

中融增鑫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:中国工商银行股份有限公司
送出日期:2018 年 03 月 30 日

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。

2.1 基金基本情况
基金名称:中融增鑫一年定期开放债券型证券投资基金
基金代码:000400
基金运作方式:契约定期开放式

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。

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

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
基金年度报告正文的网址:www.zrfund.com.cn

3.1 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况
3.1.1 主要财务指标
单位:人民币元

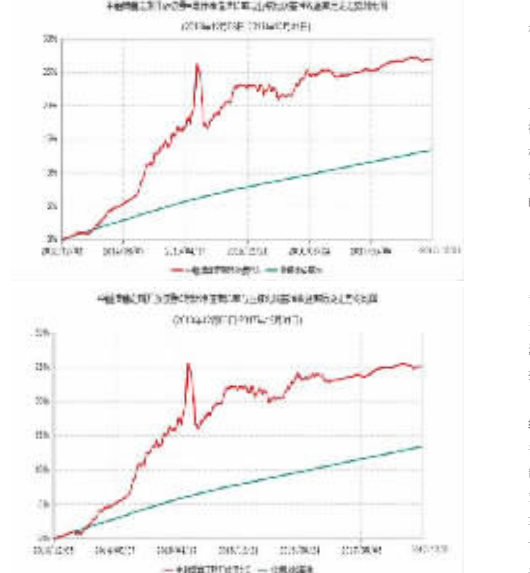
Table with 5 columns: 指标, 2017 年, 2016 年, 2015 年, 2014 年. Rows include 3.1.1.1 期间数据和指标, 3.1.1.2 本期已实现收益, 3.1.1.3 期末可供分配利润, 3.1.1.4 期末可供分配利润占期末基金资产净值的比例, 3.1.1.5 期末基金净值增长率, 3.1.1.6 期末基金份额净值增长率.

3.1.2 期末基金份额净值增长率
3.1.3 期末基金份额净值增长率
3.1.4 期末基金份额净值增长率

Table with 5 columns: 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. Rows include 过去三个月, 过去六个月, 过去一年, 过去三年, 自基金合同生效起至今.

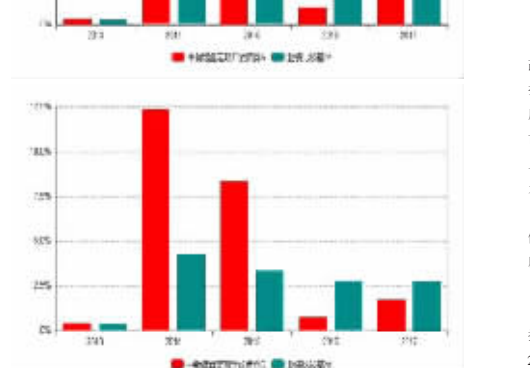
Table with 5 columns: 阶段, 份额净值增长率①, 份额净值增长率标准差②, 业绩比较基准收益率③, 业绩比较基准收益率标准差④, ①-③, ②-④. Rows include 过去三个月, 过去六个月, 过去一年, 过去三年, 自基金合同生效起至今.

3.2.1 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,建仓期结束时本基金的各项资产比例符合基金合同的有关规定。

3.2.3 过去五年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
3.3.1 基金管理人及基金托管人

3.3.2 基金管理人及基金托管人
3.3.3 基金管理人及基金托管人

3.4 基金管理人及基金托管人
3.4.1 基金管理人及基金托管人
3.4.2 基金管理人及基金托管人

3.4.3 基金管理人及基金托管人
3.4.4 基金管理人及基金托管人

Table with 5 columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期, 说明. Rows include 李倩, 王明, 王明女士, 王明女士.

3.4.5 基金管理人及基金托管人
3.4.6 基金管理人及基金托管人

3.4.7 基金管理人及基金托管人
3.4.8 基金管理人及基金托管人

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 管理人报告期内本基金运作遵守信情况的说明
报告期内,本基金管理人严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券投资基金法》及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。

4.3 管理人报告期内公平交易情况的专项说明
4.3.1 公平交易制度和内部控制
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。

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,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。

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 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,工业品价格有所抬升,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 年期国债为代表的长期利率水平分别上行 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 70bp 和 130bp。

本基金在一季度进入新的封闭期,逐步建仓,以高收益存单和短久期债券为主;二、三季度中融积极寻找长债利率债和转债的投资机会;进入四季度后,逐步增加久期,降低仓位,为新的开放期做准备。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现
截至报告期末中融增鑫一年定期开放债券 A 基金份额净值为 1.271 元;本报告期内,基金份额净值增长率为 2.09%,同期业绩比较基准收益率为 2.74%;截至报告期末中融增鑫一年定期开放债券 C 基金份额净值为 1.252 元;本报告期内,基金份额净值增长率为 1.71%,同期业绩比较基准收益率为 2.74%。

4.5 管理人及基金托管人
4.5.1 基金管理人及基金托管人
4.5.2 基金管理人及基金托管人

4.5.3 基金管理人及基金托管人
4.5.4 基金管理人及基金托管人

4.5.5 基金管理人及基金托管人
4.5.6 基金管理人及基金托管人

4.5.7 基金管理人及基金托管人
4.5.8 基金管理人及基金托管人

4.5.9 基金管理人及基金托管人
4.5.10 基金管理人及基金托管人

4.5.11 基金管理人及基金托管人
4.5.12 基金管理人及基金托管人

4.5.13 基金管理人及基金托管人
4.5.14 基金管理人及基金托管人

4.5.15 基金管理人及基金托管人
4.5.16 基金管理人及基金托管人

4.5.17 基金管理人及基金托管人
4.5.18 基金管理人及基金托管人

4.5.19 基金管理人及基金托管人
4.5.20 基金管理人及基金托管人

4.5.21 基金管理人及基金托管人
4.5.22 基金管理人及基金托管人

4.5.23 基金管理人及基金托管人
4.5.24 基金管理人及基金托管人

4.5.25 基金管理人及基金托管人
4.5.26 基金管理人及基金托管人

4.5.27 基金管理人及基金托管人
4.5.28 基金管理人及基金托管人

4.5.29 基金管理人及基金托管人
4.5.30 基金管理人及基金托管人

4.5.31 基金管理人及基金托管人
4.5.32 基金管理人及基金托管人

4.5.33 基金管理人及基金托管人
4.5.34 基金管理人及基金托管人

4.5.35 基金管理人及基金托管人
4.5.36 基金管理人及基金托管人

4.5.37 基金管理人及基金托管人
4.5.38 基金管理人及基金托管人

4.5.39 基金管理人及基金托管人
4.5.40 基金管理人及基金托管人

4.5.41 基金管理人及基金托管人
4.5.42 基金管理人及基金托管人

审计报告标题
审计报告

审计报告收件人
中融增鑫一年定期开放债券型证券投资基金全体基金份额持有人

审计意见
(一)我们审计的内容包括中融增鑫一年定期开放债券型证券投资基金(以下简称“中融增鑫”)的财务报表,包括 2017 年 12 月 31 日的资产负债表,2017 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。(二)我们的意见是我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和财务报表附注中列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)和中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,公允反映了中融增鑫 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年度的经营成果和基金净值变动情况。

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。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。按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于中融增鑫一年定期开放债券基金,并履行了职业道德方面的其他责任。

强调事项
无

其他事项
无

其他信息
无

管理层和治理层对财务报表的责任
中融增鑫一年定期开放债券型证券投资基金的基金管理人中融基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)负责按照企业会计准则、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露管理办法》和中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,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,基金管理人负责评估中融增鑫一年定期开放债券基金持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算中融增鑫一年定期开放债券基金、终止运营或别无其他现实的选择。基金管理人治理层负责监督中融增鑫一年定期开放债券基金的财务报告过程。

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,但并不能按照按照审计准则的规定对审计对象的所有重大错报获取绝对保证。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,我们将被认定为重大错报。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,我们也运用职业判断,对财务报表中高风险领域,设计并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,为发表审计意见提供基础。由于舞弊可能涉及隐瞒、伪造、篡改或遗漏信息,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。(二)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。(三)评价基金管理人治理层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。(四)基金管理人治理层负责获取或设计恰当的假设以支持其结论。同时,根据获取的审计证据,就可能对财务报表产生重大影响的舞弊或错报,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,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,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增鑫一年定期开放债券基金不再持续经营。在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。我们与基金管理人治理层计划的审计范围、时间和范围进行沟通和协商,包括我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

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,但并不能按照按照审计准则的规定对审计对象的所有重大错报获取绝对保证。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,我们将被认定为重大错报。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,我们也运用职业判断,对财务报表中高风险领域,设计并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,为发表审计意见提供基础。由于舞弊可能涉及隐瞒、伪造、篡改或遗漏信息,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。(二)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。(三)评价基金管理人治理层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。(四)基金管理人治理层负责获取或设计恰当的假设以支持其结论。同时,根据获取的审计证据,就可能对财务报表产生重大影响的舞弊或错报,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,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,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增鑫一年定期开放债券基金不再持续经营。在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。我们与基金管理人治理层计划的审计范围、时间和范围进行沟通和协商,包括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
普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)

注册会计师的姓名
薛莹 张勇

会计师事务所的地址
上海市湖滨路 202 号金天地 2 号楼普华永道中心 11 楼

审计报告日期
2017-03-22

87 年度财务报表
资产负债表
会计主体:中融增鑫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

Table with 5 columns: 资产, 附注号, 本期末 2017 年 12 月 31 日, 上年末 2016 年 12 月 31 日. Rows include 货币资金, 结算备付金, 存出保证金, 交易性金融资产, 其中:股票投资, 债券投资, 资产支持证券投资, 贵金属投资, 衍生金融资产, 买入返售金融资产, 应收清算款项, 应收股利, 应收申购款, 其他资产, 资产总计, 负债和所有者权益.

7.4 关联方关系
7.4.1 关联方名称
7.4.2 关联方关系

7.4.3 关联方关系
7.4.4 关联方关系

7.4.5 关联方关系
7.4.6 关联方关系

7.4.7 关联方关系
7.4.8 关联方关系

7.4.9 关联方关系
7.4.10 关联方关系

7.4.11 关联方关系
7.4.12 关联方关系

7.4.13 关联方关系
7.4.14 关联方关系

7.4.15 关联方关系
7.4.16 关联方关系

报告截止日 2017 年 12 月 31 日,基金份额总额 47,977,346.51 份,其中 A 类基金份额的份数总额为 27,121,512.55 份,份额净值 1.271 元;C 类基金份额的份数总额为 20,855,833.96 份,份额净值 1.252 元。

7.2 利润分配
会计主体:中融增鑫一年定期开放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

单位:人民币元

Table with 5 columns: 项目, 附注号, 本期 2017 年 01 月 01 日至 2017 年 12 月 31 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, 投资收益, 公允价值变动收益, 汇兑收益, 其他收入, 减:二、费用, 管理人报酬, 托管费, 销售服务费, 交易费用, 其他支出, 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, 四、净利润(净亏损)以“-”号填列.

7.3 所有者权益(基金净值)变动表
会计主体:中融增鑫一年定期开放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

单位:人民币元

Table with 5 columns: 项目, 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. Rows include 一、期初所有者权益(基金净值), 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润), 三、本期基金份额变动产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列), 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).

报表附注为财务报表的重要组成部分。
本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署:

王福 代首席 王福 代首席

基金管理人负责人 王福 代首席

王福 代首席

王福 代首席

王福 代首席

王福 代首席

王福 代首席

王福 代首席

王福 代首席

王福 代首席

王福 代首席

王福 代首席

王福 代首席

王福 代首席