

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:2019年07月19日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事声明本报告书不存在虚假记载、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。基金托管人声明本报告书不存在虚假记载、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。保证不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

基金合同由基金管理人和基金托管人订立，基金份额持有人和基金管理人根据基金合同享有权利并承担义务；基金管理人和基金托管人按照基金合同约定对基金财产进行管理和运作。基金财产的保管由基金托管人负责，基金管理人按照基金合同和法律的规定管理和运用基金财产，其盈亏由基金财产承担，但基金管理人办理本基金的日常运作，其管理费收入按基金合同的规定从基金资产中计提，基金管理人不承担因未履行该等规定而引起的任何法律责任。

本报告书部分财务数据经审计，未经审计的财务数据以定期报告披露的数据为准。

本报告书所载数据截止至2019年6月30日。

§ 2 基金产品概况

基金名称 中融融安二号灵活配置混合型证券投资基金

基金代码 000729

基金运作方式 封闭型开放式

基金合同生效日 2018年09月20日

报告期末基金份额总额 120,043,034份

投资目标 本基金通过股票投资、债券等金融资产的动态灵活配置，合理控制风险，追求在严格控制风险的前提下，力争实现超越业绩比较基准的绝对收益。

投资策略 本基金将综合运用多种分析方法，结合宏观经济形势、政策环境、市场估值、行业景气度、公司基本面、估值水平、资金面、流动性、交易制度、市场情绪等多方面因素，通过定性和定量相结合的方法，精选具有投资价值的股票和债券品种，构建投资组合。

业绩比较基准 沪深300指数收益率*60%+上证国债指数收益率*40%

风险收益特征 本基金为混合型基金，其风险收益特征高于货币市场基金，低于股票型基金。

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

§ 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

报告期(2018年04月01日—2019年06月30日)

1.本期已实现收益 62,503.28

2.本期利润 -749,156.66

3.期末可供分配基金份额余额 -10,687

4.期末基金资产净值 120,222,000.72

5.期末基金份额净值 1.006

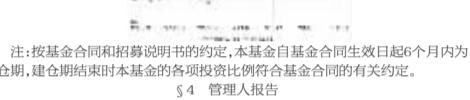
1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.上述本基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，例如：基金的申购赎回费等，计人费用后实际收益水平将低于所列数字。

3.2.1 本基金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

阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差
过去三个月	-0.07%	-0.00%	0.7%	-0.7%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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



注：按基金合同和招募说明的约定，本基金自基金合同生效日起6个月内为建仓期，建仓期结束时本基金的投资比例符合基金合同的有关规定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名 职务 任本基金的基金经理期限 证券从业年限 说明

李倩 中融融安二号灵活配置混合型证券投资基金基金经理 2018-10-21 11 李倩女士，中国国籍，毕业于对外经济贸易大学金融学院金融学专业，硕士研究生学历，具有基金从业资格。2007年2月至2014年7月任任中融基金固定收益部研究员，2014年7月加入中融基金管理有限公司，担任基金经理助理，2016年7月加入中融基金管理有限公司，担任基金经理。

2019年6月，李倩女士被任命为中融融安二号灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》及其他各项法律法规、基金合同和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合适用法律法规和基金合同的约定和约定期限，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据《证券投资基金管理办法》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。公司通过建立科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，在研究、决策、交易执行等环节，通过制度、流程、技术手段等各方面措施实现了公平对待所管理的投资组合，保证公平交易原则的实现。

本基金报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好，不同的投资组合受到了公平对待，未发生不公平的交易事件。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内未出现涉及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况。

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

5.4 报告期内单个投资者持有的基金份额比例达到或超过20%的情况

序号 姓名 持有基金份额比例 (%) 份额(份) 份额(份) 占基金资产净值比例 (%)

1 李倩 1.006 120,043,034 1.006

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《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

(3)基金管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

(4)公平交易制度的执行情况

(5)报告期末基金资产净值

(6)报告期末基金份额净值

(7)报告期末基金份额总额

(8)报告期末基金份额总金额

(9)报告期末机构投资者持有的基金份额总额

(10)报告期末机构投资者持有的基金资产净值

(11)报告期末持有机构投资者比例

(12)报告期末持有机构投资者的基金资产净值

(13)报告期末持有机构投资者的基金份额总额

(14)报告期末持有机构投资者的基金资产净值

(15)报告期末持有机构投资者的基金份额总额

(16)报告期末持有机构投资者的基金资产净值

(17)报告期末持有机构投资者的基金份额总额

(18)报告期末持有机构投资者的基金资产净值

(19)报告期末持有机构投资者的基金份额总额

(20)报告期末持有机构投资者的基金资产净值

(21)报告期末持有机构投资者的基金份额总额

(22)报告期末持有机构投资者的基金资产净值

(23)报告期末持有机构投资者的基金份额总额

(24)报告期末持有机构投资者的基金资产净值

(25)报告期末持有机构投资者的基金份额总额

(26)报告期末持有机构投资者的基金资产净值

(27)报告期末持有机构投资者的基金份额总额

(28)报告期末持有机构投资者的基金资产净值

(29)报告期末持有机构投资者的基金份额总额

(30)报告期末持有机构投资者的基金资产净值

(31)报告期末持有机构投资者的基金份额总额

(32)报告期末持有机构投资者的基金资产净值

(33)报告期末持有机构投资者的基金份额总额

(34)报告期末持有机构投资者的基金资产净值

(35)报告期末持有机构投资者的基金份额总额

(36)报告期末持有机构投资者的基金资产净值

(37)报告期末持有机构投资者的基金份额总额

(38)报告期末持有机构投资者的基金资产净值

(39)报告期末持有机构投资者的基金份额总额

(40)报告期末持有机构投资者的基金资产净值

(41)报告期末持有机构投资者的基金份额总额

(42)报告期末持有机构投资者的基金资产净值

(43)报告期末持有机构投资者的基金份额总额

(44)报告期末持有机构投资者的基金资产净值

(45)报告期末持有机构投资者的基金份额总额

(46)报告期末持有机构投资者的基金资产净值

(47)报告期末持有机构投资者的基金份额总额

(48)报告期末持有机构投资者的基金资产净值

(49)报告期末持有机构投资者的基金份额总额

(50)报告期末持有机构投资者的基金资产净值

(51)报告期末持有机构投资者的基金份额总额

(52)报告期末持有机构投资者的基金资产净值

(53)报告期末持有机构投资者的基金份额总额

(54)报告期末持有机构投资者的基金资产净值

(55)报告期末持有机构投资者的基金份额总额

(56)报告期末持有机构投资者的基金资产净值

(57)报告期末持有机构投资者的基金份额总额

(58)报告期末持有机构投资者的基金资产净值

(59)报告期末持有机构投资者的基金份额总额

(60)报告期末持有机构投资者的基金资产净值

(61)报告期末持有机构投资者的基金份额总额

(62)报告期末持有机构投资者的基金资产净值

(63)报告期末持有机构投资者的基金份额总额

(64)报告期末持有机构投资者的基金资产净值

(65)报告期末持有机构投资者的基金份额总额

(66)报告期末持有机构投资者的基金资产净值

(67)报告期末持有机构投资者的基金份额总额

(68)报告期末持有机构投资者的基金资产净值

(69)报告期末持有机构投资者的基金份额总额

(70)报告期末持有机构投资者的基金资产净值

(71)报告期末持有机构投资者的基金份额总额

(72)报告期末持有机构投资者的基金资产净值

(73)报告期末持有机构投资者的基金份额总额

(74)报告期末持有机构投资者的基金资产净值

(75)报告期末持有机构投资者的基金份额总额

(76)报告期末持有机构投资者的基金资产净值

(77)报告期末持有机构投资者的基金份额总额

(78)报告期末持有机构投资者的基金资产净值

(79)报告期末持有机构投资者的基金份额总额

(80)报告期末持有机构投资者的基金资产净值

(81)报告期末持有机构投资者的基金份额总额

(82)报告期末持有机构投资者的基金资产净值

(83)报告期末持有机构投资者的基金份额总额

(84)报告期末持有机构投资者的基金资产净值

(85)报告期末持有机构投资者的基金份额总额

(86)报告期末持有机构投资者的基金资产净值

(87)报告期末持有机构投资者的基金份额总额

(88)报告期末持有机构投资者的基金资产净值

(89)报告期末持有机构投资者的基金份额总额

(90)报告期末持有机构投资者的基金资产净值

(91)报告期末持有机构投资者的基金份额总额

(92)报告期末持有机构投资者的基金资产净值

(93)报告期末持有机构投资者的基金份额总额

(94)报告期末持有机构投资者的基金资产净值

(95)报告期末持有机构投资者的基金份额总额

(96)报告期末持有机构投资者的基金资产净值

(97)报告期末持有机构投资者的基金份额总额

(98)报告期末持有机构投资者的基金资产净值

(99)报告期末持有机构投资者的基金份额总额