

中金新安灵活配置混合型证券投资基金 招募说明书摘要

(2017 年第 1 号)

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

二〇一七年十一月

重要提示

中金新安灵活配置混合型证券投资基金的募集申请于2015年7月6日经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）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》注册，并于2017年3月29日经中国证监会证券基金机构监管部部函[2017]841号《关于中金新安灵活配置混合型证券投资基金备案确认的函》备案。本基金的基金合同于2017年3月29日生效。本基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。2017年2月8日经中国证监会[2017]307号文批复准予延期募集。

本基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。

本招募说明书经中国证监会注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。

中金新安灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者根据所持有的基金份额享受基金收益，同时承担相应的投资风险。本基金投资中的风险包括但不限于：市场风险、信用风险、流动性风险、管理风险、操作风险、技术风险、合规性风险、本基金特有风险、其他风险等。本基金为混合型基金，其长期平均风险水平和预期收益率低于股票型基金，但高于债券型基金和货币市场基金。投资者在投资本基金之前，请仔细阅读本基金的招募说明书和基金合同，全面认识本基金的风险收益特征和产品特性，并充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，谨慎做出投资决策。

投资有风险，投资人认购（或申购）本基金时应认真阅读本基金招募说明书。

基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则，在投资人作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行负责。

基金管理人管理的其他基金的业绩不构成对本基金业绩表现的保证。基金的过往业绩并不预示其未来表现。

基金管理人承诺依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基

金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。本更新招募说明书已经本基金托管人复核。本更新招募说明书所载内容截止日为2017年9月28日，有关财务数据和净值表现截止日为2017年6月30日（财务数据未经审计）。

一、基金管理人

(一) 基金管理人概况

名称：中金基金管理有限公司

住所：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：北京市西城区太平桥大街18号丰融国际大厦17层

法定代表人：林寿康

成立时间：2014年2月10日

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

批准设立文号：中国证监会证监许可〔2014〕97号

组织形式：有限责任公司

注册资本：2亿元人民币

存续期间：持续经营

联系人：张显

联系电话：010-63211122

公司的股权结构如下：

股东名称	持股比例
中国国际金融股份有限公司	100%

(二) 主要人员情况

1、基金管理人董事会成员

林寿康先生，董事长，货币经济学博士。历任国际货币基金组织国际部经济学家；香港金融管理局货币管理部高级经理；德意志摩根建富公司新兴市场部经济学家；中国信达资产管理公司国际部副主任。现任中国国际金融股份有限公司管理委员会成员、投资管理业务负责人、董事总经理。

孙菁女士，董事，管理学硕士。历任中国国际金融股份有限公司资本市场部副总经理、公司管理部副总经理、运营支持部执行总经理及负责人等职务。现任

中金基金管理有限公司总经理。

黄劲峰先生,董事,机械工程专业学士。历任高盛(亚洲)有限责任公司资产管理部亚太区首席营运官、亚太除日本首席营运官、产品研发主管、和董事总经理;北京高华证券有限责任公司负责中后台协调、风险管理岗位;高盛(亚洲),高盛集团(日本东京)担任固定收益外汇及大宗商品产品财务控制负责人、权益类产品财务控制负责人、日本产品财务控制负责人、香港财务控制负责人、执行董事等职务;香港汇丰银行担任资本市场财务经理、货币及外汇市场财务经理职务;毕马威会计师事务所-英国及香港先后担任审计、核算见习生、副经理,经理等职务。现任中国国际金融股份有限公司首席财务官、董事总经理

陈刚先生,董事,法学博士。历任国务院发展研究中心技术经济研究所研究人员;北京世泽律师事务所律师;中国国际金融有限公司合规律师、中国国际金融香港有限公司合规律师、中金美国证券有限公司法律部负责人;厚朴香港投资咨询有限公司法律合规事务负责人。陈刚先生是纽约州执业律师并具有中国法律职业资格。现任中国国际金融股份有限公司合规总监、董事总经理。

赵璧先生,董事,经济学硕士。历任中国国际金融股份有限公司投资银行部经理助理;中信产业基金管理有限公司投资经理。现任中金基金管理有限公司总经理助理。

李永先生,董事,工商管理硕士。历任中国人保资产管理有限公司交易员、风险监控员、投资经理;中国人寿资产管理有限公司养老金及机构业务部投资经理、固定收益团队负责人、固定收益部投资经理、高级投资经理、一级团队负责人;中国人寿资产管理有限公司固定收益投资委员会委员、自有资金投资委员会委员。现任中金基金管理有限公司副总经理。

张龙先生,博士。历任内蒙康隆能源有限公司总经理,现任中宝睿信投资有限公司董事长、中国建设银行独立董事。

张春先生,独立董事,经济学和决策科学博士。历任美国明尼苏达大学卡尔森管理学院金融系终身教授;中欧国际工商学院金融和会计系讲席教授、系主任、副教务长。现任上海交通大学上海高级金融学院教授、执行院长。

颜羽女士,独立董事,经济法硕士、EMBA 硕士研究生。历任云南政法干

部管理学院教师;四通集团条法部法律咨询副主任;海问律师事务所证券业务律师;嘉和律师事务所合伙人。现任嘉源律师事务所创始合伙人。

2、基金管理人监事

夏静女士,执行监事,数学系理学硕士。历任普华永道(深圳)咨询有限公司北京分公司风险管理及内部控制服务部经理;中国国际金融股份有限公司稽核部高级经理。现任中金基金管理有限公司风险管理部负责人。

3、基金管理人高级管理人员

林寿康先生,董事长,货币经济学博士。简历同上。

孙菁女士,总经理。简历同上。

李永先生,副总经理,简历同上。

李虹女士,督察长,法学硕士。历任美国众达律师事务所北京代表处律师;中国国际金融股份有限公司合规管理部副总经理。李虹女士是美国纽约州执业律师并具有中国法律职业资格。

4、本基金拟任基金经理

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,中金消费升级股票型证券投资基金基金经理。

5、投资决策委员会成员

李永先生,工商管理硕士,简历同上。

郭党钰先生,工商管理硕士,简历同上。

石玉女士,管理学硕士。历任天弘基金管理有限公司金融工程分析师、固定收益研究员;中国国际金融股份有限公司高级研究员、投资经理助理、投资经理。现任中金纯债债券型证券投资基金、中金现金管家货币市场基金基金经理。

魏宇先生,香港大学统计专业博士。历任北京尊嘉资产管理有限公司量化研究员、高级量化研究员。现任中金基金管理有限公司量化公募投资部副总经理。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、基金托管人

(一) 基金托管人情况

名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：田国立

成立时间：2004 年 09 月 17 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12 号

联系人：田青

联系电话：(010)6759 5096

中国建设银行成立于 1954 年 10 月，是一家国内领先、国际知名的大型股份制商业银行，总部设在北京。本行于 2005 年 10 月在香港联合交易所挂牌上市(股票代码 939)，于 2007 年 9 月在上海证券交易所挂牌上市(股票代码 601939)。

2017 年 6 月末，本集团资产总额 216,920.67 亿元，较上年末增加 7,283.62 亿元，增幅 3.47%。上半年，本集团实现利润总额 1,720.93 亿元，较上年同期增长 1.30%；净利润较上年同期增长 3.81%至 1,390.09 亿元，盈利水平实现平稳增长。

2016 年，本集团先后获得国内外知名机构授予的 100 余项重要奖项。荣获《欧洲货币》“2016 中国最佳银行”，《环球金融》“2016 中国最佳消费者银行”、“2016 亚太区最佳流动性管理银行”，《机构投资者》“人民币国际化服务钻石奖”，《亚洲银行家》“中国最佳大型零售银行奖”及中国银行业协会“年度最具社会责任金融机构奖”。本集团在英国《银行家》2016 年“世界银行 1000 强排名”中，以一级资本总额继续位列全球第 2；在美国《财富》2016 年世界 500 强排名第 22

位。

中国建设银行总行设资产托管业务部,下设综合处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、QFII 托管处、养老金托管处、清算处、核算处、跨境托管运营处、监督稽核处等 10 个职能处室,在上海设有投资托管服务上海备份中心,共有员工 220 余人。自 2007 年起,托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计,并已经成为常规化的内控工作手段。

(二) 主要人员情况

纪伟,资产托管业务部总经理,曾先后在中国建设银行南通分行、总行计划财务部、信贷经营部任职,并在总行公司业务部、投资托管业务部、授信审批部担任领导职务。其拥有八年托管从业经历,熟悉各项托管业务,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

龚毅,资产托管业务部副总经理,曾就职于中国建设银行北京市分行国际部、营业部并担任副行长,长期从事信贷业务和集团客户业务等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

郑绍平,资产托管业务部副总经理,曾就职于中国建设银行总行投资部、委托代理部、战略客户部,长期从事客户服务、信贷业务管理等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

黄秀莲,资产托管业务部副总经理,曾就职于中国建设银行总行会计部,长期从事托管业务管理等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

原环,资产托管业务部副总经理,曾就职于中国建设银行总行国际业务部,长期从事海外机构及海外业务管理、境内外汇业务管理、国外金融机构客户营销拓展等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

(三) 基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行,中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念,不断加强风险管理和内部控制,严格履行托管人的各项职责,切实维护资产持有人的合法权益,为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展,中国建设银行托管资产规模不断扩大,托管业务品种不断增加,已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、

(R)QFII、(R)QDII、企业年金等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至 2017 年二季度末，中国建设银行已托管 759 只证券投资基金。中国建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。中国建设银行连续 11 年获得《全球托管人》、《财资》、《环球金融》“中国最佳托管银行”、“中国最佳次托管银行”、“最佳托管专家——QFII”等奖项，并在 2016 年被《环球金融》评为中国市场唯一一家“最佳托管银行”。

三、相关服务机构

（一）基金份额发售机构

1、直销机构

（1）直销柜台

名称：中金基金管理有限公司

住所：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：北京市西城区太平桥大街 18 号丰融国际大厦 17 层

法定代表人：林寿康

电话：010-63211122

传真：010-66159121

联系人：张显

客户服务电话：400-868-1166

公司网站：www.ciccfund.com

（2）网上直销

交易系统：中金基金网上直销系统

直销系统网址：<https://trade.ciccfund.com/etrade>

2、其他销售机构

（1）中国中投证券有限责任公司

客服电话：400-600-8008、95532

网址：<http://www.china-invs.cn>

(2) 北京乐融多源投资咨询有限公司

地址: 北京市朝阳区工人体育馆北路甲2号盈科中心B座裙楼二层

网址: <https://www.hongdianfund.com/>

电话: 010-85643600

(3) 北京汇成基金销售有限公司

客服电话: 400-619-9059

网址: www.hcjijin.com

(4) 平安证券有限责任公司

客服电话: 95511-8

网站: <http://stock.pingan.com>

(5) 上海陆金所资产管理有限公司

客服电话: 400-821-9031

网站: www.lufunds.com

(6) 上海好买基金销售有限公司

注册地址: 上海市虹口区欧阳路196号26号楼2楼41号

办公地址: 上海市浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903-906室

法定代表人: 杨文斌

联系人: 王诗屿

电话: 021-20613999

传真: 021-68596919

客服电话: 400-700-9665

网址: www.ehowbuy.com

(7) 上海天天基金销售有限公司

客服电话: 400-991-8918

网址: <http://fund.eastmoney.com>

(8) 北京恒天明泽基金销售有限公司

地址: 北京市朝阳区东三环北路甲19号SOHO嘉盛中心30层

法定代表人: 周斌

客服电话: 4008980618

网址: www.chtfund.com

(9) 上海联泰资产管理有限公司

客服电话: 400-166-6788

网址: <http://www.66zichan.com>

(10) 交通银行股份有限公司

地址: 上海市银城中路 188 号

法定代表人: 牛锡明

客服电话: 95559

网址: www.bankcomm.com

(11) 上海万得投资顾问有限公司

客服电话: 400-821-0203

网站: www.520fund.com.cn

(12) 蚂蚁(杭州)基金销售有限公司

客服电话: 4000-766-123

网站: www.fund123.cn

(13) 北京肯特瑞财富投资管理有限公司

客服电话: 95118

网址: <http://fund.jd.com>

(14) 上海陆享投资管理有限公司

客服电话: 021-33356675

网站: <http://www.luxxfund.com/>

(15) 中国建设银行股份有限公司

住所: 北京市西城区金融大街 25 号

办公地址: 北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人: 王洪章

客户服务电话: 95533

网址: www.ccb.com

联系人: 王琳

(16) 中国光大银行股份有限公司

客服电话: 95595

网址: www.cebbank.com

(17) 中国国际金融股份有限公司

住所: 北京市建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层

办公地址: 北京市建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层

法定代表人: 丁学东

客户服务电话: 010-65051166

网址: www.cicc.com.cn

联系人: 杨涵宇

(18) 长城证券股份有限公司

客服电话: 400-6666-888

网站: <http://www.cgws.com/>

(19) 银河证券股份有限公司

客服电话: 95551

网站: <http://www.chinastock.com.cn/>

(20) 国信证券股份有限公司

住所: 深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层

办公地址: 深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层

法定代表人: 何如

客户服务电话: 0755-82133145

网址: <http://www.guosen.com.cn/>

联系人: 齐晓燕

(21) 上海基煜基金销售有限公司

客服电话: 4008-205-369

网址: <https://www.jiyufund.com.cn/>

(22) 和讯信息科技有限公司

客服电话：400-920-0022

网址：<http://www.licaike.com>

(23) 北京蛋卷基金销售有限公司

客服电话：4000618518

网址：<http://danjuanapp.com/>

其他销售机构详见本基金基金份额发售公告或基金管理人届时发布的变更或增减销售机构的公告。

(二) 登记机构

名称：中金基金管理有限公司

住所：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：北京市西城区太平桥大街18号丰融国际大厦17层

法定代表人：林寿康

电话：010-63211122

传真：010-66155573

联系人：白娜

(三) 出具法律意见书的律师事务所

名称：上海通力律师事务所

住所：上海市银城东路68号时代金融中心19楼

办公地址：上海市银城东路68号时代金融中心19楼

负责人：俞卫锋

电话：021-31358666

传真：021-31358600

经办律师：吕红、安冬

联系人：安冬

(四) 审计基金财产的会计师事务所

名称：毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：中国北京东长安街1号东方广场东2办公楼8层

办公地址：中国北京东长安街1号东方广场东2办公楼8层

执行事务合伙人：邹俊

电话：010-85085000

传真：010-85185111

签章注册会计师：程海良、李砾

联系人：程海良

四、基金的名称

中金新安灵活配置混合型证券投资基金。

五、基金的类型与运作方式

(一) 基金的类型

混合型证券投资基金。

(二) 基金的运作方式

运作方式为契约型开放式，存续期限为不定期。

六、基金的投资目标

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。

七、基金的投资方向

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。

基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例范围为0-95%；在每个交易日日终，在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值的5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。

八、基金的投资策略

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。

（一）大类资产配置策略

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。

（二）固定收益资产投资策略

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。

1、利率策略

本基金通过对宏观经济变量和宏观经济政策进行分析，积极主动的预测未来的利率趋势。根据相关因素的研究判断调整组合久期。如果预期利率下降，本基金将增加组合的久期；反之，如果预期利率上升，本基金将缩短组合的久期。

2、债券类属配置策略

本基金将根据国债、金融债、公司债、企业债、短融和中期票据等不同债券板块之间的相对投资价值分析，增持价值被相对低估的债券板块，减持价值被相对高估的债券板块，借以取得较高收益。

3、信用债券投资策略

本基金将根据国民经济运行周期阶段，分析企业债券、公司债券等发行人所处行业发展前景、业务发展状况、市场竞争地位、财务状况、管理水平和债务水平等因素，进行个债的精选，结合适度分散的行业配置策略，构造和优化组合。

4、期限结构配置策略

本基金对同一类属收益率曲线形态和期限结构变动进行分析，在给定组合久期以及其他组合约束条件的情形下，确定最优的期限结构。本基金期限结构调整

的配置方式包括子弹策略、哑铃策略和梯形策略。

5、骑乘策略

本基金将采用骑乘策略增强组合的持有期收益。当债券收益率曲线比较陡峭时，也即相邻期限利差较大时，可以买入期限位于收益率曲线陡峭处的债券，也即收益率水平处于相对高位的债券，随着持有期限的延长，债券的剩余期限将会缩短，债券的收益率水平将会较投资期初有所下降，对应的将是债券价格的走高，进而获得资本利得收益

6、息差策略

本基金将利用回购利率低于债券收益率的情形，通过正回购将所获得的资金投资于债券，以期获取超额收益的操作方式。

（三）权益类资产投资策略

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。

（四）期货投资策略

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。

九、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率*50%+中证全债指数收益率*50%

沪深 300 指数是由上海证券交易所和深圳证券交易所授权，由中证指数有限公司开发的中国 A 股市场指数，其成份股票为中国 A 股市场中代表性强、流动性高、流通市值大的主流股票，能够反映 A 股市场总体价格走势；中证全债指数是中证指数公司编制的综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的跨市场债券指数。基于本基金资产配置比例以及沪深 300 指数和中证全债指数的特征，选用该业绩比较基准能够反应本基金的风险收益特征。

今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的指数时，本基金管理人协商基金托管人后可以在报中国证监会备案以后变更业绩比较基准并及时公告，但不需要召集基金份额持有人大会。

十、风险收益特征

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。

十一、基金投资组合报告

基金管理人的董事会及董事保证本报告中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责任。

基金托管人根据本基金合同规定，复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本投资组合报告所载数据截至 2017 年 6 月 30 日，报告期间为 2017 年 4 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日。本报告财务数据未经审计。

1. 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	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	基金投资	-	-
3	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	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	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	-	-
7	银行存款和结算备付 金合计	7,943,365.21	1.78
8	其他资产	5,798,806.15	1.30
9	合计	445,027,620.95	100.00

2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

(1) 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	7,639.62	0.00

	务业		
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

(2) 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有沪港通投资股票。

3. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	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
----	--------	-----	--------	--------------	------

4. 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	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

5. 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	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

6. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券

投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7. 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投资。

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权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证投资。

9. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(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。

(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。

10. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(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。

(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。

(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。

11. 投资组合报告附注

(1) 本基金投资的前十名证券的发行主体本期末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。

(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。

12. 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
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

13. 报告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。

14. 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有流通受限股票。

15. 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。

十二、基金的业绩

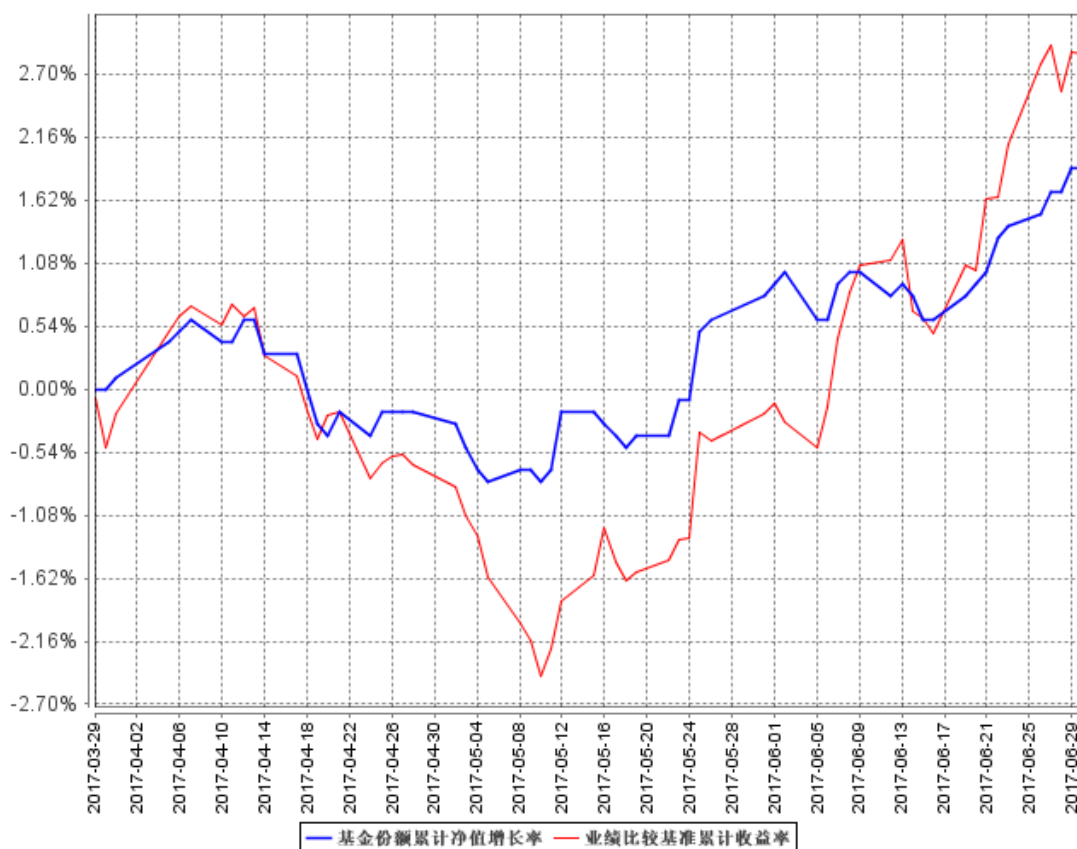
基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不预示其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

(一) 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值收 益率①	净值收 益率标 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
2017年3月 29日（基金 合同生效日） 至2017年6 月30日	1.90%	0.18%	2.88%	0.32%	-0.98%	-0.14%

（二）自基金合同生效以来基金累计净值收益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。

十三、基金的费用与税收

（一）与基金运作有关的费用

1、基金费用的种类

- （1）基金管理人的管理费；
- （2）基金托管人的托管费；
- （3）《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- （4）《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和仲裁费；
- （5）基金份额持有人大会费用；

- (6) 基金的证券期货交易费用；
- (7) 基金的银行汇划费用；
- (8) 基金的开户费用、账户维护费用；
- (9) 按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

2、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

(1) 基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.70%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.70 \% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初5个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

(2) 基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.15%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.15 \% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初5个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。若遇法

定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

上述“一、基金费用的种类中第3—9项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

（二）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- 1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、《基金合同》生效前的相关费用；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

（三）基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

十四、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《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》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他有关法律法规的要求,对本基金管理人于2017年3月15日刊登的《中金新安灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》进行了更新,并根据本基金管理人对本基金实施的投资经营活动进行了内容补充和更新,主要更新的内容如下:

- 1、在“重要提示”部分更新了相关内容;
- 2、在“第三部分基金管理人”中,对基金管理人中金基金管理有限公司的主要人员情况进行了更新;
- 3、在“第四部分基金托管人”部分更新了相关内容;
- 4、在“第四部分出具法律意见书的律师事务所”部分更新了相关内容;
- 5、在“第五部分相关服务机构”中,增加了部分销售机构并更新了相关服务机构的内容;
- 6、在“第六部分基金的募集”部分中,删除了相关募集方案,增加了本基金的募集情况说明;
- 7、在“第七部分基金合同的生效”中,删除了基金的备案条件和募集失败内容,增加了基金合同生效日期;
- 8、在“第八部分基金份额的申购与赎回”中,更新了申购与赎回的数额限制;
- 9、在“第九部分基金的投资”中,增加了“基金投资组合报告”内容;
- 10、增加了“第十部分基金的业绩”,相关数据内容截止时间为2017年6月30日;
- 11、在“第二十二部分其他应披露事项”中,增加了其他应当披露的事项。

中金基金管理有限公司

2017年11月11日