

中金安心回报集合资产管理计划 2016 年年度报告

2016 年 12 月 31 日

集合计划管理人：中国国际金融股份有限公司

集合计划托管人：华夏银行股份有限公司

送出日期：2017 年 3 月 24 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

本报告由中金安心回报集合资产管理计划（“本集合计划”）管理人中国国际金融股份有限公司（“中金公司”）编制。

集合计划托管人华夏银行股份有限公司（“华夏银行”）根据本集合计划合同规定，于2017年3月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。

集合计划管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用本集合计划资产，但不保证本集合计划一定盈利，也不保证最低收益。

本集合计划的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本集合计划说明书。

本报告相关财务资料已经审计。

本报告期自2016年1月1日起至2016年12月31日止。

本报告书中的内容由管理人负责解释。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 集合计划简介	1
2.1 集合计划基本情况	1
2.2 集合计划产品说明	1
2.3 集合计划管理人和集合计划托管人.....	1
2.4 信息披露方式	2
2.5 其他相关资料	2
§3 主要财务指标、集合计划净值表现及利润分配情况	2
3.1 主要会计数据和财务指标.....	2
3.2 集合计划净值表现	3
3.3 过去三年集合计划的利润分配情况.....	4
§4 管理人报告	4
4.1 集合计划管理人及集合计划投资主办人情况	4
4.2 管理人对报告期内本集合计划运作遵规守信情况的说明.....	6
4.3 管理人对报告期内集合计划的投资策略和业绩表现的说明	6
4.4 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	7
4.5 管理人对报告期内集合计划利润分配情况的说明	7
§5 托管人报告	8
§6 审计报告签字页	9
§7 投资组合报告	11
7.1 期末集合计划资产组合情况	11
7.2 投资组合报告附注	11
§8 集合计划份额持有人信息	12
§9 集合计划份额变动	12
§10 重大事件揭示	13
10.1 集合计划管理人、集合计划托管人的专门托管部门的重大人事变动.....	13
10.1.2 集合计划托管人的专门托管部门的重大人事变动.....	13
10.2 涉及集合计划管理人、集合计划财产、集合计划托管业务的诉讼	13
10.3 集合计划投资策略的改变	13
10.4 为集合计划进行审计的会计师事务所情况.....	13
10.5 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	13
10.6 其他重大事件	13
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	14

11.1 集合计划托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	14
11.2 涉及基金托管业务的诉讼情况	14
11.3 集合计划托管人涉及托管业务的部门及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	14
11.4 影响投资者决策的其他重要信息.....	14
§12 备查文件目录	14
11.1 本集合计划备查文件目录	14
11.2 存放地点	14
11.3 查阅方式	14
§12 审计报告正文	15

§2 集合计划简介

2.1 集合计划基本情况

集合计划名称	中金安心回报集合资产管理计划
集合计划简称	中金安心回报
交易代码	920011
集合计划运作方式	非限定性、开放式
集合计划成立日	2010年3月29日
报告期末集合计划份额总额	34,802,276.01份
集合计划存续期	本集合计划不设固定存续期限

2.2 集合计划产品说明

投资目标	以集合计划资产保值增值为目标，力争控制组合最大损失额，获取管理期间的稳定收益。
投资策略	本集合计划以股票、债券及货币市场投资为主要投资工具，以参与新股发行及增发认购为收益增强手段，灵活运用多种投资策略，追求委托资产的稳定收益。
业绩比较基准	无
风险收益特征	本集合计划的风险收益特征呈现为中等风险、收益稳定，适合推广对象为风险承受能力适中、追求稳定回报的投资者或投资组合中稳定回报的配置部分。

2.3 集合计划管理人和集合计划托管人

项目	集合计划管理人	集合计划托管人
名称	中国国际金融股份有限公司	华夏银行股份有限公司
客户服务电话	800-810-8802（固话用户）； (010)6505-0105（手机用户）	010-95577
传真	8610 65059372	8610 85238680
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	北京市东城区建国门内大街22号华夏银行大厦
办公地址	北京市西城区太平桥18号丰融国际中心南楼17层	北京市东城区建国门内大街22号华夏银行大厦
邮政编码	100032	100005

法定代表人	丁学东	吴建
-------	-----	----

2.4 信息披露方式

登载集合计划年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.cicc.com.cn/AssetMgmt/
-----------------------	---

2.5 其他相关资料

项目	会计师事务所	注册登记机构
名称	毕马威华振会计师事务所 (特殊普通合伙)	中国证券登记结算有限责任公司
办公地址	中国北京东长安街1号东方广场东2座8层	中国北京市西城区金融大街27号投资广场22-23层

§3 主要财务指标、集合计划净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2016年	2015年	2014年
本期已实现收益	-340,368.79	22,887,514.97	5,784,087.89
本期利润	-1,954,980.91	20,183,671.76	8,660,286.49
加权平均集合计划份额本期利润	-0.0877	1.1056	0.2210
本期加权平均净值利润率	-6.03%	58.79%	20.80%
本期集合计划份额净值增长率	-8.52%	72.93%	29.94%
3.1.2 期末数据和指标	2016年	2015年	2014年
期末可供分配利润	16,114,801.21	13,288,227.12	9,139,374.29
期末可供分配集合计划份额利润	0.4630	1.0077	0.3186
期末集合计划资产净值	50,917,077.22	26,758,404.18	39,872,347.02
期末集合计划份额净值	1.4630	2.0293	1.3899
3.1.3 累计期末指标	2016年	2015年	2014年
集合计划份额累计净值增长率	127.56%	148.74%	43.84%

注：①所述集合计划业绩指标不包括持有人交易集合计划的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

②本期已实现收益指集合计划本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动损益）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损益。

③对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

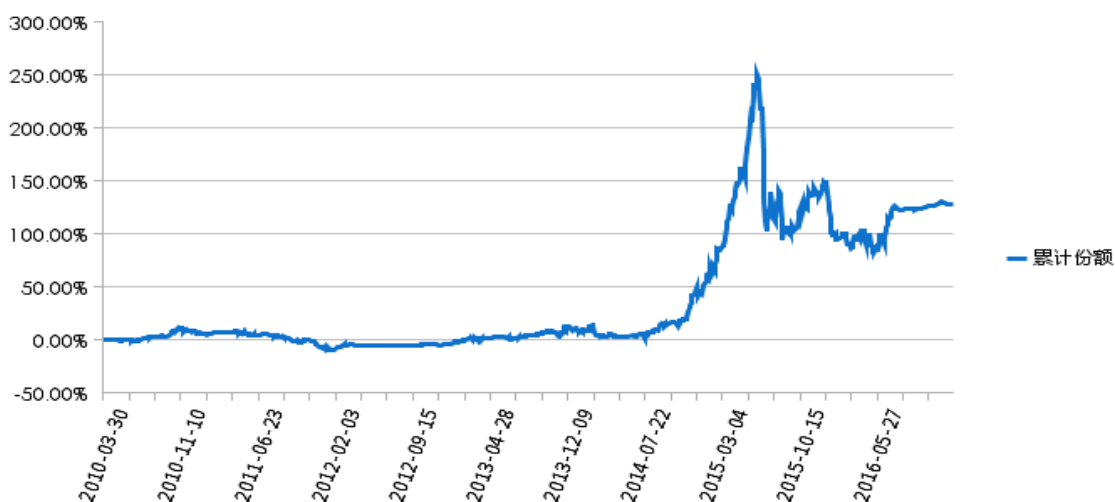
3.2 集合计划净值表现

3.2.1 集合计划份额净值增长率

阶段	份额净值增长率	份额净值增长率标准差
过去三个月	1.73%	0.20%
过去六个月	6.78%	0.40%
过去一年	-8.52%	1.32%
过去三年	105.58%	1.71%
过去五年	146.67%	1.37%
自集合计划成立至今	127.56%	1.20%

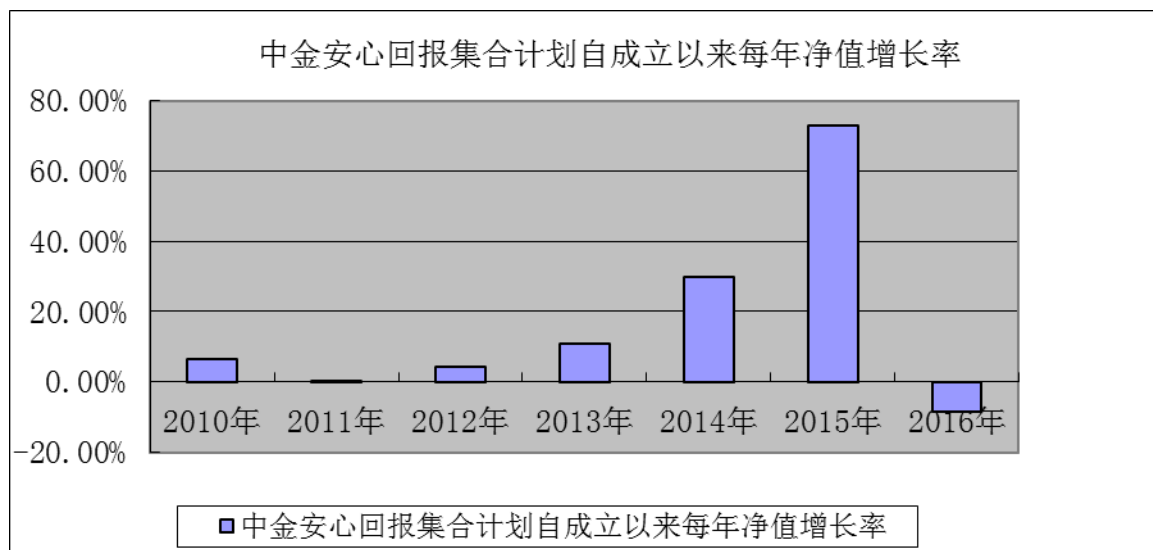
3.2.2 自集合计划成立以来集合计划份额累计净值增长率变动

中金安心回报集合资产管理计划份额累计净值增长率历史走势图
(2010年3月29日至2016年12月31日)



注：①根据本集合计划的集合计划合同规定，本集合计划自投资运作期开始之日起6个月内使集合计划的投资组合比例符合投资组合设计的要求。

3.2.3 自集合计划成立以来集合计划每年净值增长率



注：本集合计划于 2010 年 3 月 29 日成立，成立当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年集合计划的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每 10 份集合计划份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	管理人业绩报酬	本期利润分配合计	备注
2016	3.478	3,708,584.62	497,244.41	330,183.66	4,536,012.69	
2015	2.4	3,734,583.22	326,846.02	1,875,380.23	5,936,809.47	-
2014	0.012	51,385.08	2,905.46	0.00	54,290.54	
合计	5.890	7,494,552.92	826,995.89	2,205,563.89	10,527,112.70	-

§4 管理人报告

4.1 集合计划管理人及集合计划投资主办人情况

4.1.1 集合计划管理人及其管理集合计划的经验

中国国际金融股份有限公司（“中金公司”）是中国首家合资投资银行。截至 2016 年 12 月 31 日，持有中金公司全部已发行股份 5% 以上（含 5%）的股东为中央汇金投资有限责任公司、GIC Private Limited、TPG Asia V Delaware L.P.、KKR Institutions Investments L.P.、中国投融资担保股份有限公司和名力集团控股有限公司。

中金公司资产管理部成立于 2002 年，参照国际行业标准与国内监管要求，构建了面向境内外市场统一的资产管理业务平台、内部控制体系和风险管理流程，致力于为境内外客户提供全方位优质服务，实现客户资产的长期稳步增值。

中金公司资产管理业务牌照齐全、产品丰富，拥有全国社保基金管理人、企业年金投资管理人、保险资金投资管理人、境内集合/定向资产管理（定向专户）、QDII 集合/定向资产管理、人民币境外合格机构投资者（RQFII）、境外合格机构投资者（QFII）等多项业务资格，并在香港设立了独立的资产管理子公司，获得香港资产管理牌照。截至 2016 年 12 月 31 日，中金公司境内共管理 66 只集合计划，同时管理着多个全国社保基金、企业年金基金和定向资产管理业务账户。

4.1.2 集合计划投资主办人简介

姓名	职务	任本集合计划的 投资主办人期限		证券 从业 年限	说明
		任职日期	离任日期		
龚嘉斌	投资 经理	2016-7-28	-	6 年	龚嘉斌先生获清华大学经济管理学院金融硕士学位和清华大学物理学学士学位，现任中金公司资产管理部副总经理、FoF 投资经理兼 FoF 投资决策委员会成员。在此之前，龚嘉斌先生主要负责海外对冲基金母基金投资业务，在全球范围内进行策略配置和对冲基金遴选，对文艺复兴、保尔森基金、Brevan Howard、Citadel、Winton、景林资产等 600 多家知名对冲基金进行过尽职调查和策略研究，具有多年的策略配置和 FoF 投研经验。
文尽远	投资 经	2015-4-10	2016-7-27	9 年	文尽远先生，中国人民大学会计学硕士。2008 年加入中金公司，从事研究分析工作，先后担任中金公司资产

	理				管理部农业研究员，轻工研究员，食品饮料研究员，电力和环保行业研究员，投资经理助理。现任中金股票策略、中金配置、中金股票精选、中金安心回报集合资产管理计划投资经理。
--	---	--	--	--	---

注：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 管理人对报告期内本集合计划运作合规守信情况的说明

报告期内，本集合计划管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《证券公司客户资产管理业务管理办法》、《证券公司集合资产管理业务实施细则》、其他相关法律法规以及本集合计划说明书和合同的规定，本着诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用本集合计划资产。

报告期内，本集合计划合法合规运作，投资管理符合相关法律法规、本集合计划说明书和合同的规定，不存在违法违规、未履行合同承诺或损害本集合计划份额持有人利益的情形。

4.3 管理人对报告期内集合计划的投资策略和业绩表现的说明

4.3.1 本集合计划业绩表现

截至2016年12月31日，本集合计划份额净值为1.4630元，累计份额净值为2.0860元，本期净值增长率为-8.52%。

4.3.2 行情回顾及运作分析

中金安心回报集合资产管理计划成立于2010年3月，之前以权益类投资为主，力求为客户获取股市上涨带来的收益。但权益投资的波动性过高，特别是随着近年来经济结构性转型，预期股票长期回报率下行，权益投资相对风险日益增大。2016年初的熔断对投资组合的业绩影响较大。

为了更好的实现客户资产保值增值，自2016年8月以来，投资策略转型为资产配置策略，通过基本面分析和量化模型相结合，及时对市场的变化做出反应，在追求集合计划资产安全性的前提下，通过完全积极的运作在各类资产间进行动态配置，为投资者获取长期稳定的收益。

策略转型以来产品运行稳定，业绩平稳增长，截至 2016 年底，净值累计增长 4%，年化收益 9.6%，同期中证 800 指数涨幅 3.69%，中债综合财富指数跌幅为-0.63%。

4.4 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

债券市场方面，2017 年收益率走势预计先上后下，上半年 PPI 和 CPI 阶段性走高制约债券市场表现，此外通胀和防范金融风险去杠杆仍然是制约货币政策的主要因素，会对债券市场产生扰动，但考虑到当前估值已经具备一定配置价值，继续大幅下跌的概率较低，短期市场将处于震荡态势。预计全年债券市场的波动率将会加大，下半年市场环境或好于上半年。

操作上以短久期高收益债票息策略和长久期择时策略为主，精选资质较好的中票短融、PPN 及性价比较好的公司债，把握上半年加仓窗口，投资风格整体偏稳健，在把握性较大的情况下再尝试长久期的波段机会。

权益市场方面，当前经济保持较高景气度，目前 A 股年报披露步入密集期，盈利好转趋势有望延续，过去一个月沪深 300 指数 2017 年净利润市场一致预期已经有所上调，如果一季度经济超预期，则风险资产最为受益，目前 A 股总体而言利多大于利空。并且 2017 年市场若以慢牛和平稳震荡为主旋律，则风格突变和慢涨急跌等结构性特征亦会削弱，量化选股 Alpha 收益曲线将更为平滑，超额收益有望进一步增强。

4.5 管理人对报告期内集合计划利润分配情况的说明

年度	每 10 份集合计划份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	管理人业绩报酬	本期利润分配合计	备注
2016	3.478	3,708,584.62	497,244.41	330,183.66	4,536,012.69	-
合计	3.478	3,708,584.62	497,244.41	330,183.66	4,536,012.69	-

§5 托管人报告

中金安心回报集合资产管理计划 2016 年年度托管人报告

中金安心回报集合资产管理计划托管人——华夏银行股份有限公司，根据《中金安心回报集合资产管理计划集合资产管理合同》及其它有关法律文件，在集合资产管理计划运作过程中，严格遵守《证券公司客户资产管理业务管理办法》、《证券公司集合资产管理业务实施细则》及其他法律法规的规定，对中金安心回报集合资产管理计划 2016 年年度的投资运作进行了认真、独立的会计核算和投资监督，完全尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害中金安心回报集合资产管理计划份额持有人利益的行为。

托管人认为，报告期内，计划管理人中国国际金融股份有限公司在中金安心回报集合资产管理计划的投资运作、计划资产净值的计算、计划费用列支等方面，能够遵守《证券公司客户资产管理业务管理办法》等有关法律法规的规定和《中金安心回报集合资产管理计划集合资产管理合同》等有关法律文件的约定，未发现存在损害计划份额持有人利益的行为。

根据有关法律法规要求，托管人对计划管理人所编制的中金安心回报集合资产管理计划 2016 年年度报告中的财务指标、净值表现、投资组合报告等内容进行了认真、独立的会计核查，认为其真实、准确和完整。

华夏银行股份有限公司资产托管部

2017 年 3 月 24 日

§6 审计报告签字页

毕马威华振审字第 1701275 号

中金安心回报集合资产管理计划全体持有人:

我们审计了后附的第 1 页至第 22 页的中金安心回报集合资产管理计划 (以下简称“该集合计划”) 的财务报表, 包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表, 2016 年度的利润表、所有者权益 (集合计划净值) 变动表以及财务报表附注。这些财务报表已由该集合计划管理人按照财务报表附注 2 (以下简称“附注 2”) 所述的编制基础编制。

一、集合计划管理人对财务报表的责任

集合计划管理人负责按照附注 2 所述的编制基础编制财务报表 (包括确定附注 2 所述的编制基础对于在具体情况下编制财务报表的可接受性), 并负责设计、执行和维护必要的内部控制, 以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

二、注册会计师的责任

我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则, 计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序, 以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断, 包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时, 注册会计师考虑与财务报表编制相关的内部控制, 以设计恰当的审计程序, 但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价集合计划管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性, 以及评价财务报表的总体列报。

我们相信, 我们获取的审计证据是充分、适当的, 为发表审计意见提供了基础。

三、审计意见

我们认为, 该集合计划的上述财务报表在所有重大方面按照附注 2 所述的编制基础编制。

四、强调事项

我们提醒财务报表使用者关注, 如财务报表附注 4 所述, 截至本报告日止, 涉及该集合计划的部分税收法规尚未明确, 该财务报表中就此所作出的估计可能会根据日后出台的相关税务法规而作出调整。

审计报告 (续)

毕马威华振审字第 1701275 号

五、对分发和使用的限制

我们提醒财务报表使用者关注附注 2 对编制基础的说明。该集合计划的财务报表仅为按照有关法规要求提交给该集合计划持有人、该集合计划托管人、该集合计划管理人以及相关监管部门之目的而编制，仅供该集合计划持有人、该集合计划托管人、该集合计划管理人以及相关监管部门使用。因此，该财务报表可能不适用于其他用途。

本报告仅供该集合计划持有人、该集合计划托管人、该集合计划管理人以及相关监管部门为上述目的使用。除此之外，本报告不应被任何其他人士所依赖用于任何其他目的。我们对任何其他人士使用本报告产生的一切后果概不承担任何责任或义务。

上述第四部分和第五部分内容不影响已发表的审计意见。

毕马威华振会计师事务所 (特殊普通合伙)

中国注册会计师

程海良

中国 北京

管祎铭

2017 年 3 月 24 日

§7 投资组合报告

7.1 期末集合计划资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额（元）	占集合计划总资产比例
1	权益投资	5,243,790.32	8.80%
	其中：股票	5,243,790.32	8.80%
2	基金投资	702,080.69	1.18%
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	资产管理计划	5,014,281.49	8.41%
5	买入返售金融资产	38,200,000.00	64.10%
6	银行存款和结算备付金合计	10,329,429.96	17.33%
7	其他资产	105,500.42	0.18%
8	合计	59,595,082.88	100.00%

7.2 投资组合报告附注

7.2.1 声明本集合计划投资的前十名证券的发行主体本期是否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。

报告期内本集合计划投资的前十名证券的发行主体不存在其他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。

7.2.2 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	79,217.97
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	26,282.45
5	应收参与款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
	合计	105,500.42

7.2.3 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本集合计划报告期末未存在处于转股期的可转换债券。

7.2.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本集合计划报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

7.2.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§8 集合计划份额持有人信息

期末集合计划份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的集合计划份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
75.00	464,030.35	25,139,166.12	72.23%	9,663,109.89	27.77%

§9 集合计划份额变动

单位：份

集合计划成立日（2010年3月29日）份额总额	340,861,292.56
本报告期期初集合计划份额总额	13,186,039.25
本报告期集合计划总参与份额	22,770,394.46
减：本报告期集合计划总赎回份额	1,154,157.70
本报告期集合计划拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末集合计划份额总额	34,802,276.01

§10 重大事件揭示

10.1 集合计划管理人、集合计划托管人的专门托管部门的重大人事变动

报告期内，由于工作岗位调整，自 2016 年 07 月 28 日起，中金安心回报集合资产管理计划投资主办人员由文尽远先生变更为龚嘉斌先生。

10.1.2 集合计划托管人的专门托管部门的重大人事变动

报告期内，华夏银行股份有限公司公告以下重大人事变动：因工作安排，华夏银行资产托管部总经理毛剑鸣离任，且不再转任该公司其他岗位；陈秀良、徐昊光新任华夏银行资产托管部副总经理。

10.2 涉及集合计划管理人、集合计划财产、集合计划托管业务的诉讼

本报告期无涉及本集合计划管理人、集合计划财产、集合计划托管业务的诉讼事项。

10.3 集合计划投资策略的改变

本集合计划本报告期投资策略未发生改变。

10.4 为集合计划进行审计的会计师事务所情况

本集合计划本报告期应支付给毕马威华振会计师事务所的报酬为 80,000.00 元人民币。截至本报告期末，该事务所已向本集合计划提供 6 年的审计服务。

10.5 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，本集合计划管理人、托管人及其高级管理人员未发生受稽查或处罚等情况。

10.6 其他重大事件

报告期内，无其他重大事件

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 集合计划托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内，华夏银行股份有限公司公告以下重大人事变动：因工作安排，华夏银行资产托管部总经理毛剑鸣离任，且不再转任该公司其他岗位；陈秀良、徐昊光新任华夏银行资产托管部副总经理。

11.2 涉及基金托管业务的诉讼情况

无。

11.3 集合计划托管人涉及托管业务的部门及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

无。

11.4 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§12 备查文件目录

11.1 本集合计划备查文件目录

11.1.1 《中金安心回报集合资产管理计划说明书》（变更）

11.1.2 《中金安心回报集合资产管理计划集合资产管理合同》（变更）

11.1.3 《中金安心回报集合资产管理计划托管协议》

11.1.4 《关于核准中国国际金融有限公司设立中金安心回报集合资产管理计划的批复》

11.1.5 管理人业务资格批件、营业执照

11.2 存放地点

备查文件存放于集合计划管理人和/或集合计划托管人的住所。

11.3 查阅方式

投资者可到集合计划管理人、集合计划托管人的住所或集合计划管理人网站 <http://www.cicc.com.cn/AssetMgmt> 查阅备查文件或致电：800-810-8802（固话用户），(010)6505-0105（手机用户）查询。

§12 审计报告正文

中金安心回报集合资产管理计划

自 2016 年 1 月 1 日
至 2016 年 12 月 31 日止年度财务报表

审计报告

毕马威华振审字第 1701275 号

中金安心回报集合资产管理计划全体持有人：

我们审计了后附的第 1 页至第 22 页的中金安心回报集合资产管理计划（以下简称“该集合计划”）的财务报表，包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表，2016 年度的利润表、所有者权益（集合计划净值）变动表以及财务报表附注。这些财务报表已由该集合计划管理人按照财务报表附注 2（以下简称“附注 2”）所述的编制基础编制。

一、集合计划管理人对财务报表的责任

集合计划管理人负责按照附注 2 所述的编制基础编制财务报表（包括确定附注 2 所述的编制基础对于在具体情况下编制财务报表的可接受性），并负责设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

审计报告 (续)

毕马威华振审字第 1701275 号

二、注册会计师的责任

我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价集合计划管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。

我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

三、审计意见

我们认为，该集合计划的上述财务报表在所有重大方面按照附注 2 所述的编制基础编制。

四、强调事项

我们提醒财务报表使用者关注，如财务报表附注 4 所述，截至本报告日止，涉及该集合计划的部分税收法规尚未明确，该财务报表中就此所作出的估计可能会根据日后出台的相关税务法规而作出调整。

审计报告 (续)

毕马威华振审字第 1701275 号

五、对分发和使用的限制

我们提醒财务报表使用者关注附注 2 对编制基础的说明。该集合计划的财务报表仅为按照有关法规要求提交给该集合计划持有人、该集合计划托管人、该集合计划管理人以及相关监管部门之目的而编制，仅供该集合计划持有人、该集合计划托管人、该集合计划管理人以及相关监管部门使用。因此，该财务报表可能不适用于其他用途。

本报告仅供该集合计划持有人、该集合计划托管人、该集合计划管理人以及相关监管部门为上述目的使用。除此之外，本报告不应被任何其他人士所依赖于任何其他目的。我们对任何其他人士使用本报告产生的一切后果概不承担任何责任或义务。

上述第四部分和第五部分内容不影响已发表的审计意见。

毕马威华振会计师事务所 (特殊普通合伙)

中国注册会计师

程海良

中国 北京

管祎铭

2017 年 3 月 24 日

中金安心回报集合资产管理计划
资产负债表
2016年12月31日
(金额单位：人民币元)

资产	附注	2016年	2015年
银行存款	5	9,389,223.32	2,921,387.18
结算备付金		940,206.64	167,856.55
存出保证金		79,217.97	151,343.38
交易性金融资产	6	10,960,152.50	25,292,321.86
其中：股票投资		5,243,790.32	23,291,921.86
债券投资		-	2,000,400.00
基金投资		702,080.69	-
理财产品投资		5,014,281.49	-
买入返售金融资产	7	38,200,000.00	-
应收利息	8	26,282.45	116,252.23
资产合计		<u>59,595,082.88</u>	<u>28,649,161.20</u>

刊载于第 6 页至第 22 页的财务报表附注为本财务报表的组成部分。

中金安心回报集合资产管理计划

资产负债表 (续)

2016年12月31日

(金额单位：人民币元)

	附注	2016年	2015年
负债和所有者权益			
负债			
应付证券清算款		7,781,036.66	968,222.69
应付管理人报酬		36,527.51	13,235.15
应付托管费		8,652.37	4,411.70
应付交易费用	9	24,768.02	77,866.38
其他负债	10	827,021.10	827,021.10
负债合计		<u>8,678,005.66</u>	<u>1,890,757.02</u>
所有者权益			
实收基金	11	34,802,276.01	13,186,039.25
未分配利润	12	16,114,801.21	13,572,364.93
所有者权益合计		<u>50,917,077.22</u>	<u>26,758,404.18</u>
负债和所有者权益合计		<u>59,595,082.88</u>	<u>28,649,161.20</u>
集合计划份额 (份)：		34,802,276.01	13,186,039.25
集合计划份额净值：		1.4630	2.0293

此财务报表已获本集合计划管理人批准。

林寿康

管理委员会成员

冯平

资产管理部负责人

公司盖章

日期：2017年3月24日

刊载于第6页至第22页的财务报表附注为本财务报表的组成部分。

中金安心回报集合资产管理计划

利润表

2016 年度

(金额单位：人民币元)

	附注	2016 年	2015 年
收入			
利息收入		393,849.72	130,634.49
其中：存款利息收入	13	76,494.98	39,630.62
债券利息收入		18,352.86	83,878.52
买入返售金融资产收入		299,001.88	7,125.35
投资收益		16,895.23	23,910,381.78
其中：股票投资净收益	14	72,228.71	24,051,515.25
基金投资净损失	15	(89,444.79)	(231,622.77)
债券投资净 (损失) / 收益	16	(59,633.10)	330.00
股利收益	17	93,744.41	90,159.30
公允价值变动净损失	18	(1,614,612.12)	(2,703,843.21)
其他收入	19	-	284.51
(损失) / 收入合计		<u>(1,203,867.17)</u>	<u>21,337,457.57</u>
减：费用			
管理人报酬	23(c)iv	204,702.88	205,564.84
托管费	23(c)v	64,710.83	68,521.68
交易费用	20	395,500.03	781,499.29
其他费用	21	86,200.00	98,200.00
费用合计		<u>751,113.74</u>	<u>1,153,785.81</u>
净 (亏损) / 利润		<u>(1,954,980.91)</u>	<u>20,183,671.76</u>

刊载于第 6 页至第 22 页的财务报表附注为本财务报表的组成部分。

中金安心回报集合资产管理计划
所有者权益 (集合计划净值) 变动表
2016 年度
(金额单位：人民币元)

	附注	<u>实收基金</u> (附注 11)	<u>未分配利润</u> (附注 12)	<u>所有者权益合计</u>
年初所有者权益 (集合计划净值)		13,186,039.25	13,572,364.93	26,758,404.18
本年经营活动产生的集合计划 净值变动数 (本年净亏损)		-	(1,954,980.91)	(1,954,980.91)
本年集合计划份额交易产生的 集合计划净值变动数		21,616,236.76	9,033,429.88	30,649,666.64
其中：集合计划参与款		22,770,394.46	9,556,849.95	32,327,244.41
集合计划退出款		(1,154,157.70)	(523,420.07)	(1,677,577.77)
本年向集合计划份额持有人分配利润 产生的集合计划净值变动	22	-	(4,536,012.69)	(4,536,012.69)
年末所有者权益 (集合计划净值)		<u>34,802,276.01</u>	<u>16,114,801.21</u>	<u>50,917,077.22</u>

刊载于第 6 页至第 22 页的财务报表附注为本财务报表的组成部分。

中金安心回报集合资产管理计划
所有者权益 (集合计划净值) 变动表 (续)
2015 年度
(金额单位：人民币元)

	附注	<u>实收基金</u>	<u>未分配利润</u>	<u>所有者权益合计</u>
年初所有者权益 (集合计划净值)		28,688,020.02	11,184,327.00	39,872,347.02
本年经营活动产生的集合计划 净值变动数 (本年净利润)		-	20,183,671.76	20,183,671.76
本年集合计划份额交易产生的 集合计划净值变动数		(15,501,980.77)	(11,858,824.36)	(27,360,805.13)
其中：集合计划参与款		492,124.76	280,221.26	772,346.02
集合计划退出款		(15,994,105.53)	(12,139,045.62)	(28,133,151.15)
本年向集合计划份额持有人分配利润 产生的集合计划净值变动	22	-	(5,936,809.47)	(5,936,809.47)
年末所有者权益 (集合计划净值)		<u>13,186,039.25</u>	<u>13,572,364.93</u>	<u>26,758,404.18</u>

刊载于第 6 页至第 22 页的财务报表附注为本财务报表的组成部分。

中金安心回报集合资产管理计划
财务报表附注
(金额单位：人民币元)

1 基本情况

中金安心回报集合资产管理计划（“本集合计划”）是依据中国证券监督管理委员会（“中国证监会”）于 2003 年 12 月发布的《证券公司客户资产管理业务试行办法》以及于 2008 年 5 月发布的《证券公司集合资产管理业务实施细则（试行）》设立的非限定性集合资产管理计划。本集合计划的管理人为中国国际金融股份有限公司（“中金公司”），托管人为华夏银行股份有限公司（“华夏银行”）。中金公司于 2010 年 1 月 14 日取得了中国证监会出具的《关于核准中国国际金融有限公司设立中金安心回报集合资产管理计划的批复》（证监机构字 [2010] 53 号）。

本集合计划由中金公司和华夏银行作为推广机构，自 2010 年 3 月 8 日至 2010 年 3 月 24 日进行推广。本集合计划于 2010 年 3 月 29 日成立，成立之日集合计划实收份额为 340,861,292.56 份（含利息转份额 97,847.56 份），发行价格为人民币 1.00 元。该资金已由毕马威华振会计师事务所审验并出具验资报告。

本集合计划不设固定存续期，主要投资的标的物为符合法律法规及监管规定的金融工具，包括现金、银行存款、正回购、逆回购、银行理财计划、货币市场基金，债券（包括国债、央行票据、金融债、公司债、企业债、中期票据、资产支持证券、资产支持票据、资产支持收益凭证、短期融资券、超短期融资券、次级债、永续债、非公开发行定向融资工具、非公开发行公司债、同业存单、国债期货、可转债（含分离交易的可转债）、可交换债）、债券型基金，股票（包括二级市场买入的股票、因新股申购或参与公开增发或定向增发中签或获配的股票）、股票型基金，股指期货、国债期货、商品期货等金融衍生品，已在中国证券投资基金业协会备案的证券公司集合资产管理计划、等金融监管部门批准或备案发行的金融产品、以及其他中国证监会认可的投资品种。

2 财务报表编制基础

本集合计划财务报表是以持续经营为基础编制的。

本财务报表仅为按照有关法规要求向本集合计划持有人、本集合计划托管人、本集合计划管理人以及相关监管部门提供信息之目的而编制，并仅供上述使用者为上述目的使用。

本财务报表附注中不披露风险管理和公允价值相关内容。因此，本财务报表不是一份完整的财务报表，也不包含一份完整财务报表所应披露的所有会计政策及附注。

本财务报表根据以下附注 3 中所述的会计政策编制，这些会计政策符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则的要求，同时按照中国证券业协会于 2012 年 10 月 19 日颁布的《证券公司客户资产管理业务估值方法指引》的规定编制，亦参照了中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》的规定。

3 主要会计政策

(1) 会计年度

本集合计划财务报表的会计年度自公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

(2) 记账本位币

本集合计划的记账本位币为人民币，编制财务报表采用的货币为人民币。本集合计划选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

(3) 金融资产及金融负债的分类

本集合计划在初始确认时按取得资产或承担负债的目的，把金融资产和金融负债分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债、应收款项、可供出售金融资产、持有至到期投资及其他金融负债。本集合计划现无金融资产分类为持有至到期投资和可供出售金融资产。本集合计划现无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

本集合计划目前持有的投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

(4) 金融资产及金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产和金融负债在本集合计划成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

初始确认后，金融资产和金融负债的后续计量如下：

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债以公允价值计量，公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益。

应收款项以实际利率法按摊余成本计量。

除以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债以外的金融负债采用实际利率法按摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产的现金流量的合同权利终止或将所有权上几乎所有的风险和报酬转移时，本集合计划终止确认该金融资产。

金融资产转移满足终止确认条件的，本集合计划将下列两项金额的差额计入当期损益：

- 所转移金融资产的账面价值
- 因转移而收到的对价

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，本集合计划终止确认该金融负债或其一部分。

(5) 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本集合计划按下述原则计量公允价值：

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本集合计划估计公允价值时，考虑市场参与者在计量日对相关资产或负债进行定价时考虑的特征（包括资产状况及所在位置、对资产出售或者使用的限制等），并采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术。

存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大的事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本集合计划特定相关的参数。

(6) 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- 本集合计划具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；
- 本集合计划计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

(7) 实收基金

实收基金为对外发行集合计划份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于集合计划份额拆分引起的实收基金份额变动于集合计划份额拆分日根据拆分前的集合计划份额数及确定的拆分比例计算确认。由于参与和退出引起的实收基金份额变动分别于集合计划份额参与确认日及集合计划份额退出确认日确认。

(8) 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在参与或退出集合计划份额时，参与或退出款项中包含的按累计未分配的已实现收益或未弥补的已实现亏损占集合计划净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在参与或退出集合计划份额时，参与或退出款项中包含的按累计未实现利得（或损失）占集合计划净值比例计算的金额。损益平准金于集合计划份额参与确认日或集合计划份额退出确认日进行确认和计量，并于期末全额转入未分配利润或未弥补亏损。

(9) 收入 / (损失) 确认

收入是本集合计划在日常活动中形成的、会导致所有者权益增加且与所有者投入资本无关的经济利益的总流入。收入在其金额及相关成本能够可靠计量、相关的经济利益很可能流入本集合计划、并且同时满足以下不同类型收入的其他确认条件时，予以确认。

投资收益按相关金融资产于处置日成交金额与其成本的差额确认。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

货币市场基金，按基金管理公司公布的估值日每万份收益计提红利基金红利收入；其他类型基金于除权日按基金管理公司公布的收益分配方案计算确认。

分红收益按宣告的分红比例计算的金额确认。

债券利息收入按债券投资的票面价值与票面利率计算的金额，并扣除适用情况下代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，逐日计提利息收入。如票面利率与实际利率出现重大差异，按实际利率计算利息收入。

存款利息收入按每日存款余额与适用的利率逐日计提。

买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额，在回购期内按实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的收入差异较小的可采用直线法。

公允价值变动净收益 / (损失) 核算集合计划持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产、衍生金融资产、以公允价值计量且变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。

(10) 费用确认

管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按集合计划合同约定的费率和计算方法确认。

投资交易时发生的交易费用于交易日确认并作为集合计划费用计入当期损益。

卖出回购金融资产利息支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额，在回购期内以实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的支出差异较小的可采用直线法。

其他费用如不影响估值日集合计划份额净值小数点后第四位，发生时直接计入集合计划损益；如果影响集合计划份额净值小数点后第四位的，应采用待摊或预提的方法，待摊或预提计入集合计划损益。

(11) 集合计划的收益分配政策

本集合计划的每一份额享有集合计划份额收益的同等分配权。集合计划份额收益以现金形式分配，集合计划持有人可以选择现金红利或按分红除权日的集合计划份额单位净值转为集合计划份额。收益分配必须符合以下条件：

- (a) 当年的集合计划份额收益应先弥补上一年度亏损，再进行当年的收益分配；
- (b) 收益分配基准日的份额净值减去每单位份额收益分配金额后不能低于面值。

法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

(12) 分部报告

本集合计划以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部。

本集合计划目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

(13) 其他重要的会计政策和会计估计

根据本集合计划的估值原则并参照中国证监会允许的证券投资基金行业估值实务操作，本集合计划确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于特殊事项停牌股票，根据中国证监会公告 [2008] 38 号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，本集合计划参考《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》对重大影响集合计划资产净值的特殊事项停牌股票进行估值。

对于在锁定期内的非公开发行股票，参照中国证监会证监会计字 [2007] 21 号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》(以下简称“《证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价的通知》”)，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易所交易天数占锁定期内总交易所交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

4 税项

本集合计划运作过程中涉及的各项纳税事项，依照财政部、国家税务总局的相关规定以及其他相关规定执行。主要税项列示如下：

(a) 增值税

根据财政部和国家税务总局发布的《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》(财税[2016]36号)、《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》(财税[2016]140号)及《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》(财税[2017]2号)，自2016年5月1日起，金融业纳入“营改增”试点范围；自2017年7月1日(含)以后，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，按照现行规定缴纳增值税；对资管产品在2017年7月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

(b) 所得税

截至 2016 年 12 月 31 日，财政部和国家税务总局并未出台针对客户资产管理业务纳税问题的具体规定。因此，截至 2016 年 12 月 31 日，本集合计划没有计提有关所得税费用。如果涉及本集合计划业务的有关税收法规颁布，本集合计划所涉及的所得税可能会根据日后出台的相关税务法规而作出调整。

(c) 印花税

本集合计划于 2016 年度进行的证券交易所适用的印花税税率为 0.10%，根据财政部和国家税务总局的有关规定，证券（股票）交易印花税征收方式为单边征收，即仅对出让方按 0.10% 的税率征收印花税，对受让方不再征税。

(d) 代扣代缴个人所得税

根据《中华人民共和国个人所得税法》、《国家税务总局关于加强企业债券利息个人所得税代扣代缴工作的通知》（国税函 [2003] 612 号）、《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》（财税 [2012] 85 号）及《财政部国家税务总局证监会关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》（财税 [2015] 101 号）及其他相关税务法规的规定，个人投资者直接投资股票或债券的，上市公司及债券兑付机构派发或支付给个人投资者的股息红利及债券利息收入应由上市公司及债券兑付机构对相应个人所得税进行代扣代缴。本集合计划收取的股息红利及债券利息尚未由上市公司及债券兑付机构于派发或支付时代扣代缴个人所得税。截至目前，由于没有专门针对集合资产管理计划作为上述股息红利及债券利息个人所得税代扣代缴义务人的明确税务规定，经与托管行协商一致，从 2013 年 1 月 1 日起，本集合计划对所取得的股息红利收入不计提股息红利个人所得税；从 2013 年 7 月 1 日起，本集合计划在实际取得债券利息收入时按收到的利息金额确认收入，不计提债券利息个人所得税。如果上述税务事项的最终认定结果与估计存在差异，该差异将可能对作出上述最终认定期间的应代扣代缴所得税和所有者权益金额产生影响。

5 银行存款

	<u>2016 年</u>	<u>2015 年</u>
活期存款	<u>9,389,223.32</u>	<u>2,921,387.18</u>
合计	<u>9,389,223.32</u>	<u>2,921,387.18</u>

6 交易性金融资产

	<u>2016 年</u>		
	<u>成本</u>	<u>公允价值</u>	<u>估值 (减) / 增值</u>
股票投资	5,356,839.14	5,243,790.32	(113,048.82)
基金投资	707,204.96	702,080.69	(5,124.27)
资产管理计划投资	<u>5,000,000.00</u>	<u>5,014,281.49</u>	<u>14,281.49</u>
合计	<u>11,064,044.10</u>	<u>10,960,152.50</u>	<u>(103,891.60)</u>

	<u>2015 年</u>		
	<u>成本</u>	<u>公允价值</u>	<u>估值增 / (减) 值</u>
股票投资	21,727,601.34	23,291,921.86	1,564,320.52
债券投资			
其中：交易所债券	<u>2,054,000.00</u>	<u>2,000,400.00</u>	<u>(53,600.00)</u>
债券投资小计	<u>2,054,000.00</u>	<u>2,000,400.00</u>	<u>(53,600.00)</u>
合计	<u>23,781,601.34</u>	<u>25,292,321.86</u>	<u>1,510,720.52</u>

7 买入返售金融资产

	<u>2016 年</u>	<u>2015 年</u>
交易所买入返售金融资产	<u>38,200,000.00</u>	<u>-</u>

8 应收利息

	<u>2016 年</u>	<u>2015 年</u>
应收活期存款利息	1,387.16	729.89
应收结算备付金利息	465.41	83.05
应收债券利息	-	115,364.38
应收买入返售证券利息	24,390.72	-
应收保证金利息	39.16	74.91
合计	<u>26,282.45</u>	<u>116,252.23</u>

9 应付交易费用

	<u>2016 年</u>	<u>2015 年</u>
交易所市场应付交易费用	<u>24,768.02</u>	<u>77,866.38</u>
合计	<u>24,768.02</u>	<u>77,866.38</u>

本集合计划于报告期期末的交易所市场应付交易费用为本集合计划通过中金公司席位进行交易而应付中金公司的佣金。

10 其他负债

	<u>2016 年</u>	<u>2015 年</u>
代扣代缴个人所得税	747,021.10	747,021.10
应付专业服务费	<u>80,000.00</u>	<u>80,000.00</u>
合计	<u>827,021.10</u>	<u>827,021.10</u>

11 实收基金

	2016 年	
	集合计划份额 (份)	账面金额
年初余额	13,186,039.25	13,186,039.25
本年参与	22,770,394.46	22,770,394.46
本年退出	<u>(1,154,157.70)</u>	<u>(1,154,157.70)</u>
年末余额	<u>34,802,276.01</u>	<u>34,802,276.01</u>

12 未分配利润

	2016 年		
	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
年初余额	13,288,227.12	284,137.81	13,572,364.93
本年亏损	(340,368.79)	(1,614,612.12)	(1,954,980.91)
本年集合计划份额交易			
产生的变动数	11,259,877.82	(2,226,447.94)	9,033,429.88
其中：集合计划参与款	11,851,915.18	(2,295,065.23)	9,556,849.95
集合计划退出款	(592,037.36)	68,617.29	(523,420.07)
本年已分配利润	<u>(4,536,012.69)</u>	<u>-</u>	<u>(4,536,012.69)</u>
年末余额	<u>19,671,723.46</u>	<u>(3,556,922.25)</u>	<u>16,114,801.21</u>

13 存款利息收入

	2016 年	2015 年
活期存款利息收入	70,118.56	34,048.90
结算备付金利息收入	4,890.57	3,704.56
结算保证金利息收入	<u>1,485.85</u>	<u>1,877.16</u>
合计	<u>76,494.98</u>	<u>39,630.62</u>

14	股票投资净收益		
		<u>2016年</u>	<u>2015年</u>
	卖出股票成交总额	148,415,300.18	274,661,577.53
	减：卖出股票成本总额	<u>148,343,071.47</u>	<u>250,610,062.28</u>
	股票投资净收益	<u>72,228.71</u>	<u>24,051,515.25</u>
15	基金投资净损失		
		<u>2016年</u>	<u>2015年</u>
	卖出/赎回基金成交总额	2,008,172.35	7,600,746.73
	减：卖出/赎回基金成本总额	<u>2,097,617.14</u>	<u>7,832,369.50</u>
	基金投资净损失	<u>(89,444.79)</u>	<u>(231,622.77)</u>
16	债券投资净 (损失) / 收益		
		<u>2016年</u>	<u>2015年</u>
	卖出债券成交总额	4,524,317.49	306,429.37
	减：卖出债券成本总额	4,420,997.00	301,170.00
	减：应收利息总额	<u>162,953.59</u>	<u>4,929.37</u>
	债券投资净 (损失) / 收益	<u>(59,633.10)</u>	<u>330.00</u>
17	股利收益		
		<u>2016年</u>	<u>2015年</u>
	股票投资产生的股利收益	89,744.41	89,159.30
	基金投资产生的红利收益	<u>4,000.00</u>	<u>1,000.00</u>
	合计	<u>93,744.41</u>	<u>90,159.30</u>

18 公允价值变动净损失

	<u>2016 年</u>	<u>2015 年</u>
交易性金融资产		
- 股票投资	(1,677,369.34)	(2,650,243.21)
- 债券投资	53,600.00	(53,600.00)
- 基金投资	(5,124.27)	-
- 资产管理计划投资	14,281.49	-
合计	<u>(1,614,612.12)</u>	<u>(2,703,843.21)</u>

19 其他收入

	<u>2016 年</u>	<u>2015 年</u>
集合计划退出费收入	<u>-</u>	<u>284.51</u>

根据本集合计划合同及说明书的有关规定，本集合计划退出费由委托人承担。退出费中 25% 归入集合计划资产，其余部分用于支付注册登记费和其他必要的手续费。

20 交易费用

	<u>2016 年</u>	<u>2015 年</u>
交易所市场交易费用	<u>395,500.03</u>	<u>781,499.29</u>

21 其他费用

	<u>2016 年</u>	<u>2015 年</u>
专业服务费用	80,000.00	80,000.00
账户维护费用	6,000.00	18,000.00
上清所数字证书服务费用	200.00	200.00
合计	<u>86,200.00</u>	<u>98,200.00</u>

22 利润分配情况

本集合计划于 2016 年度的利润分配情况如下：

权益登记日	除息日	每 10 份	现金	再投资	计提管理人	本年利润
		集合计划	形式发放总额	形式发放总额	业绩报酬总额	分配合计
		份额分红数	人民币元	人民币元	人民币元	人民币元
2016 年 4 月 20 日	2016 年 4 月 20 日	3.7487	<u>3,708,584.62</u>	<u>497,244.41</u>	<u>330,183.66</u>	<u>4,536,012.69</u>
合计			<u>3,708,584.62</u>	<u>497,244.41</u>	<u>330,183.66</u>	<u>4,536,012.69</u>

本集合计划于 2015 年度的利润分配情况如下：

权益登记日	除息日	每 10 份	现金	再投资	计提管理人	本年利润
		集合计划	形式发放总额	形式发放总额	业绩报酬总额	分配合计
		份额分红数	人民币元	人民币元	人民币元	人民币元
2015 年 2 月 2 日	2015 年 2 月 2 日	2.40	<u>3,734,583.22</u>	<u>326,846.02</u>	<u>1,875,380.23</u>	<u>5,936,809.47</u>
合计			<u>3,734,583.22</u>	<u>326,846.02</u>	<u>1,875,380.23</u>	<u>5,936,809.47</u>

23 关联方及其交易

(a) 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

(b) 本集合计划关联方

<u>关联方名称</u>	<u>与本集合计划关系</u>
中金公司	管理人及推广机构
华夏银行	托管人及代理推广机构
中金稳益 1 号集合资产管理计划	管理人管理的集合计划

(c) 关联方交易

i) 报告期末本集合计划投资于集合计划管理人管理的其他集合计划的情况

	<u>2016年12月31日</u>	<u>2015年12月31日</u>
关联方	投资账面价值	投资账面价值
中金稳益1号集合资产管理计划	5,014,281.49	-

ii) 通过关联方交易单元进行的交易

<u>2016年</u>			
<u>关联方名称</u>	<u>交易类别</u>	<u>成交金额</u>	<u>占当年该类别成交总额比例</u>
中金公司	股票交易	280,387,609.45	100.00%
中金公司	回购交易	599,200,000.00	100.00%
中金公司	基金交易	4,808,994.45	100.00%

<u>2015年</u>			
<u>关联方名称</u>	<u>交易类别</u>	<u>成交金额</u>	<u>占当年该类别成交总额比例</u>
中金公司	股票交易	513,759,865.42	100.00%
中金公司	回购交易	70,000,000.00	100.00%
中金公司	基金交易	15,432,116.23	100.00%

iii) 应支付关联方的佣金

<u>2016年</u>				
<u>关联方名称</u>	<u>当年佣金</u>	<u>占当年佣金总额的比例</u>	<u>年末应付佣金余额</u>	<u>占年末应付佣金总额的比例</u>
中金公司	222,077.41	100.00%	24,768.02	100.00%

<u>关联方名称</u>	<u>当年佣金</u>	<u>2015 年</u>		
		<u>占当年佣金 总额的比例</u>	<u>年末应付 佣金余额</u>	<u>占年末应付佣 金总额的比例</u>
中金公司	452,906.19	100.00%	77,866.38	100.00%

上述佣金按市场佣金率计算,以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

iv) 集合计划管理人报酬

	<u>2016 年</u>	<u>2015 年</u>
当年应支付的管理费	204,702.88	205,564.84
当年应支付的管理人业绩报酬	360,988.65	3,056,736.18

按照持有人、管理人和托管人三方签订的集合资产管理合同规定,管理费按前一日资产净值的 1%的年费率按日计提,按月支付,由托管人于次月从本集合计划资产中支付予管理人。管理人业绩报酬则在本集合计划分红日、持有人退出日和本集合计划终止日时以相关年化收益率作为计提基准进行计算,从分红资金或退出资金中扣除。

v) 集合计划托管费

	<u>2016 年</u>	<u>2015 年</u>
当年发生的应支付的托管费	64,710.83	68,521.68

本集合计划自成立之日起下一日计提托管费。本集合计划的托管费按前一日集合计划资产净值的 0.20%年费率计算。

vi) 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本集合计划在 2016 年度与上年度均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

vii) 由关联方保管的银行存款余额及当年产生的利息收入

2016 年		
<u>关联方名称</u>	<u>银行存款年末余额</u>	<u>当年利息收入</u>
华夏银行	9,389,223.32	70,118.56

2015 年		
<u>关联方名称</u>	<u>银行存款年末余额</u>	<u>当年利息收入</u>
华夏银行	2,921,387.18	34,048.90

本集合计划的银行存款由本集合计划托管人华夏银行保管，按 0.72% 的利率计息。

viii) 本集合计划在承销期内参与关联方承销证券的情况

本集合计划在 2016 年度与上年度均未在承销期内参与认购关联方承销的证券。

24 年末本集合计划持有的流通受限证券

(1) 因认购新发 / 增发证券而于年末持有的流通受限证券

于 2016 年 12 月 31 日，本集合计划未持有因认购新发 / 增发证券而持有的流通受限证券。

(2) 年末持有的暂时停牌等流通受限股票

于 2016 年 12 月 31 日，本集合计划持有因暂时停牌而流通受限的股票账面价值为人民币 362,478.79 元。

25 或有或承诺事项

截至本集合计划财务报表批准报出日，本集合计划无需作披露的重大或有或承诺事项。

26 资产负债表日后事项

本集合计划于 2017 年 1 月 17 日每 10 份集合计划份额派发红利人民币 4.23 元，共计人民币 14,470,029.69 元。除以上事项外，本集合计划无其他资产负债表日后事项。