

中融国企改革灵活配置混合型证券投资基金 2017 年年度报告摘要

2017 年 12 月 31 日

基金管理人:中融基金管理有限公司
基金托管人:国信证券股份有限公司

重要提示
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...

2.1 基金基本情况
基金名称:中融国企改革灵活配置混合型证券投资基金
基金简称:中融国企改革混合

2.2 基金产品说明
投资目标:本基金投资组合中的股票资产的选择采用自上而下与自下而上相结合的方法...

2.3 基金管理人及基金托管人
基金管理人:中融基金管理有限公司
基金托管人:国信证券股份有限公司

2.4 信息披露方式
信息披露网址:www.zrfund.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

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
3.1.1 期间数据和指标

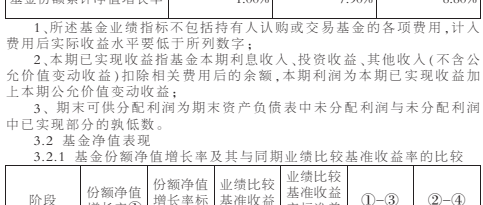
Table with 5 columns: 指标, 2017年, 2016年, 2015年, 2014年. Rows include 本期已实现收益, 本期利润, 加权平均基金份额本期利润, etc.

3.1.2 期末数据和指标
3.1.3 累计期末指标

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



3.2.2 自基金合同生效以来基金净值增长率变动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间计算,不按自然年度进行折算

3.3 过去三年基金的利润分配情况
3.4 管理人报告
3.4.1 基金管理人及基金经营情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验
4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

Table with columns: 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.

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明
4.3 公平交易制度和风险控制方法

4.4 报告期内本基金的投资策略和业绩表现的说明
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

4.6 管理人内部有关基金投资的监督稽核工作情况
4.7 基金管理人内部有关基金投资的合规管理工作

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明
4.9 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
5.2 基金托管人对本基金的投资运作、净值计算、利润分配等业务的说明

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

5.4 基金管理人本年度报告中的财务信息、净值表现、投资组合等内容真实、准确和完整,不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏

5.5 审计报告
5.5.1 审计报告基本信息

Table with columns: 财务报表是否经过审计, 审计意见类型, 审计报告编号, 会计师事务所名称.

5.5.2 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:中融国企改革灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人

审计意见:我们认为,后附的中融国企改革灵活配置混合型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制,公允反映了中融国企改革灵活配置混合型证券投资基金2017年12月31日的财务状况以及2017年度的经营成果和现金流量状况

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

其他信息:中融国企改革灵活配置混合型证券投资基金管理(以下简称“管理”)对其提供的信息负责

管理层的责任和注册会计师的责任:注册会计师的责任是对财务报表是否在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制,公允反映了中融国企改革灵活配置混合型证券投资基金2017年12月31日的财务状况以及2017年度的经营成果和现金流量状况

注册会计师对财务报表审计的责任:注册会计师的责任是对财务报表是否在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制,公允反映了中融国企改革灵活配置混合型证券投资基金2017年12月31日的财务状况以及2017年度的经营成果和现金流量状况

注册会计师对财务报表审计的责任:注册会计师的责任是对财务报表是否在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制,公允反映了中融国企改革灵活配置混合型证券投资基金2017年12月31日的财务状况以及2017年度的经营成果和现金流量状况

注册会计师对财务报表审计的责任:注册会计师的责任是对财务报表是否在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制,公允反映了中融国企改革灵活配置混合型证券投资基金2017年12月31日的财务状况以及2017年度的经营成果和现金流量状况

注册会计师对财务报表审计的责任:注册会计师的责任是对财务报表是否在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制,公允反映了中融国企改革灵活配置混合型证券投资基金2017年12月31日的财务状况以及2017年度的经营成果和现金流量状况

注册会计师对财务报表审计的责任:注册会计师的责任是对财务报表是否在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制,公允反映了中融国企改革灵活配置混合型证券投资基金2017年12月31日的财务状况以及2017年度的经营成果和现金流量状况

注册会计师对财务报表审计的责任:注册会计师的责任是对财务报表是否在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制,公允反映了中融国企改革灵活配置混合型证券投资基金2017年12月31日的财务状况以及2017年度的经营成果和现金流量状况

注册会计师对财务报表审计的责任:注册会计师的责任是对财务报表是否在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制,公允反映了中融国企改革灵活配置混合型证券投资基金2017年12月31日的财务状况以及2017年度的经营成果和现金流量状况

注册会计师对财务报表审计的责任:注册会计师的责任是对财务报表是否在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制,公允反映了中融国企改革灵活配置混合型证券投资基金2017年12月31日的财务状况以及2017年度的经营成果和现金流量状况

注册会计师对财务报表审计的责任:注册会计师的责任是对财务报表是否在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制,公允反映了中融国企改革灵活配置混合型证券投资基金2017年12月31日的财务状况以及2017年度的经营成果和现金流量状况

注册会计师对财务报表审计的责任:注册会计师的责任是对财务报表是否在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制,公允反映了中融国企改革灵活配置混合型证券投资基金2017年12月31日的财务状况以及2017年度的经营成果和现金流量状况

注册会计师对财务报表审计的责任:注册会计师的责任是对财务报表是否在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制,公允反映了中融国企改革灵活配置混合型证券投资基金2017年12月31日的财务状况以及2017年度的经营成果和现金流量状况

注册会计师对财务报表审计的责任:注册会计师的责任是对财务报表是否在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制,公允反映了中融国企改革灵活配置混合型证券投资基金2017年12月31日的财务状况以及2017年度的经营成果和现金流量状况

注册会计师对财务报表审计的责任:注册会计师的责任是对财务报表是否在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制,公允反映了中融国企改革灵活配置混合型证券投资基金2017年12月31日的财务状况以及2017年度的经营成果和现金流量状况

1. 报告截止日2017年12月31日,基金份额净值人民币1.010元,基金份额总额125,275,819.12份

Table with columns: 项目, 附注号, 本期2017年01月01日至2017年12月31日, 上年度可比期间2016年01月01日至2016年12月31日.

其中:股票投资收益 7.4.7.12 789,968.28 -27,950,513.08

其中:债券投资收益 7.4.7.13 244,483.76 39,677.95

其中:公允价值变动收益(损失)以“+”号填列 -1.02 116,197,799.71 520,147.05

其中:其他收入(损失)以“-”号填列 2.68 2,864,213.82 7,106,988.94

其中:管理费用 7.4.10.2.1 2,038,616.87 2,446,131.53

其中:其他费用 7.4.10.2.2 339,769.48 407,688.65

其中:其他支出 7.4.7.18 273,427.47 4,037,437.67

其中:卖出回购金融资产支出 7.4.7.19 212,400.00 215,731.09

其中:净利润(净亏损)以“-”号填列 12,475,286.70 -32,438,211.51

7.3 所有者权益(基金净值)变动表
会计主体:中融国企改革灵活配置混合型证券投资基金

Table with columns: 项目, 本期2017年01月01日至2017年12月31日, 上期2016年01月01日至2016年12月31日.

7.4 关联方关系
7.4.1 关联方关系
7.4.2 关联方交易

7.4.3 关联方交易
7.4.3.1 关联方交易
7.4.3.2 关联方交易

7.4.3.3 关联方交易
7.4.3.4 关联方交易

7.4.3.5 关联方交易
7.4.3.6 关联方交易

7.4.3.7 关联方交易
7.4.3.8 关联方交易

7.4.4.2.1 基金管理费
单位:人民币元

Table with columns: 项目, 本期2017年01月01日至2017年12月31日, 上期2016年01月01日至2016年12月31日.

7.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易
7.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.4.5 关联方投资本基金的情况
7.4.4.6 关联方投资本基金的情况

7.4.4.7 关联方投资本基金的情况
7.4.4.8 关联方投资本基金的情况

7.4.4.9 关联方投资本基金的情况
7.4.4.10 关联方投资本基金的情况

7.4.4.11 关联方投资本基金的情况
7.4.4.12 关联方投资本基金的情况

7.4.4.13 关联方投资本基金的情况
7.4.4.14 关联方投资本基金的情况

7.4.4.15 关联方投资本基金的情况
7.4.4.16 关联方投资本基金的情况

7.4.4.17 关联方投资本基金的情况
7.4.4.18 关联方投资本基金的情况

7.4.4.19 关联方投资本基金的情况
7.4.4.20 关联方投资本基金的情况

7.4.4.21 关联方投资本基金的情况
7.4.4.22 关联方投资本基金的情况

7.4.4.23 关联方投资本基金的情况
7.4.4.24 关联方投资本基金的情况

7.4.4.25 关联方投资本基金的情况
7.4.4.26 关联方投资本基金的情况

7.4.4.27 关联方投资本基金的情况
7.4.4.28 关联方投资本基金的情况

7.4.4.29 关联方投资本基金的情况
7.4.4.30 关联方投资本基金的情况

7.4.4.31 关联方投资本基金的情况
7.4.4.32 关联方投资本基金的情况

7.4.4.33 关联方投资本基金的情况
7.4.4.34 关联方投资本基金的情况