

中融融安二号保本混合型证券投资基金 2017年第一季度报告 2017年03月31日

中融新动力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:中国银行股份有限公司 报告送出日期:2017年04月21日

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

基金管理人:中融基金管理有限公司 基金托管人:中国光大银行股份有限公司 报告送出日期:2017年04月21日

利率债波段操作,保持基金资产的稳健增值。当前市场结构性的流动性风险和部分企业违约风险依然存在,日渐收紧的流动性水平和整体适中的估值水平,市场整体呈现的估值承压的局面并没有得到改变。

Table with 2 columns: 基金名称, 中融融安二号保本; 基金代码, 001739; 基金运作方式, 契约型开放式; 基金合同生效日, 2015年09月25日

Table with 4 columns: 序号, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值的比例(%)

Table with 2 columns: 基金名称, 中融新动力混合; 基金代码, 001413; 基金运作方式, 契约型开放式; 基金合同生效日, 2015年06月12日

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

§3 主要财务指标和基金净值表现 3.1 主要财务指标 单位:人民币元

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2017年01月01日-2017年03月31日)

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 with 5 columns: 序号, 股票代码, 名称, 数量(股), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

§3 主要财务指标和基金净值表现 3.1 主要财务指标 单位:人民币元

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2017年01月01日-2017年03月31日)

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 with 5 columns: 序号, 股票代码, 名称, 数量(股), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

3.2 基金净值表现 3.2.1 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

Table with 5 columns: 阶段, 净值增长率①, 净值增长率②, 业绩比较基准收益率③, 业绩比较基准收益率④, ①-③, ②-④

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with 4 columns: 序号, 债券品种, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

3.2 基金净值表现 3.2.1 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

Table with 5 columns: 阶段, 份额净值增长率①, 份额净值增长率②, 业绩比较基准收益率③, 业绩比较基准收益率④, ①-③, ②-④

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with 4 columns: 序号, 债券品种, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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

Table with 5 columns: 阶段, 净值增长率①, 净值增长率②, 业绩比较基准收益率③, 业绩比较基准收益率④, ①-③, ②-④

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 with 5 columns: 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(%)

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

Table with 5 columns: 阶段, 份额净值增长率①, 份额净值增长率②, 业绩比较基准收益率③, 业绩比较基准收益率④, ①-③, ②-④

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 with 5 columns: 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(%)

4.2 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

Table with 5 columns: 序号, 贵金属代码, 贵金属名称, 数量(克), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.6 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

Table with 5 columns: 序号, 资产支持证券代码, 资产支持证券名称, 数量(份), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

3.2.3 本报告期基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

Table with 5 columns: 阶段, 份额净值增长率①, 份额净值增长率②, 业绩比较基准收益率③, 业绩比较基准收益率④, ①-③, ②-④

5.6 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

Table with 5 columns: 序号, 资产支持证券代码, 资产支持证券名称, 数量(份), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

4.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

Table with 5 columns: 序号, 权证代码, 权证名称, 数量(份), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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

Table with 5 columns: 序号, 贵金属代码, 贵金属名称, 数量(克), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

3.2.3 本报告期基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

Table with 5 columns: 阶段, 份额净值增长率①, 份额净值增长率②, 业绩比较基准收益率③, 业绩比较基准收益率④, ①-③, ②-④

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

Table with 5 columns: 序号, 贵金属代码, 贵金属名称, 数量(克), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

4.4 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

Table with 5 columns: 序号, 权证代码, 权证名称, 数量(份), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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

Table with 5 columns: 序号, 权证代码, 权证名称, 数量(份), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

3.2.3 本报告期基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

Table with 5 columns: 阶段, 份额净值增长率①, 份额净值增长率②, 业绩比较基准收益率③, 业绩比较基准收益率④, ①-③, ②-④

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

Table with 5 columns: 序号, 权证代码, 权证名称, 数量(份), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

4.5 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权证投资明细

Table with 5 columns: 序号, 权证代码, 权证名称, 数量(份), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.9 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

Table with 5 columns: 序号, 权证代码, 权证名称, 数量(份), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

3.2.3 本报告期基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

Table with 5 columns: 阶段, 份额净值增长率①, 份额净值增长率②, 业绩比较基准收益率③, 业绩比较基准收益率④, ①-③, ②-④

5.9 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

Table with 5 columns: 序号, 权证代码, 权证名称, 数量(份), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

4.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

Table with 5 columns: 序号, 权证代码, 权证名称, 数量(份), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.10 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

Table with 5 columns: 序号, 权证代码, 权证名称, 数量(份), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

3.2.3 本报告期基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

Table with 5 columns: 阶段, 份额净值增长率①, 份额净值增长率②, 业绩比较基准收益率③, 业绩比较基准收益率④, ①-③, ②-④

5.10 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

Table with 5 columns: 序号, 权证代码, 权证名称, 数量(份), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

4.7 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权证投资明细

Table with 5 columns: 序号, 权证代码, 权证名称, 数量(份), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.11 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

Table with 5 columns: 序号, 权证代码, 权证名称, 数量(份), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

3.2.3 本报告期基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

Table with 5 columns: 阶段, 份额净值增长率①, 份额净值增长率②, 业绩比较基准收益率③, 业绩比较基准收益率④, ①-③, ②-④

5.11 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

Table with 5 columns: 序号, 权证代码, 权证名称, 数量(份), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

4.8 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

Table with 5 columns: 序号, 权证代码, 权证名称, 数量(份), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.12 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

Table with 5 columns: 序号, 权证代码, 权证名称, 数量(份), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

3.2.3 本报告期基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

Table with 5 columns: 阶段, 份额净值增长率①, 份额净值增长率②, 业绩比较基准收益率③, 业绩比较基准收益率④, ①-③, ②-④

5.12 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

Table with 5 columns: 序号, 权证代码, 权证名称, 数量(份), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

4.9 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

Table with 5 columns: 序号, 权证代码, 权证名称, 数量(份), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.13 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

Table with 5 columns: 序号, 权证代码, 权证名称, 数量(份), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

3.2.3 本报告期基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

Table with 5 columns: 阶段, 份额净值增长率①, 份额净值增长率②, 业绩比较基准收益率③, 业绩比较基准收益率④, ①-③, ②-④

5.13 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

Table with 5 columns: 序号, 权证代码, 权证名称, 数量(份), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)