中融沪港深大消费主题灵活配置混合型发起式证券投资基金 2018年年度报告摘要

基金管理人:中融基金管理有限公司
基金托管人:国泰君安证券股份有限公司
送出日期:2019年03月28日

§1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经全体独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人国泰君安证券股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年3月27日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中的财务资料经审计,上会会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了无保留意见的审计报告,请投资者注意阅读。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告期自2018年1月1日起至2018年12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	中融沪港深大消费主题	
基金主代码	005142	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017年11月16日	
基金管理人	中融基金管理有限公司	
基金托管人	国泰君安证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	182,347,280.63份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中融沪港深大消费主题A	中融沪港深大消费主题C
下属分级基金的交易代码	005142	005143
报告期末下属分级基金的份额总额	86,833,223.78份	95,514,056.85份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于大消费行业中具有持续增长潜力的优质上市公司,以把握中国经济增长以及结构转型带来的消费升级过程中的投资机会,在严格控制风险的条件下,追求超越业绩比较基准的投资回报,力争实现基金资产的中长期稳定增值。
投资策略	1. 大类资产配置 2. 股票投资策略 (1)大消费主题的定义 (2)个股投资策略 3. 债券投资策略 4. 股指期货投资策略 5. 中小企业私募债券投资策略 6. 资产支持证券投资策略 7. 国债期货投资策略
业绩比较基准	沪深300指数收益率×10%+恒生指数收益率×40%+上证国债指数收益率×50%
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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		中融基金管理有限公司	国泰君安证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	周妹云	王健
	联系电话	010-56517129	(021)38676252
	电子邮箱	zhoumeiyun@zrfunds.com.cn	wangj222@gtjas.com
客户服务电话		400-160-6000;010-56517299	95521
传真		010-56517001	(021)38677819

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.zrfunds.com.cn/
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	上会会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市静安区威海路755号文新报业大厦25楼
注册登记机构	中融基金管理有限公司	北京市朝阳区东风南路3号院中国信托北京园区C座4层、5层

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2018年		2017年11月16日(基金合同生效日)-2017年12月31日	
	中融沪港深大消费主题A	中融沪港深大消费主题C	中融沪港深大消费主题A	中融沪港深大消费主题C
本期已实现收益	-20,828,652.42	-28,062,971.69	131,940.08	182,255.04
本期利润	-22,421,092.92	-30,716,984.22	-319,046.42	-599,966.35
加权平均基金份额本期利润	-0.2475	-0.2472	-0.0029	-0.0032
3.1.2 期末数据和指标	$A	$B	$A	$B
期末可供分配基金份额利润	2018年末		2017年末	
期末基金份额净值	0.7425	0.7399	0.9971	0.9968

1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字;

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益;

3、期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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

中融沪港深大消费主题A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去三个月	-9.22%	1.53%	-3.09%	0.76%	-6.13%	0.77%
过去六个月	-17.76%	1.38%	-4.34%	0.64%	-13.42%	0.74%
过去一年	-25.53%	1.40%	-5.34%	0.61%	-20.19%	0.79%
自基金合同生效起至今	-25.75%	1.32%	-3.96%	0.59%	-21.79%	0.73%

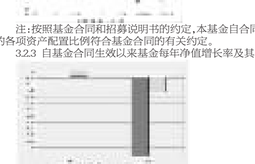
–

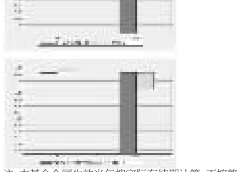
中融沪港深大消费主题C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去三个月	-9.28%	1.54%	-3.09%	0.76%	-6.19%	0.78%
过去六个月	-17.86%	1.38%	-4.34%	0.64%	-13.52%	0.74%
过去一年	-25.77%	1.40%	-5.34%	0.61%	-20.43%	0.79%
自基金合同生效起至今	-26.01%	1.32%	-3.96%	0.59%	-22.05%	0.73%

–

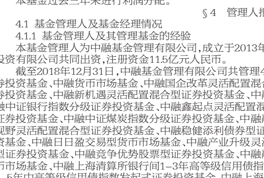
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

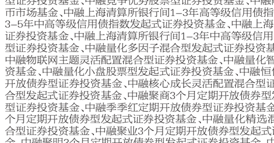




注:按照基金合同和招募说明书的约定,本基金自合同生效日起6个月内为建仓期,建仓期结束时本基金的各项资产配置比例符合基金合同的有关约定。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较





注:本基金合同生效当年按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行利润分配。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为中融基金管理有限公司,成立于2013年5月31日,由中融国际信托有限公司与上海融晟投资有限公司共同出资,注册资金11.5亿元人民币。

截至2018年12月31日,中融基金管理有限公司共管理46只基金,包括中融增鑫一年定期开放债券型证券投资基金、中融货币市场基金、中融国企改革灵活配置混合型证券投资基金、中融融安灵活配置混合型证券投资基金、中融新机遇灵活配置混合型证券投资基金、中融中证一带一路主题指数分级证券投资基金、中融中证银行指数分级证券投资基金、中融鑫起点灵活配置混合型证券投资基金、中融国证钢铁行业指数分级证券投资基金、中融中证煤炭指数分级证券投资基金、中融融安二号灵活配置混合型证券投资基金、中融鑫视野灵活配置混合型证券投资基金、中融稳健添利债券型证券投资基金、中融新经济灵活配置混合型证券投资基金、中融日日盈交易型货币市场基金、中融产业升级灵活配置混合型证券投资基金、中融融裕双利债券型证券投资基金、中融竞争优势股票型证券投资基金、中融融信双盈债券型证券投资基金、中融现金增利货币市场基金、中融上海清算所银行间1-3年高等级信用债指数发起式证券投资基金、中融上海清算所银行间3-5年中高等级信用债指数发起式证券投资基金、中融上海清算所银行间0-1年中高等级信用债指数发起式证券投资基金、中融上海清算所银行间1-3年中高等级信用债指数发起式证券投资基金、中融恒泰纯债债券型证券投资基金、中融量化多因子混合型发起式证券投资基金、中融鑫思路灵活配置混合型证券投资基金、中融物联网主题灵活配置混合型证券投资基金、中融量化智选混合型证券投资基金、中融盈泽债券型证券投资基金、中融量化小盘股票型证券投资基金、中融恒信纯债债券型证券投资基金、中融睿祥一年定期开放债券型证券投资基金、中融核心成长灵活配置混合型证券投资基金、中融沪港深大消费主题灵活配置混合型发起式证券投资基金、中融聚商3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中融鑫价值灵活配置混合型证券投资基金、中融季季红定期开放债券型证券投资基金、中融智选红利股票型证券投资基金、中融聚安3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中融量化精选混合型基金中基金(FOF)、中融医疗健康精选混合型证券投资基金、中融聚业3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中融恒裕纯债债券型证券投资基金、中融聚明3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中融恒惠纯债债券型证券投资基金。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
解静	中融国企改革灵活配置混合型证券投资基金、中融融安灵活配置混合型证券投资基金、中融融信双盈债券型证券投资基金、中融融安二号灵活配置混合型证券投资基金、中融沪港深大消费主题灵活配置混合型发起式证券投资基金的基金经理	2017-11-16	–	8	解静女士,中国国籍,毕业于牛津大学计算机科学专业,硕士研究生学历,具有基金从业资格,证券从业年限8年。2008年2月至2008年9月曾就职于摩根士丹利(伦敦)任技术分析师;2008年9月至2010年4月曾就职于莫尼塔投资发展有限公司任机构销售;2010年4月至2013年2月就职于国泰君安证券,任研究所策略分析师。2013年3月加入中融基金管理有限公司,现任权益投资部基金经理。
甘传琦	中融产业升级灵活配置混合型证券投资基金、中融沪港深大消费主题灵活配置混合型发起式证券投资基金、中融强国制造灵活配置混合型证券投资基金、中融医疗健康精选混合型证券投资基金的基金经理。	2018-02-09	–	8	甘传琦先生,中国国籍,毕业于北京大学金融学专业,硕士研究生学历,具有基金从业资格,证券从业年限8年。2010年7月至2017年3月历任博时基金管理有限公司研究员、高级研究员、基金经理助理。2017年4月加入中融基金管理有限公司,现任权益投资部基金经理。
付世伟	中融沪港深大消费主题灵活配置混合型证券投资基金、中融医疗健康精选混合型证券投资基金的基金经理及国际业务部执行总经理。	2017-11-16	–	13	付世伟先生,中国国籍,毕业于中央财经大学经济学专业,硕士研究生学历,具有CFA(特许金融分析师)、CAIA(特许另类投资分析师)资格,境外投资管理经验13年。2005年7月至2009年10月曾任国家外汇管理局中央外汇业务中心资产配置部研究员;2009年11月至2013年4月曾任中国华安投资有限公司(香港)投资组合经理;2013年5月至2015年5月曾任中再资产管理股份有限公司国际业务部高级投资经理;2015年6月至2016年3月曾任中再资产管理(香港)有限公司投资管理部高级投资经理/执行董事(证监会4号、9号牌照业务负责人);2016年3月加入中融基金管理有限公司,现任国际业务部执行总经理职位。

注:(1)上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

(2)证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期内,本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项配套法规、基金合同和其他相关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作合法合规,无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

公司制定了《公平交易管理办法》,按照证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规的规定,从组织架构、岗位设置和业务流程、系统和制度设计、内控措施和信息披露等多方面,确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合,杜绝不同投资组合之间进行利益输送,保护投资者合法权益。

公司公平交易管理办法要求境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易以及投资管理过程中各个相关环节符合公平交易的监管要求。各投资组合经理独立进行投资决策,共享研究信息、投资建议,并在投资决策委员会制度规定下独立决策,实施投资决策时享有公平的机会。所有组合投资决策与交易执行保持隔离,任何组合必须经过公司交易部集中交易。各投资组合享有平等的交易权利,共享交易资源。对交易所公开竞价交易以及银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易制定专门的交易规则,保证各投资组合获得公平的交易机会。对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易,严格遵循各投资组合交易前独立确定交易价格,交易后按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,本公司制定了《公平交易管理办法》并严格执行,公司通过建立科学、制衡的投资决策体系,加强交易分配环节的内部控制,在研究、决策、交易执行等各环节,通过制度、流程、技术手段等方面措施确保了公平对待管理的投资组合,保证公平交易原则的实现。

本报告期内,上述公平交易制度总体执行情况良好,不同的投资组合受到了公平对待,未发生不公平的交易事项。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内,未出现涉及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2018年全年市场受各种风险因素影响,总体表现不佳:一是中美贸易战不断升级,引发市场对中国贸易的担忧;二是中国经济数据普遍显示中国经济增长乏力,去杠杆力度过大导致实体经济增长放缓;三是美元升值导致部分"双高"新兴市场国家出现股债汇三杀,全球避险情绪明显上升,资金不断撤离股票市场。

本基金于2018年1月中旬结束封闭期,恰逢市场出现了较为极端的行情:1月市场快速上行,此时基金为应对赎回仓位偏低,而2月封闭期结束后开始加仓时,市场出现了一轮快速下跌,导致本基金净值出现了大幅回撤。随后基于对市场相对悲观的判断,基金维持了相对同类产品偏低的仓位水平,并坚持分散持股,避免单只个股集中持仓带来的风险;股票配置方面,防御性板块是核心配置方向,重点配置调整充分、流动性良好的个股。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末中融沪港深大消费主题A基金份额净值为0.7425元,本报告期内,该类基金份额净值增长率为-25.53%,同期业绩比较基准收益率为-5.34%;截至报告期末中融沪港深大消费主题C基金份额净值为0.7399元,本报告期内,该类基金份额净值增长率为-25.77%,同期业绩比较基准收益率为-5.34%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2019年,随着托底政策的不断落地,预计国内经济增长情况或好于预期,但海外市场仍然存在风险,可能会对港股的表现形成拖累。总体来看,我们认为港股市场2019年的投资机会或好于2019年,但外围市场的压制可能导致港股市场总体表现弱于A股。配置上,本基金将重点配置早周期、受益于经济托底政策的板块和个股。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及基金合同约定,本基金管理人应严格按照新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定,对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所在估值调整导致基金资产净值的变化在0.25%以上时对所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。报告期内,本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定,日常估值由基金管理人与基金托管人一同进行,基金份额净值由基金管理人完成估值后,经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

本基金管理人设立估值委员会,成员由高级管理人员、投资研究部门、基金运营部门、风险管理部门、法律合规部门人员组成,负责研究、指导基金估值业务。基金管理人估值委员和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经历。报告期内,基金经理参加估值委员会会议,但不介入基金日常估值业务;参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突;与估值相关的机构包括上海、深圳证券交易所,中国证券登记结算有限责任公司,中央国债登记结算有限责任公司、中证指数有限公司以及中国证券业协会等。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配,符合相关法规及基金合同的规定。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内,国泰君安证券股份有限公司(以下称"本托管人")在中融沪港深大消费灵活配置混合型发起式证券投资基金(以下称"本基金")的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真的复核,未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况(如有)、财务会计报告、投资组合报告等内容,认为其真实、准确和完整。

§6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	上会师报字(2019)第1014号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	中融沪港深大消费主题灵活配置混合型发起式证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了中融沪港深大消费主题灵活配置混合型发起式证券投资基金(以下简称"中融沪港深大消费主题")财务报表,包括2018年12月31日的资产负债表,2018年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及相关财务报表附注。我们认为,后附中融沪港深大消费主题的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》、《中融沪港深大消费主题灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》以及中国证券监督管理委员会和中国证券投资基金业协会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制,公允反映了中融沪港深大消费主题2018年12月31日的财务状况以及2018年度的经营成果和净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的"注册会计师对财务报表审计的责任"部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于中融沪港深大消费主题,并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。
强调事项	–
其他事项	我们提醒财务报表使用者关注后附财务报表附注中对编制基础的说明。同时该财务报表系中融沪港深大消费主题管理人(以下简称"管理人")根据《中融沪港深大消费主题灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》的规定为其基金份额持有人编制的,因此财务报表可能不适于其他用途。本报告仅供管理人提供中融沪港深大消费主题份额持有人和向中国证券监督管理委员会及其派出机构报送使用,不得用于其他目的。
其他信息	管理人对其他信息负责。其他信息包括中融沪港深大消费主题2018年年度报告中涵盖的信息,但不包括财务报表和我们的审计报告。我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息,我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。结合我们对财务报表的审计,我们的责任是阅读其他信息,在此过程中,考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作,如果我们确定其他信息存在重大错报,我们应当报告该事实。在这方面,我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	管理人负责按照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》、《中融沪港深大消费主题灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》以及中国证券监督管理委员会和中国证券投资基金业协会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。在编制财务报表时,管理人负责评估中融沪港深大消费主题的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项,并运用持续经营假设,除非基金拟进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险,设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。(2) 了解与审计相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。(4) 对管理人使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时,根据获取的审计证据,就可能导致对中融沪港深大消费主题持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性,审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露;如果披露不充分,我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而,未来的事项或情况可能导致中融沪港深大消费主题不能持续经营。(5) 评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露),并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与管理人就中融沪港深大消费主题的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通,包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。
会计师事务所的名称	上会会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	江嘉炜、陈大愚
会计师事务所的地址	上海市静安区威海路755号文新报业大厦25楼
审计报告日期	2019-03-20

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:中融沪港深大消费主题灵活配置混合型发起式证券投资基金

报告截止日:2018年12月31日

单位:人民币元

资 产	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
资 产:		
银行存款	33,268,447.88	41,865,342.91
结算备付金	2,419,152.56	4,143,502.48
存出保证金	432,459.56	1,255,573.29
交易性金融资产	99,498,941.58	49,864,771.61
其中:股票投资	99,498,941.58	49,864,771.61
基金投资	–	–
债券投资	–	–
资产支持证券投资	–	–
贵金属投资	–	–
衍生金融资产	–	–
买入返售金融资产	–	210,000,000.00
应收证券清算款	–	–
应收利息	17,517.22	681,249.29
应收股利	21,168.00	–
应收申购款	–	–
递延所得税资产	–	–
其他资产	–	–
资产总计	135,657,686.80	307,810,439.58
负债和所有者权益	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
负 债:		
短期借款	–	–
交易性金融负债	–	–
衍生金融负债	–	–
卖出回购金融资产款	–	–
应付证券清算款	17.96	9,248,085.98
应付赎回款	–	–
应付管理人报酬	177,392.15	378,406.17
应付托管费	29,565.38	63,067.69
应付销售服务费	12,400.93	32,000.56
应付交易费用	167,047.43	31,222.61
应交税费	–	–
应付利息	–	–
应付利润	–	–
递延所得税负债	–	–
其他负债	130,000.00	20,000.00
负债合计	516,423.85	9,772,783.01
所有者权益:		
实收基金	182,347,280.63	298,956,669.34
未分配利润	-47,206,017.68	-919,012.77
所有者权益合计	135,141,262.95	298,037,656.57
负债和所有者权益总计	135,657,686.80	307,810,439.58

报告截止日2018年12月31日,基金份额总额182,347,280.63份,其中A类基金份额的份额总额为86,833,223.78份,份额净值0.7425元;C类基金份额的份额总额为95,514,056.85份,份额净值0.7399元。

7.2 利润表

会计主体:中融沪港深大消费主题灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期:2018年01月01日至2018年12月31日

单位:人民币元

项 目	本期2018年01月01日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年11月16日(基金合同生效日)至2017年12月31日
一、收入	-46,891,730.38	-109,604.82
1.利息收入	967,246.84	1,332,457.28
其中:存款利息收入	676,283.90	211,887.50
债券利息收入	–	–
资产支持证券利息收入	–	–
买入返售金融资产收入	290,962.94	1,120,569.78
其他利息收入	–	–
2.投资收益(损失以"-"填列)	-43,751,633.16	-208,854.21
其中:股票投资收益	-45,378,552.41	-208,854.21
基金投资收益	–	–
债券投资收益	–	–
资产支持证券投资收益	–	–
贵金属投资收益	–	–
衍生工具收益	–	–
股利收益	1,626,919.25	–
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-4,246,453.03	-1,233,207.89
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	–	–
5.其他收入(损失以"-"号填列)	139,108.97	–
减:二、费用	6,246,346.76	809,407.95
1. 管理人报酬	2,856,440.35	550,293.25
2. 托管费	476,073.40	91,715.55
3. 销售服务费	221,061.37	46,537.14
4. 交易费用	2,562,771.64	100,862.01
5. 利息支出	–	–
其中:卖出回购金融资产支出	–	–
6. 税金及附加	–	–
7. 其他费用	130,000.00	20,000.00
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	-53,138,077.14	-919,012.77
减:所得税费用	–	–
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	-53,138,077.14	-919,012.77

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:中融沪港深大消费主题灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期:2018年01月01日至2018年12月31日

单位:人民币元

项 目	本期 2018年01月01日至2018年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	298,956,669.34	-919,012.77	298,037,656.57
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	–	-53,138,077.14	-53,138,077.14
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-116,609,388.71	6,851,072.23	-109,758,316.48
其中:1.基金申购款	31,381,333.87	-3,220,192.36	28,161,141.51
2.基金赎回款	-147,990,722.58	10,071,264.59	-137,919,457.99
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	–	–	–
五、期末所有者权益(基金净值)	182,347,280.63	-47,206,017.68	135,141,262.95
项 目	上年度可比期间 2017年11月16日(基金合同生效日)至2017年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	298,956,669.34	–	298,956,669.34
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	–	-919,012.77	-919,012.77
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	–	–	–
其中:1.基金申购款	–	–	–
2.基金赎回款	–	–	–
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	–	–	–
五、期末所有者权益(基金净值)	298,956,669.34	-919,012.77	298,037,656.57

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署:

王瑶	曹健	黎峰
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

中融沪港深大消费主题灵活配置混合型发起式证券投资基金(以下简称"本基金")经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监许可[2017]1531号文《关于准予中融大消费主题灵活配置混合型发起式证券投资基金(LOF)变更注册的批复》批准,由中融基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《中融沪港深大消费主题灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》("基金合同")公开募集,于2017年11月16日募集成立。本基金的基金管理人为中融基金管理有限公司,基金托管人为国泰君安证券股份有限公司。

本基金募集期为2017年10月23日至2017年11月10日,本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,本基金共募集有效净认购资金人民币298,912,471.64元,折合298,912,471.64份中融沪港深大消费主题灵活配置混合型发起式证券投资基金份额(其中:A类基金份额为109,314,268.35份;C类基金份额为189,598,203.29份)。有效认购资金在募集期间产生的利息为人民币44,197.70元,折合44,197.70份中融沪港深大消费主题灵活配置基金份额(其中:A类基金份额为18,161.11份;C类基金份额为26,036.59份),以上收到的实收基金共计人民币298,956,669.34元,折合298,956,669.34份中融沪港深大消费主题灵活配置混合型基金份额,有效认购户数为6806户。本基金募集资金经上会会计师事务所(特殊普通合伙)验资。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和基金合同等有关规定,本基金的投资范围为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)、港股通机制下允许投资的香港联合交易所上市的股票、权证、股指期货、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)、可交换公司债券、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、同业存单、货币市场工具、国债期货及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)。

本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率x10%+恒生指数收益率x40%+上证国债指数收益率x50%。

本基金的财务报表于2019年3月20日已经本基金的基金管理人及基金托管人批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日颁布的企业会计准则及相关规定(以下简称"企业会计准则")及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制,同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求,真实、完整地反映了本基金2018年12月31日的财务状况以及2018年度的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金采用公历年制,即自每年1月1日起至12月31日止。

7.4.4.2 记账本位币

以人民币为记账本位币,记账本位币单位为元。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求,本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和贷款及应收款项。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产包括股票投资、债券投资和衍生工具投资(主要为权证投资)等,其中股票投资和债券投资在资产负债表中作为交易性金融资产列报,衍生工具投资在资产负债表中作为衍生金融资产列报。

本基金持有的各类应收款项、买入返售金融资产等在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产分类为贷款及应收款项。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。

本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时,按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,取得时发生的相关交易费用计入当期损益;对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息,单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。 对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,按照公允价值进行后续计量;对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法,以摊余成本进行后续计量。 金融资产满足下列条件之一的,予以终止确认:

(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止;

(2)该金融资产已转移,且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方;或者

(3)该金融资产已转移,虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬,但是放弃了对该金融资产控制。 金融资产终止确认时,其账面价值与收到的对价的差额,计入当期损益。当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时,终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额,计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值,是指市场参与者在计量日发生的有序交易中,出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债,假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行;不存在主要市场的,本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场(或最有利市场)是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债,根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值,确定所属的公允价值层次:第一层次输入值,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,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,相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日,本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估,以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的股票投资、债券投资和权证投资等投资按如下原则确定公允价值并进行估值:

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值;估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的,按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的,应对市场交易价格进行调整,确定公允价值。

与上述投资品种相同,但具有不同特征的,应以相同资产或负债的公允价值为基础,并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等,如果该限制是针对资产持有者的,那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外,基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价;

(2) 当金融工具不存在活跃市场,采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时,优先使用可观察输入值,只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下,才可以使用不可观察输入值;

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件,应对估值进行调整并确定公允价值;

(4) 如有新增事项,按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利,且该种法定权利现在是可执行的,同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时,金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外,金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示,不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。申购、赎回、转换及红利再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金指申购、赎回、转入、转出及红利再投资等事项导致基金份额变动时,相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配(未分配利润)已实现与未实现部分各自占基金净值的比例,损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列,并于期末全额转入利润分配(未分配利润)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1)利息收入

①存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

②除贴息债外的债券利息收入在持有债券期内,按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额,逐日确认债券利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债,根据其发行价、到期价和发行期限推算内含利率后,逐日确认债券利息收入。

③买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提,若合同利率与实际利率差异较小,则采用合同利率计算确定利息收入。

(2)投资收益

①股票投资收益于交易日按卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本的差额确认。

②债券投资收益于交易日按卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本与应收利息(若有)后的差额确认。

③衍生工具投资收益于交易日按交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本后的差额确认。

④股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

(3)公允价值变动收益

公允价值变动收益于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产/负债的公允价值变动形成的利得或损失确认,并于相关金融资产/负债卖出或到期时转出计入投资收益。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的基金管理人报酬按《基金合同》约定的方法进行计提。

本基金的基金托管费按《基金合同》约定的方法进行计提。

本基金A类份额不收取销售服务费,C类基金份额的销售服务费按前一日C类基金资产净值×0.20%的年费率逐日计提。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的交易费用发生时按照确定的金额计入交易费用。

卖出回购金融资产支出按卖出回购金融资产款的摊余成本在回购期内以实际利率法逐日计提,若合同利率与实际利率差异较小,则采用合同利率计算确定利息支出。

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。 其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 本基金收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资,投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资;若投资者不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红;

(2) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值,即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值;

(3) 由于本基金 A 类份额不收取销售服务费,而 C 类份额收取销售服务费,各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同,本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权;

(4) 法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

7.4.4.12 分部报告

无。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作,本基金确定以下股票投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下:

(1) 对于证券交易所上市的股票,若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况,本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》,根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票,根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》,按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券、可分离债券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种,根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券、可分离债券和私募债券除外),按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中央国债登记结算有限责任公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

7.4.5.3 差错更正的说明

无。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局国家税务总局财税[1998]55号《关于证券投资基金税收问题的通知》、财税[2008]1号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》、财税[2016]46号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、国发[1985]19号发布和国务院令[2011]第588号修订的《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例》、国务院令[2005]第448号《国务院关于修改〈征收教育费附加的暂行规定〉的决定》及其他相关税务法规和实务操作,主要税项列示如下:

1、资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为,暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为,未缴纳增值税的,不再缴纳;已缴纳增值税的,已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税,对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务,以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、非货物期货,可以选择按照实际买入价计算销售额,或者以2017年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

2、对证券投资基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不缴纳企业所得税。

3、对基金取得的股票股息、红利收入,由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴个人所得税,个人从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,暂免征收个人所得税。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

4、对基金取得的债券利息收入,由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税,暂不缴纳企业所得税。

5、基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。

6、基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价,暂免予缴纳印花税、企业所得税和个人所得税。

7、本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
上海融晟投资有限公司	基金管理人股东
中融国际信托有限公司	基金管理人股东
中融基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
国泰君安证券股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
中融(北京)资产管理有限公司	基金管理人子公司

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

单位:人民币元

关联方名称	本期 2018年01月01日至2018年12月31日		上年度可比期间 2017年11月16日(基金合同生效日)至2017年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
国泰君安证券股份有限公司	1,334,787,962.89	80.53%	62,445,222.79	100.00%

7.4.8.1.2 权证交易

无。

7.4.8.1.3 债券交易

无。

7.4.8.1.4 债券回购交易

单位:人民币元

关联方名称	本期 2018年01月01日至2018年12月31日		上年度可比期间 2017年11月16日(基金合同生效日)至2017年12月31日	
	债券回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
国泰君安证券股份有限公司	150,000,000.00	100.00%	643,500,000.00	100.00%

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

单位:人民币元

关联方名称	本期 2018年01月01日至2018年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国泰君安证券股份有限公司	763,257.24	77.23%	5,499.00	3.29%
关联方名称	上年度可比期间 2017年11月16日(基金合同生效日)至2017年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国泰君安证券股份有限公司	31,222.61	100.00%	31,222.61	100.00%

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年11月16日(基金合同生效日)至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	2,856,440.35	550,293.25
其中:支付销售机构的客户维护费	556,597.38	106,639.39

①支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值1.50%的年费率计提,每日计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:日管理人报酬=前一日基金资产净值 X1.50% / 当年天数。

②客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用,该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支,不属于从基金资产中列支的费用项目。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年11月16日(基金合同生效日)至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	476,073.40	91,715.55

支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提,每日计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:日托管费=前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

7.4.8.2.3 销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2018年01月01日至2018年12月31日 当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中融沪港深大消费主题A	中融沪港深大消费主题C	合计
国泰君安证券股份有限公司	–	41,654.04	41,654.04
中融基金管理有限公司	–	51.16	51.16
合计	–	41,705.20	41,705.20
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2017年11月16日(基金合同生效日)至2017年12月31日 当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中融沪港深大消费主题A	中融沪港深大消费主题C	合计
国泰君安证券股份有限公司	–	7,950.50	7,950.50
中融基金管理有限公司	–	12.16	12.16
合计	–	7,962.66	7,962.66

支付基金销售机构的C类基金份额销售服务费按前一日C类基金资产净值0.20%的年费率计提,每日计提,逐日累计至每月月底,按月支付给注册登记机构,再由注册登记机构代付给销售机构。A类基金份额不收取销售服务费。C类基金销售服务费的计算公式为:

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 0.20%/当年天数。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金于本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

中融沪港深大消费主题A

份额单位:份

项目	本期 2018年01月01日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年11月16日(基金合同生效日)至2017年12月31日
基金合同生效日(2017年11月16日)持有的基金份额	–	10,000,200.02
报告期初持有的基金份额	10,000,200.02	–
报告期间申购/买入总份额	–	–
报告期间因拆分变动份额	–	–
减:报告期间赎回/卖出总份额	–	–
报告期末持有的基金份额	10,000,200.02	10,000,200.02
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	11.52%	9.15%

中融沪港深大消费主题C

份额单位:份

项目	本期 2018年01月01日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年11月16日(基金合同生效日)至2017年12月31日
基金合同生效日(2017年11月16日)持有的基金份额	–	–
报告期初持有的基金份额	–	–
报告期间申购/买入总份额	–	–
报告期间因拆分变动份额	–	–
减:报告期间赎回/卖出总份额	–	–
报告期末持有的基金份额	–	–
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	–	–

(1) 基金管理人持有本基金基金份额的交易费用按市场公开的交易费率计算并支付;

(2) 期间申购/买入总份额:含红利再投、转换入份额;期间赎回/卖出总份额:含转换出份额。

7.4.8.4.2 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。

7.4.8.5 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 2018年01月01日至2018年12月31日		上年度可比期间 2017年11月16日(基金合同生效日)至2017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
国泰君安证券股份有限公司	33,268,447.88	615,587.77	41,865,342.91	204,516.43

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转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。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

7.4.8.7.1 其他关联交易事项的说明

无

7.4.9 期末(2018年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.10 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整体的重要性,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 各层次金融工具公允价值

本基金本报告期末持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币99,498,941.58元,无属于第二层次、第三层次的余额。(2017年12月31日:属于第一层次的余额为人民币49,864,771.61元,无属于第二层次、第三层次的余额)

③ 公允价值所属层次间的重大变动

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应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换。

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	99,498,941.58	73.35
	其中:股票	99,498,941.58	73.35
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	35,687,600.44	26.31
8	其他各项资产	471,144.78	0.35
9	合计	135,657,686.80	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、渔业	1,363,978.00	1.01
B	采矿业	–	–
C	制造业	11,397,960.37	8.43
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	5,952,955.80	4.40
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	–	–
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	18,714,894.17	13.85

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值(人民币)	占基金资产净值比例(%)
基础材料	2,316,059.46	1.71
消费者非必需品	1,645,065.50	1.22
消费者常用品	2,156,766.30	1.60
能源	1,759,935.32	1.30
金融	28,441,370.85	21.05
医疗保健	2,408,586.18	1.78
工业	7,567,476.54	5.60
信息技术	9,640,688.41	7.13
电信服务	6,340,687.02	4.69
公用事业	11,139,831.56	8.24
地产业	7,367,580.27	5.45
合计	80,784,047.41	59.78

以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

8.3 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

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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	H00700	腾讯控股	23,700	6,520,505.16	4.82
2	H06837	海通证券	926,000	6,085,209.00	4.50
3	H06030	中信证券	467,500	5,529,917.25	4.09
4	H03968	招商银行	215,000	5,406,592.10	4.00
5	H00939	建设银行	856,303	4,846,890.77	3.59
6	H01109	华润置地	172,000	4,536,262.64	3.36
7	H00836	华润电力	316,000	4,169,800.75	3.09
8	H00941	中国移动	62,500	4,126,354.38	3.05
9	H01186	中国铁建	428,000	4,072,647.70	3.01
10	600498	烽火通信	140,900	4,011,423.00	2.97

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	H06030	中信证券	19,250,398.21	6.46
2	H00700	腾讯控股	17,691,410.82	5.94
3	H01109	华润置地	13,527,095.19	4.54
4	H02318	中国平安	13,378,022.66	4.49
5	H02688	新奥能源	12,301,158.17	4.13
6	600887	伊利股份	12,292,234.00	4.12
7	H01347	华虹半导体	12,152,095.43	4.08
8	H00941	中国移动	12,052,403.96	4.04
9	600562	国睿科技	10,878,699.00	3.65
10	H00958	华能新能源	10,353,243.07	3.47
11	H03993	洛阳钼业	10,245,261.77	3.44
12	H00916	龙源电力	9,999,037.08	3.35
13	H03968	招商银行	9,905,191.40	3.32
14	H02319	蒙牛乳业	9,816,237.59	3.29
15	300618	寒锐钴业	9,706,426.00	3.26
16	H01548	金斯瑞生物科技	9,702,770.65	3.26
17	H01177	中国生物制药	9,654,632.71	3.24
18	H02186	绿叶制药	9,576,489.44	3.21
19	H03323	中国建材	9,452,839.38	3.17
20	H00175	吉利汽车	9,184,785.48	3.08
21	H00027	银河娱乐	8,988,148.50	3.02
22	H02382	舜宇光学科技	8,988,117.96	3.02
23	H01208	五矿资源	8,792,117.99	2.95
24	H00998	中信银行	8,750,325.12	2.94
25	H00388	香港交易所	8,558,329.00	2.87
26	H00386	中国石油化工股份	8,198,764.94	2.75
27	H00914	海螺水泥	8,119,805.93	2.72
28	H00323	马鞍山钢铁股份	8,059,478.29	2.70
29	H02282	美高梅中国	8,054,151.41	2.70
30	H01398	工商银行	7,929,472.44	2.66
31	600028	中国石化	7,874,968.00	2.64
32	H02007	碧桂园	7,672,864.67	2.57
33	H01093	石药集团	7,567,926.97	2.54
34	603799	华友钴业	7,345,232.00	2.46
35	H02777	富力地产	7,291,608.67	2.45
36	H02018	瑞声科技	7,260,003.92	2.44
37	H00291	华润啤酒	7,111,909.33	2.39
38	H00902	华能国际电力股份	7,099,803.53	2.38
39	002152	广电运通	7,091,146.00	2.38
40	H02601	中国太保	7,005,600.74	2.35
41	H01336	新华保险	6,917,555.00	2.32
42	H00981	中芯国际	6,846,687.83	2.30
43	H06837	海通证券	6,802,503.65	2.28
44	000725	京东方A	6,730,886.00	2.26
45	H03799	达利食品	6,700,660.99	2.25
46	H01628	禹洲地产	6,680,470.94	2.24
47	H00966	中国太平	6,599,681.81	2.21
48	603993	洛阳钼业	6,533,783.00	2.19
49	000063	中兴通讯	6,500,455.00	2.18
50	H02357	中航科工	6,489,343.84	2.18
51	H00817	中国金茂	6,471,178.18	2.17
52	H06818	中国光大银行	6,462,167.46	2.17
53	H00939	建设银行	6,373,737.81	2.14
54	H00354	中国软件国际	6,087,954.83	2.04
55	002544	杰赛科技	6,074,656.00	2.04
56	300351	永贵电器	6,073,728.00	2.04
57	H00005	汇丰控股	6,071,646.88	2.04
58	H01066	威高股份	5,969,760.67	2.00

"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	H00700	腾讯控股	15,678,060.45	5.26
2	H02688	新奥能源	13,053,497.76	4.38
3	H01347	华虹半导体	12,736,861.98	4.27
4	H02318	中国平安	12,037,995.84	4.04
5	H06030	中信证券	11,850,333.93	3.98
6	H00175	吉利汽车	11,837,601.33	3.97
7	600887	伊利股份	11,259,684.91	3.78
8	600562	国睿科技	11,042,683.00	3.71
9	H02018	瑞声科技	10,659,540.47	3.58
10	H03993	洛阳钼业	10,291,861.35	3.45
11	H00958	华能新能源	9,902,383.57	3.32
12	H02319	蒙牛乳业	9,883,536.01	3.32
13	H01336	新华保险	9,638,849.02	3.23
14	H00966	中国太平	9,549,151.16	3.20
15	H01208	五矿资源	9,238,307.11	3.10
16	H02186	绿叶制药	9,193,669.66	3.08
17	H00914	海螺水泥	8,622,479.89	2.89
18	H00027	银河娱乐	8,608,832.22	2.89
19	H01548	金斯瑞生物科技	8,574,986.89	2.88
20	H00386	中国石油化工股份	8,510,645.77	2.86
21	H01109	华润置地	8,489,670.38	2.85
22	H03968	招商银行	8,171,344.88	2.74
23	H01177	中国生物制药	8,159,115.07	2.74
24	H02382	舜宇光学科技	8,095,896.84	2.72
25	H00998	中信银行	8,064,940.22	2.71
26	H00388	香港交易所	7,956,836.62	2.67
27	H00916	龙源电力	7,950,639.40	2.67
28	H01093	石药集团	7,867,969.21	2.64
29	H00941	中国移动	7,839,785.11	2.63
30	H02208	金风科技	7,805,010.84	2.62
31	H03323	中国建材	7,687,480.44	2.58
32	600028	中国石化	7,492,695.00	2.51
33	300618	寒锐钴业	7,438,806.45	2.50
34	603605	珀莱雅	7,404,321.67	2.48
35	H02601	中国太保	7,402,977.60	2.48
36	H00323	马鞍山钢铁股份	7,396,826.48	2.48
37	H02282	美高梅中国	7,334,991.82	2.46
38	H01958	北京汽车	7,277,684.89	2.44
39	H01398	工商银行	7,158,801.13	2.40
40	000725	京东方A	7,053,564.89	2.37
41	H00005	汇丰控股	6,625,197.35	2.22
42	002544	杰赛科技	6,394,175.52	2.15
43	H03799	达利食品	6,337,265.78	2.13
44	603993	洛阳钼业	6,228,868.00	2.09
45	H02777	富力地产	6,182,244.81	2.07
46	603799	华友钴业	6,036,946.91	2.03
47	H01628	禹洲地产	5,978,506.82	2.01
48	H02007	碧桂园	5,961,971.57	2.00

"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	878,688,114.52
卖出股票收入(成交)总额	779,428,939.11

"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。

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,本基金投资的前十名证券除招商银行(证券代码3968)外其他证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内收到公开谴责、处罚的情形。

2018年5月4日,中国银行保险监督管理委员会公布行政处罚决定书,(银监罚决字【2018】1号),本基金持有的招商银行(证券代码3968)的发行主体招商银行股份有限公司因内控管理严重违反审慎经营规则等违规行为被行政处罚,罚款6570万元,没收违法所得3.024万元,罚没合计6573.024万元。

对上述证券的投资决策程序的说明:本基金基于对公司整体价值的研究分析,认为上述事件不影响公司长期价值,影响较小,上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的规定。

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	432,459.56
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	21,168.00
4	应收利息	17,517.22
5	应收申购款	–
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	471,144.78

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限股票。

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
中融沪港深大消费主题A	1,773	48,975.31	16,608,377.31	19.13%	70,224,846.47	80.87%
中融沪港深大消费主题C	2,296	41,600.20	60,001.20	0.06%	95,454,055.65	99.94%
合计	4,069	44,813.78	16,668,378.51	9.14%	165,678,902.12	90.86%

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	中融沪港深大消费主题A	38,510.28	0.04%
	中融沪港深大消费主题C	1,212.88	0.00%
	合计	39,723.16	0.02%

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

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。

9.4发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,200.02	5.48%	10,000,200.02	5.48%	不少于三年
基金管理人高级管理人员	–	–	–	–	–
基金经理等人员	–	–	–	–	–
基金管理人股东	–	–	–	–	–
其他	–	–	–	–	–
合计	10,000,200.02	5.48%	10,000,200.02	5.48%	不少于三年

§10 开放式基金份额变动

单位:份

	中融沪港深大消费主题A	中融沪港深大消费主题C
基金合同生效日(2017年11月16日)基金份额总额	109,332,429.46	189,624,239.88
本报告期期初基金份额总额	109,332,429.46	189,624,239.88
本报告期基金总申购份额	21,352,755.91	10,028,577.96
减:本报告期基金总赎回份额	43,851,961.59	104,138,760.99
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	–	–
本报告期期末基金份额总额	86,833,223.78	95,514,056.85

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

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2018年3月14日发布公告,王启道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2018年6月30日发布公告,代宝香女士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

本基金本报告期内选聘上会会计师事务所(特殊普通合伙)提供首年审计服务。本基金本报告期应支付给上会会计师事务所(特殊普通合伙)的报酬为30,000.00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	
国泰君安	4	1,334,787,962.89	80.53%	763,257.24	77.23%	–
太平洋证券	4	322,628,044.68	19.47%	225,097.65	22.77%	–

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。

③以上交易单元均为新增交易单元。

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
国泰君安	–	–	150,000,000.00	100.00%	–	–	–	–
太平洋证券	–	–	–	–	–	–	–	–

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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

本基金本报告期间无单一投资者持有基金份额达到或超过20%的情况。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期无影响投资者决策的其他重要信息。

中融基金管理有限公司

二〇一九年三月二十八日