
中融融安灵活配置混合型证券投资基金

2020年第2季度报告

2020年06月30日

基金管理人:中融基金管理有限公司

基金托管人:南京银行股份有限公司

报告送出日期:2020年07月20日

§ 1 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。

基金托管人南京银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2020年7月16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。

本报告期中的财务资料未经审计。

本报告期自2020年4月1日起至2020年6月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	中融融安混合
基金主代码	001014
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年02月17日
报告期末基金份额总额	104,557,369.18份
投资目标	本基金通过对股票、债券等金融资产的动态灵活配置，合理控制风险并保持组合良好流动性的前提下，实现基金资产的长期稳定增值，力求为投资者获取超额回报。
投资策略	<ol style="list-style-type: none"> 1. 大类资产配置策略 2. 债券投资策略 3. 股票投资策略 4. 中小企业私募债券投资策略 5. 权证投资策略 6. 资产支持证券的投资策略
业绩比较基准	沪深300指数收益率×50%+上证国债指数收益率×50%
风险收益特征	本基金属于混合型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金，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	南京银行股份有限公司

§ 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

主要财务指标	报告期（2020年04月01日 - 2020年06月30日）
1. 本期已实现收益	-1,111,501.52
2. 本期利润	12,891,410.68
3. 加权平均基金份额本期利润	0.1174
4. 期末基金资产净值	105,272,671.89
5. 期末基金份额净值	1.0068

- 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，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本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	13.25%	0.95%	6.67%	0.45%	6.58%	0.50%
过去六个月	3.65%	1.55%	2.64%	0.75%	1.01%	0.80%
过去一年	11.06%	1.20%	7.54%	0.60%	3.52%	0.60%
过去三年	-2.47%	0.90%	15.33%	0.63%	-17.80%	0.27%
自基金合同生效起至今	-0.42%	0.85%	19.36%	0.60%	-19.78%	0.25%

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

中融融安灵活配置混合型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



注：按基金合同和招募说明书的约定，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各项投资比例符合基金合同的有关约定。

§ 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
		任职日期	离任日期		
冯琪	中融沪港深大消费主题灵活配置混合型发起式证券投资基金、中融融安二号灵活配置混合型证券投资基金、中融融安灵活配置混合型证券投资基金、中融高股息精选混合型证券投资基金、中融品牌优选混合型证券投资基金的基金经理。	2020-05-07	-	8	冯琪女士，中国国籍，毕业于香港大学经济学专业，研究生、硕士学位，具有基金从业资格，证券从业年限8年。2012年6月至2016年4月在泰康资产管理（香港）有限公司权益投资部任研究员职位；2016年9月至2017年11月在溪源资本有限公司投资部

					任基金经理助理职位。2018年1月加入中融基金管理有限公司，现任权益投资部基金经理。
--	--	--	--	--	--

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；基金合同生效日起即任职，则任职日期为基金合同生效日。

（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。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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。

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。

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。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

二季度尽管海外疫情尚未得到有效的控制，但全球友好的流动性环境持续推动全球主要股市上涨。A股创业板指数也在二季度创出年内新高，科技、医药、消费等板块龙头公司的市值空间不断上移。我们判断国内经济将在政策支持之下稳步修复，投资端将成为经济增长的重要动力，消费也将逐步修复，从而支撑上市公司的盈利改善。基金策略坚持积极参与打新。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末中融融安混合基金份额净值为1.0068元，本报告期内，基金份额净值增长率为13.25%，同期业绩比较基准收益率为6.67%。

§ 5 投资组合报告

5.1 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	98,835,960.54	92.60
	其中：股票	98,835,960.54	92.60
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	5,428,212.00	5.09
	其中：债券	5,428,212.00	5.09
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入 返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合 计	1,909,769.69	1.79
8	其他资产	563,442.91	0.53
9	合计	106,737,385.14	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	647,500.00	0.62
B	采矿业	2,656,797.82	2.52
C	制造业	57,652,308.36	54.76
D	电力、热力、燃气及水生 生产和供应业	2,809,179.72	2.67
E	建筑业	1,340,882.40	1.27
F	批发和零售业	3,524,469.08	3.35
G	交通运输、仓储和邮政业	2,937,298.76	2.79
H	住宿和餐饮业	450,457.00	0.43

I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,735,739.47	12.10
J	金融业	4,898,936.28	4.65
K	房地产业	2,928,071.40	2.78
L	租赁和商务服务业	1,083,374.00	1.03
M	科学研究和技术服务业	622,440.00	0.59
N	水利、环境和公共设施管理业	784,222.00	0.74
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	105,984.00	0.10
Q	卫生和社会工作	1,534,399.00	1.46
R	文化、体育和娱乐业	1,760,178.25	1.67
S	综合	363,723.00	0.35
	合计	98,835,960.54	93.89

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

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	002555	三七互娱	49,200	2,302,560.00	2.19
2	300014	亿纬锂能	23,741	1,136,006.85	1.08
3	002371	北方华创	6,000	1,025,460.00	0.97
4	600745	闻泰科技	7,900	995,005.00	0.95
5	002129	中环股份	37,900	851,234.00	0.81
6	002821	凯莱英	3,400	826,200.00	0.78
7	002384	东山精密	27,500	823,625.00	0.78
8	600763	通策医疗	4,700	783,819.00	0.74
9	002127	南极电商	35,500	751,535.00	0.71
10	600201	生物股份	26,800	746,112.00	0.71

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-

3	金融债券	5,416,112.00	5.14
	其中：政策性金融债	5,416,112.00	5.14
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	12,100.00	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	5,428,212.00	5.16

5.5 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	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	018007	国开1801	54,080	5,416,112.00	5.14
2	128115	巨星转债	121	12,100.00	0.01

5.6 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期出现被监管部门立案调查，或者在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情景。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	61,363.71
2	应收证券清算款	25,424.19
3	应收股利	-
4	应收利息	173,339.77
5	应收申购款	303,315.24
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	563,442.91

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.11.6 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，各比例的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	113,769,179.07
报告期期间基金总申购份额	9,494,930.15
减：报告期期间基金总赎回份额	18,706,740.04
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	104,557,369.18

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。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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

本基金本报告期间无单一投资者持有基金份额达到或超过20%的情况。

8.2 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。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会准予中融融安灵活配置混合型证券投资基金募集的文件
- (2) 《中融融安灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- (3) 《中融融安灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》
- (4) 《中融融安灵活配置混合型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

9.2 存放地点

基金管理人或基金托管人的住所

9.3 查阅方式

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，（010）56517299。

网址：<http://www.zrfunds.com.cn/>

中融基金管理有限公司

2020年07月20日