股票代码:600377　　股票简称:宁沪高速　　编号:临2017-025

江苏宁沪高速公路股份有限公司 关于312国道沪宁段提前终止收费经营权补偿安排的进展公告

本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，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。

根据江苏省政府要求，江苏宁沪高速公路股份有限公司（以下简称“本公司”）312国道沪宁段于2015年9月16日零时起提前终止收费经营权，经江苏省国资委批复确认，由江苏交通控股有限公司（以下简称“交通控股”）从留存收益中支付本公司经济补偿金人民币1,316,049,634元。有关详情请参见本公司于2015年12月21日在《中国证券报》、《上海证券报》以及上海证券交易所网站www.sse.com.cn、香港联合交易所网站www.hkexnews.hk刊登的公告。

于2015年12月24日、12月25日，本公司分别收到交通控股第一期补偿款人民币326,419,854元、200,000,000元。有关详情请参见本公司于2015年12月30日在《中国证券报》、《上海证券报》以及上海证券交易所网站www.sse.com.cn、香港联合交易所网站www.hkexnews.hk刊登的公告。

于2016年9月6日，本公司收到交通控股第二期补偿款人民币394,814,890元。有关详情请参见本公司于2016年9月10日在《中国证券报》、《上海证券报》以及上海证券交易所网站www.sse.com.cn、香港联合交易所网站www.hkexnews.hk刊登的公告。

于2017年7月25日，本公司收到交通控股剩余补偿款人民币394,814,890元。至此，所有补偿款项已全部结清。

特此公告。

江苏宁沪高速公路股份有限公司
二零一七年七月二十七日

证券代码:002383　　证券简称:合众思壮　　公告编号:2017-102

北京合众思壮科技股份有限公司二〇一七年半年度业绩快报

本公司及董事会全体成员保证信息披露内容的真实、准确和完整，没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

特别提示:本公告所载2017年半年度的财务数据仅为初步核算数据，已经公司内部审计部门审计，未经会计师事务所审计，与2017年8月8日披露的2017年半年度报告中披露的最终数据可能存在差异，敬请广大投资者注意投资风险。

一、2017年半年度主要财务数据和指标

单位:元

项目	本报告期	上年同期	增减变动幅度（%）
营业总收入	636,363,207.97	333,339,773.68	90.91%
营业利润	32,732,887.42	-7,750,831.31	522.31%
利润总额	45,592,318.86	1,841,537.62	2,375.77%
归属于上市公司股东的净利润	50,289,189.82	3,432,361.46	1,365.15%
基本每股收益（元）	0.0686	0.0050	1,272.00%
加权平均净资产收益率	1.25%	0.19%	1.06%
	本报告期末	本报告期初	增减变动幅度（%）
总资产	5,667,968,850.28	4,903,335,520.21	15.59%
归属于上市公司股东的所有者权益	3,503,625,465.14	3,507,425,730.28	-0.11%
股本	733,148,100.00	244,382,700.00	200.00%
归属于上市公司股东的每股净资产（元）	4.78	4.78	0.00%

注释:

1、上述数据为公司合并报表数据。

2、报告期内，公司以资本公积金向全体股东每10股转增20股，考虑上述影响后，经重新计算的2016年同期的基本每股收益均为0.0050元（调整前为0.0174元）；每股净资产为4.78元（调整前为14.35元）。

二、经营业绩和财务状况情况说明

1.公司2017年1-6月营业总收入为63,636.32万元，较上年同期增加30,302.34万元，增长幅度90.91%；营业利润为3,273.29万元，较上年同期增加4,048.37万元，增长幅度522.31%；利润总额为4,559.23万元，较上年同期增加4,375.08万元，增长幅度2,375.77%；归属上市公司股东净利润5,028.92万元，较去年同期增长4,685.68万元，增长幅度1,365.15%。

主要原因是公司战略目标的逐步落地，上年并购企业纳入合并范围及新疆等重点布局区域业务快速增长导致报告期内收入、利润同时出现快速增长。

2. 报告期内公司总资产566,796.89万元，较期初增加76,463.33万元，增长幅度为15.59%，主要是由于公司经营规模扩大所致。

3.报告期内公司股本较期初增加200.00%，主要是报告期公司将资本公积金转增股本所致。

三、与前次业绩预计的差异说明

本次业绩快报披露的经营业绩与公司2017年7月11日披露的《二〇一七年半年度业绩预告修正公告》中对2017年半年度经营业绩的预计不存在差异。

四、备查文件

1.经公司法定代表人郭信平先生、主管会计工作的负责人侯红梅女士、会计机构负责人袁学林先生签字并盖章的比较式资产负债表和利润表；

2.内部审计报告。

特此公告。

北京合众思壮科技股份有限公司董事会
二〇一七年七月二十七日

证券代码:000716　　证券简称:黑芝麻　　公告编号:2017-099

南方黑芝麻集团股份有限公司 关于发行股份及支付现金购买资产停牌进展公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露的内容真实、准确、完整，没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

特别风险提示:

公司本次发行股份及支付现金购买资产事项尚需在相关评估等工作完成后再次提交公司董事会、股东大会审议，并报中国证券监督管理委员会核准，本次发行股份及支付现金购买资产事项能否通过上述批准以及最终取得批准和核准的时间均存在不确定性，敬请广大投资者注意投资风险。

南方黑芝麻集团股份有限公司（以下简称“公司”）因筹划重大事项，经向深圳证券交易所（以下简称“深交所”）申请，公司股票（股票简称:黑芝麻，股票代码:000716）自2017年1月3日开市起停牌；并自2017年1月17日开市起转入重大资产重组事项继续停牌。

公司原预计自停牌首日起在累计不超过2个月的时间内，按照《公开发行证券的公司信息披露内容与格式准则26号—上市公司重大资产重组》的要求披露本次重大资产重组方案等相关信息并复牌。但由于本次重组涉及的工作量较大，且公司尚需与相关各方就重组方案及相关事项进行进一步协商和论证，无法在前述期限内披露重组方案；为继续推进本次重组，2017年3月2日，公司召开第八届董事会2017年第四次临时会议，审议通过了《关于筹划重组停牌期满继续停牌的议案》，申请公司股票2017年1月3日停牌2个月期满后继续停牌1个月。

2017年3月14日，公司召开第八届董事会2017年第五次临时会议，审议并通过了《关于召开股东大会审议继续停牌筹划重大资产重组事项的议案》，2017年3月31日公司召开2017年第一次临时股东大会，审议并通过了《关于筹划重组停牌期满继续停牌的议案》，本次股东大会审议通过了前述事项，同意公司继续停牌推进本次重组，据此公司经向深交所申请，公司股票继续停牌。

2017年5月5日，公司召开第八届董事会第十六次会议，审议并通过了本次发行股份及支付现金购买资产预案及摘要等相关议案，并于2017年5月9日在巨潮资讯网（http://www.cninfo.com.cn）、《中国证券报》、《证券时报》、《证券日报》上披露了本次交易事项的相关信息。

公司于2017年5月19日收到深交所下发的《关于对南方黑芝麻集团股份有限公司的重组问询函》（许可类重组问询函[2017]第11号）（以下简称“《问询函》”）。公司及中介机构已经根据《问询函》的要求，就问询所涉及的问题进行了回复。截至目前公司仍在等待深交所对公司的回复材料及相关重组文件的审查意见，在深交所出具审查意见后公司将尽快履行相关程序并及时申请复牌。

停牌期间，公司根据重组的进展情况，及时履行信息披露义务，每五个交易日发布一次重组进展公告。

公司本次发行股份及支付现金购买资产事项仍存在重大不确定性，敬请广大投资者注意投资风险。

特此公告

南方黑芝麻集团股份有限公司
董　事　会
二〇一七年七月二十七日

证券代码:002215　　证券简称:诺普信　　公告编号:2017-044

深圳诺普信农化股份有限公司 关于实际控制人股票质押式回购交易购回的公告

本公司及董事会全体成员保证公告内容真实、准确和完整，没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

深圳诺普信农化股份有限公司（以下简称“公司”）于近日接到实际控制人卢柏强先生和其控制的企业深圳市融信南方投资有限公司（以下简称“融信南方”）的通知，获悉卢柏强先生、融信南方将其持有的本公司部分股份办理了股票质押式回购交易购回业务，具体事项如下:

一、股东股份购回的基本情况

1、股东股份购回基本情况

股东名称	是否为第一大股东及一致行动人	本次购回质押股数（股）	初始交易日	购回交易日日	质权人	本次购回质押股份占其所持股份比例
卢柏强	是	20,000,000	2016年7月26日	2017年7月26日	申万宏源证券有限公司	8.10%
融信南方	是	20,000,000	2016年7月26日	2017年7月26日	申万宏源证券有限公司	17.35%

2、股东股份累计被质押的情况

截至本公告日，卢柏强先生共持有公司股票246,957,915股，占公司总股本的27.02%，累计质押其持有的公司股份185,410,000股，占卢柏强先生持有公司股份总数的75.08%，占公司总股本的20.28%。

融信南方共持有公司股票115,294,059股，占公司总股本的12.61%，融信南方累计质押其持有的公司股份55,310,000股，占融信南方持有公司股份总数的47.97%，占公司总股本的6.05%。

二、备查文件

1、股票质押式回购交易委托单（购回交易）；

2、中国证券登记结算有限责任公司股份冻结明细。

特此公告。

深圳诺普信农化股份有限公司
董事会
二〇一七年七月二十七日

中金金利债券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:中国工商银行股份有限公司

二〇一七年七月

重要提示

中金金利债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）的募集申请于2016年11月14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[2016]2662号《关于准予中金金利债券型证券投资基金注册的批复》注册，并于2016年12月13日经中国证监会证券基金机构监管部部函[2016]3163号《关于中金金利债券型证券投资基金备案确认的函》备案。本基金的基金合同于2016年12月13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。

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投资价值、收益及市场前景做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

中金金利债券型证券投资基金投资于证券及期货市场，基金净值会因为证券及期货市场波动等因素产生波动，投资人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、操作及技术风险、合规性风险、本基金特有风险、其他风险等。本基金投资品种包含中小企业私募债券，中小企业私募债券是根据相关法律法规由非上市中小企业采用非公开方式发行的债券。由于不能公开交易，一般情况下，交易不活跃，潜在较大流动性风险。当发债主体信用质量恶化时，受市场流动性所限，本基金可能无法卖出所持有的中小企业私募债券，由此可能给基金净值带来更大的负面影响和损失。本基金为债券型基金，预期收益和风险水平低于混合型基金、股票型基金，高于货币市场基金。

投资人在投资本基金之前，请仔细阅读本基金的招募说明书和基金合同等信息披露文件，全面认识本基金的风险收益特征和产品特性，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险，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。

本基金基金份额分为A、C两类，其中A类基金份额收取认/申购费，不计提销售服务费;C类基金份额不收取认/申购费，但计提销售服务费;A、C两类基金份额适用不同的赎回费率。

投资有风险，投资人认/申购本基金时应认真阅读本招募说明书及其更新。

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6月12日，有关财务数据和净值表现截止日为2017年3月31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:中国证监会

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。历任英国毕马威会计师事务所（英国及香港）审计、核算见习生、副经理，经理等职务;香港汇丰银行资本市场财务经理、货币及外汇市场财务经理职务;高盛（亚洲），高盛集团（日本东京）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;北京高华证券有限责任公司中后台协调、风险管理岗位;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职务。现任中国国际金融股份有限公司董事总经理。

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;中国国际金融股份有限公司合规律师、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。

杜季柳女士，副总经理，经济学学士。历任摩托罗拉（中国）电子有限公司财务人员;北电网络（中国）有限公司财务经理;中国国际金融股份有限公司运营支持部执行总经理、财务部负责人等职务。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。

杜季柳女士，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、本基金基金经理

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。

5、投资决策委员会成员

李永先生，工商管理硕士。历任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执行总经理。

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。

石玉女士，管理学硕士。简历同上。

魏孝先生，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策略研究员、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）基金托管人概况

名称:中国工商银行股份有限公司

注册地址:北京市西城区复兴门内大街55号

成立时间:1984年1月1日

法定代表人:易会满

注册资本:人民币35,640,625.71万元

联系电话:010-66105799

联系人:郭明

（二）主要人员情况

截至2017年3月末，中国工商银行资产托管部共有员工205人，平均年龄30岁，95%以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

（三）基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者，中国工商银行自1998年在国内首家提供托管服务以来，秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队，严格履行资产托管人职责，为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务，展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、基本养老保险、企业年金基金、QFII资产、QDII资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII专户资产、ESCROW等门类齐全的托管产品体系，同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至2017年3月，中国工商银行共托管证券投资基金709只。自2003年以来，本行连续十四年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的53项最佳托管银行大奖;是获得奖项最多的国内托管银行，优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

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

网站:www.ciccfund.com

（2）网上直销

交易系统:中金基金网上交易系统

交易系统网址:trade.ciccfund.com

2、其他销售机构

（1）中国中投证券有限责任公司

客服电话:95532

网站: http://www.china-invs.cn/

（2）上海联泰资产管理有限公司

客服电话: 021-52822063

网站: http://www.66zichan.com/

（3）平安证券有限责任公司

客服电话:95511

网址:http://stock.pingan.com

（4）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:张茹

电话:021-20613999

传真:021-68596919

客服电话:400-700-9665

网址:www.ehowbuy.com

（5）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

（6）蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

客服电话: 4000-766-123

网站:www.fund123.cn

（7）上海陆享投资管理有限公司

客服电话: 021-33356675

网站:http://www.luxxfund.com/

（8）长城证券股份有限公司

客服电话: 400-6666-888

网站:http://www.cgws.com/

（9）中国国际金融股份有限公司

注册地址: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

电话:010-65051166

传真:010-65058065

联系人:杨涵宇

网址:www.cicc.com.cn

（10）银河证券股份有限公司

客服电话:95551

网站:http://www.chinastock.com.cn/

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:上海市通力律师事务所

住所:上海市银城中路68号时代金融中心19楼

办公地址:上海市银城中路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:安冬、陆奇

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:管祎铭

四、基金的名称

中金金利债券型证券投资基金。

五、基金的类型与运作方式

（一）基金的类型

债券型证券投资基金。

（二）基金的运作方式

契约开放式。

六、基金的投资目标

在严格控制风险和保持流动性的基础上，通过积极主动的投资管理，力争实现基金资产长期稳健的增值。

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，包括国债、央行票据、金融债、次级债、地方政府债、企业债、公司债、中小企业私募债、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）、可转换债券（含可分离交易可转债的纯债部分，不可转股）、可交换债券（不可转股）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、国债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）。

本基金不投资股票、权证等权益类资产。

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:本基金投资于债券的比例不低于基金资产的80%。每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，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。

八、基金的投资策略

（一）资产配置策略

本基金为债券型基金，不直接从二级市场买入股票，也不参与一级市场新股申购或增发新股。本基金的资产配置策略主要是基于对宏观经济运行状况、货币政策、利率走势和证券市场政策分析等宏观基本面研究，结合对各大类资产的预期收益率、波动性及流动性等因素的评估，在约定的投资比例范围内确定各大类资产的中长期基本配置比例并进行调整。

（二）普通债券投资策略

1、债券类属配置策略

本基金将通过研究国民经济运行状况、货币市场及资本市场资金供求关系，分析国债、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，确定组合资产在不同债券类属之间配置比例并根据市场变化进行调整。

2、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等。

3、利率策略

本基金通过对经济运行状况，分析宏观经济运行可能情景的判研，预测财政政策、货币政策等政府宏观经济政策取向，分析金融市场资金供求状况变化趋势及结构，在此基础上预测金融市场利率水平变动趋势以及金融市场收益率曲线斜度变化趋势。组合久期是反映利率风险最重要的指标，根据对市场利率水平的变化趋势的预期，可以制定出组合的目标久期。如果预期利率下降，本基金将增加组合的久期，以较多地获得债券价格上升带来的收益;反之，本基金将缩短组合的久期，以减小债券价格下降带来的风险。

4、信用债券投资策略

本基金通过自下而上的策略，在信用类固定收益金融工具中精选个券，结合适度分散的行业配置策略，构造并优化投资组合。

（1）买入并持有策略

买入并持有策略是指选择信用风险可承担，期限与收益率相对合理的信用类产品持有到期，获取票息收益。选择买入并持有策略时，基金选券的原则包括:

1）债券的信用风险可承担。通过对债券的信用风险和收益进行分析，选择收益率较高、信用风险可承担的债券品种。

2）债券的信用利差合理。债券信用利差有明显的周期性变化，本基金可在信用利差较高并有减小趋势的情况下，加大买入并持有策略的力度。

3）债券的期限合理。根据利率市场的波动性，在相对高利率环境下，选择期限较长的品种，在相对低利率环境下，选择期限较短的品种。

（2）行业配置策略

基于深入的宏观信用环境、行业发展趋势等基本面研究，本基金将运用定性定量模型，在自下而上的个债精选策略基础上，采取适度分散的行业配置策略，从组合层面动态优化风险收益。

（3）利差轮动策略

信用债券的利差受到经济周期、行业周期等因素的影响具有周期性变化的特征，本基金将结合对经济周期和行业周期的判断，在预期利差将变大的情况下卖出此类债券，在预期利差缩小的情况下买入此类债券，以获取利差收益。

5、骑乘策略

骑乘策略是指当收益率曲线比较陡峭时，即相邻期限利差较大时，本基金将适当买入期限位于收益率曲线陡峭处的债券，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，从而此时债券的收益率水平将会较投资期初有所下降，通过债券收益率的下滑，进而获得资本利得收益。

6、息差策略

息差策略是指利用回购等方式融入低成本资金，购买较高收益的债券，以期获取超额收益的操作方式。

（三）中小企业私募债投资策略

对单个券种的分析判断与其它信用类固定收益品种的方法类似。在信用研究方面，本基金会加强自下而上的分析，将机构评级与内部评级相结合，着重通过发行方的财务状况、信用背景、经营能力、行业前景、个体竞争力等方面判断其在期限内的偿付能力，尽可能对发行人进行充分详尽地调研和分析。

（四）可转债债券投资策略

在分析宏观经济运行特征并对各类市场大势做出判断的前提下，本基金对可转债所对应的基础股票进行分析和研究，从行业选择和个券选择两方面进行全方位的评估，对盈利能力或成长性较好的行业和上市公司的可转债进行重点关注，对可转债投资价值进行有效的评估，选择投资价值较高的个券进行投资。

（五）可交换债券投资策略

可交换债券的价值主要取决于其股权价值、债券价值和内嵌期价值，本基金管理人将对可交换债券的价值进行评估，选择具有较高投资价值的可交换债券进行投资。此外，本基金还将根据新发可交换债券的预计中签率、模型定价结果，积极参与可交换债券新券的申购。

（六）资产支持证券投资策略

本基金将持续研究和密切跟踪国内资产支持证券品种的发展，将通过宏观经济、提前偿还率、资产池结构及资产池资产所在行业景气变化等因素的研究，预测资产池未来现金流变化，制定周密的投资策略。在具体投资过程中，重点关注标的证券发行条款、基础资产的类型，预测提前偿还率变化对标的证券的久期与收益率的影响，加强对未来现金流稳定性的分析。本基金将严格控制资产支持证券的总量规模，选择风险调整后的收益高的品种进行投资，实现资产支持证券对基金资产的最优贡献。

（七）国债期货投资策略

本基金投资国债期货以套期保值，回避市场风险为主要目的。结合国债交易市场和期货市场的收益性、流动性等情况，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作，获取超额收益。

九、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为:中债综合指数收益率。

中债综合指数由中央国债登记结算有限公司编制，该指数旨在综合反映债券全市场整体价格和投资回报情况。指数涵盖了银行间市场和交易所市场，具有广泛的市场代表性，基金管理人认为，该业绩比较基准目前能够忠实反映本基金的风险收益特征，适合作为本基金的业绩比较基准。

如果指数编制单位停止计算编制该指数、或今后法律规发生变化或更改指数名称、或有更适当的、更能为市场普遍接受业绩比较基准推出，本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则，经履行适当程序，调整业绩比较基准并及时公告，而无需召开基金份额持有人大会。

十、基金的风险收益特征

本基金为债券型基金，预期收益和风险水平低于混合型基金、股票型基金，高于货币市场基金。

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3月31日，报告期间为2017年1月1日至2017年3月31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	-	-
	其中:股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	345,335,000.00	63.34
	其中:债券	345,335,000.00	63.34
	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	78,590,437.89	14.42
	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	114,596,389.21	21.02
8	其他资产	6,647,757.85	1.22
9	合计	545,169,584.95	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

本基金本报告期末未持有股票资产。

（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股票资产。

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

本基金本报告期末未持有股票资产。

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	27,998,000.00	5.43
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	19,444,000.00	3.77
5	企业短期融资券	130,293,000.00	25.25
6	中期票据	20,124,000.00	3.90
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	147,476,000.00	28.58
9	其他	-	-
10	合计	345,335,000.00	66.93

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	111619166	16恒丰银行CD166	500,000	49,210,000.00	9.54
2	041652014	16南方水泥CP001	300,000	30,210,000.00	5.85
3	011698467	16洪涛装饰SCP001	300,000	29,982,000.00	5.81
4	041651044	16盈峰投资CP002	300,000	29,979,000.00	5.81
5	019513	15国债13	260,000	25,997,400.00	5.04

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。

10. 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。

（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。

（3）其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	7,104.74
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	6,640,653.11
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,647,757.85

（4）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。

（5）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股票。

（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。

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

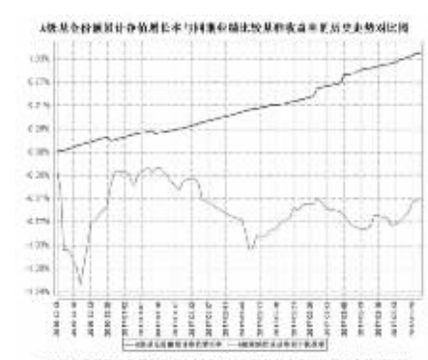
中金金利A

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
2016年12月13日（基金合同生效日）至2016年12月31日	0.14%	0.02%	-0.21%	0.25%	0.35%	-0.23%
2017年1月1日至2017年3月31日	0.96%	0.02%	-0.33%	0.07%	1.29%	-0.05%
基金合同生效日起至2017年3月31日	1.10%	0.02%	-0.54%	0.13%	1.64%	-0.11%

中金金利C

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
2016年12月13日（基金合同生效日）至2016年12月31日	0.13%	0.02%	-0.21%	0.25%	0.34%	-0.23%
2017年1月1日至2017年3月31日	0.82%	0.02%	-0.33%	0.07%	1.15%	-0.05%
基金合同生效日起至2017年3月31日	0.95%	0.02%	-0.54%	0.13%	1.49%	-0.11%

（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



注:本基金的基金合同生效日为2016年12月13日。按照本基金的基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。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）C类基金份额的销售服务费;

（4）《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;

（5）《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费;

（6）基金份额持有人大会费用;

（7）基