

中融融安保本混合型证券投资基金 2015年半年度报告

2015年6月30日

基金管理人：中融基金管理有限公司

基金托管人：南京银行股份有限公司

送出日期：2015年8月27日

§1 重要提示及目录

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。本半年度报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人南京银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2015年8月20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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年2月12日（基金合同生效日）起至2015年6月30日止。

1.2 目录

§1	重要提示及目录	2
1.1	重要提示	2
1.2	目录	3
§2	基金简介	5
2.1	基金基本情况	5
2.2	基金产品说明	5
2.3	基金管理人和基金托管人	5
2.4	信息披露方式	6
2.5	其他相关资料	6
§3	主要财务指标和基金净值表现	6
3.1	主要会计数据和财务指标	6
3.2	基金净值表现	7
§4	管理人报告	8
4.1	基金管理人及基金经理情况	8
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明	10
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
§5	托管人报告	12
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3	托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	12
§6	半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1	资产负债表	12
6.2	利润表	14
6.3	所有者权益（基金净值）变动表	15
6.4	报表附注	16
§7	投资组合报告	38
7.1	期末基金资产组合情况	38
7.2	报告期末按行业分类的股票投资组合	39
7.3	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	40
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动	41
7.6	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	43
7.7	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	43
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	43
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	44
7.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	44
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	44
7.12	投资组合报告附注	44
§8	基金份额持有人信息	45
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	45

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	46
§9 开放式基金份额变动	46
§10 重大事件揭示	46
10.1 基金份额持有人大会决议	46
10.2 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	46
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	47
10.4 基金投资策略的改变	47
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	47
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	47
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	47
10.8 其他重大事件	48
§11 影响投资者决策的其他重要信息	49
§12 备查文件目录	49
12.1 备查文件目录	49
12.2 存放地点	50
12.3 查阅方式	50

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中融融安保本混合型证券投资基金
基金简称	中融融安保本混合
基金主代码	001014
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015-02-12
基金管理人	中融基金管理有限公司
基金托管人	南京银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	475,037,159.72份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过动态调整稳健资产与风险资产在组合中的投资比例，严格控制风险、确保保本周期到期时本金安全的基础上，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金运用恒定比例组合保险（Constant Proportion Portfolio Insurance，以下简称CPPI）策略，动态调整稳健资产与风险资产在基金组合中的投资比例，以确保保本周期到期时，实现基金资产在保本基础上的保值增值的目的。 1. 资产配置策略 2. 债券投资策略 3. 股票投资策略 4. 中小企业私募债投资策略 5. 权证投资策略 6. 资产支持证券的投资策略
业绩比较基准	人民银行公布的一年期银行定期存款收益率（税后）*1.5
风险收益特征	本基金为保本混合型基金产品，属证券投资基金中的叫低风险品种，其预期风险与预期收益率低于股票型基金、非保本的混合型基金，高于货币市场基金和债券型基金。

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	南京银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	裴芸	王峰
	联系电话	85003577	(025)83177298
	电子邮箱	peiyun@zrfunds.com.cn	zctg@njcb.com.cn
客户服务电话		400-160-6000; 010-85003210	96400
传真		010-85003387	(025)86776189
注册地址		深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室	南京市中山路288号
办公地址		北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A座7层	南京市中山路268号汇杰广场2楼201室
邮政编码		100005	210008
法定代表人		王瑶	林复

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.zrfunds.com.cn/
基金半年度报告备置地点	北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A座7层

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中融基金管理有限公司	北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A座7层
基金保证人	中国投融资担保有限公司	北京市海淀区西三环北路100号金玉大厦写字楼9层

§3 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期（2015年2月12日至2015年6月30日）
---------------	----------------------------

本期已实现收益	27,532,523.57
本期利润	33,970,281.37
加权平均基金份额本期利润	0.0608
本期加权平均净值利润率	5.81%
本期基金份额净值增长率	5.00%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015年6月30日)
期末可供分配利润	17,386,480.76
期末可供分配基金份额利润	0.0366
期末基金资产净值	498,861,398.28
期末基金份额净值	1.050
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2015年6月30日)
基金份额累计净值增长率	5.00%

注：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；

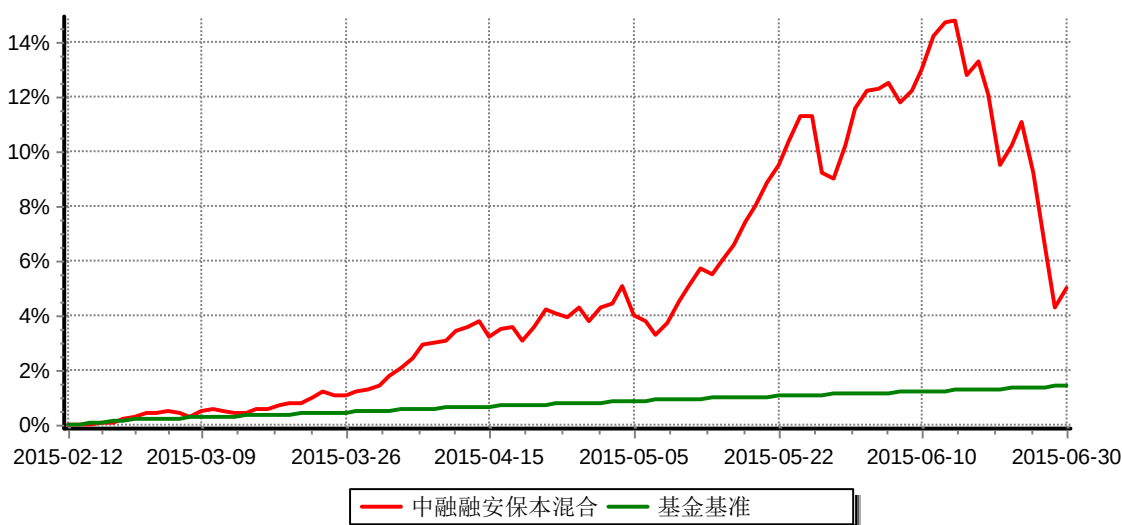
4、基金合同生效日为：2015年2月12日，无上年度可比期间的数据。

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

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
过去一个月	-3.67%	1.21%	0.30%	0.01%	-3.97%	1.20%
过去三个月	3.55%	0.84%	0.89%	0.01%	2.66%	0.83%
自基金合同生效日起至今（2015年02月12日-2015年06月30日）	5.00%	0.69%	1.41%	0.01%	3.59%	0.68%

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



图：中融融安保本混合型证券投资基金增长率与同期业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2015年02月12日至2015年6月30日)

注：本基金基金合同生效日2015年02月12日至报告期末未满1年。按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，截至报告期末本基金仍处于建仓期。

§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7.5亿元人民币。

截止2015年6月30日，中融基金管理有限公司共管理10只基金，包括中融新机遇混合、中融新动力混合、中融融安保本混合、中融增鑫定期开放债券、中融货币、中融国企改革混合、中融一带一路、中融银行、中融钢铁、中融煤炭。

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		
王玥	本基金、	2015年2月	—	5年	曾任中信建投证券股份有

	中融增鑫一年定期开放债券基金经理	12日			限公司固定收益部高级经理。2013年8月加入中融基金管理有限公司,2013年12月3日至今担任本基金基金经理。经济学硕士,具备基金从业资格,中国国籍。
贾志敏	本基金、中融货币市场基金经理、中融新动力混合基金经理、固收投资部负责人	2015年4月17日	—	8年	2014年11月起加入中融基金管理有限公司,现为公司固收投资部负责人。贾志敏先生毕业于北京大学,获硕士学位。加入中融基金以前,贾志敏先生曾在中信银行任交易员、并曾在长盛基金管理有限公司任固定收益部副总监/基金经理。具备基金从业资格。

注：（1）基金经理王玥女士任职日期指本基金基金合同生效之日；基金经理贾志敏先生任职日期指公司发布的公告中载明的任职之日；

（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合规守信情况的说明

报告期内,本基金管理人严格遵循了《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《中融融安保本混合型证券投资基金基金合同》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。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定,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》。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,并通过实时的行为监控与及时的分析评估,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。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未发生异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

今年年初以来，债市整体呈现先抑后扬的行情。第一季度，货币政策稳健偏松，央行重启逆回购、下调存款准备金率，多次下调公开市场操作利率、续作MLF、开展SLF等呵护市场，但打新干扰、股市分流、春节因素、人民币汇率疲弱以及外汇占款下降等使得流动性有所收紧，对债市的做多形成阻力。经济基本面偏弱，通胀压力不大，但公布的经济金融数据以及系列稳增长措施的出台，不断在边际上改变着市场预期，抑制债市表现，收益率曲线非常平坦。直到3月下旬，资金面有了明显的缓解，短端收益率突破向下，中长端则在政府债务置换以及供求不均的局面下，收益率突破上行，收益率曲线陡峭化修复。第二季度，债券市场表现尽管有所波折，但整体呈现牛市行情。经济依旧疲弱、货币政策宽松、流动性充裕，期间央行曾多次下调公开市场操作利率、降准降息。资金利率总体维持在低位，即使6月底季末的敏感时间，资金面也未出现实质性的收紧。整体来看，债券中短端表现好于长端，收益率曲线重归陡峭化，信用利差整体收窄但不同品种出现了明显的分化。具体来看，报告期内，1年国开收益率下行117BP，10年国开债收益率基本没变化。1年AA城投债收益率较年初下行146BP，3-5年品种下行约65-80BP，7年品种下行约38BP左右。权益市场表现则先扬后抑，6月中旬之前一直保持着较快幅度的上涨，而6月中旬开始出现前所未有的暴跌。

本基金于2月12日成立，建仓期内以定期存款和少量债券配置为主；进入二季度，组合逐步提高了股票的配置比例，债券部分则维持着低杠杆、适度久期。信用方面，严控信用风险，主要配置中高等级信用债。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，中融融安保本混合型证券投资基金的基金份额净值增长率为5.00%，同期业绩比较收益率为1.41%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望三季度，经济基本面或依旧偏弱，货币政策大概率延续偏宽松的基调，以保持平稳的流动性环境，债市在短期内应有一定的表现。但中期来看，我们保持谨慎乐观。虽然宽松预期仍在，但对债市的边际影响在减弱，较上半年而言，出现趋势性牛市行情

的概率较小。短端品种相对安全，收益的确定性较高。长端品种受制于经济底部企稳、政府债务置换、通胀可能的抬头、美联储加息等因素，压力则相对比较大，但也不乏交易性机会存在。后续需谨慎观察市场以及经济数据、货币、财政相关政策的发布，以及供需变化。做好资产配置，适度控制久期，积极捕捉交易性机会，增厚组合收益。信用品种方面，企业信用恶化的风险事件仍可能发生，个券的信用利差将继续分化。将精选个券，规避部分产能过剩、现金流严重恶化、资质较差的公司债企业债，高度重视相关发债主体信用资质的变化，严控信用风险。

我们中长期继续看好A股市场表现，经过6月的超预期下跌，许多品种具备了一定的安全边际，待市场充分调整后介入机会可能将重新显现。三季度股市可能呈现出震荡加剧、风格转换的行情，我们将坚持价值投资，灵活进行仓位控制，并进行适当的波段操作，以应对市场可能出现的超预期波动。在债券配置的基础上，积极的把握权益市场机会。自上而下稳健配置，自下而上甄选优质个股，力求为基金持有人带来稳健丰厚的投资回报。

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验。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

本基金本报告期末未进行利润分配，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合规守信情况声明

托管人声明，在本报告期内，基金托管人——南京银行股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同，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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配等方面，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本半年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：中融融安保本混合型证券投资基金

报告截止日：2015年6月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2015年6月30日
资 产：		
银行存款	6.4.7.1	9,659,752.16
结算备付金		9,805,137.34
存出保证金		393,380.24
交易性金融资产	6.4.7.2	593,770,047.50
其中：股票投资		104,158,385.90
基金投资		—
债券投资		489,611,661.60
资产支持证券投资		—

贵金属投资		—
衍生金融资产	6.4.7.3	—
买入返售金融资产	6.4.7.4	—
应收证券清算款		21,274,606.64
应收利息	6.4.7.5	10,122,856.71
应收股利		—
应收申购款		12,845.84
递延所得税资产		—
其他资产	6.4.7.6	—
资产总计		645,038,626.43
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015年6月30日
负 债：		
短期借款		—
交易性金融负债		—
衍生金融负债	6.4.7.3	—
卖出回购金融资产款		140,399,839.90
应付证券清算款		—
应付赎回款		4,470,329.20
应付管理人报酬		539,217.22
应付托管费		112,336.92
应付销售服务费		—
应付交易费用	6.4.7.7	551,115.43
应交税费		—
应付利息		1,270.62
应付利润		—
递延所得税负债		—
其他负债	6.4.7.8	103,118.86
负债合计		146,177,228.15
所有者权益：		

实收基金	6.4.7.9	475,037,159.72
未分配利润	6.4.7.10	23,824,238.56
所有者权益合计		498,861,398.28
负债和所有者权益总计		645,038,626.43

注：1. 报告截止日2015年6月30日，基金份额总额475,037,159.72份，基金份额净值1.050元。

2. 本财务报表的实际编制期间为2015年2月12日(基金合同生效日)至2015年6月30日止期间。

6.2 利润表

会计主体：中融融安保本混合型证券投资基金

本报告期：2015年2月12日至2015年6月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期2015年2月12日至2015年6月30日
一、收入		39,141,563.94
1. 利息收入		10,888,339.63
其中：存款利息收入	6.4.7.11	3,625,313.97
债券利息收入		7,136,429.18
资产支持证券利息收入		—
买入返售金融资产收入		126,596.48
其他利息收入		—
2. 投资收益（损失以“-”填列）		20,549,233.82
其中：股票投资收益	6.4.7.12	19,380,927.28
基金投资收益		—
债券投资收益	6.4.7.13	928,611.67
资产支持证券投资收益		—
贵金属投资收益		—
衍生工具收益	6.4.7.14	—
股利收益	6.4.7.15	239,694.87

3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	6.4.7.16	6,437,757.80
4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)		—
5. 其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.17	1,266,232.69
减：二、费用		5,171,282.57
1. 管理人报酬		2,650,966.35
2. 托管费		552,284.68
3. 销售服务费		—
4. 交易费用	6.4.7.18	1,074,715.42
5. 利息支出		832,883.41
其中：卖出回购金融资产支出		832,883.41
6. 其他费用	6.4.7.19	60,432.71
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		33,970,281.37
减：所得税费用		—
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		33,970,281.37

注：本财务报表的实际编制期间为2015年2月12日(基金合同生效日)至2015年6月30日止期间。

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：中融融安保本混合型证券投资基金

本报告期：2015年2月12日至2015年6月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2015年2月12日至2015年6月30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)	583,193,767.89	—	583,193,767.89
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	33,970,281.37	33,970,281.37

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)	-108,156,608.17	-10,146,042.81	-118,302,650.98
其中：1. 基金申购款	7,022,903.01	674,033.68	7,696,936.69
2. 基金赎回款	-115,179,511.18	-10,820,076.49	-125,999,587.67
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)	475,037,159.72	23,824,238.56	498,861,398.28

注：本财务报表的实际编制期间为2015年2月12日(基金合同生效日)至2015年6月30日止期间。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

王瑶

曹健

高欣

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

中融融安保本混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于准予中融融安保本混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2015]63号）的注册，由中融基金管理有限公司向社会进行公开募集，募集期结束经上会会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具上会师报字（2015）第0263号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2015年2月12日正式生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金设立时，中融融安保本基金份额已收到首次募集的有效净认购金额为人民币583,031,148.74元，折合583,031,148.74份中融融安保本基金份额；有效认购资金在募集期间产生的利息为人民币162,619.15元，折合162,619.15份中融融安保本基金份额；以上收到的实收基金共计人民币583,193,767.89元，折合583,193,767.89份中融融安保本基金份额。本基金的基金管理人和注册登记机构均为中融基金管理有限公司，基金托管人为南京银行股份有限公司。

根据《中融融安保本混合型证券投资基金合同》和《中融融安保本混合型证券投资基金招募说明书》的相关规定，本基金保本周期期限为两年，第一个保本周期自2015年2月12日起至2017年2月13日止，由中国投融资担保有限公司担任担保人，中国投融资担

保有限公司为本基金第一个保本周期的保本提供不可撤销的连带责任保证。保证范围为：在保本周期到期日，如按基金份额持有人持有到期的基金份额与到期日基金份额净值的乘积加上其持有到期的基金份额在当期保本周期内的累计分红款项之和计算的总金额低于其保本金额，则基金管理人应补足该差额（即保本赔付差额）。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同及基金招募说明书的有关规定，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）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：债券、货币市场工具等稳健资产占基金资产的比例不低于70%，股票等风险资产的比例按照恒定比例投资组合保险策略进行动态调整，从而达到防御下跌、保值增值的目的。其中，持有现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准为沪深300指数收益率*50%+上证国债指数收益率*50%，本基金的业绩比较基准仅作为衡量本基金业绩的参照，不决定也不必然反映本基金的投资策略。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则-基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于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修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露编报规则》第5号《货币市场基金信息披露特别规定》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》及其他中国证监会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于2015年6月30日的财务状况以及2015年2月12日（基金合同生效日）至2015年6月30日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止，实际编制期间为2015年2月12日（基金合同生效日）至2015年12月31日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产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资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金以交易目的持有的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的应收款项是指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。

本基金持有的可供出售金融资产是指在初始确认时即被指定为可供出售的非衍生金融资产以及没有归类到其他类别的金融资产。

本基金持有的持有至到期投资是指有明确意图和能力持有至到期的且到期日固定、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(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。

6.4.4.4 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。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的金融资产和金融负债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，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵消。但是，同时满足下列条件的以相互抵消后的净额在资产负债表内列示：具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；本基金以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金

额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资收益（损失）、债券投资收益（损失）和衍生工具投资收益（损失）按相关金融资产于处置日成交金额与其成本的差额确认。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

债券利息收入按债券投资的票面价值与票面利率计算的金额扣除应由发行债券的企业代扣代缴的个人所得税（适用于企业债和可转债等）后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提。

存款利息收入按存款本金与适用利率逐日计提。

买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额，在回购期内按实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的收入差异较小的可采用直线法。

公允价值变动收益（损失）核算基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、衍生金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。

6.4.4.10 费用的确认和计量

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。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金在保本期内收益以现金形式分配。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金的基金管

理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.4.13 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，本基金确定以下类别股票投资和债券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[2008]38号《关于进一步规范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、市盈率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，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》，若估值日在证券交易所上市交易的同一股票的收盘价低于非公开发行股票的初始取得成本时，可采用在证券交易所上市交易的同一股票的收盘价作为估值日该非公开发行股票的价值；若估值日在证券交易所上市交易的同一股票的收盘价高于非公开发行股票的初始取得成本时，按锁定期内已经过交易所交易天数占锁定期内总交易所交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

(3) 在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

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、资产支持证券和私募债券除外)，鉴于其交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息，本基金本报告期改为采用第三方估值机构根据《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》所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金于2015年3月26日起改为采用第三方估值机构根据《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》所独立提供的价格数据进行估值。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(2) 对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，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。自2013年1月1日起，对基金从上市公司取得的股息红利所得，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，暂减按25%计入应纳税所得额。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4) 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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
活期存款	9,659,752.16
定期存款	—
其中：存款期限1-3个月	—
其他存款	—

合计	9,659,752.16
----	--------------

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2015年6月30日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		99,366,465.00	104,158,385.90	4,791,920.90
贵金属投资-金交所黄金合约		—	—	—
债券	交易所市场	227,761,017.37	227,914,661.60	153,644.23
	银行间市场	260,204,807.33	261,697,000.00	1,492,192.67
	合计	487,965,824.70	489,611,661.60	1,645,836.90
资产支持证券		—	—	—
基金		—	—	—
其他		—	—	—
合计		587,332,289.70	593,770,047.50	6,437,757.80

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末的买入返售金融资产余额为零。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
应收活期存款利息	2,645.27
应收定期存款利息	—

应收其他存款利息	—
应收结算备付金利息	4,412.30
应收债券利息	10,115,622.04
应收买入返售证券利息	—
应收申购款利息	—
应收黄金合约拆借孳息	—
其他	177.10
合计	10,122,856.71

注：其他为应收结算保证金利息。

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
交易所市场应付交易费用	545,143.83
银行间市场应付交易费用	5,971.60
合计	551,115.43

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	43,086.15
预提费用	60,032.71
合计	103,118.86

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期2015年2月12日至2015年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	583,193,767.89	583,193,767.89
本期申购	7,022,903.01	7,022,903.01
本期赎回（以“-”号填列）	-115,179,511.18	-115,179,511.18
本期末	475,037,159.72	475,037,159.72

注：1、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；

2、本基金自2015年1月13日至2015年2月10日止期间公开发售，共募集有效净认购资金583,031,148.74元，折算为583,031,148.74份基金份额。根据规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入162,619.15元，折算为162,619.15份基金份额，划入基金份额持有人账户。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	—	—	—
本期利润	27,532,523.57	6,437,757.80	33,970,281.37
本期基金份额交易产生的变动数	-3,877,385.52	-6,268,657.29	-10,146,042.81
其中：基金申购款	216,750.71	457,282.97	674,033.68
基金赎回款	-4,094,136.23	-6,725,940.26	-10,820,076.49
本期已分配利润	—	—	—
本期末	23,655,138.05	169,100.51	23,824,238.56

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2015年2月12日至2015年6月30日
活期存款利息收入	62,571.78
定期存款利息收入	3,537,916.67
其他存款利息收入	—
结算备付金利息收入	23,610.79
其他	1,214.73
合计	3,625,313.97

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期2015年2月12日至2015年6月30日
股票投资收益——买卖股票 差价收入	19,380,927.28
股票投资收益——赎回差价 收入	—
合计	19,380,927.28

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年2月12日至2015年6月30日
卖出股票成交总额	325,155,705.97
减：卖出股票成本总额	305,774,778.69
买卖股票差价收入	19,380,927.28

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2015年2月12日至2015年6月30日
债券投资收益——买卖债券 (、债转股及债券到期兑付) 差价收入	928,611.67
债券投资收益——赎回差价 收入	—
债券投资收益——申购差价 收入	—
合计	928,611.67

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年2月12日至2015年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	273,543,365.07
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	269,079,546.40
减：应收利息总额	3,535,207.00
买卖债券差价收入	928,611.67

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期间无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年2月12日至2015年6月30日
股票投资产生的股利收益	239,694.87
基金投资产生的股利收益	—
合计	239,694.87

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年2月12日至2015年6月30日
1. 交易性金融资产	6,437,757.80
——股票投资	4,791,920.90
——债券投资	1,645,836.90
——资产支持证券投资	—
——基金投资	—
——贵金属投资	—

——其他	—
2. 衍生工具	—
——权证投资	—
3. 其他	—
合计	6,437,757.80

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年2月12日至2015年6月30日
基金赎回费收入	1,266,232.69
合计	1,266,232.69

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年2月12日至2015年6月30日
交易所市场交易费用	1,069,315.42
银行间市场交易费用	5,400.00
合计	1,074,715.42

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年2月12日至2015年6月30日
审计费用	16,998.31
信息披露费	43,034.40
其他	400.00
合计	60,432.71

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金并无须作披露的重大资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系**6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况**

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方无发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
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
南京银行股份有限公司(“南京银行”)	基金托管人、基金代销机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易**6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易**

本基金本报告期内未通过关联方交易单元发生股票交易、权证交易、债券交易、债券回购交易，也未发生应支付关联方的佣金业务。本基金基金合同自2015年2月12日起生效，无上年可比期间。

6.4.10.2 关联方报酬**6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2015年2月12日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,650,966.35
其中：支付销售机构的客户维护费	933,471.79

注：①支付基金管理人的基金管理人报酬按前一日基金资产净值1.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。②基金管理人报酬计算公式为：日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×1.20%/当年天数。③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。④本基金基金合同自2015年2月12日起生效，无上年可比期间。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015年2月12日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	552,284.68

注：①支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。②基金托管费计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。③本基金基金合同自2015年2月12日起生效，无上年可比期间。

6.4.10.2.3 销售服务费

本基金本报告期内无销售服务费。本基金基金合同自2015年2月12日起生效，无上年可比期间。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。本基金基金合同自2015年2月12日起生效，无上年可比期间。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期内无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。本基金基金合同自2015年2月12日起生效，无上年可比期间。

6.4.10.4.2 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

本基金本报告期末及上年度末均无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.10.5 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 2015年2月12日至2015年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
南京银行活期	9,659,752.16	62,571.78

存款		
南京银行定期存款	—	—

注：1、本基金的活期银行存款由基金托管人南京银行保管，按银行同业利率计息；定期银行存款按银行约定利率计息。

2、本基金用于证券交易结算的资金通过南京银行基金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。2015年6月30日的相关余额在资产负债表中的“结算备付金”科目中单独列示，产生的利息收入在“重要财务报表项目的说明”中的“结算备付金利息收入”下列示。

3、本基金合同生效日为2015年2月12日，无上年度末可比数据。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末在承销期内参与关联方承销证券。本基金基金合同自2015年2月12日起生效，无上年可比期间。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无需要说明的其他关联交易事项。本基金基金合同自2015年2月12日起生效，无上年可比期间。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末进行利润分配。

6.4.12 期末（2015年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：债券									
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量	期末成本总额	期末估值总额
132002	15天集EB	2015-06-11	2015-07-02	新债发行未上市	100	100	5,820	582,000	582,000
112243	15东旭债	2015-05-20	2015-07-08	新债发行未上市	100	100	100,000	10,000,000	10,000,000

注：本基金本报告期末未持有因认购新发/增发而流通受限的股票。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量	期末成本总额	期末估值总额
600212	江泉实业	2015-05-25	筹划涉及本公司股权转让相关事宜	11.01	—	—	1,400,000	16,275,424.00	15,414,000.00
002375	亚厦股份	2015-06-17	筹划员工持股计划	29.21	2015-07-20	26.29	486,938	14,081,349.47	14,223,458.98
000890	法尔胜	2015-04-20	筹划发行股份购买资产	11.80	—	—	200,000	2,343,882.00	2,360,000.00

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2015年6月30日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额28,799,865.60元，于2015年7月1日到期，是以此债券作为抵押。

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
041551005	15盾安集CP001	2015-07-01	100.86	300,000	30,258,000.00
合计				300,000	30,258,000.00

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2015年6月30日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额111,599,974.30元，于2015年7月1日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所的债券或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人的风险管理机构由董事会下属的风险与合规委员会、督察长、法律合规部、风险管理部以及各个业务部门组成。

公司实行全面、系统的风险管理，风险管理覆盖公司所有战略环节、业务环节和操作环节。同时制定了系统化的风险管理程序，对风险管理的整个流程进行评估和改进。公司构建了分工明确、相互协作、彼此牵制的风险管理组织结构，形成了由四大防线共同筑成的风险管理体系：第一道防线由各个业务部门构成，各业务部门总监作为风险责任人，负责制订本部门的作业流程以及风险控制措施；第二道监控防线由公司专属风险管理部门法律合规部和风险管理部构成，法律合规部负责对公司业务的法律合规风险进行监控管理，风险管理部负责对公司投资管理风险和运作风险进行监控管理；第三道防线是由公司经营管理层构成，公司管理层对风险状况进行全面监督并及时制定相应的对策和实施监控措施；在上述这三道风险监控防线中，公司督察长和法律合规人员对风险控制措施和合规风险情况进行全面检查、监督，并视所发生问题情节轻重及时反馈给各部门。督察长独立于公司其他业务部门和公司管理层，对内部控制制度的执行情况实行严格检查和及时反馈，并独立报告；第四道监控防线由董事会下属的风险与合规委员会构成，风险与合规委员会通过督察长和法律合规人员的工作，掌握整体风险状况并进行决策。风险与合规委员会负责检查公司业务的内控制度的实施情况，监督公司对相关法律法规和公司制度的执行。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券等，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金在进

行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2015年6月30日
A-1	141,164,000.00
A-1 以下	-
未评级	80,319,000.00
合计	221,483,000.00

6.4.13.2.2 按中长期信用评级列示的债券投资

中长期信用评级	本期末 2015年6月30日
AAA	33,160,790.50
AAA 以下	234,967,871.10
未评级	-
合计	268,128,661.60

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限的投资品种比例等。本基金所持有的交易性金融资产分别在证券交易所和银行间同业市场交易，未持有有重大流动性风险的投资品种。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

金额单位：人民币元

本期末 2015年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	9,659,752.16				9,659,752.16
结算备付金	9,805,137.34				9,805,137.34
存出保证金	393,380.24				393,380.24
交易性金融资产	274,779,420.10	214,607,011.00	225,230.50	104,158,385.90	593,770,047.50
应收证券清算款				21,274,606.64	21,274,606.64
应收利息				10,122,856.71	10,122,856.71
应收申购款				12,845.84	12,845.84
资产总计	294,637,68	214,607,01	225,230.50	135,568,69	645,038,62

	9.84	1.00		5.09	6.43
负债					
卖出回购金融资产款	140,399,839.90				140,399,839.90
应付赎回款				4,470,329.20	4,470,329.20
应付赎回费				43,086.15	43,086.15
应付管理人报酬				539,217.22	539,217.22
应付托管费				112,336.92	112,336.92
应付交易费用				551,115.43	551,115.43
应付利息				1,270.62	1,270.62
其他负债				60,032.71	60,032.71
负债总计	140,399,839.09			5,777,388.25	146,177,228.15
利率敏感度缺口	154,237,849.94	214,607,011.00	225,230.50	129,791,306.84	498,861,398.28

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

利率风险的敏感性分析			
假设	假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他变量不变；		
假设	其他市场变量保持不变；		
假设	此项影响并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末	上年度末

		2015年6月30日	2014年12月31日
	市场利率下降 25 个基点	1,415,614.74	-
	市场利率上升 25 个基点	-1,406,706.92	-

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日		上年度末 2014年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	104,158,385.90	20.88		
交易性金融资产-债券投资	489,611,661.60	98.15		
衍生金融资产-权证投资				
其他				
合计	593,770,047.50	119.03		

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于2015年6月30日，本基金主要投资于固定收益品种，因此除市场利率之外的市场价格因素的变动对本基金资产净值无重大影响。

6.4.14 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

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：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：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2015 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 72,386,157.42 元，属于第二层次的余额为 521,383,890.08 元，无属于第三层次的余额。

(ii) 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。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2015 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d) 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，其账面价值与公允价值相差很小。

(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。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比
----	----	-------	----------

			例 (%)
1	权益投资	104,158,385.90	16.15
	其中：股票	104,158,385.90	16.15
2	固定收益投资	489,611,661.60	75.90
	其中：债券	489,611,661.60	75.90
	资产支持证券	—	—
3	贵金属投资	—	—
4	金融衍生品投资	—	—
5	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
6	银行存款和结算备付金合计	19,464,889.50	3.02
7	其他各项资产	31,803,689.43	4.93
8	合计	645,038,626.43	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

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	11,325.00	—
B	采矿业	24,750.00	—
C	制造业	52,933,928.53	10.61
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	14,223,458.98	2.85
F	批发和零售业	15,260,667.00	3.06
G	交通运输、仓储和邮政业	5,708,667.96	1.14
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	350,733.34	0.07
J	金融业	206,040.00	0.04
K	房地产业	2,250.09	—
L	租赁和商务服务业	22,565.00	—

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	15,414,000.00	3.09
	合计	104,158,385.90	20.88

7.3 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

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	600686	金龙汽车	700,829	18,039,338.46	3.62
2	300351	永贵电器	407,005	15,608,641.75	3.13
3	600212	江泉实业	1,400,000	15,414,000.00	3.09
4	600120	浙江东方	450,300	15,260,667.00	3.06
5	600703	三安光电	485,000	15,180,500.00	3.04
6	002375	亚厦股份	486,938	14,223,458.98	2.85
7	600125	铁龙物流	369,972	5,708,667.96	1.14
8	000890	法尔胜	200,000	2,360,000.00	0.47
9	002395	双象股份	39,000	797,550.00	0.16
10	300464	星徽精密	19,138	697,388.72	0.14
11	300469	信息发展	6,596	302,360.64	0.06
12	601211	国泰君安	6,000	206,040.00	0.04
13	300483	沃施股份	9,356	153,438.40	0.03
14	300448	浩云科技	500	48,295.00	0.01
15	603789	星光农机	1,000	40,010.00	0.01
16	603818	曲美股份	1,000	32,690.00	0.01
17	603979	金诚信	1,000	24,750.00	—
18	300476	胜宏科技	500	23,800.00	—

19	002769	普路通	500	22,565.00	—
20	002772	众兴菌业	500	11,325.00	—
21	600215	长春经开	207	2,250.09	—
22	002220	天宝股份	40	571.20	—
23	300229	拓尔思	3	77.70	—

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	600118	中国卫星	30,300,563.80	6.07
2	600104	上汽集团	24,071,395.12	4.83
3	600215	长春经开	22,142,680.22	4.44
4	600120	浙江东方	22,029,086.75	4.42
5	600686	金龙汽车	21,398,113.40	4.29
6	002375	亚厦股份	21,217,302.50	4.25
7	600703	三安光电	21,187,919.00	4.25
8	000768	中航飞机	18,770,554.12	3.76
9	600125	铁龙物流	18,447,430.52	3.70
10	600859	王府井	17,088,447.00	3.43
11	002418	康盛股份	16,986,525.80	3.41
12	600000	浦发银行	16,420,682.07	3.29
13	600212	江泉实业	16,275,424.00	3.26
14	300351	永贵电器	15,748,085.35	3.16
15	600728	佳都科技	12,548,816.00	2.52
16	601318	中国平安	10,217,692.00	2.05
17	601668	中国建筑	9,358,850.00	1.88
18	600895	张江高科	9,100,293.75	1.82
19	002454	松芝股份	6,275,667.75	1.26
20	002465	海格通信	6,087,313.50	1.22

注：“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。

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	600118	中国卫星	28,762,746.55	5.77
2	600215	长春经开	25,523,473.02	5.12
3	600104	上汽集团	25,504,125.92	5.11
4	600859	王府井	18,716,714.60	3.75
5	600728	佳都科技	17,401,990.98	3.49
6	600000	浦发银行	17,133,250.00	3.43
7	000768	中航飞机	16,111,308.63	3.23
8	600125	铁龙物流	15,593,411.01	3.13
9	002418	康盛股份	14,258,854.30	2.86
10	600895	张江高科	13,023,375.27	2.61
11	601668	中国建筑	12,380,388.05	2.48
12	601318	中国平安	10,929,855.00	2.19
13	600005	武钢股份	7,715,484.35	1.55
14	300351	永贵电器	7,288,863.40	1.46
15	002375	亚厦股份	7,275,641.12	1.46
16	002454	松芝股份	6,819,996.25	1.37
17	600120	浙江东方	6,213,343.82	1.25
18	600875	东方电气	5,489,751.39	1.10
19	600686	金龙汽车	5,390,402.00	1.08
20	601688	华泰证券	4,422,071.04	0.89

注：“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。

7.4.3 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

买入股票的成本（成交）总额	405,141,243.69
卖出股票的收入（成交）总额	325,155,705.97

注：“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	—	—
2	央行票据	—	—
3	金融债券	30,162,000.00	6.05
	其中：政策性金融债	30,162,000.00	6.05
4	企业债券	227,107,431.10	45.53
5	企业短期融资券	191,321,000.00	38.35
6	中期票据	40,214,000.00	8.06
7	可转债	807,230.50	0.16
8	其他	—	—
9	合计	489,611,661.60	98.15

7.6 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

金额单位：人民币元

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	122126	11庞大02	450,000	47,317,500.00	9.49
2	041551005	15盾安集CP001	300,000	30,258,000.00	6.07
3	150202	15国开02	300,000	30,162,000.00	6.05
4	122070	11海航01	292,330	29,817,660.00	5.98
5	112045	11宗申债	241,000	25,639,990.00	5.14

7.7 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。

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投资。

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**

本基金本报告期末无股指期货投资。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末无股指期货投资。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**7.11.1 本期国债期货投资政策**

本基金本报告期末无国债期货投资。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货投资。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

7.12.2 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。

7.12.3 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	393,380.24
2	应收证券清算款	21,274,606.64
3	应收股利	—
4	应收利息	10,122,856.71
5	应收申购款	12,845.84

6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	31,803,689.43

7.12.4 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。

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	流通受限部分的 公允价值	占基金资产净 值比例 (%)	流通受限情况 说明
1	600212	江泉实业	15,414,000.00	3.09	筹划涉及本公司股权转让相关事宜
2	002375	亚厦股份	14,223,458.98	2.85	筹划员工持股计划
3	000890	法尔胜	2,360,000.00	0.47	筹划发行股份购买资产

7.12.6 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。

§ 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

份额单位：份

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
3,544	134,039.83	13,393,032.36	2.82%	461,644,127.3	97.18%

				6	
--	--	--	--	---	--

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本报告期末，本基金基金管理人的从业人员未持有本基金。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2015年2月12日)基金份额总额	583,193,767.89
本报告期期初基金份额总额	583,193,767.89
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	7,022,903.01
基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	115,179,511.18
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	—
本报告期期末基金份额总额	475,037,159.72

注：1、基金合同生效日为2015年2月12日；

2、总申购份额含转入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 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

2015年1月9日发布《基金行业高级管理人员变更公告》，任命严九鼎先生担任中融基金管理有限公司副总经理。

2015年2月28日发布《基金行业高级管理人员变更公告》，任命王瑶女士担任中融基金管理有限公司法定代表人、董事长、代任总经理；免除王瑶女士总经理职务；免除桂松蕾女士法定代表人、董事长职务。

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无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，为本基金进行审计的会计师事务所为上会会计师事务所(特殊普通合伙)。

10.6 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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况**10.7.1 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比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
五矿证券有限公司	2	729,328,912.69	100%	638,414.68	100%	—

注：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。

③本基金合同于2015年2月12日生效，本基金选择了五矿证券的交易单元作为本基金交易单元，本报告期内交易单位未发生变化。

10.7.2 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	
	成交金额	占当期债券成交总额比例	成交金额	占当期债券回购成交总额比例	成交金额	占当期权证成交总额比例
五矿证券有限公司	376,783,329.41	100%	4,796,788,000	100%	—	—

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	信息披露方式	披露日期
1	中融融安保本招募说明书	证券日报、管理人网站	2015-01-10
2	中融融安保本混合型证券投资基金托管协议	证券日报、管理人网站	2015-01-10
3	中融融安保本混合型证券投资基金基金份额发售公告	证券日报、管理人网站	2015-01-10
4	中融融安保本混合型证券投资基金合同	证券日报、管理人网站	2015-01-10
5	关于增加海通证券为中融旗下基金销售机构的公告	证券日报、管理人网站	2015-01-16
6	关于中融融安保本基金增加基金销售机构公告	证券日报、管理人网站	2015-01-29
7	关于中融融安保本基金增加基金销售机构公告	证券日报、管理人网站	2015-02-06
8	中融融安保本混合型证券投资基金基金合同生效公告	证券日报、管理人网站	2015-02-13
9	高级管理人员变更公告	证券日报、上海证券报、中国证券报、证券时报、管理人网站	2015-02-28
10	关于开通 400 全国统一客服热线的公告	证券日报、上海证券报、中国证券报、证券时报、管理人网站	2015-03-05
11	中融基金管理有限公司关于公司住所变更的公告	证券日报、上海证券报、中国证券报、证券时报、管理人网站	2015-03-14
12	中融基金参加齐鲁证券费率优惠公告	证券日报、上海证券报、中国证券报、证券时报、管理人网站	2015-03-16
13	关于开通通联支付直销网上交易和费率优惠的公告	证券日报、上海证券报、中国证券报、证券时报、管理人网站	2015-03-21
14	中融基金管理有限公司关于增加注册资本的公告	证券日报、上海证券报、中国证券报、证券	2015-03-25

		时报、管理人网站	
15	关于旗下基金调整交易所固定收益品种估值方法的公告	证券日报、上海证券报、中国证券报、证券时报、管理人网站	2015-03-27
16	中融基金管理有限公司基金经理变更公告	证券日报、管理人网站	2015-04-18
17	关于增加中信建投证券股份有限公司为中融旗下部分基金销售机构的公告	证券日报、上海证券报、中国证券报、证券时报、管理人网站	2015-04-27
18	关于增加北京增财基金销售有限公司为中融旗下开放式证券投资基金销售机构的公告	证券日报、上海证券报、中国证券报、证券时报、管理人网站	2015-04-28
19	关于网上直销交易申购费率优惠的公告	证券日报、上海证券报、中国证券报、证券时报、管理人网站	2015-05-05
20	关于增加北京钱景财富投资管理有限公司为中融旗下开放式证券投资基金销售机构的公告	证券日报、上海证券报、中国证券报、证券时报、管理人网站	2015-05-06
21	关于增加深圳众禄基金销售有限公司为中融旗下开放式证券投资基金销售机构及参加其费率优惠活动的公告	证券日报、上海证券报、中国证券报、证券时报、管理人网站	2015-05-07
22	关于增加中国民族证券有限责任公司为中融旗下开放式证券投资基金销售机构的公告	证券日报、上海证券报、中国证券报、证券时报、管理人网站	2015-05-07
23	中融融安保本混合型证券投资基金开放日常申购、赎回业务公告	证券日报、管理人网站	2015-05-08
24	关于增加华西证券股份有限公司为中融旗下开放式证券投资基金销售机构的公告	证券日报、上海证券报、中国证券报、证券时报、管理人网站	2015-05-11

§11 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。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会核准中融融安保本混合型证券投资基金募集的文件
- (2) 《中融融安保本混合型证券投资基金基金合同》
- (3) 《中融融安保本混合型证券投资基金招募说明书》
- (4) 《中融融安保本混合型证券投资基金托管协议》
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照
- (6) 基金托管人业务资格批件、营业执照

12.2 存放地点

基金管理人或基金托管人的办公场所

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可在支付工本费后，在合理时间取得上述文件的复印件

咨询电话：中融基金管理有限公司客户服务 400-160-6000（免长途话费），（010）85003210

网址：<http://www.zrfunds.com.cn/>

中融基金管理有限公司

2015年8月27日