收益率的比较

-基金经理(或基金经

一管理人对报告期内本 基金运作遵规守信情

-公平交易专项说明

行情况

项说明

绩表现

说明

中投资组合报告

□报告期内基金的投资

策略和业绩表现说明

一报告期内基金的投

资策略和运作分析

上报告期内基金的业

一报告期内管理人对本

基金持有人数或基金

资产净值预警情形的

─报告期末基金资产组

─报告期末按行业分类 的股票投资组合

一公平交易制度的执

一异常交易行为的专

理小组)简介

况的说明

┗其他指标

中管理人报告

一自基金合同生效以

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



	王要财务指标	报告期(2019-04-01 至 2019-06-30)	
本期已实现收益			1, 987, 355. 93
本期利润			1, 552, 022. 75
加权平均基金份额本期利润			0. 0015
期末基金资产净值			1, 011, 243, 757. 98
期末基金份额净值			1. 0077
		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。 用,例如:基金的申购、赎回费等,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。	

主要财务指标

基金净值表现

单位:人民币元

单位:人民币元

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	0.15 %	0.04 %	0.65 %	0.06 %	-0.50 %	-0.02

中融稳健添利债券型证券投资基金的基金经

公平交易制度的执行情况

异常交易行为的专项说明

序号

1

权益类投资

其中: 股票

采矿业

制造业

D

序号

2

180313

1920009

1820049

190302

101653047

代码

公允价值变动总额合计(元)

股指期货投资本期收益(元)

国债期货投资本期收益(元)

本期国债期货投资评价

其他资产构成

序号

报告期期初基金份额总额

报告期期末基金份额总额

基金管理人固有资金

基金管理人高级管理人员

报告期期间基金总申购份额

减:报告期期间基金总赎回份额

报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)

存出保证金

应收股利

应收利息

应收申购款

应收证券清算款

国债期货投资本期公允价值变动(元)

股指期货投资本期公允价值变动(元)

本基金投资股指期货的投资政策

债券代码

电力、热力、燃气及水生产和供应业

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

本基金采取相对稳健的配置策略,主要配置了中高等级信用债和利率债。

项目

中融聚业3个月定期开放债券型发起式证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



其他指标 报告期(2019-04-01至2019-06-30) 其他指标 报告期(2019-06-30)

其他指标

基金经理(或基金经理小组)简介 任本基金的基金经理期限 姓名 说明 职务 证券从业年限 离任日期 任职日期 中融恒信纯债债券型证券投资基金、中融季季 红定期开放债券型证券投资基金、中融盈泽债 券型证券投资基金、中融睿祥一年定期开放债 券型证券投资基金、中融上海清算所银行间0-1 年中高等级信用债指数发起式证券投资基金、 中融上海清算所银行间1-3年高等级信用债指数 发起式证券投资基金、中融上海清算所银行间 |王玥女士,中国国籍,北京大学经济学硕士,香港大学金融学硕士。具备基金从业资格,证券 | 1-3年中高等级信用债指数发起式证券投资基 2018-10-17 从业年限8年。2010年7月至2013年7月曾就职于中信建投证券股份有限公司固定收益部,任高 王玥 金、中融上海清算所银行间3-5年中高等级信用 级经理。2013年8月加入中融基金管理有限公司,现任固收投资部副总经理。 [债指数发起式证券投资基金、中融聚业3个月定] 期开放债券型发起式证券投资基金、中融恒裕 纯债债券型证券投资基金、中融恒惠纯债债券 型证券投资基金、中融聚明3个月定期开放债券 型发起式证券投资基金的基金经理及固收投资 部副总经理。 中融货币市场基金、中融日日盈交易型货币市 场基金、中融融裕双利债券型证券投资基金、 中融融信双盈债券型证券投资基金、中融上海 清算所银行间1-3年高等级信用债指数发起式证 券投资基金、中融上海清算所银行间3-5年中高 等级信用债指数发起式证券投资基金、中融上 |朱柏蓉女士,中国国籍,毕业于清华大学金融学专业,硕士研究生学历,具有基金从业资格, 海清算所银行间0-1年中高等级信用债指数发起 证券从业年限5年。2013年7月至2014年10月曾任职于中信建投基金管理有限公司交易员。2014 朱柏蓉 2019-05-10 式证券投资基金、中融上海清算所银行间1-3年 年11月至2017年5月曾任职于泰康资产管理有限公司固定收益交易高级经理。2017年6月加入中 中高等级信用债指数发起式证券投资基金、中 融基金管理有限公司,现任固收投资部基金经理。 融鑫价值灵活配置混合型证券投资基金、中融 鑫思路灵活配置混合型证券投资基金、中融聚 业3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、

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》及其各项配套法规、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有关法律法规和基金合同的规定和约定,无损害基金份额持有人利益的行为。

管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

公平交易专项说明

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,本公司制定了《公平交易管理办法》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、交易执行等各环节,通过制度、流程、技术手段等各方面措施确保了公 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项。

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。 报告期内基金的投资策略和运作分析

【震荡下行。整个二季度,资金相对宽松,银行间隔夜价格下行120bp至1.5%,1年国开债上行18bp至2.73%,10年国开上行5bp至3.63%,1年AAA中短期融资券收平于3.2%、1年AA中短期融资券上行15bp至3.7%。

报告期内基金的业绩表现 截至报告期末中融聚业定期开放债券基金份额净值为1.0077元,本报告期内,基金份额净值增长率为0.15%,同期业绩比较基准收益率为0.65%。 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

投资组合报告

报告期末基金资产组合情况

2019年二季度主要经济金融数据短期回暖,通胀预期升温,债券市场面临阶段性调整。生产方面,工业企业利润筑底反弹,1月至5月全国规模以上工业利润总额23790.2亿元,同比下降2.3%,同比增速相比前值小幅反弹但仍然负增。6月全国制造业PMI指数为49.4%,仍

在枯荣线之下,制造业景气依旧偏弱。通胀方面,4月、5月CPI分别为2.5和2.7,进入6月后,高频数据显示前期带动通胀上行的猪肉、鲜果价格已趋于回落,通胀压力将逐步缓解。基本面上,年初财政持续发力,经济和股市在4月份都出现了阶段性回升,叠加4月货币

|政策边际收紧,债券收益率迅速上行。但进入5月份,情况出现逆转,中美贸易摩擦升温,财政前期透支后开始出现放缓,银行刚兑打破导致流动性分层,央行注入流动性维稳市场情绪,市场风险偏好进一步下降。债券市场在经历4月份的超调后,5月信心修复,收益率

金额(元)

占基金总资产的比例(%)

2	固定收益投资	1, 109, 150, 000. 00	98	
	其中:债券	1, 109, 150, 000. 00	98. 17	
	资产支持证券		_	
3	贵金属投资		_	
4	金融衍生品投资		-	
5	买入返售金融资产		-	
	其中: 买断式回购的买入返售金融资产		_	
6	银行存款和结算备付金合计	1, 293, 440. 73		
7	其他资产	19, 395, 308. 72	1.	
8	合计	1, 129, 838, 749. 45	100.00	
	·····································	告期末按行业分类的股票投资组合		
报告期末按行	业分类的境内股票投资组合			
序号	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例(%)	
A	农、林、牧、渔业		_	

建筑业 E 批发和零售业 交通运输、仓储和邮政业 住宿和餐饮业 信息传输、软件和信息技术服务业 J 金融业 房地产业 K 租赁和商务服务业 M 科学研究和技术服务业 水利、环境和公共设施管理业 N 居民服务、修理和其他服务业 教育 卫生和社会工作 文化、体育和娱乐业 S 综合 合计 注: 本基金本报告期末未持有股票。 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细 股票代码 占基金资产净值比例(%) 序号 股票名称 数量(股) 公允价值(元) 注: 本基金本报告期末未持有股票。

序号 债券品种 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%) 国家债券 1 央行票据 2 金融债券 3 803, 101, 000. 00 79.42 26. 76 其中: 政策性金融债 270, 649, 000. 00 2.08 企业债券 20, 985, 000. 00 4 5 企业短期融资券 中期票据 10.99 6 111, 143, 000. 00 7 可转债(可交换债) 8 同业存单 173, 921, 000. 00 17. 20 其他 9 合计 109.68 10 1, 109, 150, 000. 00

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

数量(张)

1,000,000

1,000,000

900,000

900,000

600,000

公允价值(元)

101, 140, 000

99, 560, 000

91, 800, 000

89, 919, 000

60, 348, 000

公允价值变动(元)

金额(元)

占基金资产净值比例(%)

风险说明

单位:人民币元

19, 393, 181. 62

单位:份

1, 003, 483, 998. 03

1, 003, 483, 998. 03

单位: 份

2, 127. 10

10.00

9.85

9.08

8.89

5. 97

债券名称

18进出13

19进出02

名称

16荣盛MTN002

19日照银行绿色金融01

18贵阳银行绿色金融01

报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注: 本基金本报告期末未持有资产支持证券。							
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							
序号	贵金属代码	贵金属名称	数量(份)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例(%)		
注: 本基金本报告期末未持有贵金属。							
	报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细						
		注: 本基金本	报告期末未持有权证。				

报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

合约市值(元)

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

注: 本基金本报告期末未持有股指期货。

持仓量(买/卖)

报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明							
本期国债期货投资政策							
		报告期末本基金投	资的国债期货持仓和损益明细				
代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(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)				_			

注: 本基金本报告期末未持有国债期货。

投资组合报告附注 受到调查以及处罚情况

名称

股告期内基金投资的前十名证券除18贵阳银行绿色金融01、19日照银行绿色金融01、18湖州银行绿色金融01外其他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。 贵州银监局2018年12月14日发布对贵阳银行股份有限公司的行政处罚(黔银监罚决字〔2018〕18号),央行济南分行2018年12月29日发布对日照银行股份有限公司的行政处罚(济银罚字〔2018〕第29、30号),日照银保监分局2019年2月1日发布对日照银行股份有限公司 约行政处罚(日银保监罚决字〔2019〕1号),中国银行业监督管理委员会湖州监管分局2018年10月24日发布对湖州银行股份有限公司的行政处罚(湖银监罚决字〔2018〕6号)。前述发行主体受到的处罚未影响其正常业务运作,上述证券的投资决策程序符合相关法律 法规和公司制度的规定。
申明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库
基金投资的前十名股票未超过基金合同规定的备选股票库。

6	其他应收款			
7	待摊费用			
8	其他			
9	合计			19, 395, 308.
报告期末持有的处于	于转股期的可转换债券明细			
		注:本基金本报告期末未持有处于转	及期的可转换债券。 ————————————————————————————————————	
报告期末前十名股票	票中存在流通受限情况的说明			

注:本基金本报告期末未持有股票。

开放式基金份额变动

注: 申购含红利再投、转换入份额及金额, 赎回含转换出份额及金额。

数值

基金份额

1.00 %

三年

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,各比例的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

项目

项目

(3)《中融聚业3个月定期开放债券型发起式证券投资基金招募说明书》

(4)《中融聚业3个月定期开放债券型发起式证券投资基金托管协议》

(5) 基金管理人业务资格批件、营业执照

(6) 基金托管人业务资格批件、营业执照

(7) 中国证监会要求的其他文件

10, 000, 000. 00

基金管理人运用固有资金投资本基金情况 基金管理人持有本基金份额变动情况

1.00 %

报告期期初管理人	持有的本基金份额						10, 000, 000. 00
报告期期间买入/目	申购总份额						
报告期期间卖出/则	读回总份额						
报告期期末管理人	持有的本基金份额						10, 000, 000. 00
报告期期末持有的	本基金份额占基金总份额比例(%)						1
序号	用固有资金投资本基金交易明细交易方式	交易日期	交易份额(份)			交易金额(元)	适用费率
合计							
			报告期末发起式基金发	起资金持有份额情况			
	项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总	总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限

10, 000, 000. 00

基金管理人股东 其他		-%		-%			
其他							
		- %		-%			
合计	10, 000, 000	1 %	10, 000, 000	1 %		三年	
	·					·	
		报告期内单一投资者	者持有基金份额比例达到或超过20%的情况				
北次老米即	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
投资者类别 序号	持有基金份额比	比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构 1 2	0190401 - 20190630		993, 483, 998. 03	0.00	0.00	993, 483, 998. 03	99.00
个人			_	_	_	_	-
			产品特有风险		<u> </u>	'	

影响投资者决策的其他重要信息 本报告期无影响投资者决策的其他重要信息。 备查文件目录 (1) 中国证监会准予中融聚业3个月定期开放债券型发起式证券投资基金募集的文件 (2)《中融聚业3个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》

存放地点

查阅方式

基金管理人或基金托管人的办公场所 投资者可在营业时间免费查阅,也可在支付工本费后,在合理时间取得上述文件的复印件。

| 咨询电话:中融基金管理有限公司客户服务电话400-160-6000(免长途话费),(010)56517299。 网址: http://www.zrfunds.com.cn/

益不受损害,管理人有权根据基金合同和招募说明书的约定,暂停或者拒绝申购、暂停赎回,基金份额持有人存在可能无法及时赎回持有的全部基金份额的风险。