

(上接 D360 页) 1. 报告截止日 2017 年 2 月 16 日(基金合同生效前日),基金份额净值 1.01 元,基金份额总额 32,205,421.89 份。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 2 月 16 日(基金合同生效前日)。

7.2 利润表 会计主体:中融融安保本混合型证券投资基金 报告期:2017 年 01 月 01 日至 2017 年 02 月 16 日 单位:人民币元

Table with columns: 项目, 附注号, 本期 2017 年 01 月 01 日至 2017 年 02 月 16 日, 上年度可比期间 2016 年 01 月 01 日至 2016 年 12 月 31 日. Rows include 一、收入, 利息收入, 债券利息收入, etc.

7.3 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 报告期:2017 年 01 月 01 日至 2017 年 02 月 16 日 单位:人民币元

Table with columns: 项目, 2017 年 01 月 01 日至 2017 年 02 月 16 日, 2016 年 01 月 01 日至 2016 年 12 月 31 日. Rows include 一、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, etc.

7.4 报告附注 7.4.1 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

7.4.2 差错更正的说明 本基金在本报告期间内无须说明的会计差错更正。

7.4.3 关联方关系 7.4.3.1 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

7.4.3.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

Table with columns: 关联方名称, 与本基金的关系. Rows include 中融国际信托有限公司, 上海融晟投资有限公司, etc.

7.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易 7.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.4.2 关联方报酬 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 02 月 16 日, 上年度可比期间 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, etc.

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

7.4.4.4.1 报告期间内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况 7.4.4.4.2 报告期末除基金管理人以外的其他关联方投资本基金的情况

7.4.4.5 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

Table with columns: 关联方名称, 本期 2017 年 01 月 01 日至 2017 年 02 月 16 日, 上年度可比期间 2016 年 01 月 01 日至 2016 年 12 月 31 日. Rows include 南京银行活期存款, etc.

(1) 本基金的活期银行存款由基金托管人南京银行保管, 按银行同期利率计息。

(2) 本基金用于证券交易的资金通过南京银行基金托管清算资金

专用存款账户转入中国证券投资基金业协会, 按照银行利率计息。 2017 年 2 月 16 日(基金合同生效前日)的相关余额在资产负债表中“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。

7.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况 无。

7.4.5 期末(2017 年 02 月 16 日)本基金持有的流通受限证券 7.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

7.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票 无。

7.4.5.3 期末采用公允价值计量中作为抵押的债券 7.4.5.3.1 银行间市场债券正回购 无。

7.4.5.3.2 交易所市场债券正回购 无。

7.4.6 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, 其公允价值基于估值技术确定, 估值技术包括参考活跃市场中类似金融工具的报价、市场公认估值技术、现金流量折现法等。

② 公允价值所属层次的重大变动 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移。

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(转型后) 8.1 期末基金资产组合情况 金额单位:人民币元

Table with columns: 序号, 项目, 金额, 占基金总资产的比例(%). Rows include 1 权益投资, 2 基金投资, 3 固定收益投资, etc.

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 金额单位:人民币元

Table with columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金总资产的比例(%). Rows include A 农林牧渔, B 采矿业, C 制造业, etc.

8.2.2 报告期末按行业分类的境外股票投资组合 金额单位:人民币元

8.3 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 金额单位:人民币元

Table with columns: 序号, 股票代码, 名称, 数量, 期末公允价值, 公允价值占基金资产净值比例(%). Rows include 1 600030 中信证券, 2 000776 广发证券, etc.

8.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资 金额单位:人民币元

Table with columns: 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(%). Rows include 1 071221011 17 湘海证券 CP011, 2 101553001 15 闽通 MT001, etc.

8.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名贵金属投资 金额单位:人民币元

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 金额单位:人民币元

Table with columns: 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(%). Rows include 1 071221011 17 湘海证券 CP011, 2 101553001 15 闽通 MT001, etc.

8.7 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 金额单位:人民币元

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权证投资 金额单位:人民币元

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 金额单位:人民币元

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、处罚的情况。

8.12.2 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。

8.12.3 期末其他各项资产构成 单位:人民币元

Table with columns: 序号, 名称, 金额. Rows include 1 存出保证金 142,161.38, 2 应收证券清算款, etc.

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。

8.13 投资组合报告附注 8.13.1 报告期内, 本基金未召开基金份额持有人大会。

8.13.2 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、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 本基金管理人于 2017 年 11 月 9 日发布公告, 侯利鹏先生不再担任中融基金管理有限公司副总经理。

(2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 本基金管理人于 2017 年 12 月 21 日发布公告, 侯利鹏先生不再担任中融基金管理有限公司副总经理。

8.13.3 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。

8.13.4 基金投资策略的改变 本基金自中融融安保本混合型证券投资基金转型以来, 中融融安保本混合型证券投资基金于 2017 年 2 月 13 日就本报告期内, 由于不符合《基金合同》约定, 该基金自本期到期后于 2017 年 2 月 17 日转型为保本的混合型证券投资基金, 名称相应变更为“中融融安保本混合型证券投资基金”。

8.13.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 本基金本报告期支付给会计师事务所(特殊普通合伙)的报酬为 30,000.00 元人民币, 该审计机构已连续 3 年为本基金提供审计服务。

8.13.6 管理人、托管人及其高级管理人员受奖惩或处分等情况 本报告期无管理人、托管人及其高级管理人员受奖惩或处分等情况。

8.13.7 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

Table with columns: 券商名称, 交易单元数量, 股票交易成交金额, 佣金, 占当期股票成交总额的比例, 占当期佣金总额的比例. Rows include 中天证券, 五矿证券, etc.

8.13.8 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

Table with columns: 券商名称, 股票交易成交金额, 佣金, 占当期股票成交总额的比例, 占当期佣金总额的比例. Rows include 中天证券, 五矿证券, etc.

8.13.9 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

8.13.10 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

8.13.11 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

8.13.12 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

8.13.13 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

8.13.14 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

8.13.15 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

8.13.16 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

8.13.17 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

8.13.18 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

8.13.19 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

8.13.20 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

8.13.21 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

8.13.22 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

8.13.23 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

8.13.24 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

8.13.25 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

8.13.26 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

8.13.27 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

8.13.28 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

8.13.29 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

8.13.30 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

8.13.31 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

8.13.32 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

8.13.33 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

8.13.34 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

8.13.35 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

8.13.36 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

8.13.37 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

8.13.38 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

8.13.39 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

8.13.40 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

8.13.41 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

8.13.42 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

8.13.43 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

8.13.44 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

8.13.45 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

8.13.46 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

8.13.47 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

8.13.48 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

8.13.49 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

8.13.50 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

8.13.51 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

8.13.52 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

8.13.53 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

8.13.54 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

8.13.55 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

8.13.56 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

8.13.57 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

8.13.58 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

8.13.59 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

8.13.60 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

8.13.61 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

8.13.62 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

8.13.63 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

8.13.64 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

8.13.65 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

8.13.66 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

8.13.67 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

8.13.68 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

8.13.69 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

8.13.70 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

8.13.71 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

8.13.72 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

8.13.73 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

8.13.74 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

8.13.75 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

8.13.76 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

8.13.77 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

8.13.78 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

8.13.79 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

8.13.80 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

8.13.81 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

8.13.82 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

8.13.83 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

8.13.84 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

8.13.85 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

8.13.86 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

8.13.87 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

8.13.88 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

8.13.89 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

8.13.90 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

8.13.91 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

8.13.92 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

8.13.93 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

8.13.94 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

8.13.95 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

8.13.96 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

8.13.97 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

8.13.98 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

8.13.99 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

8.13.100 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

8.13.101 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

8.13.102 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

8.13.103 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

8.13.104 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

8.13.105 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

8.13.106 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

8.13.107 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

8.13.108 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

8.13.109 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

8.13.110 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

8.13.111 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

8.13.112 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

8.13.113 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

8.13.114 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

8.13.115 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

8.13.116 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

8.13.117 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

8.13.118 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

8.13.119 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

8.13.120 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

8.13.121 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

8.13.122 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

8.13.123 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

8.13.124 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

8.13.125 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

8.13.126 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

8.13.127 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

8.13.128 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

8.13.129 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

8.13.130 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

8.13.131 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

8.13.132 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

8.13.133 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

8.13.134 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

8.13.135 基金租用证券公司