

# 中金新安灵活配置混合型证券投资基金 2017 年半年度报告

2017 年 6 月 30 日

基金管理人：中金基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2017 年 8 月 29 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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 28 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 3 月 29 日起至 2017 年 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>6</b>
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	8
2.4 信息披露方式.....	8
2.5 其他相关资料.....	8
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>9</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	9
3.2 基金净值表现.....	9
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>11</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	14
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	15
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	15
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>16</b>
6.1 资产负债表.....	16
6.2 利润表.....	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19

6.4 报表附注.....	20
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>45</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	45
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	45
7.3 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.....	46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	50
7.6 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.....	50
7.7 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.....	51
7.8 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.....	51
7.9 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.....	51
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	51
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	51
7.12 投资组合报告附注.....	52
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>53</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	53
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	53
8.3 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的情况.....	53
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>54</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>55</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	55
10.2 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.....	55
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	55
10.4 基金投资策略的改变.....	55
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	55
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	55
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	55
10.8 其他重大事件.....	57
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>59</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	59

11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	59
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>60</b>
12.1 备查文件目录.....	60
12.2 存放地点.....	60
12.3 查阅方式.....	60

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	中金新安灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	中金新安
基金主代码	004385
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 3 月 29 日
基金管理人	中金基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	377,060,154.94 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在风险可控的前提下，力争实现超越业绩比较基准的稳定收益。
投资策略	<p>本基金的投资策略主要包括大类资产配置策略、固定收益类资产投资策略、权益类资产投资策略以及期货投资策略。</p> <p>（一）大类资产配置策略。</p> <p>本基金将采用“自上而下”的分析方法，综合分析宏观经济周期与形势、货币政策、财政政策、利率走势、资金供求、流动性风险、信用风险等因素，分析比较债券市场、股票市场、及现金类资产的收益风险特征，动态调整各大类资产的投资比例，控制投资组合的系统性风险。</p> <p>（二）固定收益资产投资策略。</p> <p>本基金投资组合在进行固定收益类资产的投资时，主要通过分析宏观经济形势、货币政策、财政政策、债</p>

	<p>券市场券种供求关系及资金供求关系，主动判断市场利率变化趋势，确定和动态调整固定收益类资产的平均久期及债券资产配置。</p> <p>（三）权益类资产投资策略</p> <p>本基金将重点投资于具备内生性增长基础或具备外延式扩张能力的价值创造型企业，并重点关注相关个股的安全边际及绝对收益机会。在股票选择方面，充分发挥“自下而上”的主动选股能力，结合对宏观经济状况、行业成长空间、行业集中度、公司内生性增长动力的判断，结合财务与估值分析，深入挖掘盈利预期稳步上升、成长性发生根本变化且价值低估的上市公司，构建股票投资组合。同时将根据行业、公司状况的变化，基于估值水平的波动，动态优化股票投资组合。</p> <p>（四）期货投资策略</p> <p>本基金的期货策略主要为对冲策略。本基金将以投资组合的避险保值和有效管理为目标，根据风险管理的原则，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，适当参与股指期货的投资。本基金将按照现货头寸和股票特性，使用量化方法剥离并测算整体的市场风险，进而动态调整期货对冲的数量，以达到对冲市场风险。</p>
业绩比较基准	<p>沪深 300 指数收益率×50%+中证全债指数收益率×50%。</p>
风险收益特征	<p>本基金为混合型基金，理论上其预期风险与预期收益水平低于股票型证券投资基金，高于债券型证券投资基金和货币市场基金。</p>

### 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		中金基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杜季柳	田青
	联系电话	010-63211122	010-67595096
	电子邮箱	xxpl@ciccfund.com	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		400-868-1166	010-67595096
传真		010-66159121	010-66275853
注册地址		北京市朝阳区建国门外大街1号国贸写字楼2座26层05室	北京市西城区金融大街25号
办公地址		北京市西城区太平桥大街18号丰融国际中心北楼17层	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼长安兴融中心
邮政编码		100032	100033
法定代表人		林寿康	王洪章

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.ciccfund.com/">http://www.ciccfund.com/</a>
基金半年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中金基金管理有限公司	北京市西城区太平桥大街18号丰融国际中心北楼17层



### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 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	报告期(2017年3月29日 - 2017年6月30日)
本期已实现收益	5,211,647.45
本期利润	7,851,131.70
加权平均基金份额本期利润	0.0190
本期加权平均净值利润率	1.90%
本期基金份额净值增长率	1.90%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)
期末可供分配利润	4,815,324.91
期末可供分配基金份额利润	0.0128
期末基金资产净值	384,233,884.94
期末基金份额净值	1.019
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017年6月30日)
基金份额累计净值增长率	1.90%

注：1、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；

2、本报告所列示的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；

3、期末可供分配利润采用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孰低数；

4、本基金合同生效日为2017年3月29日，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。

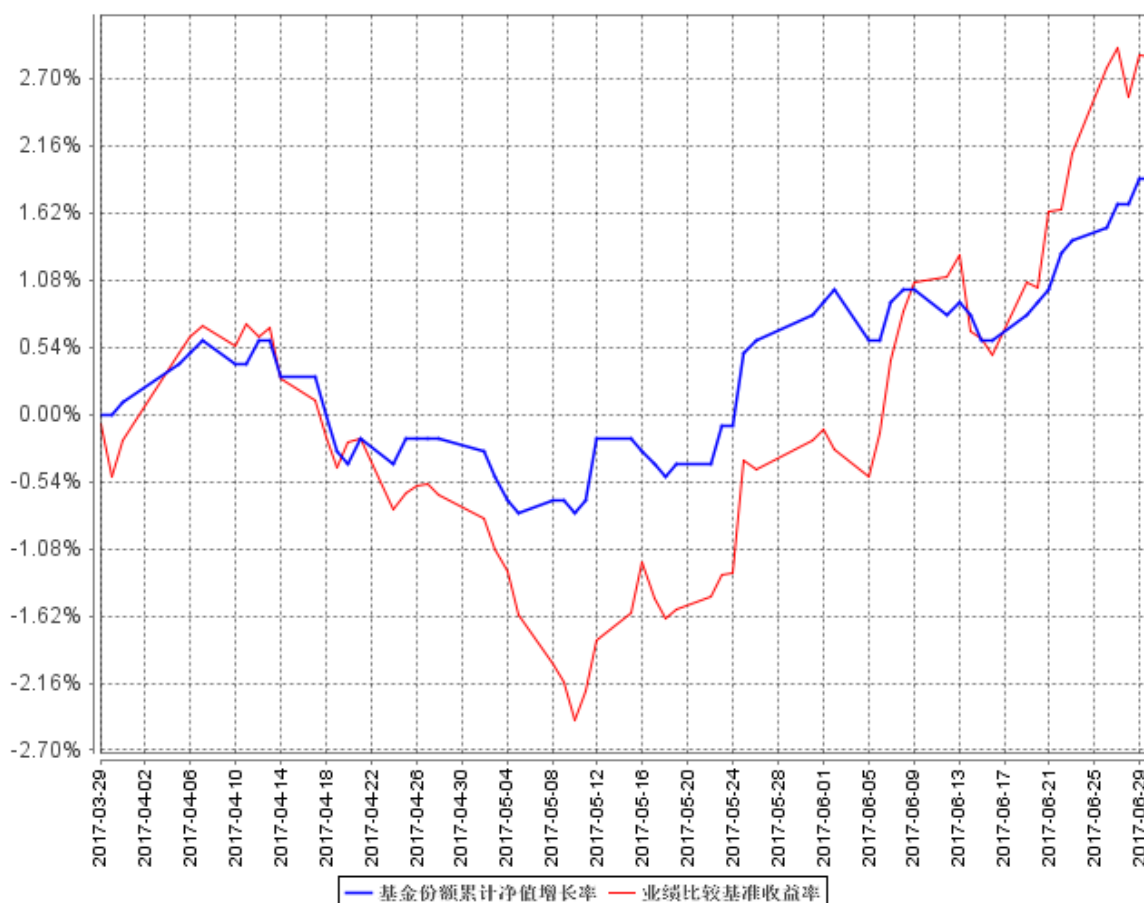
#### 3.2 基金净值表现

### 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

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
过去一个月	1.09%	0.16%	3.09%	0.34%	-2.00%	-0.18%
过去三个月	1.80%	0.19%	3.10%	0.32%	-1.30%	-0.13%
自基金合同生效起至今	1.90%	0.18%	2.88%	0.32%	-0.98%	-0.14%

### 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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金的基金合同生效日为 2017 年 3 月 29 日，按基金合同约定，本基金自基金合同生效日起 6 个月内为建仓期，截至本报告期末，本基金建仓期尚未结束。

## § 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

中金基金管理有限公司（简称“中金基金”、“公司”）成立于 2014 年 2 月，由中国国际金融股份有限公司（简称“中金公司”）作为全资股东出资设立，是证监会批准设立的第 90 家公募基金公司，也是首家通过发起设立方式由单一股东持股的基金公司，注册资本 2.00 亿元人民币。母公司中金公司作为中国第一家中外合资投资银行，致力于为国内外机构及个人客户提供高品质的金融服务。中金基金注册地址为北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸写字楼 2 座 26 层 05 室，办公地址为北京市西城区太平桥大街 18 号丰融国际中心北楼 17 层。

截至 2017 年 6 月 30 日，公司旗下管理 10 支开放式基金——中金现金管家货币市场基金、中金纯债债券型证券投资基金、中金绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金、中金消费升级股票型证券投资基金、中金沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金、中金中证 500 指数增强型发起式证券投资基金、中金量化多策略灵活配置混合型证券投资基金、中金金利债券型证券投资基金、中金新安灵活配置混合型证券投资基金和中金丰沃灵活配置混合型证券投资基金，证券投资基金管理规模 52.62 亿。

#### 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		
郭党钰	中金新安基金经理	2017 年 3 月 29 日	-	14	郭党钰先生，工商管理硕士。历任宁波镇海炼化投资经理；华泰证券项目经理；德恒证券高级经理；华策投资有限公司投资副总经理；招商基金管理有限公司投资经理。现任中金基金管理有限公司投资

					管理部执行总经理。
--	--	--	--	--	-----------

注：1、任职日期说明：任职日期为基金合同生效日

2、证券从业年限的计算标准：证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定

3、本基金无基金经理助理

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司开展投资、研究活动防控内幕交易指导意见》、基金合同和其他法律法规，本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有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 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一直坚持公平对待旗下所有投资组合，严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，规范投资、研究和交易等各相关流程，通过系统控制和人工监控等方式在各环节严格控制，确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。

本报告期内，本基金运作符合法律法规和公司公平交易制度的规定。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

本报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未超过该证券当日成交量的 5%。

## 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

本基金成立于 3 月底，第二季度正式开始运作。

债券投资部分，判断债券市场二季度的表现相对谨慎，从为组合带来相对确定的投资回报角度考虑，本基金的债券投资主要集中在短久期信用债及满足流动性要求的利率债。

权益投资部分，从稳健的角度，投资集中在估值较低的银行股和部分公共事业股票，由于受 4 月中旬金融行业监管政策的频繁出台影响，略有波动，之后呈现稳步恢复的态势，整体看，取得了正收益，和我们最初策略的预期相符。

本基金权益投资方面的策略以稳健收益为主，选股更加注重低估值和确定性，因此会持续聚焦于盈利的确定性高且估值低于长期均衡水平的行业及个股。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.019 元；本报告期基金份额净值增长率为 1.90%，业绩比较基准收益率为 2.88%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，二季度 PPI 已经出现阶段性高点，CPI 回落，但 PMI 好于预期，汽车销售和地产有所恢复，上游行业产品价格维持景气，经济呈现稳定的态势。

中期来看，货币政策在中性基调下预计维持适度灵活，而房地产、基建投资的持续性及对相关产业链影响需要持续跟踪评估。第二，从上市公司中报预告看，上游和部分中游制造业、下游消费行业公司盈利同比增速较高，能够带来市场情绪的修复。第三，在全球经济复苏、各国宽松货币政策缓慢退出的预期下，企业盈利增长和估值的匹配度将成为投资者更加关注的因素。

策略上，股票方面，我们继续维持低估值行业个股，集中度方面会根据市场变化略有调整分散。债券方面，我们继续维持低久期投资策略，争取为组合带来确定性较强的固收投资回报。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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，委员由公司总经理、分管运营领导、研究部、基金运营部、风险管理部、监察稽核部等相关人员组成，负责研究、指导基金估值业务。基金管理人估值委员会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。本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司、中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定提供债券品种

的估值数据。

#### **4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的规定以及本基金基金合同对基金利润分配原则的约定，本报告期内未实施利润分配。

#### **4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明**

本基金本报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

## § 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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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基金托管人应尽的义务。

### 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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：中金新安灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	7,333,815.61	-
结算备付金		609,549.60	-
存出保证金		35,028.23	-
交易性金融资产	6.4.7.2	417,285,449.59	-
其中：股票投资		124,352,541.29	-
基金投资		-	-
债券投资		292,932,908.30	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	14,000,000.00	-
应收证券清算款		262,216.74	-
应收利息	6.4.7.5	5,190,427.97	-
应收股利		-	-
应收申购款		311,133.21	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		445,027,620.95	-
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2017 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2016 年 12 月 31 日</b>



<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		55,949,382.06	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		4,282,266.67	-
应付管理人报酬		233,930.11	-
应付托管费		50,127.89	-
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	156,378.93	-
应交税费		-	-
应付利息		9,691.83	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	111,958.52	-
负债合计		60,793,736.01	-
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	377,060,154.94	-
未分配利润	6.4.7.10	7,173,730.00	-
所有者权益合计		384,233,884.94	-
负债和所有者权益总计		445,027,620.95	-

注：1、报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.019 元，基金份额总额 377,060,154.94 份。

2、本基金合同生效日为 2017 年 3 月 29 日，无上年度可比期间数据。

## 6.2 利润表

会计主体：中金新安灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 3 月 29 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2017年3月29日(基 金合同生效日)至 2017年6月30日	上年度可比期间 2016年1月1日至 2016年6月30日
<b>一、收入</b>		9,192,738.44	-
1.利息收入		3,351,415.96	-
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,285,454.68	-
债券利息收入		1,820,152.64	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		245,808.64	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		2,873,032.11	-
其中：股票投资收益	6.4.7.12	2,643,463.44	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-81,003.73	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	310,572.40	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	2,639,484.25	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	328,806.12	-
<b>减：二、费用</b>		1,341,606.74	-
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	739,901.00	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	158,550.23	-
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	207,148.15	-

5. 利息支出		127,555.09	-
其中：卖出回购金融资产支出		127,555.09	-
6. 其他费用	6.4.7.19	108,452.27	-
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		7,851,131.70	-
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		7,851,131.70	-

注：本基金合同生效日为 2017 年 3 月 29 日，无上年度可比期间数据。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中金新安灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 3 月 29 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 3 月 29 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、基金合同生效日所有者权益（基金净值）	412,253,948.92	-	412,253,948.92
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	7,851,131.70	7,851,131.70
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）	-35,193,793.98	-677,401.70	-35,871,195.68
其中：1.基金申购款	54,598,732.75	-190,962.17	54,407,770.58
2.基金赎回款	-89,792,526.73	-486,439.53	-90,278,966.26

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）	377,060,154.94	7,173,730.00	384,233,884.94

注：本基金合同生效日为 2017 年 3 月 29 日，无上年度可比期间数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>          孙菁          </u>	<u>          杜季柳          </u>	<u>          白娜          </u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

以下简称“中国证监会”）于 2015 年 7 月 6 日证监许可[2015]1516 号《关于准予中金新安灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》核准募集，由中金基金管理有限公司（以下简称“中金基金”）依照《中华人民共和国证券投资基金法》及配套规则和《中金新安灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》和《中金新安灵活配置混合型证券投资基金份额发售公告》公开募集。本基金为契约型开放式基金，存续期限为不定期。本基金的管理人为中金基金，托管人为中国建设银行股份有限公司北京复兴支行（以下简称“建设银行”）。

本基金自 2017 年 3 月 20 日至 2017 年 3 月 27 日止期间公开发售。经向中国证监会备案，《中金新安灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 3 月 29 日正式生效，合同生效日基金实收份额为 412,253,948.92 份，发行价格为人民币 1.00 元。该资金已由毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）审验并出具验资报告。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、可转债（含可分离交易可转换债券）、次级债、短期融资券、中期票据等）、债券回购、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

## 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础。本财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则的要求，同时亦按照中国证监会颁布的同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

## 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2017 年 6 月 30 日的财务状况、自 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

## 6.4.4 重要会计政策和会计估计

### 6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本财务报表的实际编制期间为 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日。

### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币，编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

本基金在初始确认时按取得资产或承担负债的目的，把金融资产和金融负债分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债、应收款项、持有至到期投资、可供出售金融资产和其他金融负债。本基金现无金融资产分类为持有至到期投资和可供出售金融资产。本基金现无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

本基金目前持有投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

#### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

初始确认后，金融资产和金融负债的后续计量如下：

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债以公允价值计量，公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益。

应收款项以实际利率法按摊余成本计量。

除以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债以外的金融负债采用实际利率法按摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产的现金流量的合同权利终止或将所有权上几乎所有的风险和报酬转移时，本基金终止确认该金融资产。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

- (1) 所转移金融资产的账面价值；
- (2) 因转移而收到的对价。

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，本基金终止确认该金融负债或其一部分。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本基金估计公允价值时，考虑市场参与者在计量日对相关资产或负债进行定价时考虑的特征（包括资产状况及所在位置、对资产出售或者使用的限制等），并采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术。

存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调

整最近交易市价以确定公允价值。

当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- (1) 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；
- (2) 本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量，并于会计期末全额转入“未分配利润 / (累计亏损) ”。

#### 6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资收益、债券投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其成本的

差额确认。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税（如适用）后的净额确认。

债券利息收入按债券投资的票面价值与票面利率计算的金额扣除应由发行债券的企业代扣代缴的个人所得税（如适用）后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，逐日计提利息收入。如票面利率与实际利率出现重大差异，按实际利率计算利息收入。

存款利息收入按每日存款余额与适用的利率逐日计提。

买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额，在回购期内按实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的收入差异较小的可采用直线法。

公允价值变动收益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产、衍生金融资产、以公允价值计量且变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。

#### **6.4.4.10 费用的确认和计量**

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

本基金的交易费用用于进行股票、债券、权证等交易发生时按照确定的金额确认。

卖出回购金融资产利息支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额，在回购期内以实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的支出差异较小的可采用直线法。

本基金的其他费用如不影响估值日基金份额净值小数点后第四位，发生时直接计入基金损益；如果影响基金份额净值小数点后第四位的，应采用待摊或预提的方法，待摊或预提计入基金损益。

#### **6.4.4.11 基金的收益分配政策**

在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每份基金份额每次收益分配比例不得低于收益分配基准日该次单位可供分配利润的 10%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；本基金收益分配方式为现金分红；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；每一基金份额享有同等分配权；基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资人自行承担。当投资人的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基



金登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为基金份额。

#### 6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，本基金根据中国证监会公告 [2008] 38 号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会计字 [2007] 21 号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易所交易天数占锁定期内总交易所交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》（以下简称“估值处理标准”），在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

无

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

无

### 6.4.5.3 差错更正的说明

无

### 6.4.6 税项

根据财税字 [1998] 55 号文《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收问题的通知》、财税 [2002] 128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税 [2004] 78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税 [2012] 85 号文《财政部、国家税务总局、证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税 [2015] 101 号《财政部、国家税务总局、证监会关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税 [2005] 103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字 [2008] 16 号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税 [2008] 1 号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税 [2016] 36 号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税 [2016] 140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税 [2017] 2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税 [2015] 125 号文《关于内地与香港基金互认有关税收政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金，不属于营业税征收范围，不征收营业税。

(2) 证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入暂免征收营业税和企业所得税。

(3) 自 2016 年 5 月 1 日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税（以下称营改增）试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券收入免征增值税。

2018 年 1 月 1 日（含）以后，资管产品管理人（以下称管理人）运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下称资管产品运营业务），以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。管理人接受投资者委托以及管理人发生的除资管产品运营业务以外的其他增值税应税行为（以下称其他业务），按照现行规定缴纳增值税。管理人应分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额，未分别核算的，资管产品运营业务不得适用于简易计税方法。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。因

此，截至 2017 年 6 月 30 日，本基金没有计提有关增值税费用。

(4) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(5) 对基金取得的股票的股息、红利收入，债券的利息收入，由上市公司、发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，股权登记日为自 2013 年 1 月 1 日起至 2015 年 9 月 7 日期间的，暂减按 25% 计入应纳税所得额，股权登记日在 2015 年 9 月 8 日及以后的，暂免征收个人所得税。

(6) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(7) 对投资者（包括个人和机构投资者）从基金分配中取得的收入，暂不征收个人所得税和企业所得税。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
活期存款	7,333,815.61
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	7,333,815.61

注：本基金合同生效日为 2017 年 3 月 29 日，无上年度可比期间数据。

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
----	------------------------

		成本	公允价值	公允价值变动
股票		122,338,508.14	124,352,541.29	2,014,033.15
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	21,722,593.37	21,727,908.30	5,314.93
	银行间市场	270,584,863.83	271,205,000.00	620,136.17
	合计	292,307,457.20	292,932,908.30	625,451.10
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		414,645,965.34	417,285,449.59	2,639,484.25

注：本基金合同生效日为 2017 年 3 月 29 日，无上年度可比期间数据。

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券	14,000,000.00	-
合计	14,000,000.00	-

注：本基金合同生效日为 2017 年 3 月 29 日，无上年度可比期间数据。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2017 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	1,476.53
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	274.30
应收债券利息	5,193,954.49
应收买入返售证券利息	-5,293.15
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	15.80
合计	5,190,427.97

注：本基金合同生效日为 2017 年 3 月 29 日，无上年度可比期间数据。

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	145,867.07
银行间市场应付交易费用	10,511.86
合计	156,378.93

注：本基金合同生效日为 2017 年 3 月 29 日，无上年度可比期间数据。

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	10,519.36

预提费用	101,439.16
合计	111,958.52

注：本基金合同生效日为 2017 年 3 月 29 日，无上年度可比期间数据。

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017 年 3 月 29 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	412,253,948.92	412,253,948.92
本期申购	54,598,732.75	54,598,732.75
本期赎回(以“-”号填列)	-89,792,526.73	-89,792,526.73
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	377,060,154.94	377,060,154.94

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	5,211,647.45	2,639,484.25	7,851,131.70
本期基金份额交易产生的变动数	-396,322.54	-281,079.16	-677,401.70
其中：基金申购款	379,184.47	-570,146.64	-190,962.17
基金赎回款	-775,507.01	289,067.48	-486,439.53
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,815,324.91	2,358,405.09	7,173,730.00

**6.4.7.11 存款利息收入**

单位：人民币元

项目	本期 2017年3月29日(基金合同生效日)至2017年6月30日
活期存款利息收入	27,094.54
定期存款利息收入	1,254,194.44
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	4,068.94
其他	96.76
合计	1,285,454.68

注：本基金合同生效日为2017年3月29日，无上年度可比期间数据。

**6.4.7.12 股票投资收益****6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2017年3月29日(基金合同生效日)至2017年6月30日
卖出股票成交总额	40,281,657.39
减：卖出股票成本总额	37,638,193.95
买卖股票差价收入	2,643,463.44

注：本基金合同生效日为2017年3月29日，无上年度可比期间数据。

**6.4.7.13 债券投资收益****6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2017年3月29日(基金合同生效日)至2017年6月30日
----	--------------------------------------

债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-81,003.73
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	-81,003.73

注：本基金合同生效日为 2017 年 3 月 29 日，无上年度可比期间数据。

#### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年3月29日(基金合同生效日)至2017年 6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	45,848,769.19
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	44,742,003.73
减：应收利息总额	1,187,769.19
买卖债券差价收入	-81,003.73

注：本基金合同生效日为 2017 年 3 月 29 日，无上年度可比期间数据。

#### 6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无赎回差价收入。

#### 6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无申购差价收入。

#### 6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

##### 6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无买卖权证差价收入。



**6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益**

本基金本报告期无其他衍生工具投资收益。

**6.4.7.15 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2017年3月29日(基金合同生效日)至2017年6月30日
股票投资产生的股利收益	310,572.40
基金投资产生的股利收益	-
合计	310,572.40

注：本基金合同生效日为2017年3月29日，无上年度可比期间数据。

**6.4.7.16 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2017年3月29日(基金合同生效日)至2017年6月30日
1. 交易性金融资产	2,639,484.25
——股票投资	2,014,033.15
——债券投资	625,451.10
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	2,639,484.25

注：本基金合同生效日为2017年3月29日，无上年度可比期间数据。

**6.4.7.17 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 3 月 29 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	328,806.12
合计	328,806.12

注：本基金合同生效日为 2017 年 3 月 29 日，无上年度可比期间数据。

#### 6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 3 月 29 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	203,898.15
银行间市场交易费用	3,250.00
合计	207,148.15

注：本基金合同生效日为 2017 年 3 月 29 日，无上年度可比期间数据。

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 3 月 29 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日
审计费用	20,288.02
信息披露费	81,151.14
其他	400.00
帐户维护费	360.00
汇划手续费	6,253.11
合计	108,452.27

注：本基金合同生效日为 2017 年 3 月 29 日，无上年度可比期间数据。

## 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的资产负债表日后事项。

## 6.4.9 关联方关系

### 6.4.9.1 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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中金基金	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
建设银行	基金托管人、基金销售机构
中金公司	基金管理人的股东、基金销售机构

注：1、本基金本报告期关联方未发生变化。

2、以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。

#### 6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

#### 6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

**6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金**

本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

**6.4.10.2 关联方报酬****6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期
	2017年3月29日(基金合同生效日)至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	739,901.00
其中：支付销售机构的客户维护费	197,756.93

注：1、支付基金管理人中金基金管理有限公司的基本管理费按前一日基金资产净值 0.70%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基本管理费=前一日基金资产净值×0.70%/当年天数；

2、根据《开放式证券投资基金销售费用管理规定》，本基金本报告期销售服务机构的客户维护费为 197,756.93 元。；

3、本基金合同生效日为 2017 年 3 月 29 日，无上年度可比期间数据。

**6.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期
	2017年3月29日(基金合同生效日)至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	158,550.23

注：1、支付基金托管人建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.15%的年费率计提，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×0.15%/当年天数。

2、本基金合同生效日为 2017 年 3 月 29 日，无上年度可比期间数据。

**6.4.10.2.3 销售服务费**

基金本报告期无销售服务费。

**6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

**6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况****6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

本报告期内，基金管理人未运用固有资金投资本基金。

**6.4.10.4.2 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**

本报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

**6.4.10.5 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3月29日(基金合同生效日)至2017年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
建设银行	7,333,815.61	27,094.54

注：1、本基金的银行存款由基金托管人建设银行保管，按银行同业利率或约定利率计息。

2、本基金通过“建设银行基金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的结算备付金和存出保证金，于2017年6月30日的相关余额为人民币644,577.83元，本期间产生的利息收入为人民币4,165.70元。

3、本基金合同生效日为2017年3月29日，无上年度可比期间数据。

**6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金本报告期末在承销期内参与认购关联方承销的证券。

**6.4.10.7 其他关联交易事项的说明**

无

**6.4.11 利润分配情况**

本基金本报告期内未实施利润分配。

**6.4.12 期末（2017年6月30日）本基金持有的流通受限证券****6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票
----------------------

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002879	长缆科技	2017年6月5日	2017年7月7日	新股流通受限	18.02	18.02	1,313	23,660.26	23,660.26	-
002882	金龙羽	2017年6月15日	2017年7月17日	新股流通受限	6.20	6.20	2,966	18,389.20	18,389.20	-
603933	睿能科技	2017年6月28日	2017年7月6日	新股流通受限	20.20	20.20	857	17,311.40	17,311.40	-
603305	旭升股份	2017年6月30日	2017年7月10日	新股流通受限	11.26	11.26	1,351	15,212.26	15,212.26	-
300670	大烨智能	2017年6月26日	2017年7月3日	新股流通受限	10.93	10.93	1,259	13,760.87	13,760.87	-
300672	国科微	2017年6月30日	2017年7月12日	新股流通受限	8.48	8.48	1,257	10,659.36	10,659.36	-
603331	百达精工	2017年6月27日	2017年7月5日	新股流通受限	9.63	9.63	999	9,620.37	9,620.37	-
300671	富满电子	2017年6月27日	2017年7月5日	新股流通受限	8.11	8.11	942	7,639.62	7,639.62	-
603617	君禾股份	2017年6月23日	2017年7月	新股流通受限	8.93	8.93	832	7,429.76	7,429.76	-

		日	3 日						
--	--	---	-----	--	--	--	--	--	--

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 6 月 30 日，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人民币 55,949,382.06 元，其中卖出回购证券款人民币 25,989,667.00 元于 2017 年 7 月 3 日到期，剩余部分于 2017 年 7 月 7 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的银行间市场交易的债券和 / 或在新质押式回购下转入质押库的债券，按银行间市场规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 6 月 30 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为 0，无抵押债券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金，其预期风险与预期收益水平低于股票型证券投资基金，高于债券型证券投资基金和货币市场基金。

本基金的基金管理人风险管理的目标为在有效控制风险的前提下，实现基金份额持有人利益最大化；建立并完善风险控制体系，实现从公司决策、执行到监督的有效运作，从而将各种风险控制控制在合理水平，保障业务稳健运行。

本基金管理人建立科学严密的风险管理体系和职责清晰的五道内部控制防线，采用“自上而下”和“自下而上”相结合的方式进行风险管理。“自上而下”是指通过董事会、风控与合规委员会、公司下设的风险管理委员会和风险管理部、各业务部门以及每个业务环节和岗位自上而下形成的风险管理和监督体系。“自下而上”是指每个业务环节和岗位，各业务部门以及风险管理部对

相关风险进行监控并逐级上报从而形成的风险控制和反馈体系。通过这种上下结合的风险控制体系，实现风险控制的有效性和全面性。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程发生交收违约，或者基金所投资的债券发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金持有一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%。除通过上述投资限定控制相应信用风险外，本基金管理人通过信用分析团队建立了内部评级体系和交易对手库，对发行人及债券投资进行内部评级，对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能出现的信用风险。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	220,542,000.00	-
合计	220,542,000.00	-

注：以上按短期信用评级列示的债券投资中不包含国债、政策性金融债及央行票据等。

##### 6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	50,729,653.40	-
未评级	-	-
合计	50,729,653.40	-

注：以上按长期信用评级列示的债券投资中不包含国债、政策性金融债及央行票据等。



### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险指基金投资组合的证券会因为各种原因使交易的执行难度提高，买入成本或变现成本增加。本基金的流动性风险主要来自两个方面：一是基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，二是基金投资品种所处的交易市场不活跃而造成变现困难。本基金保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，以备支付基金份额持有人的赎回款项。此外，本基金亦可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求。本基金所投资的证券在证券交易所或银行间市场交易，除在“期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制的情况外，其余均能及时变现。

### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指证券市场中各种证券的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动，导致基金收益的不确定性。包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

#### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指由于市场利率变动导致金融工具的公允价值或现金流量发生波动，由此带来基金收益的不确定性。利率敏感性金融工具面临因市场利率上升而导致公允价值下降的风险。市场利率的变化还将带来票息的再投资风险，对基金的收益造成影响。本基金管理人在利率风险管理方面，定期监控本基金面临的利率风险敞口，并通过调整基金投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	7,333,815.61	-	-	-	7,333,815.61
结算备付金	609,549.60	-	-	-	609,549.60
存出保证金	35,028.23	-	-	-	35,028.23
交易性金融资产-股票 投资	-	-	-	124,352,541.29	124,352,541.29
交易性金融资产-债券 投资	292,932,908.30	-	-	-	292,932,908.30

买入返售金融资产	14,000,000.00	-	-	-	14,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	262,216.74	262,216.74
应收利息	-	-	-	5,190,427.97	5,190,427.97
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	311,133.21	311,133.21
资产总计	314,911,301.74	-	-	130,116,319.21	445,027,620.95
负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	55,949,382.06	-	-	-	55,949,382.06
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	4,282,266.67	4,282,266.67
应付管理人报酬	-	-	-	233,930.11	233,930.11
应付托管费	-	-	-	50,127.89	50,127.89
应付交易费用	-	-	-	156,378.93	156,378.93
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	9,691.83	9,691.83
其他负债	-	-	-	111,958.52	111,958.52
负债总计	55,949,382.06	-	-	4,844,353.95	60,793,736.01
利率敏感度缺口	258,961,919.68	-	-	125,271,965.26	384,233,884.94
上年度末 2016 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
负债					

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	该利率敏感性分析数据结果为基于本基金报表日组合持有固定收益类资产的利率风险状况测算的理论变动值对基金资产净值的影响金额。
	假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他市场变量均不发生变化。
	此项影响并未考虑基金经理为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2017年6月30日）	上年度末（2016年12月31日）
	市场利率下降 25 个基点	199,534.45	-
	市场利率上升 25 个基点	-199,534.45	

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金面临的其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金部分投资于证券交易所上市的股票，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日		上年度末 2016年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产—股票投资	124,352,541.29	32.36	-	-
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	292,932,908.30	76.24	-	-
交易性金融资产—贵金属投	-	-	-	-

资				
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	417,285,449.59	108.60	-	-

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

本期末本基金成立未满一年，尚无足够经验数据。

#### 6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

本基金未采用风险价值法或类似方法进行分析、管理市场风险。

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 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	124,352,541.29	27.94
	其中：股票	124,352,541.29	27.94
2	固定收益投资	292,932,908.30	65.82
	其中：债券	292,932,908.30	65.82
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	14,000,000.00	3.15
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	7,943,365.21	1.78
7	其他各项资产	5,798,806.15	1.30
8	合计	445,027,620.95	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 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

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	5,202,898.44	1.35
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	23,838,560.09	6.20
E	建筑业	-	-

F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,639.62	0.00
J	金融业	95,303,443.14	24.80
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	124,352,541.29	32.36

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票资产。

### 7.3 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	000001	平安银行	4,196,897	39,408,862.83	10.26
2	601288	农业银行	7,087,633	24,948,468.16	6.49
3	601328	交通银行	1,664,500	10,253,320.00	2.67
4	000543	皖能电力	1,642,162	9,573,804.46	2.49

5	600000	浦发银行	737,366	9,327,679.90	2.43
6	000539	粤电力A	1,554,189	8,283,827.37	2.16
7	601818	光大银行	2,015,500	8,162,775.00	2.12
8	600900	长江电力	388,877	5,980,928.26	1.56
9	601398	工商银行	609,969	3,202,337.25	0.83
10	000858	五粮液	44,100	2,454,606.00	0.64
11	000651	格力电器	32,000	1,317,440.00	0.34
12	000333	美的集团	23,400	1,007,136.00	0.26
13	002880	卫光生物	998	75,548.60	0.02
14	603801	志邦股份	1,406	47,522.80	0.01
15	603043	广州酒家	1,810	45,738.70	0.01
16	300666	江丰电子	2,276	43,448.84	0.01
17	603335	迪生力	2,230	24,864.50	0.01
18	002879	长缆科技	1,313	23,660.26	0.01
19	603679	华体科技	809	21,438.50	0.01
20	603938	三孚股份	1,246	20,932.80	0.01
21	002882	金龙羽	2,966	18,389.20	0.00
22	603933	睿能科技	857	17,311.40	0.00
23	603305	旭升股份	1,351	15,212.26	0.00
24	300669	沪宁股份	841	14,650.22	0.00
25	300670	大烨智能	1,259	13,760.87	0.00
26	603286	日盈电子	890	13,528.00	0.00
27	300672	国科微	1,257	10,659.36	0.00
28	603331	百达精工	999	9,620.37	0.00
29	300671	富满电子	942	7,639.62	0.00
30	603617	君禾股份	832	7,429.76	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	000001	平安银行	40,706,178.00	10.59
2	601288	农业银行	24,769,548.00	6.45
3	000543	皖能电力	17,277,245.32	4.50
4	000539	粤电力A	12,389,301.48	3.22
5	600000	浦发银行	11,132,356.90	2.90
6	601328	交通银行	10,391,094.03	2.70
7	601818	光大银行	8,268,784.00	2.15
8	600900	长江电力	8,267,790.00	2.15
9	000600	建投能源	8,247,272.73	2.15
10	601398	工商银行	4,134,328.00	1.08
11	601006	大秦铁路	4,125,492.00	1.07
12	000625	长安汽车	2,957,199.00	0.77
13	000858	五粮液	2,377,189.00	0.62
14	002027	分众传媒	2,091,699.55	0.54
15	000651	格力电器	1,204,732.29	0.31
16	000333	美的集团	839,362.00	0.22
17	601878	浙商证券	93,364.05	0.02
18	603980	吉华集团	59,322.80	0.02
19	300660	江苏雷利	47,479.74	0.01
20	002872	天圣制药	44,807.11	0.01

### 7.4.2 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

金额单位：人民币元



序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	000600	建投能源	9,649,427.70	2.51
2	000543	皖能电力	4,678,878.39	1.22
3	601006	大秦铁路	4,612,212.08	1.20
4	000539	粤电力A	4,146,118.34	1.08
5	600900	长江电力	3,405,642.59	0.89
6	000625	长安汽车	3,030,678.00	0.79
7	000001	平安银行	2,596,078.17	0.68
8	002027	分众传媒	2,182,209.11	0.57
9	600000	浦发银行	2,123,151.88	0.55
10	601398	工商银行	1,279,770.44	0.33
11	601288	农业银行	1,275,074.52	0.33
12	601878	浙商证券	183,855.36	0.05
13	603980	吉华集团	107,712.27	0.03
14	300660	江苏雷利	93,858.44	0.02
15	002872	天圣制药	91,757.43	0.02
16	603197	保隆科技	57,950.86	0.02
17	603855	华荣股份	55,678.48	0.01
18	002875	安奈儿	48,867.60	0.01
19	300658	延江股份	48,828.90	0.01
20	603767	中马传动	45,017.70	0.01

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	159,976,702.09
卖出股票收入（成交）总额	40,281,657.39

注：7.4.1 项“买入金额”、7.4.2 项“卖出金额”及 7.4.3 项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买入或卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

## 7.5 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	21,661,254.90	5.64
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	66,653.40	0.02
5	企业短期融资券	220,542,000.00	57.40
6	中期票据	50,663,000.00	13.19
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	292,932,908.30	76.24

## 7.6 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	101452017	14 紫江集 MTN001	200,000	20,262,000.00	5.27
2	1282318	12 滨化股 MTN1	200,000	20,232,000.00	5.27
3	011760061	17 洋丰 SCP001	200,000	20,098,000.00	5.23
4	011698612	16 中电熊猫 SCP001	200,000	20,084,000.00	5.23

5	011698711	16 兖州煤业 SCP006	200,000	20,072,000.00	5.22
5	011698874	16 沪华信 SCP004	200,000	20,072,000.00	5.22

### 7.7 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。

### 7.8 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。

### 7.9 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。

### 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

#### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

#### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1

本基金投资的前十名证券的发行主体本期未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。

### 7.12.2

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。

### 7.12.3 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	35,028.23
2	应收证券清算款	262,216.74
3	应收股利	-
4	应收利息	5,190,427.97
5	应收申购款	311,133.21
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,798,806.15

### 7.12.4 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。

### 7.12.5 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不存在流通受限的情况。

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
3,077	122,541.49	89,177,591.89	23.65%	287,882,563.05	76.35%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	23,302.79	0.0062%

### 8.3 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的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2017年3月29日）基金份额总额	412,253,948.92
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	54,598,732.75
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	89,792,526.73
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	377,060,154.94

注：报告期期间基金总申购份额含转换入份额；基金总赎回份额含转换出份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 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

本基金本报告期内，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 10.3 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。

### 10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金的审计机构为毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙），该审计机构自基金合同生效日起向本基金提供审计服务，无改聘情况。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人、托管人及其高级管理人员在本报告期内未受到任何稽查或处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 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	佣金	占当期佣金 总量的比例	

			例			
中投证券	2	154,329,044.50	77.37%	112,861.70	77.37%	-
方正证券	1	26,976,086.38	13.52%	19,727.75	13.52%	-
民族证券	1	18,156,098.81	9.10%	13,277.62	9.10%	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源证 券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
中金	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-

注：1、本基金管理人负责选择证券经营机构，租用其交易单元作为本基金的交易单元。基金交易单元的选择标准如下：

- (1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- (2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- (3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面的向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析报告及丰富全面的信息服务；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

2、基金交易单元的选择程序如下：

- (1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构。
- (2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

### 10.7.2 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
------	------	--------	------



	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
中投证券	27,973,673.25	49.57%	232,900,000.00	44.49%	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
民族证券	28,461,036.84	50.43%	290,600,000.00	55.51%	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源证 券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中金	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中金新安灵活配置混合型证券投资 基金基金合同生效公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2017年3月30日
2	中金基金管理有限公司关于中金 新安灵活配置混合型证券投资基 金开展赎回费率优惠的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2017年4月26日
3	关于中金新安灵活配置混合型证 券投资基金开放日常申购、赎回、 转换、定期定额投资业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2017年4月26日
4	关于新增长城证券股份有限公司	《中国证券报》、《上	2017年5月19日

	为销售机构的公告	海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	
5	关于中金新安灵活配置混合型证券投资基金增加国信证券股份有限公司为销售机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2017年6月10日
6	关于中金基金管理有限公司调整旗下基金最低持有份额的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2017年6月29日
7	关于中金基金管理有限公司旗下基金调整直销中心最低申购金额的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及/或公司网站	2017年6月29日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本报告期内，本基金不存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金不存在影响投资者决策的其他重要信息。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予本基金募集注册的文件；
- 2、《中金新安灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《中金新安灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- 4、本基金申请募集注册的法律意见书；
- 5、基金管理人业务资格批复、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批复、营业执照；
- 7、报告期内本基金在指定媒上发布的各项公告；
- 8、中国证监会要求的其他文件。

### 12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

### 12.3 查阅方式

投资者营业时间内可到基金管理人和/或基金托管人的住所免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件和复印件。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人。

咨询电话：010-63211122 400-868-1166

传真：010-66159121

中金基金管理有限公司

2017年8月29日