

中融鑫回报灵活配置混合型证券投资基金 2017年第一季度报告

2017年03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 基金管理人、基金托管人及基金销售机构在本报告期内不存在虚假记载、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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年4月17日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。

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预示其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前请仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告期为2017年1月1日起至2017年3月31日止。

2.1 基金基本情况

Table with 2 columns: Item and Value. Includes fund name, type, start date, and investment objectives.

3.1 主要财务指标和基金净值表现

1. 本期已实现收益 181.84 2. 本期利润 202.78 3. 加权平均基金份额本期利润 0.0134

4. 期末基金资产净值 589,157,891.61 5. 期末基金份额净值 1.0092

3.2 本报告期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

中融鑫回报混合 A 净值表现

Table showing performance metrics for 3 months and 6 months for Class A.

中融鑫回报混合 C 净值表现

Table showing performance metrics for 3 months and 6 months for Class C.

3.2.2 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

注:按照基金合同和招募说明书的约定,本基金合同生效日起6个月内为建仓期,截至本报告期末仍在建仓期内。

4. 基金管理人

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

Table with columns: Name, Position, Start Date, End Date, Tenure.

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 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

报告期内,本基金管理人严格遵守了《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套法规。

4.3 公平交易专项说明

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。

4.4 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

报告期内,本基金管理人严格遵守了《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套法规。

4.5 基金管理人或基金托管人的办公场所

3.9 查询方式 投资者可在营业时间内免费查询,也可在支付工本费后,在合理时间内取得上述文件的复印件。

咨询电话:中融基金管理有限公司客户服务 400-160-6000 (免长途话费) (010)85003210

网址: http://www.zrfund.com.cn/

中融基金管理有限公司 二〇一七年四月二十一日

中融鑫思路灵活配置混合型证券投资基金 2017年第一季度报告

2017年03月31日

基金管理人:中融基金管理有限公司 基金托管人:交通银行股份有限公司

重要提示 基金管理人、基金托管人及基金销售机构在本报告期内不存在虚假记载、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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年4月17日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。

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预示其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前请仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告期为2017年1月1日起至2017年3月31日止。

2.1 基金基本情况

Table with 2 columns: Item and Value. Includes fund name, type, start date, and investment objectives.

3.1 主要财务指标和基金净值表现

1. 本期已实现收益 2,701.25 2. 本期利润 2,084.23 3. 加权平均基金份额本期利润 0.0182

4. 期末基金资产净值 116,254.22 5. 期末基金份额净值 1.0182

3.2 本报告期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

中融鑫思路混合 A 净值表现

Table showing performance metrics for 3 months and 6 months for Class A.

中融鑫思路混合 C 净值表现

Table showing performance metrics for 3 months and 6 months for Class C.

3.2.2 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

注:按照基金合同和招募说明书的约定,本基金合同生效日起6个月内为建仓期,截至本报告期末仍在建仓期内。

4. 基金管理人

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

Table with columns: Name, Position, Start Date, End Date, Tenure.

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 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

报告期内,本基金管理人严格遵守了《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套法规。

4.3 公平交易专项说明

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。

4.4 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

报告期内,本基金管理人严格遵守了《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套法规。

4.5 基金管理人或基金托管人的办公场所

3.9 查询方式 投资者可在营业时间内免费查询,也可在支付工本费后,在合理时间内取得上述文件的复印件。

咨询电话:中融基金管理有限公司客户服务 400-160-6000 (免长途话费) (010)85003210

网址: http://www.zrfund.com.cn/

中融基金管理有限公司 二〇一七年四月二十一日

意味着持有人民币现金类产品的收益率显著上升,利率提高有助于稳定人民币汇率。

从经典的美林投资时钟角度观察,16年下半年商品价格大幅上涨,股债俱跌,说明16年下半年经济再度步入过热期,而从16年12月开始,随着货币利率的大幅上升,股债一度齐跌,商品高位震荡,意味着经济已经步入滞胀期,而17年2季度将是滞胀向衰退转化的关键时期。

4.5 报告期内基金的业绩表现 截至报告期末中融鑫思路混合 A 基金份额净值为 1.0182 元;本报告期基金份额净值增长率为 1.82%,同期业绩比较基准收益率为 1.83%。

截至报告期末中融鑫思路混合 C 基金份额净值为 1.0179 元;本报告期基金份额净值增长率为 1.79%,同期业绩比较基准收益率为 1.83%。

5.1 投资组合报告

5.1.1 报告期末按资产组合情况

Table showing asset allocation by category: Equity, Fixed Income, Cash, etc.

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table showing stock holdings by industry: Agriculture, Manufacturing, etc.

5.3 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

Table listing top 10 stocks by market value.

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table showing bond holdings by type: Government, Corporate, etc.

5.5 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

Table listing top 5 bonds by market value.

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

5.7 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

5.8 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

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 报告期内,本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求,未发现本基金投资的前十名股票发行主体本期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。

5.11.2 基金投资的前十名股票未超过基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

Table showing other assets: Cash, Receivables, etc.

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

5.12 基金资产净值

5.13 其他资产构成

Table showing other assets: Cash, Receivables, etc.

基金合同生效日至报告期末基金总资产 114,723.99 基金合同生效日至报告期末基金总负债 2,259.83

基金合同生效日至报告期末基金净资产 112,464.16

报告期末基金份额总额 114,723.99

报告期末基金份额净值 1.0092

报告期末基金份额总额 114,723.99

报告期末基金份额净值 1.0092

报告期末基金份额总额 114,723.99

报告期末基金份额净值 1.0092

报告期末基金份额总额 114,723.99

报告期末基金份额净值 1.0092

报告期末基金份额总额 114,723.99

报告期末基金份额净值 1.0092

报告期末基金份额总额 114,723.99

报告期末基金份额净值 1.0092

报告期末基金份额总额 114,723.99

报告期末基金份额净值 1.0092

报告期末基金份额总额 114,723.99

报告期末基金份额净值 1.0092

报告期末基金份额总额 114,723.99

报告期末基金份额净值 1.0092

报告期末基金份额总额 114,723.99

报告期末基金份额净值 1.0092

报告期末基金份额总额 114,723.99

报告期末基金份额净值 1.0092

报告期末基金份额总额 114,723.99

报告期末基金份额净值 1.0092

报告期末基金份额总额 114,723.99

报告期末基金份额净值 1.0092