中融睿祥一年定期开放债券型证券投资基金 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:中国邮政储蓄银行股份有限公司
送出日期:2018 年 03 月 30 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。

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2018 年 3 月 22 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。

本报告中的财务资料经审计,上会会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了无保留意见的审计报告,请投资者注意阅读。

本报告期自 2017 年 8 月 24 日起至 2017 年 12 月 31 日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中融睿祥一年定期开放债券型证券投资基金	
基金简称	中融睿祥定期开放债券	
基金主代码	003071	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 08 月 24 日	
基金管理人	中融基金管理有限公司	
基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	244,221,681.92 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中融睿祥定期开放债券 A	中融睿祥定期开放债券 C
下属分级基金的交易代码	003071	003072
报告期末下属分级基金的份额总额	244,114,821.94 份	106,859.98 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在追求基金资产长期稳定增值的基础上,力求获得超越业绩比较基准的稳定收益。
投资策略	1.资产配置策略 2.债券投资组合策略 3.信用类债券投资策略 4.相对价值策略 5.债券选择策略 6.资产支持证券等品种投资策略 7.中小企业私募债券投资策略 8.期限管理策略 9.短期交易性策略
业绩比较基准	中债综合财富指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金,属于中等预期风险和预期收益的产品,其长期平均预期风险和预期收益率低于混合型基金、股票型基金,高于货币市场基金。

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	中国邮政储蓄银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	裴芸	田东辉
	联系电话	010-56517128	010-68858113
	电子邮箱	peiyun@zrfunds.com.cn	tiandonghui@psbc.com
客户服务电话		400-160-6000;010-56517299	95580
传真		010-56517001	010-68858120

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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.zrfunds.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

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	本期 2017 年 08 月 24 日(基金合同生效日)-2017 年 12 月 31 日	
	中融睿祥定期开放债券 A	中融睿祥定期开放债券 C
本期已实现收益	3,522,871.02	1,427.80
本期利润	–279,407.40	–235.36
加权平均基金份额本期利润	–0.0011	–0.0022
本期加权平均净值利润率	–0.11%	–0.22%
本期基金份额净值增长率	–0.11%	–0.22%
3.1.2 期末数据和指标	2017 年末	
期末可供分配利润	–279,407.40	–235.36
期末可供分配基金份额利润	–0.0011	–0.0022
期末基金资产净值	243,835,414.54	106,624.62
期末基金份额净值	0.9989	0.9978
3.1.3 累计期末指标	2017 年末	
基金份额累计净值增长率	–0.11%	–0.22%

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、本基金合同生效日为 2017 年 08 月 24 日,本报告期为 2017 年 08 月 24 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日。

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

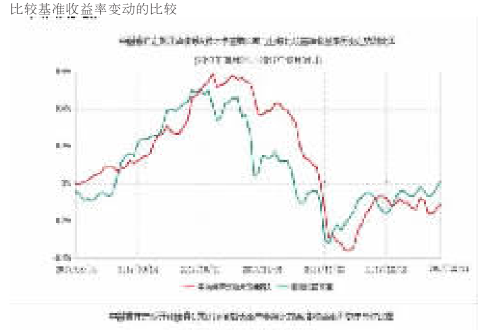
中融睿祥定期开放债券 A

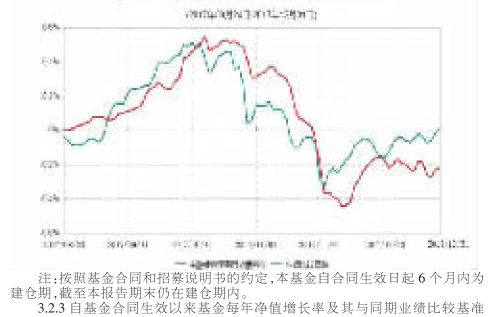
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	–0.45%	0.05%	–0.43%	0.06%	–0.02%	–0.01%
自基金合同生效起至今	–0.11%	0.04%	0.01%	0.05%	–0.12%	–0.01%

中融睿祥定期开放债券 C

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
过去三个月	–0.53%	0.05%	–0.43%	0.06%	–0.10%	–0.01%
自基金合同生效起至今	–0.22%	0.04%	0.01%	0.05%	–0.23%	–0.01%

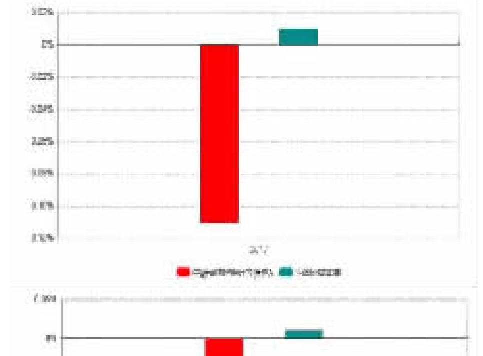
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

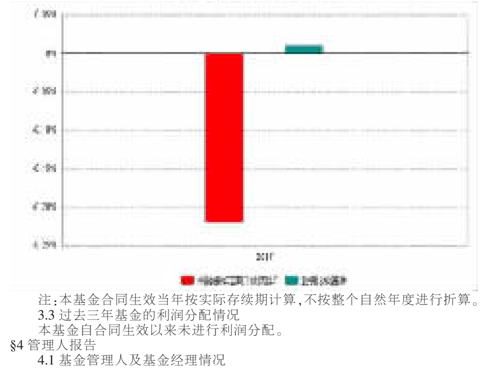




注:按照基金合同和招募说明书的约定,本基金自合同生效日起 6 个月内为建仓期,截至本报告期末仍在建仓期内。

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: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

本基金自合同生效以来未进行利润分配。

§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 11.5 亿元人民币。

截止 2017 年 12 月 31 日,中融基金管理有限公司共管理 40 只基金,包括中融增鑫一年定期开放债券型证券投资基金、中融货币市场基金、中融国企改革灵活配置混合型证券投资基金、中融融安灵活配置混合型证券投资基金、中融新机遇灵活配置混合型证券投资基金、中融中证一带一路主题指数分级证券投资基金、中融中证银行指数分级证券投资基金、中融鑫起点灵活配置混合型证券投资基金、中融国证钢铁行业指数分级证券投资基金、中融中证煤炭指数分级证券投资基金、中融融安二号保本混合型证券投资基金、中融新优势灵活配置混合型证券投资基金、中融稳健添利债券型证券投资基金、中融新经济灵活配置混合型证券投资基金、中融日日盈交易型货币市场基金、中融产业升级灵活配置混合型证券投资基金、中融融丰纯债债券型证券投资基金、中融融裕双利债券型证券投资基金、中融竞争优势股票型证券投资基金、中融融信双盈债券型证券投资基金、中融强国制造灵活配置混合型证券投资基金、中融现金增利货币市场基金、中融上海清算所银行间 1-3 年高等级信用债指数发起式证券投资基金、中融上海清算所银行间 3-5 年中高等级信用债指数发起式证券投资基金、中融上海清算所银行间 0-1 年中高等级信用债指数发起式证券投资基金、中融上海清算所银行间 1-3 年中高等级信用债指数发起式证券投资基金、中融恒泰纯债债券型证券投资基金、中融量化多因子混合型发起式证券投资基金、中融鑫思路灵活配置混合型证券投资基金、中融物联网主题灵活配置混合型证券投资基金、中融量化智选混合型证券投资基金、中融盈泽债券型证券投资基金、中融恒瑞纯债债券型证券投资基金、中融量化小盘股票型发起式证券投资基金、中融睿丰一年定期开放债券型证券投资基金、中融新产业灵活配置混合型证券投资基金、中融恒信纯债债券型证券投资基金、中融睿祥一年定期开放债券型证券投资基金、中融核心成长灵活配置混合型证券投资基金、中融沪港深大消费主题灵活配置混合型发起式证券投资基金。

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		
李倩	本基金、中融增鑫定期开放债券、中融货币、中融融安二号保本、中融融丰纯债、中融现金增利货币、中融恒泰纯债、中融盈泽债券、中融睿丰定期开放债券、中融恒信纯债基金基金经理。	2017-08-24	–	10 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,学士学历,具有基金从业资格,证券从业年限 10 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。任固收投资部基金经理,于 2017 年 8 月至今任本基金基金经理。

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。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期内,本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项配套法规、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 公平交易制度和控制方法

公司制定了《公平交易管理制度》,按照证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规的规定,从组织架构、岗位设置和业务流程、系统和制度建设、内控措施和信息披露等多方面,确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合,杜绝不同投资组合之间进行利益输送,保护投资者合法权益。

公司公平交易管理制度要求境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易以及投资管理过程中各个相关环节符合公平交易的监管要求。各投资组合能够公平地获得投资信息、投资建议,并在投资决策委员会的制度规范下独立决策,实施投资决策时享有公平的机会。所有组合投资决策与交易执行保持隔离,任何组合必须经过公司交易部集中交易。各组合享有平等的交易权利,共享交易资源。对交易所公开竞价交易以及银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易制定专门的交易规则,保证各投资组合获得公平的交易机会。对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易,严格遵循各投资组合交易前独立确定交易要素,交易后按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配。

4.3.2 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》并严格执行,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,在研究、决策、交易执行等各环节,通过制度、流程、技术手段等各方面措施确保了公平对待所管理的投资组合,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。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

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

2017 年,国内经济温和复苏,PPI 高位震荡,CPI 温和上涨,随着供给侧改革和行业去杠杆的加码,工业品价格有所抬头,经济韧性较强。央行维持"防风险、去杠杆、抑泡沫"的政策基调,在监管加码和 MPA 考核的双重压力下,货币市场超储全年低位运行,资金价格波动较大,重心上移,债券市场持续调整,纵观全年,以 10 年国开和国债为代表的长端利率水平分别上行 112bp 和 80bp,中债总财富指数全年下跌了 1.19%。以 R001 和 R007 为代表的资金价格水平分别上行了 70bp 和 130bp。

本基金成立于 17 年三季度中旬,采用中短久期的票息策略,在四季度初降低了部分中等久期债券仓位,增配期限匹配的高收益资产。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末中融睿祥定期开放债券 A 基金份额净值为 0.9989 元;本报告期内,基金份额净值增长率为–0.11%,同期业绩比较基准收益率为 0.01%;截至报告期末中融睿祥定期开放债券 C 基金份额净值为 0.9978 元; 本报告期内,基金份额净值增长率为–0.22%,同期业绩比较基准收益率为 0.01%;

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

预计 2018 年经济的韧性依然存在,去杠杆和严监管的基调仍将持续,货币政策也将延续"锁短放长"的中性思路,叠加外围资金环境全面收缩的环境,债市趋势性机会暂时还难出现,利率债博弈的机会成本也较高。信用债,受益于企业盈利改善,现金流稳定,叠加目前收益水平已经上升到历史高位,配置价值凸现。资金面延续去年节奏:月初、季度初持续宽松,资金价格走低,跨月和跨季等关键时点非银融资难度上升。

本基金整体久期可控,静态收益处于较高水平,计划在一季度维持基本配置。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内,本基金管理人在内部监察稽核工作中,一切从合规运作、保障基金份额持有人的利益出发,由督察长领导法律合规部及风险管理部对公司经营、基金运作及员工行为的合规性进行定期和不定期检查,推动公司内部控制机制的完善与优化,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。本报告期内,公司内部控制体系运行顺利,本基金运作没有出现违法违规行为。

本报告期内,本基金管理人内部监察稽核工作重点集中于以下几个方面:

1、根据基金监管法律法规的最新变化,推动公司各部门及时完善与更新制度规范和业务流程,制定、颁布和更新了一系列公司基本管理制度,确保内控制度的适时性、全面性和合法合规性,并加强内部督导,将风险意识贯穿于各岗位与各业务环节。

2、日常监察和专项监察相结合,通过定期检查、不定期抽查、专项监察等工作方法,加强了对基金日常业务的合规审核和合规监测,并加强了对重要业务和关键业务环节的监督检查。

3、规范基金销售业务,保证基金销售业务的合法合规性。公司在基金募集和持续营销活动中,严格规范基金销售业务,按照《证券投资基金销售管理办法》及相关法规规定审查宣传推介材料,逐步落实反洗钱法律法规各项要求,并督促销售部门做好投资者教育工作。

4、规范基金投资业务,保证投资管理工作规范有序、合法合规进行。公司制定了严格规范的投资管理制度和流程机制,以投资决策委员会为最高投资决策机构,投资业务均按照管理制度和业务流程执行。

5、以外聘律师、讲座等多种方式加强合规教育与培训,促进公司合规文化的建设,及时向公司传达基金相关的法律法规;加大了对员工行为的监察稽核力度,从源头上防范合规风险,防范利益输送行为。公司自成立以来,各项业务运作正常,内部控制和风险防范措施逐步完善并积极发挥作用。我们将继续以风险控制为核心,进一步提高内部监察工作的科学性和有效性,切实保障基金的规范运作,充分保障基金份额持有人的利益。

4.7 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历。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。

4.8 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遵规守信情况声明

本报告期内,中国邮政储蓄银行股份有限公司(以下称"本托管人")在中融睿祥一年定期开放债券型证券投资基金(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遵规守信、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。

本报告期内,本基金未进行利润分配。

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

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、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	上会师报字(2018)第 1116 号

6.2 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	中融睿祥一年定期开放债券型证券投资基金份额持有人
审计意见	我们审计了中融睿祥一年定期开放债券型证券投资基金(以下简称"中融睿祥定期开放债券")财务报表,包括 2017 年 12 月 31 日的资产负债表,2017 年 8 月 24 日(合同生效日)起至 2017 年 12 月 31 日止期间的利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及相关财务报表附注。我们认为,后附中融睿祥定期开放债券的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》、《中融睿祥一年定期开放债券型证券投资基金基金合同》以及中国证券监督管理委员会和中国证券业投资基金业协会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制,公允反映了中融睿祥定期开放债券 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年 8 月 24 日(合同生效日)起至 2017 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净值变动情况。
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。审计报告的"注册会计师对财务报表审计的责任"部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于中融睿祥定期开放债券,并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。
强调事项	–
其他事项	我们提醒财务报表使用者关注后附财务报表附注中对编制基础的说明。同时该财务报表系中融睿祥定期开放债券管理人(以下简称"管理人")根据《中融睿祥一年定期开放债券型证券投资基金基金合同》的规定为其基金份额持有人编制的,因此财务报表可能不适于其他用途。本报告仅供管理人提供中融睿祥定期开放债券份额持有人和向中国证券监督管理委员会及其派出机构报送使用,不得用于其他目的。
其他信息	管理人对其他信息负责。其他信息包括中融睿祥定期开放债券 2017 年 8 月 24 日(合同生效日)起至 2017 年 12 月 31 日止期间报告中涵盖的信息,但不包括财务报表和我们的审计报告。我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息,我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。结合我们对财务报表的审计,我们的责任是阅读其他信息,在此过程中,考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作,如果我们确定其他信息存在重大错报,我们应当报告该事实。在这方面,我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	管理人负责按照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》、《中融上海清算所银行间 3-5 年中高等级信用债指数发起式证券投资基金基金合同》以及中国证券监督管理委员会和中国证券业投资基金业协会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。在编制财务报表时,管理人负责评估中融银行间 3-5 年中高等级信用债指数的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项,并运用持续经营假设,除非基金进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:(1)识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险,设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。(2)了解与审计相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。(3)评价管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。(4)对管理人使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时,根据获取的审计证据,就可能导致对中融睿祥定期开放债券持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性,审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露;如果披露不充分,我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而,未来的事项或情况可能导致中融睿祥定期开放债券不能持续经营。(5)评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露),并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与管理人就中融睿祥定期开放债券的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通,包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。
会计师事务所的名称	上会会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	张健江嘉炜
会计师事务所的地址	上海市静安区威海路 755 号文新报业大厦 20 楼
审计报告日期	2018-03-22

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:中融睿祥一年定期开放债券型证券投资基金
报告截止日:2017 年 12 月 31 日
单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 12 月 31 日
资产:		
银行存款	7.4.7.1	1,668,072.73
结算备付金		3,066,198.06
存出保证金		5,614.76
交易性金融资产	7.4.7.2	349,044,661.10
其中:股票投资		–
基金投资		–
债券投资		349,044,661.10
资产支持证券投资		–
贵金属投资		–
衍生金融资产	7.4.7.3	–
买入返售金融资产	7.4.7.4	–
应收证券清算款		–
应收利息	7.4.7.5	6,073,006.40
应收股利		–
应收申购款		–
递延所得税资产		–
其他资产	7.4.7.6	–
资产总计		359,857,553.05
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 12 月 31 日
负债:		
短期借款		–
交易性金融负债		–
衍生金融负债	7.4.7.3	–
卖出回购金融资产款		115,555,483.66
应付证券清算款		73,503.56
应付赎回款		–
应付管理人报酬		103,559.40
应付托管费		20,711.87
应付销售服务费		27.24
应付交易费用	7.4.7.7	5,843.01
应交税费		–
应付利息		65,785.15
应付利润		–
递延所得税负债		–
其他负债	7.4.7.8	90,600.00
负债合计		115,915,513.89
所有者权益:		
实收基金	7.4.7.9	244,221,681.92
未分配利润	7.4.7.10	–279,642.76
所有者权益合计		243,942,039.16
负债和所有者权益总计		359,857,553.05

1、报告截止日 2017 年 12 月 31 日,基金份额总额 244,221,681.92 份,其中 A 类基金份额的份额总额为 244,114,821.94 份,份额净值 0.9989 元;C 类基金份额的份额总额为 106,859.98 份,份额净值 0.9978 元。

2、本财务报表的实际编制期间为 2017 年 08 月 24 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日止期间。

7.2 利润表

会计主体:中融睿祥一年定期开放债券型证券投资基金
本报告期:2017 年 08 月 24 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日
单位:人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 08 月 24 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日
一、收入		1,719,780.30
1.利息收入		5,678,325.39
其中:存款利息收入	7.4.7.11	48,107.39
债券利息收入		5,166,767.18
资产支持证券利息收入		–
买入返售金融资产收入		463,450.82
其他利息收入		–
2.投资收益(损失以"–"填列)		–154,603.51
其中:股票投资收益	7.4.7.12	–
基金投资收益		–
债券投资收益	7.4.7.13	–154,603.51
资产支持证券投资收益		–
贵金属投资收益		–
衍生工具收益	7.4.7.14	–
股利收益		–
3.公允价值变动收益(损失以"–"号填列)	7.4.7.15	–3,803,941.58
4.汇兑收益(损失以"–"号填列)		–
5.其他收入(损失以"–"号填列)	7.4.7.16	–
减:二、费用		1,999,423.06
1.管理人报酬	7.4.10.2.1	432,236.54
2.托管费	7.4.10.2.2	86,447.34
3.销售服务费	7.4.10.2.3	113.45
4.交易费用	7.4.7.17	4,452.83
5.利息支出		1,385,172.90
其中:卖出回购金融资产支出		1,385,172.90
6.其他费用	7.4.7.18	91,000.00
三、利润总额(亏损总额以"–"号填列)		–279,642.76
减:所得税费用		–
四、净利润(净亏损以"–"号填列)		–279,642.76

注:本财务报表的实际编制期间为 2017 年 8 月 24 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日止期间。

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:中融睿祥一年定期开放债券型证券投资基金
本报告期:2017 年 08 月 24 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日
单位:人民币元

项目	本期 2017 年 08 月 24 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 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)	244,221,681.92	–	244,221,681.92
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	–	–279,642.76	–279,642.76
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)	–	–	–
其中:1.基金申购款	–	–	–
2.基金赎回款	–	–	–
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)	244,221,681.92	–279,642.76	243,942,039.16

注:本财务报表的实际编制期间为 2017 年 8 月 24 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日止期间。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署:

王瑶	代宝香	鞠帅平
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

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

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

7.4.2 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。

7.4.3 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
上海融晟投资有限公司	基金管理人股东
中融国际信托有限公司	基金管理人股东
中融(北京)资产管理有限公司	基金管理人子公司
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
中国邮政储蓄银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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

7.4.4.1.1 股票交易

无。

7.4.4.1.2 权证交易

无。

7.4.4.1.3 应支付关联方的佣金

无。

7.4.4.1.4 债券交易

无。

7.4.4.1.5 债券回购交易

无。

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

项目	本期 2017 年 08 月 24 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	432,236.54
其中:支付销售机构的客户维护费	153.69

①支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.50%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:日管理人报酬=前一日基金资产净值 X0.50%/当年天数。

②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。

③本基金基金合同自 2017 年 8 月 24 日起生效,无上年可比期间。

7.4.4.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2017 年 08 月 24 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	86,447.34

①支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.10%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 X0.10%/当年天数。

②本基金基金合同自 2017 年 8 月 24 日起生效,无上年可比期间。

7.4.4.2.3 销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2017 年 08 月 24 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中融睿祥定期开放债券 A	中融睿祥定期开放债券 C	合计
中融基金管理有限公司	–	2.58	2.58
合计	–	2.58	2.58

①支付基金销售机构的 C 类基金份额销售服务费按前一日 C 类基金资产净值 0.30%的年费率计提,每日计提,逐日累计至每月月底,按月支付给注册登记机构,再由注册登记机构代付给销售机构。A 类基金份额不收取销售服务费。C 类基金销售服务费的计算公式为:

C 类基金份额的日销售服务费=前一日 C 类基金资产净值 X0.30%/当年天数。

②本基金基金合同自 2017 年 8 月 24 日起生效,无上年可比期间。

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

无。

7.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.4.4.2 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

无。

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

关联方名称	本期 2017 年 08 月 24 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入
中国邮政储蓄银行股份有限公司	1,668,072.73	29,752.90

①本基金的银行存款由基金托管人保管,按银行同业利率计息。本基金用于证券交易结算的资金通过托管人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。

②本基金基金合同自 2017 年 8 月 24 日起生效,无上年可比期间。

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 12 月 31 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

无。

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 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 12 月 31 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是 77,555,483.66 元,是以如下债券作为质押:

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
1080101	10 邵阳城投债	2018-01-02	100.35	100,000	10,035,000.00
1180200	11 冀新合作债	2018-01-02	101.42	47,000	4,766,740.00
1280320	12 宜昌财投债	2018-01-02	40.68	500,000	20,340,000.00
1380168	13 邯郸交通债	2018-01-02	100.68	75,000	7,551,000.00
1380173	13 金外滩债	2018-01-02	60.75	200,000	12,150,000.00
1380243	13 振湘治理债	2018-01-02	60.75	200,000	12,150,000.00
1480121	14 甬广聚债	2018-01-02	83.03	200,000	16,606,000.00
合计				1,322,000	83,598,740.00

7.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

截止本报告期末 2017 年 12 月 31 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 38,000,000.00 元,于 2018 年 1 月 2 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。

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,其公允价值计量基于公允价值的输入值的可观察程度以及该等输入值对公允价值计量整体的重要性,被划分为三个层次:

第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次输入值是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。

第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。

②各层级金融工具公允价值

于 2017 年 12 月 31 日,本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第二层次的余额为人民币 349,044,661.10 元,无属于第一层次及第三层次的余额。

③公允价值所属层级间的重大变动

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(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。

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换。

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

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	–	–
	其中:股票	–	–
2	基金投资	–	–
3	固定收益投资	349,044,661.10	97.00
	其中:债券	349,044,661.10	97.00
	资产支持证券	–	–
4	贵金属投资	–	–
5	金融衍生品投资	–	–
6	买入返售金融资产	–	–
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	–	–
7	银行存款和结算备付金合计	4,734,270.79	1.32
8	其他各项资产	6,078,621.16	1.69
9	合计	359,857,553.05	100.00

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

本基金本报告期末未持有股票投资。

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明细

本基金本报告期末未持有股票投资。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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

本基金本报告期无股票累计买入金额。

8.4.2 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

本基金本报告期无股票累计卖出金额。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期无股票累计买入、卖出金额。

8.5 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	–	–
	其中:政策性金融债	–	–
4	企业债券	171,587,661.10	70.34
5	企业短期融资券	109,858,000.00	45.03
6	中期票据	67,599,000.00	27.71
7	可转债(可交换债)	–	–
8	同业存单	–	–
9	其他	–	–
10	合计	349,044,661.10	143.09

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	1280320	12 宜昌财投债	500,000	20,340,000.00	8.34
2	1380168	13 邯郸交通债	200,000	20,136,000.00	8.25
3	011772029	17 津海泰 SCP002	200,000	19,998,000.00	8.20
4	011760138	17 华立 SCP003	200,000	19,984,000.00	8.19
5	011760141	17 国泰租赁 SCP002	200,000	19,978,000.00	8.19

8.7 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。

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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

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明细

本基金本报告期末未持有权证。

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、处罚的情形。

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

序号	名称	金额
1	存出保证金	5,614.76
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	6,073,006.40
5	应收申购款	–
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	6,078,621.16

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情况。

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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

份额级别	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
中融睿祥定期开放债券 A	202	1,208,489.22	244,014,680.00	99.96%	100,141.94	0.04%
中融睿祥定期开放债券 C	52	2,055.00	–	–	106,859.98	100.00%
合计	254	961,502.68	244,014,680.00	99.92%	207,001.92	0.08%

分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中,对下属分级基金,比例的分母采用各自级别的份额,对合计数,比例的分母采用下属分级基金份额的合计数(即期末基金份额总额)。

9.2 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,本基金管理人的从业人员未持有本基金。

9.3 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

本报告期末,本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人、基金经理未持有本基金。

§10 开放式基金份额变动

单位:份

	中融睿祥定期开放债券 A	中融睿祥定期开放债券 C
基金合同生效日(2017 年 08 月 24 日)基金份额总额	244,114,821.94	106,859.98
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	–	–
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	–	–
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	–	–
本报告期期末基金份额总额	244,114,821.94	106,859.98

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。

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内,本基金未召开基金份额持有人大会。

11.2 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

本基金管理人于 2017 年 11 月 9 日发布公告,易海波先生担任中融基金管理有限公司副总经理。

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。

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未发生重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期内选聘上会会计师事务所(特殊普通合伙)提供首年审计服务。本基金本报告期应支付给上会会计师事务所(特殊普通合伙)的报酬为 10,600.00 元人民币。

11.6 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
银河证券	2	–	–	–	–	–

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。

本基金合同于 2017 年 8 月 24 日生效,以上交易单元均为本报告期新增交易单元。

11.7.2 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		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
银河证券	39,962,956.50	100.00%	3,459,020,000.00	100.00%	–	–	–	–

中融基金管理有限公司
二〇一八年三月三十日