

中融融安二号保本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:中融融安基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
重要提示:基金管理人、基金托管人、基金销售机构应当勤勉尽责,诚实守信,依法合规地开展基金业务。

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 基金管理人及基金情况简介
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融安基金管理有限公司,成立于2013年5月31日,由中国国际信托有限公司与上海融晟投资有限公司共同出资,注册资本11.5亿元人民币。

进行定期和不定期检查,推动公司内部控制制度的完善与优化,保证各项法规和管理制度的落实,发现问题及时提出建议,并跟踪改进落实情况。
5.3 报告期内,本基金管理人内部控制体系建设持续完善,未发现违反法律法规、基金合同约定以及公司内部管理制度等违法违规行为。

7 年度财务报表

7.1 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:2017年12月31日
单位:人民币元

Table with columns: 资产, 附注, 2017年12月31日, 2016年12月31日. Rows include 货币资金, 债券投资, 银行存款, 其他应收款, 其他流动资产, 其他资产, 负债, 应付账款, 应付债券, 其他应付款, 其他流动负债, 其他负债, 所有者权益, 实收基金, 未分配利润, 所有者权益合计.

2017年12月31日

Table with columns: 项目, 2017年01月01日至2017年12月31日, 2016年01月01日至2016年12月31日. Rows include 期初所有者权益(基金净值), 本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润), 本期基金份额交易产生的基金份额变动数(净值减少), 本期基金份额持有人申购/赎回基金产生的基金份额变动数(净值减少), 本期基金份额持有人申购/赎回基金产生的基金份额变动数(净值增加), 期末所有者权益(基金净值).

2.2 基金产品说明

Table with columns: 基金名称, 基金简称, 基金代码, 基金运作方式, 基金合同生效日, 基金管理人, 基金托管人, 报告期末基金总份额, 基金合同存续期.

Table with columns: 投资目标, 投资策略, 业绩比较基准, 风险收益特征. Rows include 投资目标: 通过动态调整股票资产与风险资产在组合中的投资比例, 严格控制风险, 确保本报告期内基金份额净值的基础上, 力争实现基金资产的长期稳定增值。

2.3 基金管理人、基金托管人

Table with columns: 项目, 基金管理人, 基金托管人. Rows include 名称, 基金管理人: 中融融安基金管理有限公司, 基金托管人: 中国银行股份有限公司.

2.4 信息披露方式

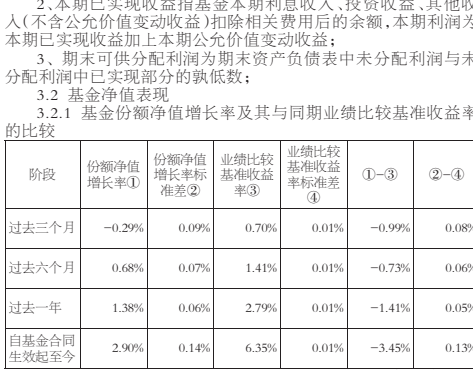
Table with columns: 基金管理人, 基金托管人. Rows include 名称, 基金管理人: 中融融安基金管理有限公司, 基金托管人: 中国银行股份有限公司.

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

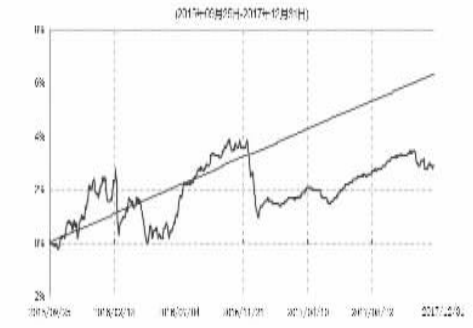
Table with columns: 3.1.1 期间数据和指标, 2017年, 2016年, 2015年9月25日(基金合同生效日)至2015年12月31日. Rows include 本期已实现收益, 本期利润, 加权平均基金份额本期利润, 本期加权平均净值增长率.

3.2 基金净值表现



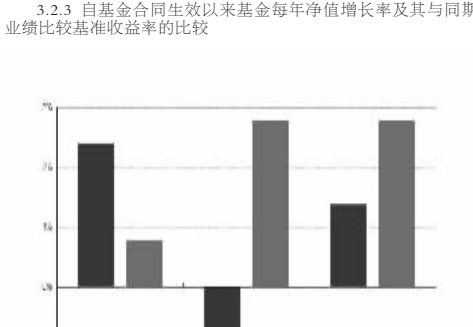
注:按照基金合同约定,本基金自合同生效日起6个月内建仓,建仓期结束时本基金的各项资产配置比例符合基金合同的有关规定。

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



注:按照基金合同约定,本基金自合同生效日起6个月内建仓,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。

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:按照基金合同约定,本基金自合同生效日起6个月内建仓,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。

4.1.2 基金管理人、基金托管人

Table with columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期, 说明. Rows include 李倩, 基金经理, 2015-10, 2017-10; 沈潼, 基金经理, 2017-04, 2017-04.

4.1.3 基金管理人、基金托管人

Table with columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期, 说明. Rows include 李倩, 基金经理, 2015-10, 2017-10; 沈潼, 基金经理, 2017-04, 2017-04.

4.1.4 基金管理人、基金托管人

Table with columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期, 说明. Rows include 李倩, 基金经理, 2015-10, 2017-10; 沈潼, 基金经理, 2017-04, 2017-04.

4.1.5 基金管理人、基金托管人

Table with columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期, 说明. Rows include 李倩, 基金经理, 2015-10, 2017-10; 沈潼, 基金经理, 2017-04, 2017-04.

4.1.6 基金管理人、基金托管人

Table with columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期, 说明. Rows include 李倩, 基金经理, 2015-10, 2017-10; 沈潼, 基金经理, 2017-04, 2017-04.

4.1.7 基金管理人、基金托管人

Table with columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期, 说明. Rows include 李倩, 基金经理, 2015-10, 2017-10; 沈潼, 基金经理, 2017-04, 2017-04.

4.1.8 基金管理人、基金托管人

Table with columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期, 说明. Rows include 李倩, 基金经理, 2015-10, 2017-10; 沈潼, 基金经理, 2017-04, 2017-04.

4.1.9 基金管理人、基金托管人

Table with columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期, 说明. Rows include 李倩, 基金经理, 2015-10, 2017-10; 沈潼, 基金经理, 2017-04, 2017-04.

4.1.10 基金管理人、基金托管人

Table with columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期, 说明. Rows include 李倩, 基金经理, 2015-10, 2017-10; 沈潼, 基金经理, 2017-04, 2017-04.

4.1.11 基金管理人、基金托管人

Table with columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期, 说明. Rows include 李倩, 基金经理, 2015-10, 2017-10; 沈潼, 基金经理, 2017-04, 2017-04.

4.1.12 基金管理人、基金托管人

Table with columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期, 说明. Rows include 李倩, 基金经理, 2015-10, 2017-10; 沈潼, 基金经理, 2017-04, 2017-04.

4.1.13 基金管理人、基金托管人

Table with columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期, 说明. Rows include 李倩, 基金经理, 2015-10, 2017-10; 沈潼, 基金经理, 2017-04, 2017-04.

4.1.14 基金管理人、基金托管人

Table with columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期, 说明. Rows include 李倩, 基金经理, 2015-10, 2017-10; 沈潼, 基金经理, 2017-04, 2017-04.

4.1.15 基金管理人、基金托管人

Table with columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期, 说明. Rows include 李倩, 基金经理, 2015-10, 2017-10; 沈潼, 基金经理, 2017-04, 2017-04.

4.2 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内,本基金管理人秉承“稳健、灵活、进取”的投资理念,严格执行基金合同约定的投资范围和策略,通过动态调整股票资产与风险资产在组合中的投资比例,严格控制风险,确保本报告期内基金份额净值的基础上,力争实现基金资产的长期稳定增值。

4.3 报告期内基金业绩表现

报告期内,本基金管理人秉承“稳健、灵活、进取”的投资理念,严格执行基金合同约定的投资范围和策略,通过动态调整股票资产与风险资产在组合中的投资比例,严格控制风险,确保本报告期内基金份额净值的基础上,力争实现基金资产的长期稳定增值。

4.4 报告期内基金投资组合报告

报告期内,本基金管理人秉承“稳健、灵活、进取”的投资理念,严格执行基金合同约定的投资范围和策略,通过动态调整股票资产与风险资产在组合中的投资比例,严格控制风险,确保本报告期内基金份额净值的基础上,力争实现基金资产的长期稳定增值。

4.5 报告期内基金投资组合报告

报告期内,本基金管理人秉承“稳健、灵活、进取”的投资理念,严格执行基金合同约定的投资范围和策略,通过动态调整股票资产与风险资产在组合中的投资比例,严格控制风险,确保本报告期内基金份额净值的基础上,力争实现基金资产的长期稳定增值。

4.6 报告期内基金投资组合报告

报告期内,本基金管理人秉承“稳健、灵活、进取”的投资理念,严格执行基金合同约定的投资范围和策略,通过动态调整股票资产与风险资产在组合中的投资比例,严格控制风险,确保本报告期内基金份额净值的基础上,力争实现基金资产的长期稳定增值。

4.7 报告期内基金投资组合报告

报告期内,本基金管理人秉承“稳健、灵活、进取”的投资理念,严格执行基金合同约定的投资范围和策略,通过动态调整股票资产与风险资产在组合中的投资比例,严格控制风险,确保本报告期内基金份额净值的基础上,力争实现基金资产的长期稳定增值。

4.8 报告期内基金投资组合报告

报告期内,本基金管理人秉承“稳健、灵活、进取”的投资理念,严格执行基金合同约定的投资范围和策略,通过动态调整股票资产与风险资产在组合中的投资比例,严格控制风险,确保本报告期内基金份额净值的基础上,力争实现基金资产的长期稳定增值。

4.9 报告期内基金投资组合报告

报告期内,本基金管理人秉承“稳健、灵活、进取”的投资理念,严格执行基金合同约定的投资范围和策略,通过动态调整股票资产与风险资产在组合中的投资比例,严格控制风险,确保本报告期内基金份额净值的基础上,力争实现基金资产的长期稳定增值。

4.10 报告期内基金投资组合报告

报告期内,本基金管理人秉承“稳健、灵活、进取”的投资理念,严格执行基金合同约定的投资范围和策略,通过动态调整股票资产与风险资产在组合中的投资比例,严格控制风险,确保本报告期内基金份额净值的基础上,力争实现基金资产的长期稳定增值。

4.11 报告期内基金投资组合报告

报告期内,本基金管理人秉承“稳健、灵活、进取”的投资理念,严格执行基金合同约定的投资范围和策略,通过动态调整股票资产与风险资产在组合中的投资比例,严格控制风险,确保本报告期内基金份额净值的基础上,力争实现基金资产的长期稳定增值。

4.12 报告期内基金投资组合报告

报告期内,本基金管理人秉承“稳健、灵活、进取”的投资理念,严格执行基金合同约定的投资范围和策略,通过动态调整股票资产与风险资产在组合中的投资比例,严格控制风险,确保本报告期内基金份额净值的基础上,力争实现基金资产的长期稳定增值。

4.13 报告期内基金投资组合报告

报告期内,本基金管理人秉承“稳健、灵活、进取”的投资理念,严格执行基金合同约定的投资范围和策略,通过动态调整股票资产与风险资产在组合中的投资比例,严格控制风险,确保本报告期内基金份额净值的基础上,力争实现基金资产的长期稳定增值。

4.14 报告期内基金投资组合报告

报告期内,本基金管理人秉承“稳健、灵活、进取”的投资理念,严格执行基金合同约定的投资范围和策略,通过动态调整股票资产与风险资产在组合中的投资比例,严格控制风险,确保本报告期内基金份额净值的基础上,力争实现基金资产的长期稳定增值。

4.15 报告期内基金投资组合报告

报告期内,本基金管理人秉承“稳健、灵活、进取”的投资理念,严格执行基金合同约定的投资范围和策略,通过动态调整股票资产与风险资产在组合中的投资比例,严格控制风险,确保本报告期内基金份额净值的基础上,力争实现基金资产的长期稳定增值。

7.2 利润表

Table with columns: 项目, 附注, 2017年12月31日, 2016年12月31日. Rows include 一、收入, 利息收入, 债券利息收入, 资产支持证券利息收入, 其他利息收入, 投资收益, 公允价值变动收益(损失), 其他业务收入, 其他收益, 二、费用, 管理人报酬, 托管费, 销售服务费, 其他费用, 三、利润总额, 四、净利润, 五、其他综合收益, 六、综合收益总额.

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

Table with columns: 项目, 附注, 2017年12月31日, 2016年12月31日. Rows include 实收基金, 未分配利润, 所有者权益合计.

7.4 关联方关系

Table with columns: 关联方名称, 与本公司的关系. Rows include 上海融晟投资有限公司, 基金管理人股东; 中国国际信托有限公司, 基金管理人股东; 中融融安基金管理有限公司, 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, 基金托管人、基金销售机构; 中融融安(北京)资产管理有限公司, 基金管理人子公司.

7.5 关联方交易

7.5.1 关联方交易
7.5.1.1 关联方交易
7.5.1.2 关联方交易
7.5.1.3 关联方交易
7.5.1.4 关联方交易

7.6 关联方交易

7.6.1 关联方交易
7.6.1.1 关联方交易
7.6.1.2 关联方交易
7.6.1.3 关联方交易
7.6.1.4 关联方交易

7.4 关联方关系

Table with columns: 关联方名称, 与本公司的关系. Rows include 上海融晟投资有限公司, 基金管理人股东; 中国国际信托有限公司, 基金管理人股东; 中融融安基金管理有限公司, 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, 基金托管人、基金销售机构; 中融融安(北京)资产管理有限公司, 基金管理人子公司.

7.5 关联方交易

Table with columns: 项目, 2017年01月01日至2017年12月31日, 2016年01月01日至2016年12月31日. Rows include 当期发生的基金应支付的管理费, 其中:支付给销售机构的客户维护费.

7.6 关联方交易

Table with columns: 项目, 2017年01月01日至2017年12月31日, 2016年01月01日至2016年12月31日. Rows include 当期发生的基金应支付的管理费, 其中:支付给销售机构的客户维护费.

7.7 关联方交易

Table with columns: 项目, 2017年01月01日至2017年12月31日, 2016年01月01日至2016年12月31日. Rows include 当期发生的基金应支付的管理费, 其中:支付给销售机构的客户维护费.

7.8 关联方交易

Table with columns: 项目, 2017年01月01日至2017年12月31日, 2016年01月01日至2016年12月31日. Rows include 当期发生的基金应支付的管理费, 其中:支付给销售机构的客户维护费.

7.9 关联方交易

Table with columns: 项目, 2017年01月01日至2017年12月31日, 2016年01月01日至2016年12月31日. Rows include 当期发生的基金应支付的管理费, 其中:支付给销售机构的客户维护费.

7.10 关联方交易

Table with columns: 项目, 2017年01月01日至2017年12月31日, 2016年01月01日至2016年12月31日. Rows include 当期发生的基金应支付的管理费, 其中:支付给销售机构的客户维护费.

7.11 关联方交易

Table with columns: 项目, 2017年01月01日至2017年12月31日, 2016年01月01日至2016年12月31日. Rows include 当期发生的基金应支付的管理费, 其中:支付给销售机构的客户维护费.

7.12 关联方交易

Table with columns: 项目, 2017年01月01日至2017年12月31日, 2016年01月01日至2016年12月31日. Rows include 当期发生的基金应支付的管理费, 其中:支付给销售机构的客户维护费.

7.13 关联方交易

Table with columns: 项目, 2017年01月01日至2017年12月31日, 2016年01月01日至2016年12月31日. Rows include 当期发生的基金应支付的管理费, 其中:支付给销售机构的客户维护费.

7.14 关联方交易

Table with columns: 项目, 2017年01月01日至2017年12月31日, 2016年01月01日至2016年12月31日. Rows include 当期发生的基金应支付的管理费, 其中:支付给销售机构的客户维护费.

7.15 关联方交易

Table with columns: 项目, 2017年01月01日至2017年12月31日, 2016年01月01日至2016年12月31日. Rows include 当期发生的基金应支付的管理费, 其中:支付给销售机构的客户维护费.

7.16 关联方交易

Table with columns: 项目, 2017年01月01日至2017年12月31日, 2016年01月01日至2016年12月31日. Rows include 当期发生的基金应支付的管理费, 其中:支付给销售机构的客户维护费.