

中融稳健添利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:中国农业银行股份有限公司

重要提示 1.1 重要提示 基金管理人、基金托管人、基金销售机构... 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...

基金简介 2.1 基金基本情况 基金名称:中融稳健添利债券型证券投资基金 基金简称:中融稳健添利 基金代码:001779

2.2 基金产品说明 投资目标:在注重资产安全性和流动性的前提下,积极主动调整投资组合,追求基金资产的长期稳定增值... 投资策略:1. 债券投资策略 2. 股票投资策略 3. 衍生品投资策略

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:中国农业银行股份有限公司

2.4 信息披露方式 基金信息披露网站:www.zrfund.com.cn 基金年度报告正文网址:https://www.zrfund.com.cn/

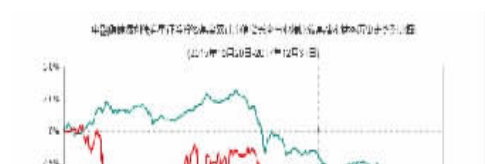
3.1 主要会计数据和财务指标 金额单位:人民币元 本期期末余额 2017 年末 2016 年末 2015 年 12 月 31 日

3.1.1 期间数据和指标 本期已实现收益 917,315.4 453,122.02 -3,761,972.91 本期净利润 -2,808,900.9 681,523.82 -1,211,866.28

3.1.2 期末数据和指标 2017 年末 2016 年末 2015 年末 期末可供分配基金份额利润 -0.0930 -0.0431 -0.0118

3.1.3 累计期末指标 2017 年末 2016 年末 2015 年末 基金份额累计净值增长率 -8.10% -4.30% -0.60%

3.2 基金业绩比较基准 本基金业绩比较基准为:中融稳健添利债券型证券投资基金业绩比较基准:1.50%+1.00%\*债券指数收益率+0.50%\*股票指数收益率



3.2.2 基金合同生效以来基金业绩比较基准收益变动的比较 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 本基金过去三年未进行利润分配。

4 基金管理人报告 4.1 基金管理人及基金托管人 4.1.1 基金管理人及基金托管人的基本情况

中融稳健添利债券型证券投资基金 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

Table with columns: Name, Position, Term, Description. Lists key personnel like 秦绍 (Investment Manager) and 王玥 (Compliance Officer).

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 管理人报告期内本基金遵守法律法规的情况 报告期内,本基金管理人严格遵守了《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

4.3 管理人报告期内公平交易的情况 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

4.3.1 公平交易制度的执行情况 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

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《公平交易管理制度》并严格执行

4.3.3 异常交易行为的专项说明 报告期内未发现异常交易行为

4.4 管理人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业绩分析

4.4.2 报告期内基金的业绩表现 截至报告期末中融稳健添利债券型证券投资基金净值为 0.919; 本报告期内,基金份额净值增长率为 -3.97%,同期业绩比较基准收益率为 -2.46%。

4.5 管理人对外宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 展望 2018 年,短期内的经济韧性将依然存在,通胀压力升温,基本面整体将出现稳中略降、前高后低的态势

4.6 管理人内部有关基金业务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

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... 2. 日常监督和专项监督检查相结合,通过定期检查、不定期抽查、专项监察等工作方法...

4.7 管理人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

4.8 管理人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

4.9 报告期内管理人对本基金持有人或基金资产净值预警情况的说明 本报告期内,本基金存在基金资产净值连续 20 个工作日低于 5000 万的情形

5.1 报告期内本基金管理人遵守法律法规的情况 在托管本基金的过程中,本基金管理人严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规性、净值计算、利润分配等情况的说明 本托管人对中融基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算

5.3 托管人对本年度报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见 本托管人对中融基金管理有限公司的年度报告符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定

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

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:中融稳健添利债券型证券投资基金全体基金份额持有人

审计意见 我们认为:中融稳健添利债券型证券投资基金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 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

形成审计报告的基础 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

强调事项 我们提醒财务报表使用者关注,本报告财务报表附注中对于中融稳健添利债券型证券投资基金资产净值的计算,中融稳健添利债券型证券投资基金资产净值的计算,中融稳健添利债券型证券投资基金资产净值的计算

其他信息 管理人对其其他信息负责,其他信息包括但不限于:中融稳健添利债券型证券投资基金 2017 年年度报告中披露的信息,但不构成财务报表组成部分

管理层和治理层对财务报表的责任 管理层负责按照企业会计准则和《证券投资基金法》、《证券投资基金信息披露管理办法》的规定编制财务报表,并对其真实性、准确性、完整性、及时性负责

7.3 所有者权益(基金净值)变动表 会计主体:中融稳健添利债券型证券投资基金 本报告期:2017 年 01 月 01 日至 2017 年 12 月 31 日

Table with columns: Item, 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. Shows changes in assets, liabilities, and net assets.

7.4 基金管理人报告 7.4.1 基金管理人及基金托管人 7.4.1.1 基金管理人及基金托管人的基本情况

Table with columns: Asset, 附注号, 本期末 2017 年 12 月 31 日, 上年度末 2016 年 12 月 31 日. Lists assets like 银行存款, 结算备付金, 存出保证金, etc.

Table with columns: 负债和所有者权益, 附注号, 本期末 2017 年 12 月 31 日, 上年度末 2016 年 12 月 31 日. Lists liabilities and equity items like 应付债券, 应付赎回款, etc.

注: 报告截止日 2017 年 12 月 31 日, 基金份额总额 50,655,952.27 份, 份额净值 0.919 元。

会计主体:中融稳健添利债券型证券投资基金 本报告期:2017 年 01 月 01 日至 2017 年 12 月 31 日

Table with columns: Item, 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. Shows expenses like 当期发生的基金应支付的托管费, 销售服务费, etc.

注: ①支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值 0.20% 的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付; ②基金管理人报酬计算公式:日基金管理人报酬=前一日基金资产净值 x 0.80% 当年天数;

③客户维护费是指基金管理人及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;

Table with columns: Item, 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. Shows expenses like 当期发生的基金应支付的托管费, 销售服务费, etc.

注: ①支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值 0.20% 的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付; ②基金管理人报酬计算公式:日基金管理人报酬=前一日基金资产净值 x 0.20% 当年天数;

③客户维护费是指基金管理人及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;

Table with columns: Item, 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. Shows expenses like 当期发生的基金应支付的托管费, 销售服务费, etc.

注: ①支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值 0.20% 的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付; ②基金管理人报酬计算公式:日基金管理人报酬=前一日基金资产净值 x 0.20% 当年天数;

③客户维护费是指基金管理人及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;

Table with columns: Item, 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. Shows expenses like 当期发生的基金应支付的托管费, 销售服务费, etc.

注: ①支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值 0.20% 的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付; ②基金管理人报酬计算公式:日基金管理人报酬=前一日基金资产净值 x 0.20% 当年天数;

③客户维护费是指基金管理人及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;

报告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:

Table with columns: Name, Position, Signature. Lists 王瑶 (Fund Manager) and 鞠柳平 (Accountant).

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保持一致的说明

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

Table with columns: Name, Relationship. Lists 中融国际信托有限公司 (Fund Manager), 上海融晟投资有限公司 (Fund Manager), etc.

注: 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

Table with columns: Item, 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. Shows 当期发生的基金应支付的托管费, 销售服务费.

注: ①支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值 0.20% 的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付; ②基金管理人报酬计算公式:日基金管理人报酬=前一日基金资产净值 x 0.80% 当年天数;

③客户维护费是指基金管理人及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;

Table with columns: Item, 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. Shows expenses like 当期发生的基金应支付的托管费, 销售服务费.

注: ①支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值 0.20% 的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付; ②基金管理人报酬计算公式:日基金管理人报酬=前一日基金资产净值 x 0.20% 当年天数;

③客户维护费是指基金管理人及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;

Table with columns: Item, 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. Shows expenses like 当期发生的基金应支付的托管费, 销售服务费.

注: ①支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值 0.20% 的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付; ②基金管理人报酬计算公式:日基金管理人报酬=前一日基金资产净值 x 0.20% 当年天数;

③客户维护费是指基金管理人及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;

Table with columns: Item, 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. Shows expenses like 当期发生的基金应支付的托管费, 销售服务费.

注: ①支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值 0.20% 的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付; ②基金管理人报酬计算公式:日基金管理人报酬=前一日基金资产净值 x 0.20% 当年天数;

③客户维护费是指基金管理人及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;

Table with columns: Item, 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. Shows expenses like 当期发生的基金应支付的托管费, 销售服务费.

注: ①支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值 0.20% 的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付; ②基金管理人报酬计算公式:日基金管理人报酬=前一日基金资产净值 x 0.20% 当年天数;

③客户维护费是指基金管理人及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;

Table with columns: Item, 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. Shows expenses like 当期发生的基金应支付的托管费, 销售服务费.