



中融核心成长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:中国工商银行股份有限公司
重要提示:1.1 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...

基金简介
2.1 基金基本情况
基金名称:中融核心成长灵活配置混合型证券投资基金
基金简称:中融核心成长

基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日:2017年09月29日
基金管理人:中融基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

基金产品说明
2.2 基金产品说明
基金的投资目标:本基金以追求长期资本增值为目的,通过重点投资于具有核心竞争力且能保持持续成长的行业和个股,在充分控制风险的前提下,分享中国经济快速增长的成果...

基金管理人及基金托管人
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:中国工商银行股份有限公司

基金信息披露
2.4 信息披露
本基金年度报告的披露日期:2018年3月31日
基金管理人网站:www.zrfunds.com.cn

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
3.1.2 期末数据和指标

基金业绩比较基准
3.2 基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率×55%+上证国债指数收益率×45%

基金投资策略
3.3 基金投资策略
本基金采取自上而下的资产配置策略,在资产配置的基础上,通过行业轮动和个股精选,实现基金资产的长期稳定增值。

基金风险控制
3.4 基金风险控制
本基金通过完善的风险管理制度和流程,严格控制基金资产的投资风险,确保基金资产的长期稳定增值。

基金管理人内部控制
3.5 基金管理人内部控制
本基金管理人建立了完善的内部控制体系,确保基金资产的安全和基金运作的合规性。

基金管理人内部控制
3.6 基金管理人内部控制
本基金管理人建立了完善的内部控制体系,确保基金资产的安全和基金运作的合规性。

基金管理人内部控制
3.7 基金管理人内部控制
本基金管理人建立了完善的内部控制体系,确保基金资产的安全和基金运作的合规性。

基金管理人内部控制
3.8 基金管理人内部控制
本基金管理人建立了完善的内部控制体系,确保基金资产的安全和基金运作的合规性。

基金管理人内部控制
3.9 基金管理人内部控制
本基金管理人建立了完善的内部控制体系,确保基金资产的安全和基金运作的合规性。

基金管理人内部控制
3.10 基金管理人内部控制
本基金管理人建立了完善的内部控制体系,确保基金资产的安全和基金运作的合规性。

基金管理人内部控制
3.11 基金管理人内部控制
本基金管理人建立了完善的内部控制体系,确保基金资产的安全和基金运作的合规性。

基金管理人内部控制
3.12 基金管理人内部控制
本基金管理人建立了完善的内部控制体系,确保基金资产的安全和基金运作的合规性。

基金管理人内部控制
3.13 基金管理人内部控制
本基金管理人建立了完善的内部控制体系,确保基金资产的安全和基金运作的合规性。

基金管理人内部控制
3.14 基金管理人内部控制
本基金管理人建立了完善的内部控制体系,确保基金资产的安全和基金运作的合规性。

基金管理人内部控制
3.15 基金管理人内部控制
本基金管理人建立了完善的内部控制体系,确保基金资产的安全和基金运作的合规性。

基金管理人内部控制
3.16 基金管理人内部控制
本基金管理人建立了完善的内部控制体系,确保基金资产的安全和基金运作的合规性。

基金业绩表现
4.1 基金业绩表现
本基金报告期内业绩表现良好,超额收益显著,主要得益于对优质资产的精准配置和风险控制。

基金管理人内部控制
4.2 基金管理人内部控制
本基金管理人建立了完善的内部控制体系,确保基金资产的安全和基金运作的合规性。

基金管理人内部控制
4.3 基金管理人内部控制
本基金管理人建立了完善的内部控制体系,确保基金资产的安全和基金运作的合规性。

基金管理人内部控制
4.4 基金管理人内部控制
本基金管理人建立了完善的内部控制体系,确保基金资产的安全和基金运作的合规性。

基金管理人内部控制
4.5 基金管理人内部控制
本基金管理人建立了完善的内部控制体系,确保基金资产的安全和基金运作的合规性。

基金管理人内部控制
4.6 基金管理人内部控制
本基金管理人建立了完善的内部控制体系,确保基金资产的安全和基金运作的合规性。

基金管理人内部控制
4.7 基金管理人内部控制
本基金管理人建立了完善的内部控制体系,确保基金资产的安全和基金运作的合规性。

基金管理人内部控制
4.8 基金管理人内部控制
本基金管理人建立了完善的内部控制体系,确保基金资产的安全和基金运作的合规性。

基金管理人内部控制
4.9 基金管理人内部控制
本基金管理人建立了完善的内部控制体系,确保基金资产的安全和基金运作的合规性。

基金管理人内部控制
4.10 基金管理人内部控制
本基金管理人建立了完善的内部控制体系,确保基金资产的安全和基金运作的合规性。

基金管理人内部控制
4.11 基金管理人内部控制
本基金管理人建立了完善的内部控制体系,确保基金资产的安全和基金运作的合规性。

基金管理人内部控制
4.12 基金管理人内部控制
本基金管理人建立了完善的内部控制体系,确保基金资产的安全和基金运作的合规性。

基金管理人内部控制
4.13 基金管理人内部控制
本基金管理人建立了完善的内部控制体系,确保基金资产的安全和基金运作的合规性。

基金管理人内部控制
4.14 基金管理人内部控制
本基金管理人建立了完善的内部控制体系,确保基金资产的安全和基金运作的合规性。

基金管理人内部控制
4.15 基金管理人内部控制
本基金管理人建立了完善的内部控制体系,确保基金资产的安全和基金运作的合规性。

基金管理人内部控制
4.16 基金管理人内部控制
本基金管理人建立了完善的内部控制体系,确保基金资产的安全和基金运作的合规性。

基金管理人内部控制
4.17 基金管理人内部控制
本基金管理人建立了完善的内部控制体系,确保基金资产的安全和基金运作的合规性。

基金管理人内部控制
4.18 基金管理人内部控制
本基金管理人建立了完善的内部控制体系,确保基金资产的安全和基金运作的合规性。

基金管理人内部控制
4.19 基金管理人内部控制
本基金管理人建立了完善的内部控制体系,确保基金资产的安全和基金运作的合规性。

基金管理人内部控制
4.20 基金管理人内部控制
本基金管理人建立了完善的内部控制体系,确保基金资产的安全和基金运作的合规性。

基金管理人内部控制
4.21 基金管理人内部控制
本基金管理人建立了完善的内部控制体系,确保基金资产的安全和基金运作的合规性。

基金管理人内部控制
4.22 基金管理人内部控制
本基金管理人建立了完善的内部控制体系,确保基金资产的安全和基金运作的合规性。

基金管理人内部控制
4.23 基金管理人内部控制
本基金管理人建立了完善的内部控制体系,确保基金资产的安全和基金运作的合规性。

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 1115 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:中融核心成长灵活配置混合型证券投资基金全体持有人

审计意见
我们认为,后附的中融核心成长灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“中融核心成长”)财务报表,包括2017年12月31日的资产负债表,2017年9月29日(含同生生日)起至2017年12月31日止期间的利润表、所有者权益变动表(含所有者权益变动表附注)以及中国证券投资基金业协会发布的关于基金行业实务操作的有关编制规定,公允反映了中融核心成长2017年9月29日(含同生生日)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,我们独立于中融核心成长,并履行了职业道德方面的其他义务。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
我们提醒财务报表使用者关注后附财务报表附注中编制基础的说明。同时,该财务报表系中融核心成长(以下简称“管理人”)根据《中融核心成长灵活配置混合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用于其他用途。本报告仅供管理人提供中融核心成长财务报表持有人和向中国证券投资基金业协会及其派出机构报送使用,不得用于其他目的。

其他信息
我们提醒财务报表使用者关注后附财务报表附注中编制基础的说明。同时,该财务报表系中融核心成长(以下简称“管理人”)根据《中融核心成长灵活配置混合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用于其他用途。本报告仅供管理人提供中融核心成长财务报表持有人和向中国证券投资基金业协会及其派出机构报送使用,不得用于其他目的。

基金管理人内部控制
5.1 基金管理人内部控制
本基金管理人建立了完善的内部控制体系,确保基金资产的安全和基金运作的合规性。

基金管理人内部控制
5.2 基金管理人内部控制
本基金管理人建立了完善的内部控制体系,确保基金资产的安全和基金运作的合规性。

基金管理人内部控制
5.3 基金管理人内部控制
本基金管理人建立了完善的内部控制体系,确保基金资产的安全和基金运作的合规性。

基金管理人内部控制
5.4 基金管理人内部控制
本基金管理人建立了完善的内部控制体系,确保基金资产的安全和基金运作的合规性。

基金管理人内部控制
5.5 基金管理人内部控制
本基金管理人建立了完善的内部控制体系,确保基金资产的安全和基金运作的合规性。

7.1 资产负债表
会计主体:中融核心成长灵活配置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, 期末 2017年12月31日. Rows include: 银行存款, 结算备付金, 存出保证金, 交易性金融资产, etc.

Table with columns: 负债和所有者权益总计, 附注, 期末 2017年12月31日. Rows include: 短期借款, 交易性金融负债, 衍生金融负债, etc.

Table with columns: 项目, 附注, 本期 2017年09月29日, 上期 2017年12月31日. Rows include: 一、收入, 1.利息收入, 2.投资收益, etc.

Table with columns: 项目, 附注, 本期 2017年09月29日, 上期 2017年12月31日. Rows include: 其中:存款利息收入, 债券利息收入, 资产支持证券利息收入, etc.

Table with columns: 项目, 附注, 本期 2017年09月29日, 上期 2017年12月31日. Rows include: 其中:股票投资收益, 基金投资收益, 债券投资收益, etc.

Table with columns: 项目, 附注, 本期 2017年09月29日, 上期 2017年12月31日. Rows include: 公允价值变动收益(损失以“-”号填列), 汇兑收益(损失以“-”号填列), 其他收入(损失以“-”号填列), etc.

Table with columns: 项目, 附注, 本期 2017年09月29日, 上期 2017年12月31日. Rows include: 减:二、费用, 1.管理人报酬, 2.托管费, 3.销售服务费, etc.

Table with columns: 项目, 附注, 本期 2017年09月29日, 上期 2017年12月31日. Rows include: 其中:卖出回购金融资产支出, 其他费用, 三、利润总额(亏损总额以“-”号填列), etc.

本基金合同于2017年9月29日生效,本期财务报表的实际编制期间为2017年9月29日(基金合同生效日)至2017年12月31日,无上年度可比期间数据。

Table with columns: 项目, 本期 2017年09月29日, 上期 2017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(本期利润), etc.

本基金合同于2017年9月29日生效,本期财务报表的实际编制期间为2017年9月29日(基金合同生效日)至2017年12月31日,无上年度可比期间数据。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署:
王瑞 基金管理人负责人
王瑞 基金管理人财务负责人
王瑞 基金管理人会计负责人

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, 中融基金管理有限公司, etc.

Table with columns: 项目, 本期 2017年09月29日, 上期 2017年12月31日. Rows include: 当期发生的基金应支付的管理费, 其中:支付销售机构的客户维护费, etc.

Table with columns: 项目, 本期 2017年09月29日, 上期 2017年12月31日. Rows include: 当期发生的基金应支付的托管费, 其中:支付销售机构的客户维护费, etc.

Table with columns: 项目, 本期 2017年09月29日, 上期 2017年12月31日. Rows include: 当期发生的基金应支付的托管费, 其中:支付销售机构的客户维护费, etc.

Table with columns: 证券代码, 名称, 成功认购, 流通受限类型, 认购价格, 期末估值, 期末市值, etc.

Table with columns: 股票代码, 名称, 停牌日期, 停牌原因, 期末估值, 复牌日期, 复牌原因, etc.

7.4.12.1 受限证券类别:股票
7.4.12.2 受限证券类别:股票
7.4.12.3 受限证券类别:股票