中融国证钢铁行业指数分级证券投资基金2019年第2季度报告

2019-06-30

基金管理人：中融基金管理有限公司

基金托管人：海通证券股份有限公司

报告送出日期：2019-07-19

§1 重要提示
§2 基金简介
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况
§4 管理人报告
§5 托管人报告
§6 审计报告
§7 财务报表
§8 投资组合明细
§9 基金份额变动情况
§10 重大事件揭示
§11 影响投资者决策的其他重要信息
§12 备查文件目录

重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本季度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。

基金托管人根据本季度报告所载内容编制基金资产估值表，已按照《中国证券投资基金业绩比较基准指数编制规则（试行）》的有关规定，法定信息披露义务人编制并披露了本季度报告所载内容，保证其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，但不保证本基金一定盈利。

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。

本报告摘自中融钢铁指数分级证券投资基金2019年第2季度报告全文，投资者欲了解详细内容，应认真阅读本季度报告全文。

本报告财务指标和投资组合报告等内容，截至2019年6月30日止。

§2 基金简介

基金基本情况

项目	内容
基金名称	中融钢铁
场内简称	-
基金主代码	165521
基金运作方式	上市契约型开放式
基金合同生效日	2015-06-18
报告期末基金份额总额	127,458,134.38份
投资目标	本基金采用指数化投资策略，跟踪产品标的指数变动情况和市场走势，并尽量减少一定波动。
投资策略	1、定期调整跟踪标的指数的权重配比 2、日常跟踪标的指数成分股的变动情况 本基金主要采用以主要跟踪标的股票的权重配比为基础，结合成份股市场表现情况和流动性情况，并根据标的指数编制规则及时调整权重配比，并根据标的指数成分股及其权重变化进行相应调整。 当预期成份股发生调整，或成份股发生配股、增发、分红等行为，以及因其他原因导致跟踪标的权重发生较大变化，导致本基金投资组合偏离目标时，基金管理人可以根据市场情况，采取调整组合久期、调整组合结构、调整组合成份股权重配比的方式进行调整。
业绩比较基准	80%×上证钢铁行业指数收益率+15%×同期银行活期存款利率（税后）
风险收益特征	本基金为跟踪指数型证券投资，其长期预期风险和预期收益率低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。
基金管理人	中融基金管理有限公司
基金托管人	海通证券股份有限公司

主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	主要业务（A）	财务状况（B）	经营成果（C）	现金流量（D）
		2019-04-01 - 2019-06-30	2019-04-01 - 2019-06-30	2019-04-01 - 2019-06-30
本期已实现收益	2,845,165.44	-	-	-
本期利润	-16,113,556.42	-	-	-
加权平均基金份额本期利润	-0.1102	-	-	-
期末基金资产净值	141,231,365.46	-	-	-
期末基金份额净值	0.9401	-	-	-

注：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（不含公允价值变动损益）扣除费用后的余额。本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动损益。

2、上述财务指标数据均按照相关法规及会计准则计算，并按照实际情况入账。期末基金份额净值=期末资产净值/期末份额总数。

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

本期末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

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	-6.98%	1.21 %	-11.49 %	1.01 %	4.51 %	0.20 %

本期末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

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
过去一年	-16.00%	1.21 %	-23.05 %	1.01 %	7.05 %	0.20 %

本期末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

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
自基金合同生效起至今	-9.59%	1.21 %	-15.49 %	1.01 %	5.90 %	0.20 %

本期末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

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
自基金合同生效起至今	-9.59%	1.21 %	-15.49 %	1.01 %	5.90 %	0.20 %

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

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

§4 管理人报告

基金管理人及其管理基金的经验和现状

截至期末，本基金管理人共管理基金：《中作长三角经济发展主题股票》、《中作长三角经济发展主题股票A》、《中作长三角经济发展主题股票B》、《中作长三角经济发展主题股票C》、《中融稳健增长灵活配置混合型证券投资基金》、《中融稳健增长灵活配置混合型证券投资基金A》、《中融稳健增长灵活配置混合型证券投资基金C》、《中融新经济灵活配置混合型证券投资基金》、《中融新经济灵活配置混合型证券投资基金A》、《中融新经济灵活配置混合型证券投资基金C》、《中融钢铁指数分级证券投资基金》、《中融钢铁指数分级证券投资基金A》、《中融钢铁指数分级证券投资基金B》、《中融稳健增长灵活配置混合型证券投资基金D》、《中融新经济灵活配置混合型证券投资基金D》、《中融钢铁指数分级证券投资基金D》。

公平交易专项说明

公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格执行《证券投资基金管理人内部公平交易控制制度》，《证券投资基金管理人公平交易操作指引》，《证券投资基金管理人关联交易管理制度》，《证券投资基金管理人关联交易管理实施细则》，《证券投资基金管理人关联交易管理实施细则之关联方名单管理实施细则》，《证券投资基金管理人关联交易管理实施细则之关联交易管理实施细则》，《证券投资基金管理人关联交易管理实施细则之关联交易管理实施细则之关联方关联交易管理实施细则》，《证券投资基金管理人关联交易管理实施细则之关联交易管理实施细则之