

1998, 1999, 2000, 2001, 2002, 2003, 2004, 2005, 2006, 2007, 2008, 2009, 2010, 2011, 2012, 2013, 2014, 2015, 2016, 2017, 2018, 2019, 2020, 2021, 2022, 2023, 2024, 2025, 2026, 2027, 2028, 2029, 2030, 2031, 2032, 2033, 2034, 2035, 2036, 2037, 2038, 2039, 2040, 2041, 2042, 2043, 2044, 2045, 2046, 2047, 2048, 2049, 2050, 2051, 2052, 2053, 2054, 2055, 2056, 2057, 2058, 2059, 2060, 2061, 2062, 2063, 2064, 2065, 2066, 2067, 2068, 2069, 2070, 2071, 2072, 2073, 2074, 2075, 2076, 2077, 2078, 2079, 2080, 2081, 2082, 2083, 2084, 2085, 2086, 2087, 2088, 2089, 2090, 2091, 2092, 2093, 2094, 2095, 2096, 2097, 2098, 2099, 2100, 2101, 2102, 2103, 2104, 2105, 2106, 2107, 2108, 2109, 2110, 2111, 2112, 2113, 2114, 2115, 2116, 2117, 2118, 2119, 2120, 2121, 2122, 2123, 2124, 2125, 2126, 2127, 2128, 2129, 2130, 2131, 2132, 2133, 2134, 2135, 2136, 2137, 2138, 2139, 2140, 2141, 2142, 2143, 2144, 2145, 2146, 2147, 2148, 2149, 2150, 2151, 2152, 2153, 2154, 2155, 2156, 2157, 2158, 2159, 2160, 2161, 2162, 2163, 2164, 2165, 2166, 2167, 2168, 2169, 2170, 2171, 2172, 2173, 2174, 2175, 2176, 2177, 2178, 2179, 2180, 2181, 2182, 2183, 2184, 2185, 2186, 2187, 2188, 2189, 2190, 2191, 2192, 2193, 2194, 2195, 2196, 2197, 2198, 2199, 2200, 2201, 2202, 2203, 2204, 2205, 2206, 2207, 2208, 2209, 2210, 2211, 2212, 2213, 2214, 2215, 2216, 2217, 2218, 2219, 2220, 2221, 2222, 2223, 2224, 2225, 2226, 2227, 2228, 2229, 2230, 2231, 2232, 2233, 2234, 2235, 2236, 2237, 2238, 2239, 2240, 2241, 2242, 2243, 2244, 2245, 2246, 2247, 2248, 2249, 2250, 2251, 2252, 2253, 2254, 2255, 2256, 2257, 2258, 2259, 2260, 2261, 2262, 2263, 2264, 2265, 2266, 2267, 2268, 2269, 2270, 2271, 2272, 2273, 2274, 2275, 2276, 2277, 2278, 2279, 2280, 2281, 2282, 2283, 2284, 2285, 2286, 2287, 2288, 2289, 2290, 2291, 2292, 2293, 2294, 2295, 2296, 2297, 2298, 2299, 2300, 2301, 2302, 2303, 2304, 2305, 2306, 2307, 2308, 2309, 2310, 2311, 2312, 2313, 2314, 2315, 2316, 2317, 2318, 2319, 2320, 2321, 2322, 2323, 2324, 2325, 2326, 2327, 2328, 2329, 2330, 2331, 2332, 2333, 2334, 2335, 2336, 2337, 2338, 2339, 2340, 2341, 2342, 2343, 2344, 2345, 2346, 2347, 2348, 2349, 2350, 2351, 2352, 2353, 2354, 2355, 2356, 2357, 2358, 2359, 2360, 2361, 2362, 2363, 2364, 2365, 2366, 2367, 2368, 2369, 2370, 2371, 2372, 2373, 2374, 2375, 2376, 2377, 2378, 2379, 2380, 2381, 2382, 2383, 2384, 2385, 2386, 2387, 2388, 2389, 2390, 2391, 2392, 2393, 2394, 2395, 2396, 2397, 2398, 2399, 2400, 2401, 2402, 2403, 2404, 2405, 2406, 2407, 2408, 2409, 2410, 2411, 2412, 2413, 2414, 2415, 2416, 2417, 2418, 2419, 2420, 2421, 2422, 2423, 2424, 2425, 2426, 2427, 2428, 2429, 2430, 2431, 2432, 2433, 2434, 2435, 2436, 2437, 2438, 2439, 2440, 2441, 2442, 2443, 2444, 2445, 2446, 2447, 2448, 2449, 2450, 2451, 2452, 2453, 2454, 2455, 2456, 2457, 2458, 2459, 2460, 2461, 2462, 2463, 2464, 2465, 2466, 2467, 2468, 2469, 2470, 2471, 2472, 2473, 2474, 2475, 2476, 2477, 2478, 2479, 2480, 2481, 2482, 2483, 2484, 2485, 2486, 2487, 2488, 2489, 2490, 2491, 2492, 2493, 2494, 2495, 2496, 2497, 2498, 2499, 2500, 2501, 2502, 2503, 2504, 2505, 2506, 2507, 2508, 2509, 2510, 2511, 2512, 2513, 2514, 2515, 2516, 2517, 2518, 2519, 2520, 2521, 2522, 2523, 2524, 2525, 2526, 2527, 2528, 2529, 2530, 2531, 2532, 2533, 2534, 2535, 2536, 2537, 2538, 2539, 2540, 2541, 2542, 2543, 2544, 2545, 2546, 2547, 2548, 2549, 2550, 2551, 2552, 2553, 2554, 2555, 2556, 2557, 2558, 2559, 2560, 2561, 2562, 2563, 2564, 2565, 2566, 2567, 2568, 2569, 2570, 2571, 2572, 2573, 2574, 2575, 2576, 2577, 2578, 2579, 2580, 2581, 2582, 2583, 2584, 2585, 2586, 2587, 2588, 2589, 2590, 2591, 2592, 2593, 2594, 2595, 2596, 2597, 2598, 2599, 2600, 2601, 2602, 2603, 2604, 2605, 2606, 2607, 2608, 2609, 2610, 2611, 2612, 2613, 2614, 2615, 2616, 2617, 2618, 2619, 2620, 2621, 2622, 2623, 2624, 2625, 2626, 2627, 2628, 2629, 2630, 2631, 2632, 2633, 2634, 2635, 2636, 2637, 2638, 2639, 2640, 2641, 2642, 2643, 2644, 2645, 2646, 2647, 2648, 2649, 2650, 2651, 2652, 2653, 2654, 2655, 2656, 2657, 2658, 2659, 2660, 2661, 2662, 2663, 2664, 2665, 2666, 2667, 2668, 2669, 2670, 2671, 2672, 2673, 2674, 2675, 2676, 2677, 2678, 2679, 26

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	128024	宁行转债	15,000	1,569,150.00	1.45
2	123006	东财转债	8,000	962,160.00	0.89
3	110042	航电转债	5,000	525,750.00	0.48
4	126028	德棉转债	5,000	519,850.00	0.48
5	435044	宏开转债	8,000	807,200.00	0.75

7.7 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。

7.8 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。

7.9 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。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资于股指期货投资比例, 若本基金投资股指期货, 本基金在任何交易日终, 其持有的买入股指期货合约价值, 不得超过上一交易日基金资产净值的 10%; 持有的卖出股指期货合约价值不得超过本基金持有的股票总市值的 20%; 本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值, 合计不得超过基金资产净值的 95%; 本基金在任何交易日终, 其持有的股指期货合约价值不得超过基金资产净值的 10%。

本基金在进行股指期货投资时, 将通过中证市场和期货市场流行趋势的研究, 并结合股指期货的估值模型, 其合理的估值水平。

本基金管理人将充分考量股指期货的收益性、流动性及风险特征, 通过资产配置、品种选择, 谨慎进行投资, 以降低投资组合的整体风险。

法律法规对于本基金股指期货投资的投资策略另有规定的, 本基金将按照法律法规的规定执行。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

根据本基金基金合同, 本基金不能投资于国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.1.21 本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体(除“南商银行”公告其分行违规外)均未被监管部门立案调查或在报告期内因一年受到公开谴责、主要的违规。

根据 2016 年 1 月 30 日南商银行发布的公告,公司截止发行收到中国银监会江苏监管局行政处罚,根据 2016 年 2 月 16 日南商银行公告的处罚,公司截止发行收到中国银监会江苏监管局行政处罚,根据 2016 年 2 月 16 日南商银行公告的处罚,公司截止发行收到中国银监会江苏监管局行政处罚,根据 2016 年 2 月 16 日南商银行公告的处罚,公司截止发行收到中国银监会江苏监管局行政处罚。

情况发生后,本基金管理人就上述公司受处罚事件进行了及时分析和研究,认为上述公司存在的违规问题对经济环境和现金流未产生重大的实质影响,对该公司股票价值并未产生实质影响,本基金管理人将继续对该公司进行跟踪研究。

7.1.22 基金投资的前十名股票中,没有投资于中国证监会公开规定该股票属于之的情况。

7.1.23 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	应收利息	
2	应收股利	23,961.66

4	应收账款		-
4	应收利息		31,265.84
5	应收账款坏账准备		3,639.29
6	其他应收款		-
7	预付账款		-
8	其他		-
9	合计		58,265.65

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占合并资产总额比例(%)
1	128024	中行转债	1,569,150.00	1.45
2	123005	东财转债	962,150.00	0.89
3	110942	康拓转债	525,750.00	0.48
4	123029	鼎信转债	518,000.00	0.48
5	123013	鼎信转债	616,800.00	0.57

6	113013	国寿证券	506,550.00	0.47
7	110040	民生证券	497,800.00	0.46
8	113034	格林证券	451,200.00	0.43

7.12.5 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	流通受限部分占总市值	占基金资产净值比例(%)	流通受限说明
1	601565	东方食品	2,696,827.44	2.87	股票中止

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

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	占基金份额比例	持有份额	占基金份额比例
2,344	35,483.28	0.00	0.00%	83,172,899.01	100.00%

8.2 期末基金管理人从从业人员持有本基金的情况

项目	持有基金份额总额(亩)	占基金份额总额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	0.00	0.00%

8.3 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的情况

项目	持有基金份额总量的区间(亩)
----	----------------

本公司高级管理人员、基金托管人和相关中介机构及其从业人员持有基金份额的情况	0
基金基金管理人持有本基金基金份额	0

9 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日至 2017 年 5 月 15 日: 基金份额总额	124,777,296.87
基金总申购份额	125,651,046.81
本期赎回基金份额总额	15,441,802.17
期末本开放式基金基金份额总额	52,980,535.71
本期净申购基金份额	52,980,535.71
本期应支付基金申购费用	-
本期应支付基金赎回费用	-
本期应支付基金销售服务费	83,172,808.91

10 重大事件揭示

50.4 基金份额持有人大会决议

报告期内,本基金无基金份额持有人重大决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门发生重大人事变动

本报告期内本基金管理人未发生重大人事变动。

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。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务诉讼

报告期内,本基金未涉及对公司运营管理及基金运作产生重大影响的与本基金管理人、基金财产、基金托管业务相关的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的重大变更

报告期内,本基金投资策略无重大变更。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同成立以来聘请普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)提供审计服务。

10.6 管理人、托管人及基金高级管理人员是否被监管机构处罚

本报告期内,基金管理人、基金托管人及其高级管理人员均未受相关处罚。

10.7 基金租用证券公司交易席位有关情况

券商名称	交易单元数量	股票交易		印支付证券交易的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金的比例	
华安公司	1	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	-

光大证券	1	15,900,025.18	16.99%	25.58%	16.94%
招商证券	1	15,000,390.80	22.23%	14,050.92	22.91%
恒泰证券	1	4,977,599.84	5.80%	4,655.58	7.71%
东北证券	1	2,532,438.13	2.69%	1,801.42	2.64%
中泰证券	1	2,110,855.20	2.48%	1,504.47	2.23%
太平洋证券	2	1,996,040.09	2.35%	1,421.29	2.24%
西藏证券	1	1,856,520.15	1.12%	1,357.89	2.14%
国元证券	1	953,283.16	2.18%	920.83	1.69%

3、基金仓位使用的选择标准是：

- (1) 流动性强、信誉良好；
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (3) 经营行为规范，在最近一年内无重大违规经营行为；
- (4) 内部控制管理严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- (5) 公司具有足够的研究能力，能及时、充分掌握行业和公司相关的关于宏观经济部分分析、行业发展趋势及资本市场走向，个股分析的研究以及关于基金仓位使用的信息，根据基金仓位的特点，确定个股/行业配置。

4、投资程序是：根据各上市公司提供的各项资料，经服务小组的评估筛选，经交易员提供信用标准

金麒麟单位：人民币元						
券商名称	债券交易		股票交易		衍生品交易	
	成交金额	占当期债券买卖成交总额的占比	成交金额	占当期股票买卖成交总额的占比	成交金额	占当期衍生品买卖成交总额的占比
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	194,880.00	3.08%	-	-	-	-
光大证券	3,318,038.50	55.25%	-	-	-	-
光大证券	2,794,028.10	44.22%	-	-	-	-
招商证券	-	-	8,000,000.00	34.78%	-	-
光大证券	-	-	15,000,000.00	65.22%	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	10,769.00	0.17%	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-

影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化区间				报告期末持有基金份额	
	序号	持有基金份额比例达到或超过 20% 的区间/时点	期初份额	期初份额	期末份额	金额占比
机构	1	2018 年 1 月 31 日至 2018 年 5 月 22 日	13,563,713.71	13,276,713.71	26,774,450.27	0.00

产品净值波动

基金业绩评价者认为,以上过了集中时,可能会影响单一基金净值,但本基金因涉及基金份额净值波动较大,基金净值波动风险相对固定,风险。