
客服电话：400-001-1566
72)上海利得基金销售有限公司
住所：上海市宝山区蕴川路 5475 号 1033 室
办公地址：上海浦东新区峨山路 91 弄 61 号 10 号楼 12 楼
法定代表人：李兴春
客服电话：400-921-7733
73)深圳富济基金销售有限公司
住所：深圳市福田区福田街道金田路中洲大厦 35 层 01B、02、03、04 单位
法定代表人：刘鹏宇
电话：0755-83999907-815
联系人：马力佳
客服电话：0755-83999907
74)北京广源达信基金销售有限公司
住所：北京市西城区新街口外大街 28 号 C 座六层 605 室
办公地址：北京市朝阳区望京东园四区浦项中心 B 座 19 层
法定代表人：齐剑辉
客服电话：400-623-6060
75)上海云湾基金销售有限公司
住所：中国（上海）自由贸易试验区新金桥路 27 号 13 号楼 2 层
办公地址：中国（上海）自由贸易试验区新金桥路 27 号 13 号楼 2 层
法定代表人：桂水发
电话：021-20530224
联系人：江辉
客服电话：400-820-1515
76)上海联泰基金销售有限公司
住所：中国（上海）自由贸易试验区富特北路 277 号 3 层 310 室
办公地址：上海市长宁区福泉北路 518 号 8 号楼 3 层
法定代表人：燕斌
电话：021-52822063
联系人：兰敏
客服电话：400-118-1188
77)北京电盈基金销售有限公司
住所：北京市朝阳区呼家楼(京广中心)1 号楼 36 层 3603 室
办公地址：北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 F 座 12 层 B 室
法定代表人：曲馨月
电话：010-56176118
联系人：张旭
客服电话：400-100-3391
78)深圳前海凯恩斯基金销售有限公司
住所：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）
办公地址：深圳市福田区福华路 355 号岗厦皇庭中心 8 楼 DE
法定代表人：高锋
电话：0755-82880158
联系人：廖嘉琦
客服电话：400-804-8688
79)深圳前海财厚基金销售有限公司
住所：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）
办公地址：深圳市南山区南山大道 1088 号南园枫叶大厦 15 层 15K 室
法定代表人：杨艳平
电话：0755-86575665
联系人：李军
客服电话：0755-86575665
80)泰诚财富基金销售(大连)有限公司
住所：辽宁省大连市沙河口区星海中龙园 3 号
办公地址：辽宁省大连市沙河口区星海中龙园 3 号
法定代表人：林卓
电话：0411-88891212
联系人：徐江
客服电话：400-0411-001
81)上海万得基金销售有限公司
住所：中国（上海）自由贸易试验区福山路 33 号 11 楼 B 座
办公地址：上海市浦东新区福山路 33 号 8 楼
法定代表人：王廷富
电话：021-51327185
联系人：徐亚丹
客服电话：400-799-1888
82)北京汇成基金销售有限公司
住所：北京市海淀区中关村大街 11 号 E 世界财富中心 A 座 11 层 1108 号
办公地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 E 世界财富中心 A 座 11 层
法定代表人：王伟刚
客服电话：400-619-9059
83)深圳市金斧子基金销售有限公司
住所：深圳市南山区粤海街道科技园中区科苑路 15 号科兴科学园 B 栋 3 单元 11 层
办公地址：深圳市南山区粤海街道科技园中区科苑路 15 号科兴科学园 B 栋 3 单元 7 层
法定代表人：赖任军
电话：0755-29330513
联系人：刘昕霞
客服电话：400-9302-888
84)北京肯特瑞基金销售有限公司
住所：北京市海淀区中关村东路 66 号 1 号楼 22 层 2603-06
办公地址：北京市大兴区亦庄经济开发区科创十一街 18 号院京东集团总部
法定代表人：江卉
客服电话：95118
85)北京君德汇富基金销售有限公司
住所：北京市东城区建国门内大街 18 号 4 层办公楼二座 414
办公地址：北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 F 座 12 层 B 室
法定代表人：李振
电话：010-51455516
联系人：周雯
客服电话：400-829-1218
86)天津万家财富资产管理有限公司
住所：天津自贸区（中心商务区）迎宾大道 1988 号滨海浙商大厦公寓 2-2413 室
办公地址：北京市西城区丰盛胡同 28 号太平洋保险大厦 5 层
法定代表人：李修辞
电话：010-5901384
联系人：王芳芳
客服电话：010-59013842
87)上海大智慧基金销售有限公司
住所：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 428 号 1 号楼 1102 单元
办公地址：上海市浦东新区杨高南路 428 号 1 号楼 1102、1103 单元
法定代表人：申健
电话：021-20219188
联系人：印强明
客服电话：021-20292031
88)和讯信息科技有限公司
住所：北京市朝阳区朝外大街 22 号 1002 室
办公地址：北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层
法定代表人：王莉
客服电话：400-920-0022
89)上海基煜基金销售有限公司
住所：上海市崇明县长兴镇路潘园公路 1800 号 2 号楼 6153 室（上海泰和经济发展区）
办公地址：上海市浦东新区银城中路 488 号的太平金融大厦 1503-1504 室
法定代表人：王翔
电话：021-65370077-209
联系人：俞申莉
客服电话：400-820-5369
90)凤凰金信(银川)基金销售有限公司
住所：宁夏银川市金凤区阅海湾中央商务区万寿路 142 号 14 层 1402 办公用房
办公地址：北京市朝阳区紫月路 18 号院朝来高科技产业园 18 号楼
法定代表人：张旭
客服电话：400-810-5919
91)南京苏宁基金销售有限公司
住所：南京市玄武区苏宁大道 1-5 号
办公地址：南京市玄武区苏宁大道 1-5 号
法定代表人：王锋
客服电话：95177
92)深圳盈信基金销售有限公司
住所：深圳市福田区莲花街道商报东路英龙商务大厦 8 楼 A-1（811-812）
办公地址：大连市中山区南山 1910 小区 A3-1
法定代表人：苗宏升
电话：0411-66661322
联系人：王清臣
客服电话：4007-903-688
93)乾道盈泰基金销售(北京)有限公司
住所：北京市西城区德胜门外大街 13 号院 1 号楼 1302
办公地址：北京市西城区德胜门外大街合生财富广场 1302 室
法定代表人：王兴吉
电话：18500501595
联系人：宋子琪
客服电话：400-088-8080
94)北京蛋卷基金销售有限公司
住所：北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层 222507
办公地址：北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层 222507
法定代表人：钟斐斐
电话：010-61840688
联系人：戚晓强
客服电话：400-159-9288
95)武汉市伯嘉基金销售有限公司
住所：湖北省武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际 SOHO 城（一期）第 7 栋 23 层 1 号、4 号
办公地址：湖北省武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际 SOHO 城（一期）第 7 栋 23 层 1 号、4 号
法定代表人：陶捷
客服电话：4000-027-9899
96)天津国美基金销售有限公司
住所：天津经济技术开发区第一大街 79 号 MSDC1-28 层 2801
办公地址：北京市朝阳区霄云路 26 号鹏润大厦 B 座 9 层
法定代表人：丁东华
电话：010-59287105
联系人：许艳
客服电话：400-111-0889
97)北京格上富信基金销售有限公司
住所：北京市朝阳区东三环北路 19 号楼 701 内 09 室
办公地址：北京市朝阳区东三环北路 19 号楼 701 内 09 室
法定代表人：李悦章
电话：010-85594745
联系人：张林
客服电话：400-066-8586
98)上海挖财基金销售有限公司
住所：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 5 层 01、02、03 室
办公地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 5 层 01、02、03 室
法定代表人：冷飞
客服电话：021-50810673
99)上海华夏财富投资管理有限公司
住所：上海市虹口区东大名路 687 号 1 幢 2 楼 268 室
办公地址：北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 16 层
法定代表人：毛淮平
客服电话：400-817-5666
100)中民财富基金销售(上海)有限公司
住所：上海市黄浦区中山南路 100 号 7 层 05 单元
办公地址：上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 27 层
法定代表人：弭洪军
客服电话：400-876-5716
101)深圳信诚基金销售有限公司
住所：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）
办公地址：深圳市福田区时代财富大厦第 49A 单元
法定代表人：周文
客服电话：0755-23946579
102)喜鹊财富基金销售有限公司
住所：西藏拉萨市柳梧新区柳梧大厦 1513 室
办公地址：西藏拉萨市柳梧新区柳梧大厦 1513 室
法定代表人：陈皓
客服电话：4006997719
103)通华财富(上海)基金销售有限公司
住所：上海市虹口区同丰路 667 弄 107 号 201 室
办公地址：上海市浦东新区陆家嘴世纪金融广场杨高南路 799 号 3 号楼 9 楼
法定代表人：马刚
客服电话：95156
104)沈阳麟龙投资顾问有限公司
住所：辽宁省沈阳市东陵区白塔二南街 18-2 号 B 座 601
办公地址：辽宁省沈阳市东陵区白塔二南街 18-2 号 B 座 601
法定代表人：朱荣晖
联系人：陈巧玲
客服电话：400-003-5811
105)厦门市鑫鼎盛控股有限公司
住所：厦门市思明区鹭江道 2 号厦门第一广场西座 1501-1504 室
法定代表人：陈洪生
客服电话：400-918-0808
106)中证金牛(北京)投资咨询有限公司
住所：北京市丰台区东管头 1 号 2 号楼 2-45 室
办公地址：北京市西城区宣武门外大街甲 1 号环球财讯中心 A 座 5 层
法定代表人：钱昊旻
电话：010-59336593
联系人：徐荣
客服电话：4008-909-998
107)贵州省贵文文化基金销售有限公司
住所：贵州省贵阳市南明区龙洞堡电子商务港太升国际 A 栋 2 单元 5 层 17 号
办公地址：贵州省贵阳市南明区兴业西路 CCDI 大楼一楼
法定代表人：陈成
电话：0851-85407888
联系人：黄笛
客服电话：0851-85407888
108)济安财富(北京)基金销售有限公司
住所：北京市朝阳区太阳宫中路 16 号院 1 号楼 3 层 307
办公地址：北京市朝阳区太阳宫中路 16 号院 1 号楼 3 层 307
法定代表人：杨健
电话：010-65309516
联系人：李海燕
客服电话：400-673-7010
109)嘉实财富管理有限公司
住所：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号上海国金中心办公楼二期 53 层 5312-15 单元
办公地址：北京市朝阳区建国路 91 号金地中心 A 座 6 层
法定代表人：赵学军
电话：010-85097570
联系人：余永键
客服电话：400-021-8850
110)宜信普泽(北京)基金销售有限公司
住所：北京市朝阳区建国路 88 号 9 号楼 15 层 1809
办公地址：北京市朝阳区建国路 88 号 SOHO 现代城 C 座 1809
法定代表人：戎兵
电话：010-52858244
联系人：魏晨
客服电话：400-6099-200
111)和耕传承基金销售有限公司
住所：河南自贸试验区郑州片区（郑东）东风东路东、康宁街北 6 号楼 6 楼 602、603 房间
办公地址：北京市朝阳区酒仙桥路 6 号国际电子城 360 大厦 A 座
法定代表人：王旋
联系人：董亚芳
客服电话：4000-555-671
112)民商基金销售(上海)有限公司
办公地址：上海市浦东新区张杨路 707 号生命人寿大厦 32 楼
法定代表人：贲惠琴
联系人：童筱爽
客服电话：021-50206003
113)大河财富基金销售有限公司
住所：贵州省贵阳市南明区新华路 110-134 号富中国际广场 1 栋 20 层 1.2 号
法定代表人：王荻
客服电话：0851-88235678
114)大连网金基金销售有限公司
住所：辽宁省大连市沙河口区体坛路 22 号诺德大厦 2 层 202 室
法定代表人：樊怀东
客服电话：4000899100
115)中信期货有限公司
住所：深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层 1301-1305 室、14 层
办公地址：深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场(二期)北座 13 层 1301-1305 室、14 层
法定代表人：张皓
电话：13718246886/010-60834022
联系人：刘宏莹
客服电话：400-990-8826
116)东海期货有限责任公司
住所：江苏省常州市延陵西路 23、25、27、29 号
办公地址：上海市浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦 8 楼
法定代表人：陈太康
电话：021-68757102
联系人：李天雨
客服电话：95531/4008888588
117)大有期货有限公司
住所：湖南省长沙市天心区芙蓉南路二段 128 号现代广场三、四楼
办公地址：湖南省长沙市天心区芙蓉南路二段 128 号现代广场三、四楼
法定代表人：颜如意
电话：0731-84409106、0731-84409130
联系人：马科、王霞
客服电话：4006-365-058
基金管理人可根据有关法律法规的要求增加、更换其他机构销售本基金，并及时公告。

二、注册登记机构
名称：中融基金管理有限公司
住所：深圳市福田区莲花街道益田路 6009 号新世界中心 29 层
办公地址：北京市朝阳区东风南路 3 号院中融信托北京园区 C 座 4 层、5 层
法定代表人：王瑶
电话：010-56517000
传真：010-56517001
联系人：黎峰
网址：www.zrfunds.com.cn

三、出具法律意见书的律师事务所
名称：北京市众一律师事务所
住所：北京市东城区东四十条甲 22 号南新仓国际大厦 A 座 502 室
办公地址：北京市东城区东四十条甲 22 号南新仓国际大厦 A 座 502 室
负责人：云大慧
电话：010-64096085
传真：010-64096188
联系人：唐琨
经办律师：云大慧、唐琨

四、审计基金资产的会计师事务所
名称：上会会计师事务所
住所：上海市静安区威海路 755 号文新报业大厦 25 楼
办公地址：上海市静安区威海路 755 号文新报业大厦 25 楼
执行事务合伙人：张晓荣（首席合伙人）
电话：021-52920000
传真：021-52921369
经办注册会计师：张健、江嘉炜
联系人：杨伟平

第四部分 基金的名称

中融新机遇灵活配置混合型证券投资基金

第五部分 基金类型、运作方式与存续期间

1. 基金类型：混合型。
2. 基金的运作方式：契约型开放式。
3. 基金存续期间：不定期。

第六部分 基金的投资目标

本基金通过积极优选具备利润创造能力并且估值水平具备竞争力的优势上市公司，同时通过优化风险收益配比来追求绝对收益，力求实现基金资产的长期稳定增值。

第七部分 基金的投资范围

本基金的投资对象是具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证、股指期货等权益类金融工具，以及债券等固定收益类金融工具（包括国债、金融债券、地方政府债、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据、企业债券、公司债券、可转换公司债券（含可分离交易可转债）、中小企业私募债券、资产支持证券、次级债、债券回购、银行存款、货币市场工具等）、国债期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例范围为 0-95%；权证投资比例为基金资产净值的 0-3%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

股指期货、国债期货的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

第八部分 基金的投资策略

1. 大类资产配置

从宏观经济环境和证券市场走势进行研判，结合考虑相关类别资产的风险收益水平，动态调整股票、债券、货币市场工具等资产的配置比例，优化投资组合。

2. 股票投资策略

本基金采用自上而下与自下而上相结合的选股策略，从宏观经济转型、政策制度导向、产业的升级与变革等多个角度，前瞻性地判断下一阶段可能涌现出的新机遇领域和板块，同时从定性和定量的角度，自下而上地分析上市公司的基本面情况和估值水平，精选受益于“新机遇”具有投资价值的个股。

在行业的配置选择上，本基金将持续跟踪、研究分析受益于新机遇发展的典型产业，选择其中受益程度高、成长性好的相关主题行业进行重点配置，并积极更新调整新机遇主题的范畴界定。

在个股的具体选择策略上，采取自下而上的方式，主要从定量分析、定性分析两个方面对上市公司进行考察，精选个股。并根据市场走势与上市公司基本面的变化，适时调整股票投资组合。

定量分析

（1）成长性指标：主营业务收入增长率、净利润增长率等；

（2）财务指标：毛利率、营业利润率、净利率、净资产收益率、经营活动净收益 / 利润总额等；

（3）估值指标：市盈率（PE）、市盈率相对盈利增长比率（PEG）、市销率（PS）和总市值。绝对估值与相对估值相结合。

定性分析

（1）公司的核心竞争力，体现在行业地位、市场占有率、产品、技术、品牌、营销、资源、渠道等多个方面；

（2）具有良好的公司管理能力和治理结构。

3. 债券投资策略

通过对宏观经济趋势、金融货币政策、供求因素、估值因素、市场行为因素等进行评估分析，对固定收益类资产和货币资产等的预期收益进行动态跟踪，从而决定其配置比例。固定收益类资产中，本基金将采取久期管理、收益率曲线策略、类属配置等积极投资策略，在不同券种之间进行配置。

4. 股指期货投资策略

本基金认为在符合一定条件的市场环境中，有必要审慎灵活地综合运用股指期货进行套期保值交易来对冲系统性风险、降低投资组合波动性并提高资金管理效率。本基金在股指期货投资中将以控制风险为原则，以套期保值为目的，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，并按照中国金融期货交易所套期保值管理的有关规定执行。

本基金参与股指期货套期时将综合考虑：

（1）股指期货交易品种的流动性；

（2）股指期货交易品种与现货市场的相关度；

（3）通过股指期货进行套期保值交易的必要性；

（4）股指期货套期保值交易的综合成本，来判断是否进行套期保值交易或套期保值的合理对冲比率。

5. 中小企业私募债券投资策略

本基金对中小企业私募债的投资综合考虑安全性、收益性和流动性等方面特征进行全方位的研究和比较，对个券发行主体的性质、行业、经营情况、以及债券的增信措施等进行全面分析，选择具有优势的品种进行投资，并通过久期控制和调整，适度分散投资来管理组合的风险。

6. 资产支持证券投资策略

资产支持证券主要包括资产抵押贷款支持证券（ABS）、住房抵押贷款支持证券（MBS）等证券品种。本基金将重点对市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等影响资产支持证券价值的因素进行分析，并辅助采用数量化定价模型，评估资产支持证券的相对投资价值并做出相应的投资决策。

第九部分 基金的业绩比较基准

沪深 300 指数收益率 ×55%+ 上证国债指数收益率 ×45%

第十部分 基金的风险收益特征

本基金为混合型基金，预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于证券投资基金中的中高风险和中高预期收益产品。

第十一部分 基金的投资组合报告

本基金管理人董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对本报告内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金基金合同规定，于 2018 年 12 月 6 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。本投资组合报告所载数据截至 2018 年 9 月 30 日，本报告中所列财务数据未经审计。

1、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	69,148,793.99	66.69
	其中：股票	69,148,793.99	66.69
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	6,400,172.00	6.17
	其中：债券	6,400,172.00	6.17
	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	28,002,119.82	27.01
8	其他资产	137,597.78	0.13
9	合计	103,688,683.59	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

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、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	54,131,388.32	52.38
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	4,396,738.00	4.25
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,851,294.67	3.73
J	金融业	2,740,000.00	2.65
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	2,249,373.00	2.18
R	文化、体育和娱乐业	1,780,000.00	1.72
S	综合	-	-
	合计	69,148,793.99	66.91

3、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	40,000	2,740,000.00	2.65
2	000596	古井贡酒	27,900	2,322,117.00	2.25
3	002507	涪陵榨菜	89,100	2,321,055.00	2.25
4	600872	中炬高新	70,100	2,285,260.00	2.21
5	603288	海天味业	28,628	2,267,337.60	2.19
6	600519	贵州茅台	3,100	2,263,000.00	2.19
7	300015	爱尔眼科	69,748	2,249,373.00	2.18
8	600566	济川药业	56,700	2,233,413.00	2.16
9	600779	水井坊	54,400	2,224,960.00	2.15
10	300577	开润股份	67,060	2,212,980.00	2.14

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	6,400,172.00	6.19
	其中：政策性金融债	6,400,172.00	6.19
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	-	-
9	其他	-	-
10	合计	6,400,172.00	6.19

5、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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	018005	国开 1701	63,620	6,400,172.00	6.19

6、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

7、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、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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

9、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。

10、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。

11、投资组合报告附注

11.1 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。

11.2 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。

11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	16,289.05
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	121,308.73
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	137,597.78

11.4 报告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。

11.5 报告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。

11.6 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。

第十二部分 基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。基金业绩数据截至 2018 年 9 月 30 日。

本基金合同生效日为 2015 年 5 月 4 日，基金合同生效以来基金投资业绩与同期业绩比较基准的比较如下表所示：

一、本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
自基金合同生效日（2015 年 5 月 4 日）起至 2015 年 12 月 31 日	1.50%	0.16%	-9.43%	1.52%	10.93%	-1.36%
2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	-2.96%	0.38%	-7.52%	1.01%	4.56%	-0.63%
2016 年 7 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	1.32%	0.18%	3.40%	0.42%	-2.08%	-0.24%
2017 年 1 月 1 日至 2017 年 3 月 31 日	0.30%	0.18%	6.03%	0.31%	-5.73%	-0.13%
2017 年 7 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	-0.20%	0.23%	5.55%	0.39%	-5.75%	-0.16%
2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	-1.10%	0.32%	-5.94%	0.64%	4.84%	-0.32%
2018 年 7 月 1 日至 2018 年 9 月 30 日	-5.97%	0.95%	-0.59%	0.75%	-5.38%	0.20%

二、自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注：按照基金合同和招募说明书的约定，本基金自基金合同生效日起 6 个月内为建仓期，建仓期结束时本基金的各项投资比例符合基金合同的有关约定。

第十三部分 基金的费用与税收

一、基金费用的种类

1. 基金管理人的管理费；
2. 基金托管人的托管费；
3. 基金合同生效后与基金相关的信息披露费用；
4. 基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费、仲裁等法律费用；
5. 基金份额持有人大会费用；
6. 基金的证券交易费用、证券账户开户费；
7. 基金的银行汇划费用；
8. 基金的开户费用、账户维护费用；
9. 按照国家有关规定和基金合同约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1. 基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.50%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H=E×1.50%÷当年天数

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，基金管理人与基金托管人核对一致后，以双方认可的方式于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

H=E×0.25%÷当年天数

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，基金管理人与基金托管人核对一致后，以双方认可的方式于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

上述“一、基金费用的种类中第 3-9 项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

1. 基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；
2. 基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
3. 基金合同生效前的相关费用；
4. 其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

四、费用调整

基金管理人和基金托管人协商一致后，可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率等相关费率。

调高基金管理费率、基金托管费率或基金销售费率等费率，须召开基金份额持有人大会审议；调低基金管理费率、基金托管费率或基金销售费率等费率，无须召开基金份额持有人大会。

基金管理人必须最迟于新的费率实施日前在指定媒介上公告。

五、基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

第十四部分 对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他有关法律法规的要求，对本基金的招募说明书进行了更新，主要更新内容如下：

（一）更新了“重要提示”中的相关内容。

（二）更新了“第二部分 释义”中的相关内容。

（三）更新了“第三部分 基金管理人”中的相关内容。

（四）更新了“第四部分 基金托管人”中的相关内容。

（五）更新了“第五部分 相关服务机构”中的相关内容。

（六）更新了“第九部分 基金的投资”中的相关内容。

（七）更新了“第十部分 基金的业绩”中的相关内容。

（八）更新了“第二十部分 托管协议的内容摘要”中的相关内容。

（九）更新了“第二十二部分 其他应披露事项”中的相关内容。

中融基金管理有限公司
2018 年 12 月 18 日