

# 中融融安二号保本混合型证券投资基金 2016年半年度报告

2016年06月30日

基金管理人：中融基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2016年08月24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体独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2016年8月23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2016年1月1日起至2016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的说明.....	9
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.....	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	11
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.....	13
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.....	32
7.1 期末基金资产组合情况.....	32
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	33
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.....	34
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	34
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.....	36
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.....	36
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.....	36
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.....	36
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	37
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	37
7.12 投资组合报告附注.....	37
§8 基金份额持有人信息.....	38
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	38
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	38
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情况.....	38
§9 开放式基金份额变动.....	38
§10 重大事件揭示.....	39
10.1 基金份额持有人大会决议.....	39
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.....	39
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	39

10.4	基金投资策略的改变.....	39
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	39
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.....	39
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	39
10.8	其他重大事件.....	40
§11	影响投资者决策的其他重要信息.....	43
§12	备查文件目录.....	43
12.1	备查文件目录.....	43
12.2	存放地点.....	43
12.3	查阅方式.....	43

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	中融融安二号保本混合型证券投资基金
基金简称	中融融安二号保本
基金主代码	001739
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年09月25日
基金管理人	中融基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	229,893,125.78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。
业绩比较基准	三年期银行定期存款收益率（税后）
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较低风险品种，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	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	裴芸	王永民
	联系电话	010-85003300	010-66594896
	电子邮箱	peiyun@zrfunds.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-160-6000；010-85003210	95566
传真		010-85003386	010-66594942
注册地址		深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室	北京市西城区复兴门内大街1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	北京市西城区复兴门内大街1号
邮政编码	100005	100818
法定代表人	王瑶	田国立

## 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	<a href="http://www.zrfunds.com.cn/">http://www.zrfunds.com.cn/</a>
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

## § 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（2016年1月1日至2016年6月30日）
本期已实现收益	2,181,305.63
本期利润	-3,331,978.09
加权平均基金份额本期利润	-0.0141
本期加权平均净值利润率	-1.39%
本期基金份额净值增长率	-1.37%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2016年6月30日）
期末可供分配利润	2,401,341.88
期末可供分配基金份额利润	0.0104
期末基金资产净值	232,294,467.66
期末基金份额净值	1.010
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2016年6月30日）
基金份额累计净值增长率	1.00%

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；

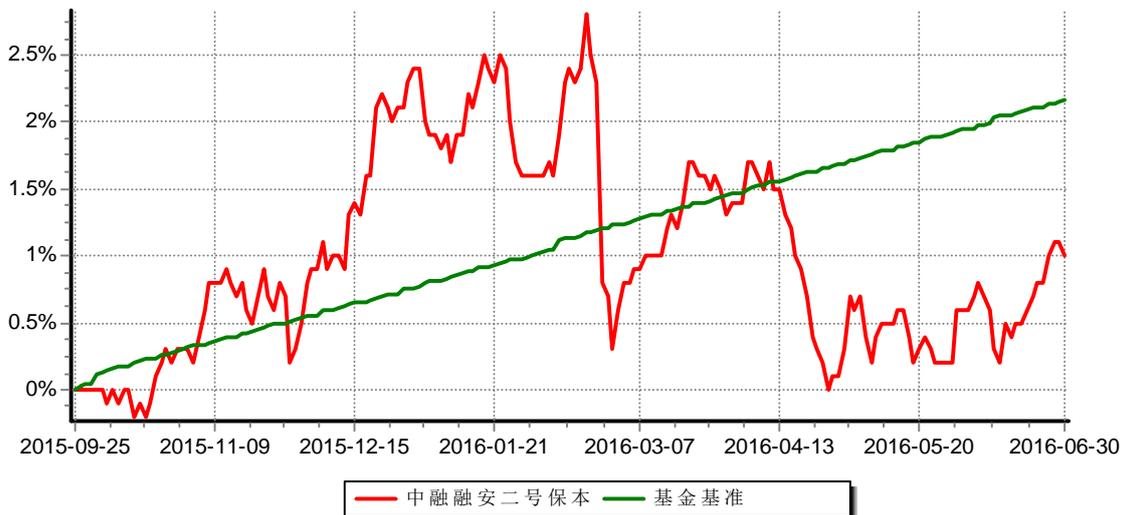
- 2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；
- 3、期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数；

### 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	0.40%	0.13%	0.22%	0.01%	0.18%	0.12%
过去三个月	-0.39%	0.16%	0.69%	0.01%	-1.08%	0.15%
过去六个月	-1.37%	0.22%	1.38%	0.01%	-2.75%	0.21%
自基金合同生效日起至今（2015年09月25日-2016年06月30日）	1.00%	0.20%	2.16%	0.01%	-1.16%	0.19%

#### 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：中融融安二号保本混合型证券投资基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

（2015年9月25日至2016年6月30日）

注：本基金基金合同生效日2015年9月25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，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规定。

## § 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2016年6月30日，中融基金管理有限公司共管理18只基金，包括中融增鑫定期开放债券、中融货币、中融国企改革混合、中融融安保本混合、中融新机遇混合、中融一带一路、中融银行、中融新动力混合、中融钢铁、中融煤炭、中融融安二号保本、中融白酒、中融新优势混合、中融稳健添利债券、中融新经济混合、中融日盈、中融产业升级混合、中融融丰纯债。

#### 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期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李倩	本基金、中融货币、中融日盈基金经理	2015年10月28日	—	9年	李倩女士，中国国籍，毕业于对外经济贸易大学金融学专业，本科学历，具有基金从业资格，证券从业年限9年。2007年7月至2014年7月曾任银华基金管理有限公司交易管理部交易员，固定收益部基金经理助理。2014年7月加入中融基金管理有限公司，任固收投资部(北京)基金经理，2015年10月至今任本基金基金经理。
贾志敏	本基金、中融货币、中融融安保本混合、中融新动力混合、中融新优势	2015年09月25日	—	10年	贾志敏先生，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10年。2006年7月至2012年10月曾任中信银行资金资本市场部交易员；2012年10月至2014年11月曾任长盛基金管理有限公

	混合、中融新经济混合基金经理、固收投资部（北京）负责人				司固定收益部副总监。2014年11月加入中融基金管理有限公司，任固收投资部（北京）总监，于2015年9月任本基金基金经理。
--	-----------------------------	--	--	--	---

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。

（3）根据本基金管理人于2016年8月20日发布的《中融基金管理有限公司基金经理变更公告》，贾志敏先生不再担任本基金基金经理。

## 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、《中融融安二号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

本公司原则上禁止不同投资组合之间（完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的投资组合除外）或同一投资组合在同一交易日内进行反向交易。如果因应对大额赎回等特殊情况进行反向交易的，则需经公司领导严格审批并留痕备查。

本报告期内，本投资组合与本公司管理的其他投资组合未发生过同日反向交易的情况，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的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年债市呈现宽幅震荡走势。一季度随着对过度悲观的经济预期修正，收益率曲

线呈陡峭化调整趋势，期限利差走阔。二季度债券市场在多重因素的冲击下，先抑后扬。收益率曲线得到了修复，利率债和高等级债的中长端下行明显，接近年内低点，曲线趋于平坦化。过剩产能的信用利差持续扩大。具体来看上半年：R001运行区间在1.9%-2.20%，最终上行5bp。R007运行区间在2.25%-2.6%，最终上行26bp。1年期金融债总体震荡上行，最终上行15bp至2.62%。10年期金融债宽幅震荡后又回到年初水平至3.15%。1年的AAA短融共计上行5bp至2.95%，1年的AA短融基本与年初持平至3.76%。5年的AAA企业债上行10bp至3.42%，5年的AA企业债小幅下行5bp至4.32%。

本基金一季度逐渐降低了债券组合杠杆，保持中短久期，精选个券，提高组合防御能力。在英国脱欧公投落地后，加仓了中长债，提高组合杠杆，并适当拉长组合久期。

权益市场方面，2016年上半年以来，宏观经济国内GDP同比增长6.7%，季度之间增速十分平稳。经济的内生动力较弱，房地产和制造业投资增速依旧在下行通道之中。民间投资增速下滑较快，年初以来基建投资成为支撑投资增长的主力。政府在稳增长和调结构之间进行着艰难的平衡，政府托底经济的意愿依旧明显。上半年财政收入和支出增速分别为7.1%和15.1%，支出增速大大高于收入增速。上半年新增社融与信贷规模已占全年的54%和62%。

全球经济缺乏增长引擎，货币政策的效果降低，信息传递速度加快。由于缺少经济周期和基本面支撑，资产价格受流动性和情绪驱动明显，交易拥挤和投机氛围浓厚造成资产价格波动大和轮动快可能是常态。2016年上半年A股市场振幅较大。截至2016年6月30日，万得全A指数下跌18.26%，上证综指下跌20%，创业板指数下跌19.85%。A股中长期受经济结构转型、改革预期、流动性、汇率等因素的支配。今年1季度由于担忧美国加息、国内资本外流和人民币贬值加速，在熔断制度助推之下，市场大幅回调。虽然股票仓位整体在安全垫的范围之内，但受到股市深幅回调的影响，组合净值出现一定回撤。随着二季度股市企稳，我们参与反弹减少了回撤的幅度，并逐渐调低了权益资产的仓位，集中把握确定性较高的投资机会，提高组合仓位的有效性。

#### 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二号保本混合份额净值为1.010元；本报告期基金份额净值增长率为-1.37%，业绩比较基准收益率为1.38%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

经济增长缺乏新亮点，长期来看收益率仍处于下行通道。全球黑天鹅事件频发，避险情绪升温，宽松预期再起，整体环境仍有利于债市。政策方面，在金融机构去杠杆和供给侧改革的基调下，我们难再现大水漫灌式货币宽松，资金价格大概率维持低位震荡，下行突破概率不大，上行弹性宽裕。

我们将密切关注宏观经济运行情况、资金面走势、以及各种政策的发布，组合将做好资产配置，适度控制久期和杠杆，积极捕捉交易性机会，增厚组合收益。同时严控信用风险，甄选个券。

权益市场方面，展望下半年，中国经济面临的下行压力仍然较大，去产能、去库存、去杠杆以及稳增长多目标更难平衡。预计下半年房地产投资增速较上半年回落，民间投资继续下滑，工业去产能如果严格执行短期带来的压力将使稳增长承压。政府为了完成稳增长的目标，仍然需要财政、货币及产业政策从各方面进行托底。

我们认为指数上看不到趋势性的机会，但是阶段性和结构性的机会仍然存在，需要把握好操作节奏。经济内生动力弱、业绩驱动不明显；小盘股估值高位，大盘股国家队控盘；产业资本减持和巨大的再融资小消磨资金，市场对中长期仍然缺乏信心，预计市场仍然会是存量博弈的格局。由于经济内生动力弱、无风险利率低，国内资本流动管制和全球资产荒的背景，股市仍会有业绩确定和流动性驱动的结构行情。我们将根据市场节奏和安全垫的要求灵活调整仓位，控制回撤，精选估值合理的优质成长股获取绝对收益。

#### 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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在中融融安二号保本混合型证券投资基金（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合规守信、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地复核，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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## § 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：中融融安二号保本混合型证券投资基金

报告截止日：2016年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	204,858.29	377,183.86
结算备付金		659,258.66	2,860,177.40
存出保证金		68,170.05	44,989.73
交易性金融资产	6.4.7.2	303,821,315.40	387,059,086.54
其中：股票投资		10,917,390.00	14,224,590.64
基金投资		—	—
债券投资		292,903,925.40	372,834,495.90
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	—	5,700,000.00
应收证券清算款		—	2,981,404.19
应收利息	6.4.7.5	5,767,362.02	6,671,018.87

应收股利		—	—
应收申购款		—	299.64
递延所得税资产		—	—
其他资产	6.4.7.6	—	—
资产总计		310,520,964.42	405,694,160.23
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016年6月30日</b>	<b>上年度末 2015年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
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		77,799,774.50	154,499,662.75
应付证券清算款		—	2,695,177.64
应付赎回款		39,326.22	30,124.54
应付管理人报酬		229,153.48	250,771.56
应付托管费		38,192.24	41,795.26
应付销售服务费		—	—
应付交易费用	6.4.7.7	41,616.00	103,820.69
应交税费		—	—
应付利息		13,187.80	24,962.34
应付利润		—	—
递延所得税负债		—	—
其他负债	6.4.7.8	65,246.52	88,307.38
负债合计		78,226,496.76	157,734,622.16
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	229,893,125.78	242,068,624.62
未分配利润	6.4.7.10	2,401,341.88	5,890,913.45
所有者权益合计		232,294,467.66	247,959,538.07
负债和所有者权益总计		310,520,964.42	405,694,160.23

注：报告截止日2016年6月30日，基金份额总额229,893,125.78份，份额净值1.010元。

## 6.2 利润表

会计主体：中融融安二号保本混合型证券投资基金

本报告期：2016年1月1日至2016年6月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2016年1月1日至2016年6月30日
<b>一、收入</b>		141,087.47
1. 利息收入		8,751,225.59
其中：存款利息收入	6.4.7.11	48,410.73
债券利息收入		8,683,465.11
资产支持证券利息收入		—
买入返售金融资产收入		19,349.75
其他利息收入		—
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-3,188,126.07
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-3,517,382.16
基金投资收益		—
债券投资收益	6.4.7.13	322,506.09
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	6,750.00
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-5,513,283.72
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	91,271.67
<b>减：二、费用</b>		3,473,065.56
1. 管理人报酬		1,426,925.48
2. 托管费		237,820.94
3. 销售服务费		—
4. 交易费用	6.4.7.18	295,030.71
5. 利息支出		1,417,124.82

其中：卖出回购金融资产支出		1,417,124.82
6. 其他费用	6.4.7.19	96,163.61
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-3,331,978.09
减：所得税费用		—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-3,331,978.09

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中融融安二号保本混合型证券投资基金

本报告期：2016年1月1日至2016年6月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2016年1月1日至2016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)	242,068,624.62	5,890,913.45	247,959,538.07
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	-3,331,978.09	-3,331,978.09
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）	-12,175,498.84	-157,593.48	-12,333,092.32
其中：1. 基金申购款	566,057.42	8,949.19	575,006.61
2. 基金赎回款	-12,741,556.26	-166,542.67	-12,908,098.93
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）	229,893,125.78	2,401,341.88	232,294,467.66

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

中融融安二号保本混合型证券投资基金(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[2015]1747号文《关于准予中融融安二号保本混合型证券投资基金注册的批复》批准,由基金发起人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《中融融安二号保本混合型证券投资基金基金合同》(“基金合同”)发起,于2015年9月25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,基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金募集期为2015年8月13日至2015年9月23日,本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,募集资金总额为人民币247,376,790.22元,有效认购户数为1,671户。其中,认购资金在募集期间产生的利息共计人民币54,211.04元,折合基金份额54,211.04份,按照基金合同的有关约定计入基金份额持有人的基金账户。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)、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)、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、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)。

本基金业绩比较基准:三年期银行定期存款收益率(税后)。

### 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3号《半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

本基金2016年上半年度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2016年6月30日的财务状况以及2016年上半年的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策与最近一期年度报告一致。

### 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

本基金本报告期不涉及会计政策变更事项。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期不涉及会计估计变更事项。

#### 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

#### 1、印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年4月24日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的3‰调整为1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年9月19日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

#### 2、营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税和企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，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，暂不征收企业所得税。

#### 3、个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定，对基金取得的股票的股息、红利收入，债券的利息收入、储蓄存款利息收入，由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《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》的规定，自2013年1月1日起，证券投资基金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，暂减按25%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；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号文《财政部国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自2008年10月9日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

#### 4、增值税

根据财政部 国家税务总局财税〔2016〕36号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》，经国务院批准，自2016年5月1日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税（以下称营改增）试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。根据上述规定，对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券免征增值税；基金管理费、手续费、投资顾问费及销售服务费应全额按直接收费金融服务6%的税率缴税；基金公司的自营投资业务，按照“金融商品转让”这一规定缴纳。

### 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 2016年6月30日
活期存款	204,858.29
定期存款	—
其中：存款期限1-3个月	—
其他存款	—
合计	204,858.29

## 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	11,134,936.60	10,917,390.00	-217,546.60
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—
债券	交易所市场	119,174,496.02	115,647,925.40
	银行间市场	177,444,892.84	177,256,000.00
	合计	296,619,388.86	292,903,925.40
资产支持证券	—	—	—
基金	—	—	—
其他	—	—	—
合计	307,754,325.46	303,821,315.40	-3,933,010.06

## 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或负债。

## 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

本基金于本报告期末未持有买入返售金融资产。

## 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金于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 2016年6月30日
应收活期存款利息	344.30
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	296.76
应收债券利息	5,766,690.26
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	30.70
合计	5,767,362.02

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产余额。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
交易所市场应付交易费用	33,623.70
银行间市场应付交易费用	7,992.30
合计	41,616.00

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	601.94
预提费用	64,644.58
合计	65,246.52

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期2016年1月1日至2016年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	242,068,624.62	242,068,624.62
本期申购	566,057.42	566,057.42
本期赎回（以“-”号填列）	-12,741,556.26	-12,741,556.26
本期末	229,893,125.78	229,893,125.78

注：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

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	4,277,783.08	1,613,130.37	5,890,913.45
本期利润	2,181,305.63	-5,513,283.72	-3,331,978.09
本期基金份额交易产生的变动数	-233,018.71	75,425.23	-157,593.48
其中：基金申购款	9,252.82	-303.63	8,949.19
基金赎回款	-242,271.53	75,728.86	-166,542.67
本期已分配利润	—	—	—
本期末	6,226,070.00	-3,824,728.12	2,401,341.88

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2016年1月1日至2016年6月30日
活期存款利息收入	22,577.54
定期存款利息收入	—
其他存款利息收入	—
结算备付金利息收入	25,023.19
其他	810.00
合计	48,410.73

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2016年1月1日至2016年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-3,517,382.16
股票投资收益——赎回差价收入	—
合计	-3,517,382.16

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

	2016年1月1日至2016年6月30日
卖出股票成交总额	110,091,121.96
减：卖出股票成本总额	113,608,504.12
买卖股票差价收入	-3,517,382.16

#### 6.4.7.13 债券投资收益

##### 6.4.7.13.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出债券及债券到期兑付成交总额	265,604,119.63
减：卖出债券及债券到期兑付成本总额	261,135,649.01
减：应收利息总额	4,145,964.53
买卖债券差价收入	322,506.09

#### 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 2016年1月1日至2016年6月30日
股票投资产生的股利收益	6,750.00
基金投资产生的股利收益	—
合计	6,750.00

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
1. 交易性金融资产	-5,513,283.72
——股票投资	-199,786.11
——债券投资	-5,313,497.61
——资产支持证券投资	—

——基金投资	0
——贵金属投资	—
——其他	—
2. 衍生工具	—
——权证投资	—
3. 其他	—
合计	-5, 513, 283. 72

## 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
基金赎回费收入	91, 027. 28
转换费收入	244. 39
合计	91, 271. 67

## 6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
交易所市场交易费用	292, 105. 71
银行间市场交易费用	2, 925. 00
合计	295, 030. 71

## 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
审计费用	14, 918. 54
信息披露费	49, 726. 04
其他	901. 48
帐户维护费	15, 000. 00
汇划手续费	15, 617. 55
合计	96, 163. 61

#### 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
中国银行股份有限公司（以下简称“中国银行”）	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

###### 6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期未通过关联方进行股票交易。本基金成立于2015年09月25日，无上年可比期间。

###### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。本基金成立于2015年09月25日，无上年度可比期间。

###### 6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期无应支付关联方的佣金。本基金成立于2015年09月25日，无上年度可比期间。

###### 6.4.10.1.4 债券交易

本基金本报告期未通过关联方进行债券交易。本基金成立于2015年09月25日，无上年度可比期间。

###### 6.4.10.1.5 债券回购交易

本基金本报告期未通过关联方进行债券回购交易。本基金成立于2015年09月25日，无上年度可比期间。

##### 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	
	2016年1月1日至2016年6月30日	
当期发生的基金应支付的管理费	1,426,925.48	
其中：支付销售机构的客户维护费	776,789.37	

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9月25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	
	2016年1月1日至2016年6月30日	
当期发生的基金应支付的托管费	237,820.94	

注：①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×0.25%/当年天数。②本基金基金合同自2015年09月25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

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。本基金成立于2015年09月25日，无上年度可比期间。

#### 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

本基金基金管理人于本报告期末运用固有资金投资本基金。本基金成立于2015年09月25日，无上年度可比期间。

##### 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

除基金管理人之外，本基金的其他关联方于本报告期末及上年度末未持有本基金。

#### 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	
	2016年1月1日至2016年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国银行活期存款	204,858.29	22,577.54

注：1、本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

2、本基金用于证券交易结算的资金通过“中国银行股份有限公司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。2016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、本基金基金合同自2015年09月25日起生效，无上年可比期间。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期未在承销期内参与关联方承销证券。本基金成立于2015年09月25日，无上年度可比期间。

#### 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。本基金成立于2015年09月25日，无上年度可比期间。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2016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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌股票。

##### 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2016年06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50,999,774.50元，于2016年7月1日到期，是以以下债券作为抵押。

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
1080171	10吴江发展债	2016-07-01	104.64	200,000	20,928,000.00
1180095	11常城建债	2016-07-01	105.24	110,000	11,576,400.00
1280366	12鄂西圈投债	2016-07-01	110.35	200,000	22,070,000.00
合计				510,000	54,574,400.00

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2016年06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26,800,000.00元，于2016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和内控及风险管理委员会构成，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，公司督察长和监察稽核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经理、内控及风险管理委员会、公司总经理、监管机构。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监察稽核人员的工作，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 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
A-1	30,211,000.00	60,297,000.00
A-1以下	—	—
未评级	31,799,820.00	53,103,600.00
合计	62,010,820.00	113,400,600.00

注：短期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由债券发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。未评级中包含政策性金融债及超短期融资券等。

#### 6.4.13.2.2按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
AAA	15,641,086.30	36,279,694.80
AAA以下	195,205,019.10	223,154,201.10
未评级	20,047,000.00	—
合计	230,893,105.40	259,433,895.90

注：长期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由债券发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。

#### 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上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制的投资品种比例等。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

单位：人民币元

本期末 2016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	204,858.29	—	—	—	204,858.29
结算备付金	659,258.66	—	—	—	659,258.66
存出保证金	68,170.05	—	—	—	68,170.05
交易性金融资产	155,446,261.60	127,398,663.80	10,059,000.00	10,917,390.00	303,821,315.40
应收利息	—	—	—	5,767,362.02	5,767,362.02
资产总计	156,378,548.60	127,398,663.80	10,059,000.00	16,684,752.02	310,520,964.42
负债					
卖出回购金融资产款	77,799,774.50	—	—	—	77,799,774.50
应付赎回款	—	—	—	39,326.22	39,326.22
应付管理人报酬	—	—	—	229,153.48	229,153.48
应付托管费	—	—	—	38,192.24	38,192.24
应付交易费用	—	—	—	41,616.00	41,616.00
应付利息	—	—	—	13,187.80	13,187.80
其他负债	—	—	—	65,246.52	65,246.52
负债总计	77,799,774.50	—	—	426,722.26	78,226,496.76
利率敏感度缺口	78,578,774.10	127,398,663.80	10,059,000.00	16,258,029.76	232,294,467.66
上年度末 2015年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计

资产					
银行存款	377,183.86	—	—	—	377,183.86
结算备付金	2,860,177.40	—	—	—	2,860,177.40
存出保证金	44,989.73	—	—	—	44,989.73
交易性金融资产	158,717,423.70	214,117,072.20	—	14,224,590.64	387,059,086.54
买入返售金融资产	5,700,000.00	—	—	—	5,700,000.00
应收证券清算款	—	—	—	2,981,404.19	2,981,404.19
应收利息	—	—	—	6,671,018.87	6,671,018.87
应收申购款	—	—	—	299.64	299.64
资产总计	167,699,774.69	214,117,072.20	—	23,877,313.34	405,694,160.23
负债					
卖出回购金融资产款	154,499,662.75	—	—	—	154,499,662.75
应付证券清算款	—	—	—	2,695,177.64	2,695,177.64
应付赎回款	—	—	—	30,124.54	30,124.54
应付管理人报酬	—	—	—	250,771.56	250,771.56
应付托管费	—	—	—	41,795.26	41,795.26
应付交易费用	—	—	—	103,820.69	103,820.69
应付利息	—	—	—	24,962.34	24,962.34
其他负债	—	—	—	88,307.38	88,307.38
负债总计	154,499,662.75	—	—	3,234,959.41	157,734,622.16
利率敏感度缺口	13,200,111.94	214,117,072.20	—	20,642,353.93	247,959,538.07

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 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 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
	市场利率下降25个基点	1,351,137.09	1,665,262.55
	市场利率上升25个基点	-1,335,900.47	-1,646,583.11

注：利率风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的情况下，利率发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值可参考的公允价值产生的影响。于2015年6月30日，若市场利率上升或下降25个基点且其他市场变量保持不变，本基金资产净值可参考的公允价值发生的变动。

#### 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 2016年6月30日		上年度末 2015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	10,917,390.00	4.70	14,224,590.64	5.74
交易性金融资产-债券 投资	292,903,925.40	126.09	372,834,495.90	150.36
衍生金融资产-权证 投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	303,821,315.40	130.79	387,059,086.54	156.10

**6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析**

假设	1、假定本基金的业绩比较基准变化5%，其他变量不变；		
假设	2、用期末时点比较基准浮动5%基金资产净值相应变化来估测组合市场价格风险；		
假设	3、Beta系数是根据组合在过去一个年度的净值数据和基准指数数据回归得出，反映了基金和基准的相关性。		
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

		2016年6月30日	2015年12月31日
	业绩比较基准增加5%	929, 177. 87	915, 733. 12
	业绩比较基准减少5%	-929, 177. 87	-915, 733. 12

#### 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2016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34,352,840.00元，属于第二层次的余额为269,468,475.4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，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)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票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，确定相关股票公允价值应属第二层次还是第三层次。

## §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	10,917,390.00	3.52
	其中：股票	10,917,390.00	3.52
2	固定收益投资	292,903,925.40	94.33

	其中：债券	292,903,925.40	94.33
	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	864,116.95	0.28
7	其他各项资产	5,835,532.07	1.88
8	合计	310,520,964.42	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	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	8,890,690.00	3.83
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	—	—
J	金融业	—	—
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	2,026,700.00	0.87
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—

	合计	10,917,390.00	4.70
--	----	---------------	------

### 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	002366	台海核电	79,000	4,211,490.00	1.81
2	300115	长盈精密	140,000	2,884,000.00	1.24
3	600763	通策医疗	65,000	2,026,700.00	0.87
4	002326	永太科技	88,000	1,795,200.00	0.77

### 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	000858	五粮液	7,009,016.00	2.83
2	300059	东方财富	5,487,309.00	2.21
3	300166	东方国信	5,316,718.00	2.14
4	300101	振芯科技	4,774,546.25	1.93
5	002366	台海核电	4,275,521.00	1.72
6	600570	恒生电子	4,182,200.00	1.69
7	002223	鱼跃医疗	3,798,154.00	1.53
8	000488	晨鸣纸业	3,671,261.30	1.48
9	002390	信邦制药	3,662,600.00	1.48
10	603885	吉祥航空	3,655,543.30	1.47
11	002241	歌尔股份	3,596,122.90	1.45
12	002117	东港股份	3,442,150.00	1.39
13	002345	潮宏基	3,294,573.99	1.33
14	600196	复星医药	3,292,400.00	1.33
15	600418	江淮汽车	3,043,362.00	1.23
16	300115	长盈精密	2,937,173.00	1.18
17	601888	中国国旅	2,920,522.00	1.18
18	000888	峨眉山A	2,355,500.00	0.95

19	600487	亨通光电	2,338,654.63	0.94
20	603308	应流股份	2,309,230.00	0.93

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	000858	五粮液	7,753,500.00	3.13
2	600570	恒生电子	5,601,998.60	2.26
3	300166	东方国信	5,080,451.00	2.05
4	300059	东方财富	4,901,431.00	1.98
5	300101	振芯科技	4,634,147.02	1.87
6	002223	鱼跃医疗	3,941,290.00	1.59
7	603885	吉祥航空	3,658,828.24	1.48
8	601888	中国国旅	3,544,150.00	1.43
9	002117	东港股份	3,520,223.00	1.42
10	000488	晨鸣纸业	3,474,666.50	1.40
11	600196	复星医药	3,441,323.47	1.39
12	002390	信邦制药	3,413,892.00	1.38
13	002345	潮宏基	3,296,893.00	1.33
14	002241	歌尔股份	3,163,169.42	1.28
15	600876	洛阳玻璃	3,055,000.00	1.23
16	002572	索菲亚	3,016,168.00	1.22
17	600418	江淮汽车	3,002,752.00	1.21
18	600519	贵州茅台	2,485,259.00	1.00
19	300146	汤臣倍健	2,373,812.48	0.96
20	000888	峨眉山A	2,369,785.00	0.96

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	110,501,089.59
卖出股票的收入（成交）总额	110,091,121.96

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

### 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	1,799,820.00	0.77
2	央行票据	—	—
3	金融债券	30,047,000.00	12.93
	其中：政策性金融债	30,047,000.00	12.93
4	企业债券	165,618,655.40	71.30
5	企业短期融资券	50,211,000.00	21.62
6	中期票据	21,792,000.00	9.38
7	可转债	23,435,450.00	10.09
8	其他	—	—
9	合计	292,903,925.40	126.09

### 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	1280366	12鄂西圈投债	200,000	22,070,000.00	9.50
2	101460025	14潍坊滨投MTN001	200,000	21,792,000.00	9.38
3	112220	14福星01	193,250	21,549,307.50	9.28
4	1180095	11常城建债	200,000	21,048,000.00	9.06
5	1080171	10吴江发展债	200,000	20,928,000.00	9.01

### 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 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	68,170.05
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	5,767,362.02
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	5,835,532.07

**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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 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
1,359	169,163.45	366,555.63	0.1594%	229,526,570.15	99.8406%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	98.55	—

### 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情况

- 注：1、本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金；  
2、本基金的基金经理未持有本基金。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2015年9月25日)基金份额总额	247,376,790.22
本报告期期初基金份额总额	242,068,624.62
本报告期基金总申购份额	566,057.42
减：本报告期基金总赎回份额	12,741,556.26
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	229,893,125.78

注：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。

## § 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

2016年5月6日发布《基金行业高级管理人员变更公告》，任命侯利鹏先生担任中融基金管理有限公司副总经理。

2016年7月1日发布《基金行业高级管理人员变更公告》，任命代宝香女士担任中融基金管理有限公司副总经理。

2016年5月18日，经公司第二届股东会第二十三次会议审议通过，聘任刘洋先生为董事，同时免去范韬先生的董事职务。

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，基金托管人的专门基金托管部无重大人事变动。

### 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

为本基金进行审计的会计师事务所为上会会计师事务所，本报告期内本基金未变更为本基金审计的会计师事务所。

### 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	

东北证券	1	68,040,069.7	30.84%	49,758.36	30.84%	—
兴业证券	2	152,552,141.85	69.16%	111,561.38	69.16%	—
联讯证券	2	—	—	—	—	—

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本报告期内新增联讯证券的交易单元作为本基金交易单元。

### 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
东北证券	147,452,265.13	85.1%	1,906,200,000	74.24%	—	—
兴业证券	25,809,707.69	14.9%	661,464,000	25.76%	—	—
联讯证券	—	—	—	—	—	—

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中融基金管理有限公司关于2016年1月4日发生指数熔断调整旗下部分基金开放时间的公告	证券日报、基金管理人网站	2016-01-04
2	关于旗下基金增加中国国际金融股份有限公司为销售机构及开通转换业务并参与其费率优惠活动	证券日报、基金管理人网站	2016-01-13

	的公告		
3	关于旗下基金增加宏信证券有限责任公司为销售机构的公告	证券日报、基金管理人网站	2016-01-18
4	关于旗下基金增加安信证券股份有限公司为销售机构及开通定投、转换业务并参与其费率优惠活动的公告	证券日报、基金管理人网站	2016-02-01
5	关于旗下基金增加渤海证券股份有限公司为销售机构及开通转换业务的公告	证券日报、基金管理人网站	2016-02-17
6	关于旗下基金增加北京微动利投资管理有限公司为销售机构及开通定投、转换业务并参与其费率优惠活动的公告	证券日报、基金管理人网站	2016-03-24
7	关于旗下部分基金增加上海好买基金销售有限公司为销售机构及开通定投、转换业务并参与其费率优惠活动的公告	证券日报、基金管理人网站	2016-03-30
8	关于旗下基金增加深圳市新兰德证券投资咨询有限公司为销售机构及开通转换业务并参与其费率优惠活动的公告	证券日报、基金管理人网站	2016-03-31
9	关于旗下基金增加联讯证券股份有限公司为销售机构及开通定投、转换业务的公告	证券日报、基金管理人网站	2016-04-01
10	关于旗下基金增加上海长量基金销售投资顾问有限公司为销售机构及开通定投、转换业务并参与其费率优惠活动的公告	证券日报、基金管理人网站	2016-04-14
11	关于旗下基金增加上海凯石财富基金销售有限公司为销售机构及开通定投、转换业务并参与其费率优惠活动的公告	证券日报、基金管理人网站	2016-04-19
12	关于旗下基金增加奕丰金融服务（深圳）有限公司为销售机构及开通定投、转换业务并参与其费	证券日报、基金管理人网站	2016-04-20

	率优惠活动的公告		
13	关于旗下部分基金增加北京新浪仓石基金销售有限公司为销售机构并参与其费率优惠活动的公告	证券日报、基金管理人网站	2016-04-25
14	关于旗下部分基金增加北京展恒基金销售股份有限公司为销售机构及开通定投、转换业务并参与其费率优惠活动的公告	证券日报、基金管理人网站	2016-04-27
15	基金行业高级管理人员变更公告	证券日报、基金管理人网站	2016-05-06
16	关于旗下部分基金增加众升财富（北京）基金销售有限公司为销售机构及开通定投、转换业务并参与其费率优惠活动的公告	证券日报、基金管理人网站	2016-05-11
17	关于旗下部分基金增加珠海盈米财富管理有限公司为销售机构及开通定投、转换业务并参与其费率优惠活动的公告	证券日报、基金管理人网站	2016-05-11
18	关于旗下部分基金增加北京懒猫金融信息服务有限公司为销售机构的公告	证券日报、基金管理人网站	2016-05-19
19	关于旗下部分基金增加杭州数米基金销售有限公司为销售机构及开通定投、转换业务并参与其费率优惠活动的公告	证券日报、基金管理人网站	2016-05-23
20	关于旗下部分基金增加一路财富（北京）信息科技有限公司及开通定投、转换业务并参与其费率优惠活动的公告	证券日报、基金管理人网站	2016-05-25
21	中融基金关于调整旗下部分开放式基金申购金额下限的公告	证券日报、基金管理人网站	2016-05-26
22	中融基金管理有限公司关于公司从业人员在子公司兼职情况的公告	证券日报、基金管理人网站	2016-05-28
23	关于旗下部分基金增加深圳富济财富管理有限公司为销售机构及开通定投、转换业务并参与其费	证券日报、基金管理人网站	2016-06-06

	率优惠活动的公告		
24	关于旗下基金增加北京广源达信投资管理有限公司为销售机构及开通定投、转换业务、参与其费率优惠活动并调整申购金额下限的公告	证券日报、基金管理人网站	2016-06-08
25	关于旗下部分基金参加上海陆金所资产管理有限公司定投业务并参与其费率优惠活动的公告	证券日报、基金管理人网站	2016-06-13
26	关于旗下部分基金增加上海云湾投资管理有限公司为销售机构及开通转换业务的公告	证券日报、基金管理人网站	2016-06-17
27	关于旗下部分基金参加北京新浪仓石基金销售有限公司转换、定投业务的公告	证券日报、基金管理人网站	2016-06-22
28	关于旗下部分基金增加上海联泰资产管理有限公司为销售机构及开通定投、转换业务并参与其费率优惠活动的公告	证券日报、基金管理人网站	2016-06-29

### § 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二号保本混合型证券投资基金募集的文件
- (2) 《中融融安二号保本混合型证券投资基金基金合同》
- (3) 《中融融安二号保本混合型证券投资基金招募说明书》
- (4) 《中融融安二号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

基金管理人的办公场所或托管人住所

#### 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  
二〇一六年八月二十四日