中融上海浦东新区1期-15年高等级信用债集发起式证券投资基金2019年第2季度报告

2019-04-15

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

报告送出日期：2019-07-19

重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对报告内容的真实性、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2019年7月19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基金的招募说明书。

本报告财务数据未经审计。

本报告期2019年01月01日至2019年03月31日。

基金基本情况

项目	内容
基金简称	中融新利3年(中长期信用债债券)
交易代码	001981
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018-12-27
报告期末基金份额总额	10,928,326.34
投资目标	本基金采用稳定风险收益的投资理念，通过严格的信用分析和审慎稳定的风险管理方法，以实现风险收益比的最优化和稳健。
投资策略	1、资产配置策略 2、债券投资策略 3、资产支持证券投资策略 4、股指期货策略 5、国债期货投资策略 6、中小企业私募债投资策略
业绩比较基准	三年期银行定期存款税后收益率+200BP（税后业绩比较基准=[((((1+三年期银行定期存款利率)*(1-20%)-1)/365)*365/3]*100%）
风险收益特征	本基金为债券型基金，其长期平均风险和预期收益率低于股票基金，混合基金，高于货币市场基金。本基金为债券型基金，其年为债券型基金，以及由投资风险程度决定的其他特征和风险的风险收益特征。
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
下属A类份额的简称	中融3年A(中长期信用债债券)
下属A类份额的交易代码	001980
报告期末下属A类份额的份额总额	9,452,300.30
下属C类份额的简称	中融3年C(中长期信用债债券)
下属C类份额的交易代码	001981
报告期末下属C类份额的份额总额	1,475,957.32

主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	主要业绩	中融3年C(中长期信用债债券)(C类)	中融3年A(中长期信用债债券)(A类)
		2019-01-01 - 2019-03-30	2019-01-01 - 2019-03-30
本期已实现利息		10,368.32	4,882.55
本期利润		-81,922.37	1,150.13
加权平均基金份额本期利润		-0.0640	0.0002
期末基金资产净值		9,496,102.27	1,480,288.24
期末基金份额净值		1.2032	1.0982

注：1、本期已实现利息收益未考虑利息税。2、期末利润为，不含公允价值变动损益。3、加权平均基金份额本期利润=本期利润/本期发行份额总数。4、上述业绩指标不包括持有人交易费用及赎回费用，例如：认购费、申购费等，详见相关法规及基金合同及招募说明书等。

基金净值表现

本期内期末业绩率指标及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率标准差①	业绩比较基准收益率②	业绩比较基准收益率标准差③	①-②	②/③
过去三个月	0.4%	0.5%	0.0%	-0.1%	0.5 %

本期内期末业绩率指标及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差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
过去三个月	0.3%	0.4%	0.5%	0.0%	-0.2%	0.4 %

本期内期末业绩率指标及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差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
过去三个月	0.3%	0.4%	0.5%	0.0%	-0.2%	0.4 %

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

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：1、业绩比较基准：两百三年期银行存款税后收益率。

2、自本基金成立日（2018年12月27日）至报告期末，本基金净值增长率为0%，业绩比较基准收益率为0.0%。

管理人对报告期内基金运作遵规守信情况的说明

报告期内，本基金投资组合严格遵循《证券投资基金管理暂行办法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第2号：年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露XBRL实例指引》、《证券投资基金信息披露XBRL分类标准第1号：证券投资基金财务报告》、《证券投资基金信息披露XBRL分类标准第2号：证券投资基金年度报告》等法律法规及中国证监会不时颁布的其他有关规定，基金合同、招募说明书及其他有关基金运作文件的规定，本着为基金持有人谋利益的原则，勤勉尽责地管理和运用基金资产，没有违规违法行为。

管理人对报告期内基金投资策略和业绩表现的说明

报告期内，本基金投资组合严格遵循《证券投资基金管理暂行办法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第2号：年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露XBRL实例指引》、《证券投资基金信息披露XBRL分类标准第1号：证券投资基金财务报告》、《证券投资基金信息披露XBRL分类标准第2号：证券投资基金年度报告》等法律法规及中国证监会不时颁布的其他有关规定，基金合同、招募说明书及其他有关基金运作文件的规定，本着为基金持有人谋利益的原则，勤勉尽责地管理和运用基金资产，没有违规违法行为。

报告期内基金的业绩表现

报告期内基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	中融3年C(中长期信用债债券)(C类)	业绩比较基准收益率②	业绩比较基准收益率标准差③	①-②	②/③
过去三个月	-0.6%	0.5%	0.0%	-1.1%	0.5 %

报告期内基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	中融3年A(中长期信用债债券)(A类)	业绩比较基准收益率②	业绩比较基准收益率标准差③	①-②	②/③
过去三个月	-0.3%	0.5%	0.0%	-0.8%	0.5 %

管理人在报告期内履行投资管理职责的情况

报告期内基金投资策略的执行情况

报告期内，本基金投资组合严格遵循《证券投资基金管理暂行办法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第2号：年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露XBRL实例指引》、《证券投资基金信息披露XBRL分类标准第1号：证券投资基金财务报告》、《证券投资基金信息披露XBRL分类标准第2号：证券投资基金年度报告》等法律法规及中国证监会不时颁布的其他有关规定，基金合同、招募说明书及其他有关基金运作文件的规定，本着为基金持有人谋利益的原则，勤勉尽责地管理和运用基金资产，没有违规违法行为。

投资组合报告

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	权益投资市场		
2	固定收益投资		
3	固定收益投资	9,346,420.00	80.20
4	其中：债券	9,346,420.00	80.20
5	资产支持证券		
6	贵金属投资		
7	金融衍生品投资		
8	买入返售金融资产		
9	其中：买断式回购的买入返售金融资产		
10	银行存款和结算备付金合计	417,407.32	3.58
11	其他资产	128,703.12	1.10
12	合计	10,892,530.44	100.00

报告期末按行业分类的股票投资组合

报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	行业类别	公允价值（元）	占资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业		
B	采矿业		
C	制造业		
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业		
E	建筑业		
F	批发和零售业		
G	交通运输、仓储和邮政业		
H	住宿和餐饮业		
I	信息传输、软件和信息技术服务业		
J	金融业		
K	房地产业		
L	租赁和商务服务业		
M	科学研究和技术服务业		
N	水利、环境和公共设施管理业		
O	居民服务、修理和其他服务业		
P	教育		
Q	卫生和社会工作		
R	文化、体育和娱乐业		
S	综合		
	合计		

注：报告业末按大类行业分类。

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

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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1					
2					
3					
4					
5					
6					
7					
8					
9					
10					

注：报告业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。

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

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	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国债期货	1,107,420.00	11.71
2	3-5年期		
3	金融债券	1,501,370.00	15.88
4	其中：政策性金融债	1,501,370.00	15.88
5	企业债券	1,000,000.00	10.58
6	其中：可交换债券		
7	中期票据		
8	短期融资券（可交换债）		
9	同业存单		
10	其他		
11	合计	3,608,790.00	38.17

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

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

序号	证券代码	证券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	1128011	16国信01	10,000	1,005,500	10.63
2	1280002	18六行01	12,000	1,132,320	11.97
3	1128007	16中南01	12,000	1,113,360	11.77
4	1280078	18邮政01	10,000	1,000,400	9.48
5	1180110	20中信01	10,000	989,900	9.37

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贵金属投资明细

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贵金属投资明细

序号	名称	数量（克）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1				
2				
3				
4				
5				
6				
7				
8				
9				
10				

注：报告业末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名贵金属投资明细。

报告期末投资组合中的国债期货投资情况

报告期末国债期货投资明细

代码	名称	持仓量（买方-卖方）	合约价值（元）	公允价值变动（元）	风险指标说明
公允价值变动总额合计（元）					
国债期货投资本期收益（元）					
国债期货投资本期公允价值变动（元）					

注：报告业末持有的国债期货交易明细。

投资组合报告附注

报告期末投资决策程序说明

报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律和法规要求，本基金管理人投资管理部门负责日常投资工作及研究，成立投资决策委员会，定期召开会议。

报告期末基金投资的前十名证券发行主体中，除国债、政策性金融债以外，一年内受到公开谴责、处罚的情况。

报告期末基金投资的前十名证券发行主体中，除国债、政策性金融债以外，一年内受到公开谴责、处罚的证券投资明细

报告期末基金投资的前十名证券发行主体中，除国债、政策性金融债以外，一年内受到公开谴责、处罚的证券投资明细

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	379.12
2	应收证券清算款	
3	应收股利	
4	应收利息	113,963.20
5	应收申购款	14,360.80
6	其他应收款	
7	待摊费用	
8	其他	
9	合计	128,703.12

报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：报告业末持有的处于转股期的可转换债券。

报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：报告业末股票投资组合。

投资组合报告附注

报告期末基金投资的前三名证券的发行主体及其投资决策程序的说明

报告期内，本基金投资的前三名证券的发行主体及其投资决策程序均符合法律法规要求，投资决策程序一致。

报告期末基金投资的前三名证券的发行主体，本期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、处罚的情况。

报告期末基金投资的前三名证券的发行主体，本期出现信用评级调整情况的说明

报告期末基金投资的前三名证券的发行主体，本期出现信用评级调整情况。

投资组合报告附注

报告期末其他资产组成明细

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	379.12
2	应收证券清算款	
3	应收股利	
4	应收利息	113,963.20
5	应收申购款	14,360.80
6	其他应收款	
7	待摊费用	
8	其他	
9	合计	128,703.12

报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：报告业末持有的处于转股期的可转换债券。

报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：报告业末股票投资组合。

投资组合报告附注

报告期末基金投资的股指期货交易情况说明

报告期末基金投资的股指期货交易情况。

报告期末基金投资的国债期货交易情况说明

报告期末基金投资的国债期货交易情况。

投资组合报告附注

报告期末基金投资的股票资本利得税预提情况

报告期末基金投资的股票资本利得税预提情况。

基金管理人运用固有资金投资本基金情况

基金管理人运用固有资金投资情况

项目	中融3年C(中长期信用债债券)	中融3年A(中长期信用债债券)
报告期期初管理人持有的本基金份额	10,000,000.00	1,000,000.00
报告期期间申购/买入总份额		
报告期期间赎回/卖出总份额		
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,000,000.00	1,000,000.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	90.42	10.42

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额（份）	交易金额（元）	适用费率
合计					

报告期末发生巨额赎回的情况说明

报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	序号	持有基金份额比例达到或超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	占基金总份额比例
机构	1	2019-01 - 2019-03-29	10,000,000.00	0.00	0.00	10,000,000.00	90.74 %
个人			0.00	0.00	0.00	0.00	0.00 %
产品特有风险							

报告期末，持有基金份额比例达到或超过20%的投资者，未因巨额赎回而导致其基金份额比例低于20%，或因其他原因导致基金份额比例低于20%，或因巨额赎回而导致基金份额比例低于20%，或因其他原因导致基金份额比例低于20%，可能导致基金净值出现较大幅度波动的风险。

影响投资决策的其他重要信息

报告期内基金运作未发生其他应披露事项。

备查文件目录

（1）中国证监会批准中融3年期信用债债券型证券投资基金募集的文件

（2）《中融3年期信用债债券型证券投资基金基金合同》

（3）《中融3年期信用债债券型证券投资基金招募说明书》

（4）《中融3年期信用债债券型证券投资基金托管协议》

（5）报告期内披露的所有公告原件

（6）基金管理人业务资格批件、营业执照

（7）中国证监会要求的其他文件

存放地点

基金管理人或基金托管人的办公场所

查阅方式

投资者在营业时间内可免费查阅，也可在支付工本费后，在合理时间内获得上述文件的复印件。

投资者也可通过中融基金管理有限公司客户服务电话400-666-0000（长途话费）、010-56512500、

网址：http://www.ferbank.com.cn/