中融增鑫一年定期开放债券型证券投资基金 2018年年度报告摘要

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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, 对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经全体独立董 事签字问题、并由董事长签 7-4中國。7-14國中於亞杰 基金計程,中国直觸行股份有限公司根据本基金合同規定,于2019年3月20日复核了本 中中的財务指称。净值表限,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 不存在金额已线,影号结选该或看取土遗漏。 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,但不保证基金一定高

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 基金的组赛的明节及其逻辑。 本格色中的明节或其逻辑。 本格色中的明节或其逻辑。 在原意见的时间较少,由于原本。 是由于原本。 本年度报告解逻辑自年度报告正义,投资者次解详和内容,应阅读年度报告正义。 本报告期间200年1月1日基础2008年2月3日日上。

基金简称	中融增鑫定期开放债券	
基金主代码	000400	
基金运作方式	契约型定期开放式	
基金合同生效日	2013年12月03日	
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
报告期末基金份额总额	70,162,333.53份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中融增鑫定期开放债券A	中融增鑫定期开放债券C
下属分级基金的交易代码	000400	000401
报告期末下属分级基金的份额总额	57.869.670.64%	12.292.662.89份

基准的稳定收益。	定增值的基础上,力求获得超		
基准的稳定收益。	定增值的基础上,力求获得超		
略			
1.资产配置策略 2.债券投资组合策略 3.信用及债券投资策略 4.相对价值策略 6.资产支持证券等品种投资策略 7.中小企业转逐等品种投资策略 8.期限管理策略 9.知识全的性策略			
银行公布的一年	期定期存款利率 (税后)+1		
	风险与预期收益高于货币市场 型基金。		
夠			

名称		中艇基並官埋有限公司	中国工商银行股份有限公司
姓名		周妹云	鄉明
信息披露 负责人	联系电话	010-56517129	(010)66105799
2427	电子邮箱	zhoumeiyun@zrfunds.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务印	包括	400-160-6000;010-56517299	95588
传真		010-56517001	(010)66105798

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	上海市黄浦区湖滨路202号领展企业广 场2座普华永道中心11楼
注册登记机构	中融基金管理有限公司	北京市朝阳区东风南路3号院中融信托 北京园区C座4层、5层

3.1 主要会计数据和财务指标

	201	8年	201	7年	2016年		
3.1.1 期间数 据和指标	中融增鑫定 期开放债券 A	中融增鑫定 期开放债券 C	中融增鑫定 期开放债券 A	中融增鑫定 期开放债券 C	中融增鑫定 期开放债券 A	中融增鑫定 期开放债券 C	
本期已实现 收益	2,386, 214.51	473,312.60	862,178.79	519,256.32	1,920, 533.43	435,151.70	
本期利润	3,461, 145.81	710,666.19	781,526.95	455,290.89	1,998, 136.42	460,123.96	
加权平均基 金份額本期 利润	0.0630	0.0558	0.0273	0.0215	0.0138	0.0087	
3.1.2 期末数 掘和指标	\$A	\$B	\$A	\$B	\$A	\$E	
期末可供分 配基金份額 利润	2018年末		2017	年末	2016	年末	
期末基金份 額净值	1.333	1.308	1.271	1.252	1.245	1.231	

更低于所列数字, 2、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; 3、期末可供分配利润为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

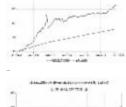
32 基金净值表现 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较 中融增鑫定期开放债券A

阶段	份额净 值增长 率①	份額净 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	2.38%	0.06%	0.69%	0.01%	1.69%	0.05%
过去六个月	4.55%	0.07%	1.38%	0.01%	3.17%	0.06%
过去一年	4.88%	0.08%	2.74%	0.01%	2.14%	0.07%
过去三年	8.29%	0.09%	8.22%	0.01%	0.07%	0.08%
过去五年	32.77%	0.17%	15.81%	0.01%	16.96%	0.16%
自基金合同 生效起至今	33.30%	0.17%	16.15%	0.01%	17.15%	0.16%

中融增鑫定期开放债券C

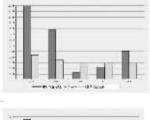
阶段	份額净 值增长 率①	值增长 率标准 差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①-③	2-4
过去三个月	2.35%	0.06%	0.69%	0.01%	1.66%	0.05%
过去六个月	4.39%	0.07%	1.38%	0.01%	3.01%	0.06%
过去一年	4.47%	0.08%	2.74%	0.01%	1.73%	0.07%
过去三年	7.04%	0.09%	8.22%	0.01%	-1.18%	0.08%
过去五年	30.28%	0.17%	15.81%	0.01%	14.47%	0.16%
自基金合同 生效起至今	30.80%	0.17%	16.15%	0.01%	14.65%	0.16%

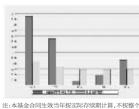
322 白其全今同生势以本其全份额累计净值增长索弥动及其与同期业绩比较其准断效索 变动的比较



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资产配置比例符合基金合同的有关约定。 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较





33 讨去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为中融基金管理有限公司,成立于2013年5月31日,由中融国际信托有限公司 与上海融晟投资有限公司共同出资,注册资金11.5亿元人民币。

截至2018年12月31日,中融基金管理有限公司共管理46只基金,包括中融增鑫一年定期开 放债券型证券投资基金、中融货币市场基金、中融国企改革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、中融新机遇灵活配置混合型证券投资基金、中融中证一带 一路主题指数分级证券投资基金、中融中证银行指数分级证券投资基金、中融鑫起点灵活配置 混合型证券投资基金、中融国证钢铁行业指数分级证券投资基金、中融中证煤炭指数分级证券 投资基金、中融融安二号灵活配置混合型证券投资基金、中融鑫视野灵活配置混合型证券投资 基金、中融稳健添利债券型证券投资基金、中融新经济灵活配置混合型证券投资基金、中融日日 盈交易型货币市场基金、中融产业升级灵活配置混合型证券投资基金、中融融裕双利债券型证 券投资基金、中融竞争优势股票型证券投资基金、中融融信双盈债券型证券投资基金、中融现金 曾利货币市场基金、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年中高等级信用 债指数发起式证券投资基金、中融恒泰纯债债券型证券投资基金、中融量化多因子混合型发起 式证券投资基金、中融鑫思路灵活配置混合型证券投资基金、中融物联网主题灵活配置混合型 证券投资基金、中融量化智选混合型证券投资基金、中融盈泽债券型证券投资基金、中融量化小

券型证券投资基金, 中融核心成长灵活配置混合型证券投资基金, 中融沪港深大消费主颇灵活 配置混合型发起式证券投资基金、中融聚商3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中融鑫 价值灵活配置混合型证券投资基金。中融季季红定期开放债券型证券投资基金、中融智选红利 股票型证券投资基金、中融聚安3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中融量化精选混合 型基金中基金(FOF)、中融医疗健康精选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、中融恒約鈍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、中融值进纯债债券型证券投资基金。 4.12 基金安理(或基金参理)或1多基金金理即即简介

94.8			证券从业年	認明	
200	400	任职日期	高任日期	PA	
李佰	中國維中組織的學型 使有用的基金。中醫藥 有一型延步與營糧。中醫藥 有一型延步與營糧。 中醫藥 可可提供 可 可 可 可 可 可 可 可 可 可 可 可 可 可 可 可 可	2017-02-16	-	11	李硕女士,中国国籍。毕业于对外北洲贸易大 子金融学中心,学士等形,具有指金从业资 街。但另从空南山市。2000年7月至5004年7 街。但另从空影中就上的一个大小小小小小小小小小小小小小小小小小小小小小小小小小小小小小小小小小小小小
沈瀬	中國產業的共產業 在一個學的學術 中國人工作。 中國人工作 中國人工作 中國人工作 中國人工作 中國人工作 中國人工作 中國人工作 中國人工作 中國人工作 中國人工作 中國人工作 中國人工作 中國人工作 中國人工作 中國人工作 中國人工作 中國人工作 中國人工作 中國 中國人工作 中國 中國 中國 中國 中國 中國 中國 中國 中國 中國 中國 中國 中國	2017-04-11	-	11	認識女士,中國國籍。每金丁馬托大亨会計畫 該中途,衛士研究生活力,具有基金地企業 13月內國軍計場副為這種辦理和成功。由任 交易數。如如中型的人中聯基查問申相 公司,提任副教投資那基金物別。 即任任使日期填写。

(2)证券外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。 42管理人对报告期内未检查运行继续户情况的说明 按估期内,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)及复各项配偿法据、基金合同和其他相关法律法律的规定、充衡实实信用、勤助业务 的原则管理和运用基金资产、在严格控制规定的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益、本基 金运件管理符合有关法律法规和基金同的规定和约定,先拥市基金份额持有人利益的行为。 4.2 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

·司制定了《公平交易管理办法》,按照证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导

意见》等法律法规的规定,从组织架构、岗位设置和业务流程、系统和制度建设、内控措施和信息 披露等多方面,确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合,杜绝不同投资组合之间进行利

披露等多方面,确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合、杜绝不同投资组合之间进行利益输送。保中设备合长权益。
公司公平交易管理办法要求编内上市股票,债券的一级市场中期,二级市场交易以及投资管理处并定设制中各个相关东省符合公平交易的监管要求。各投资组合能够公平地族得投资信息、投资组次,并在设度决策委员会的制度规定下独立决策,实施投资决策时中名公平的机会。所有组合投资决策与交易对于保持隔离,任何组合必须经过公司交易居集中中交易。各组合享有平等的支贴权政计方安息对发行保持隔离,任何组合必须经过公司交易居集中中交易。各组合享有平等的支贴权利,在安全局公规分分及影比较,行政分别定专门的交易规则,保证各投资组合获得公平的交易机会。对于部分债券一级市场市期,非公开发行股票申购等以公司名义进行符交易,严格遗憾各投资组合交易前独立确定交易要素、交易更素、交易已按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配。
4.32 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相同等。》,本公司制定了《公平交易制度相对价格代表,是一个专业,是一个专业,是一个专业的企业,是一个专业,是一个专业的企业,是一个专业的企业,是一个专业的企业,是一个专业的企业,是一个专业的企业,是一个专业的企业,是一个专业的企业,是一个专业的企业,是一个专业的企业,是一个专业的企业,是一个专业的企业,是一个专业的企业,是一个专业的企业,是一个专业的企业,是一个专业的企业,是一个专业,是一个专业,是一个专业,是一个专业,是一个专业的企业,是一个专业的企业,是一个专业,是一个专业的企业,是一个专业的企业,是一个专业的企业,是一个专业,是一个专业,是一个专业的企业,是一个专业的企业,是一个专业,是一个专业,是一个专业,是一个专业,是一个专业,是一个专业的企业,是一个专业,是一个专业的企业,是一个专业的企业,是一个专业,是一个工作,一个工作,是一个工作,是一个工作,是一个工作,是一个工作,是一个工作,是一个工作,是一个工作,是一个工作,是一个工作,是一个工作,一个工作,是一个工作,一个工作,一个工作,是一个工作,是一个工作,是一个工作,是一个工作,是一个工作,是一个工作,是一个工作,是一个工作,一个工作,是一个工作,一个工作,一个工作,是一个工作

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 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。 4.3.3 异常交易行为的专项说明

43.3 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。 44.6 型人力报告期内基金的投资策略和业债表现的说明 44.1 报告期内基金投资策略和运作分析。

44 管理人对报告期内基金的投资旗略和业债表现的说明 441 报告即内基金投资解和运作分析 分化中上行。前期对继依和高等级信用使受金追捧、改益率大桶下滑、民企和底等级信用使受 施资环境恶化影响、表现不信、信用利益支强、生中以后、改剪重心逐步由支杠杆转移到能增长。 相关政策电小形常继发布、资化政策生物的一型不然、资金而持续激发、带动被等市场进一步上 行、全年来看,1-3年国开竞益于资金面的宽松、下行150-170bp,5-10年国开普遍下行1200p左

本基金根据市场行情动态调整配置策略,维持了适度的久期和杠杆水平。

4.42 报告期内基金的业绩表现 截至报告期末中融增鑫定期开放债券A基金份额净值为1.333元,本报告期内,该类基金份 额净值增长率为4.88%,同期业绩比较基准收益率为2.74%;截至报告期末中融增鑫定期开放债 券C基金份额净值为1.308元,本报告期内,该类基金份额净值增长率为4.47%,同期业绩比较基

女益率为2.74%。 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 展望2019年,我们认为经济基本面仍有利于债券市场,但随着宽信用政策推进,债券市场尤 其长端利率值的或原被的加大、从基本而上看,例计明年地产投资、基础,进口一消费等继续 承压,货币政策维持合理充裕,整体不均依然利于债市。但同时由于稳增长、稳敛业等底线思维 的约束,例计将有更多宽信用政策出台,基本而环境对债市尤其中长端利率债的友好边际将逐

渐降低,需要警惕预期的转向给市场带来调整压力。 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

"品」(3月以口用)3個近日18位日下中中9年3日以下, 根据中町直接会科关规定及基合合同约定,本基金管理人应严格按照新准则,中国证监会 相关规定和基金合同关于估值的约定,对基金所持有的投资品种进行估值。本基金基金托管人 根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所在估值调整导数基金资产净 值的变化在0.25%以上时对所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见。定价服 证的文化在420%以上1945所采用的相关企量模型。据以及参级的每三年之类和呼吸感见。是扩除 多机构按照隔值全同约定提供定衡服务。报告即为,本基金管理人一种格量产业企业会计准则为 《证券投资基金会计核算业券指引》以及中国证据会相关规定和基金合同的约定。且常估值由 基金管理人与基金托管人一同进行。基金份额净值由基金管理人完成恰值后,经基金托管人复 核无限后由基金管理人对外公布。月末,年中和年末估值复接与基金会计报目的核对同的进行。

本基金管理人设立估值委员会,成员由高级管理人员、投资研究部门、基金运营部门、风险 等理部门。法律合规部门入员组成,负责研究、指导基金恰值业务,基金管则人们创度的对象。 管理部门法律合规部门入员组成,负责研究、指导基金恰值业务,基金管则也值委员员会会会 会计均具有专业胜任能力和相关工作经历。报告期内,基金经理参加估值委员会会议,但不介入 基金日常估值业务;参与结值流程各方之间不存在任何重大利益冲突;与估值相关的机构包括 上海、深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司、中央国债登记结算有限责任公司、中 证指数有限公司以及中国证券业协会等。

本基金本报告期未进行利润分配,符合相关法规及基金合同的规定。 § 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

6.1 报告期内,本基金托管人理规划管间600mm 本报告期内,本基金托管人在对中域增露一年定期开放债券型证券投资基金的托管过程 中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金 份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。 2 托管人对报告期内本其全投资运作遵规守信,净值计管,利润分配

本报告期/中機帽畫一年定期开放债券型证券投资基金的管理人——中職基金管理有限公司在中職增產一年定期开放债券型证券投资基金的投资运作。基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各 重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内,中融增鑫一年定期开放债券型证 **券投资基金未进行利润分配。**

2026年3年7月7日9月7日6。 53 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 本托管人依法对中融基金管理有限公司编制和按路的中融增鑫一年定期开放债券型证券

投资基金2018年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告 等内容进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

普华永道中天审字(2019)第24022号

§6 审计报告 6.1 审计报告基本信息 财务报表是否经过审计 审计意见类型

5.2 审计报告的基本内容	
审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	中融增鑫—年定期开放债券型证券投资基金全体基 金份额持有人
审计意见	(一)我们由计的内容 我们由计了中期增加。一定识别开 级债券到证券包括各位以下离除一种增加的工程的 债券基金。均的转程表,包括2010年12月31日的资产 负债表。2018年9时制度私用专程数益。债金净位 安动港以及财务报废附注。(二)我们的意见 我们认为, 国前的协务报废制注中师列示的中国证券也管管理委 会议下高收中间监查分。中间监查的管管理委 会议下高收中间监查分。中间进步位管管理委 会议下高收中间监查分。中间当时会现在分 行的基合于业交易中间制,公会取了中间增加。 2018年2018年2018年2018年2018年2018年2018年2018年
形成审计意见的基础	我们按照中国法国会计师审计·格别的规定执行了审 计工作。审计报告的"注册会计师对例务规定执行了审 计工作。即分进一步相应"支机"在这些编制下的责任。我们 相信,我们抓取的审计上部是充分。适当的,为发表审 计意见操行。其他,按照可能开始之计师和边缘等 别,我们独立于中域增加定即开放做券基金。并履行了 率处通信的对比他是任
强调事项	_
其他事项	_
其他信息	_
管理层和治理层对财务报表的责任	中級時度定期开放债券基金的基金管理人中職基金 管理有限公司(下商等·基金管理)人中管理员大线 附全业62十油则和中国证益2、中国基金业场全发布 的关系现及大作到金产和业务性介制的一个型的内 高速的,这世界是不在一个工程,不是一个工程的一个型的内 原型别。这世界是不在一个工程,不是一个工程的一个型的 工作的一个工程,不是一个工程,不是一个工程的一个工程。 工程的一个工程,不是一个工程,不是一个工程的一个工程, 工程的一个工程,不是一个工程,不是一个工程的一个工程, 工程的一个工程,不是一个工程,不是一个工程的一个工程, 工程的一个工程,不是一个工程,不是一个工程, 工程的一个工程,不是一个工程,不是一个工程, 工程的一个工程,不是一个工程,不是一个工程, 工程的一个工程,不是一个工程,不是一个工程, 工程的一个工程,不是一个工程,不是一个工程,不是一个工程, 工程的工程,不是一个工程,不是一个工程,不是一个工程,不是一个工程, 工程的工程,不是一个一个工程,不是一个工程,不是一个一个工程,不是一个工程,不是一个工程,不是一个工程,不是一个工程,不是一个工程,不是一个工程,不是一个工程,不是一个工程,不是一个工程,不是一个工程,不是一个工程,不是一个工程,不是一个工程,不是一个工程,不是一个工程,不是一个工程,不是一个一个工程,不是一个一个一个工程,一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个
注册会计师对财务报表审计的责任	该们的自乐是对炒多很表徵依括。不存在由于舞弊或错误导致的工业,并出租合审计 计意见的审计报告。合理应证是高水平的保证。但并 不在保证证据申请中,由现在审计,意见的审计报告。合理应证是高水平的保证。但并 不在保证证据申请中,则未有 "他们是高水平的保证。但并 存在时后能发现。 情报可能由于海界或前国资效、如 是由于国际的情况,但 "他们是一个,我们正知知处,则是一个,我们正知知处,是一个,我们正知知处,则是一个,我们正知知处,则是一个,我们正知知处,则是一个,我们正知知处,则是一个,我们正知知处,是一个,我们正知知此,是一个,我们正知知此,是一个,我们是一个一个,我们是一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个

7.1 资产负债表 会计主体:中融增鑫—年定期开放债券型证券投资基金 报告截止日:2018年12月31日

:计师事务所的地址

上海市黄浦区湖滨路202号领展企业广场2库普华:

单位:人民币元

衍生金融资产 1,115,182 负债和所有者权益 55,349,778 递延所得税负债 所有者权益: 实收基金 未分配利润

報知 (1985年 1985年 1985年

		ーーに・ノベレ
项目	本期2018年01月01日至2018 年12月31日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年 12月31日
一、收入	7,274,787.28	2,369,698.33
1.利息收入	7,050,125.15	2,758,468.13
其中:存款利息收入	37,350.26	345,514.74
债券利息收人	6,881,933.92	2,197,669.64
资产支持证券利息收入	-	-
买人返售金融资产收入	130,840.97	215,283.75
其他利息收人	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	-1,087,622.76	-244,152.53
其中:股票投资收益	-	4,479.32
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-1,087,622.76	-248,531.85
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	-	-100.00
 公允价值变动收益(损失以 "-"号填列) 	1,312,284.89	-144,617.27
4.汇兑收益(损失以"-"号填 列)	-	_
5.其他收入(损失以"-"号填 列)	-	-
减:二、费用	3,102,975.28	1,132,880.49
1. 管理人报酬	609,899.57	439,409.70
2. 托管费	174,257.06	125,545.52
3. 销售服务费	64,344.49	105,606.53
4. 交易费用	7,713.16	7,019.23
5. 利息支出	2,009,246.53	250,842.50
其中:卖出回购金融资产支出	2,009,246.53	250,842.50
6. 税金及附加	23,140.55	-
7. 其他费用	214,373.92	204,457.01
三、利润总额(亏损总额以"-" 号填列)	4,171,812.00	1,236,817.84
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填 列)	4,171,812.00	1,236,817.84

会计主体:中融增鑫一年定期开放债券型证券投资本报告期:2018年01月01日至2018年12月31日

项目	2018年01月01日至2018年12月31日				
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计		
一、期初所有者权益(基金净值)	47,977,346.51	12,600,702.27	60,578,048.78		
二、本期经营活动产生的基金净 值变动数(本期利润)	-	4,171,812.00	4,171,812.00		
三、本期基金份额交易产生的基 金净值变动数(净值减少以"-" 号填列)	22,184,987.02	6,310,830.48	28,495,817.50		
其中:1.基金申购款	52,974,791.96	14,475,276.73	67,450,068.69		
2.基金赎回款	-30,789,804.94	-8,164,446.25	-38,954,251.19		
四、本期向基金份额持有人分配 利润产生的基金净值变动(净值 减少以""号填列)	-	-	-		
五、期末所有者权益(基金净值)	70,162,333.53	23,083,344.75	93,245,678.28		
项目	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年12月31日				
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计		
一、期初所有者权益(基金净值)	197,711,821.76	47,697,242.35	245,409,064.11		
二、本期经营活动产生的基金净 值变动数(本期利润)	-	1,236,817.84	1,236,817.84		
三、本期基金份额交易产生的基 金净值变动数(净值减少以"-" 号填列)	-149,734, 475.25	-36,333,357.92	-186,067,833.17		
其中:1.基金申购款	14,301,245.10	3,431,178.96	17,732,424.06		
2.基金赎回款	-164,035, 720.35	-39,764,536.88	-203,800,257.23		
四、本期向基金份额持有人分配 利润产生的基金净值变动(净值 减少以""号填列)	-	-	_		
五、期末所有者权益(基金净值)	47,977,346.51	12,600,702.27	60,578,048.78		
设表附注为财务报表的组成部分 体报告7.1至7.4财务报表由下列	ð.	111,000,70227	55,570,040.71		

基金管理人负责人 主管会计工作负责人

会计机构负责人

资产双虹响小感等。 (3)如您苏尔姆克生面大变化或此学双17/2。 行题影并确定公允价值。 7.4.46 金融资产和金融负债的抵销 本基金特有的资产和承租的负债基本力金融资产和金融负债,当本基金1)具有抵销已确认 金额的法定权和且该种法定权规定是可执行的;且2)交易双方准备按净额结算时,金融资产 与金融负债按抵销与的净额在资产负债表中列示。

, 发行基金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 收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

多收益。 用题回引起的实改基金变动分别于基金甲购确以口及难证项目的。 74.4 以最后 15.4 以最后 15.5 以后,25.5 以后,

小的则按直线统计算。 74.411 基金的收益分配政策 本基金同一类别内的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配,但基金 份鄉持有人可选善现金红利或将现金红利按分红权益制投资日的基金份额价值目动转为基金 份鄉任行和投资、若刚未未分配剩间中的未实现陷分加致。包括基金经营而办产生的未实则 抵益以及基金份额交易产生的未实现平准金等,则则未可供分配利润的金额为则未未分配利润 中的已实现现分,若则未未分配利润的未全聚成份为负数,则期末可供分配利润的金额为期末 未分配利润,即已实现配分相抵未实现配分后的余额。 经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

分交物列工用设在邮件在山顶侧足收加加中的可收购的多数介土对电影外机等则分排形力放照中 证据数有限公司所数立选提供的信档集编能之分的值。本基金特有的银行间间设计场间定收益 品种按照中央国债登记结算有限责任公司所独立提供的估值结果确定公允价值。 745 会计政策变更的说明 745 台计政策变更的说明

7452 会计估计变更的说明

7.4.5.3 差错更正的说明

无。 7.4.6 模项 根规附按哪,国家税务总局财款1200811号4关于企业所得股营干优惠政策的通知3,财税 201218号号4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3,财税12016 101号4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3,财税1201636号4关 子金加海开营业税及证即储税时从自约通知3,财税20164号4关于进一场明确企而相关程数增 2016年7日7日2016年7日2016年7日2016年7日2016年7日2016年7日2016年7日2016年7日2016年7日2016年7 于全面推升對收稅改正增值於法。的通知》,數稅2016/046号(关于进一申明确企面推开書改增 法自金融业方表或第的通訊》,較稅2016/05日(关于金融制。即此往來勢增稅級政策的补充通 知)。財稅12017/3号(关于勞稅一點,較稅2016/05日(大于金融制。即成多等增值移政策的通知),財稅 [2017/3号(关于發管产品增值級政策有关中國的补充通知),財稅2017/60号(关于资管产品增 值稅利美河國加資則),股稅2017/50号(关于與稅307/3元),以政稅2017/60号(关于资管产品增 值稅利美河國加資則),股稅2017/50号(关于與稅307/3元)。 1),省管产品品資出和中发生的增稅級及稅行为,但或管产品管理人为增值稅的稅人。资管 产品管理人运营营管产品上超中发生的增稅級及稅行为,但或管产品管理人为增值稅的稅人。资管 产品管理人运营营管产品上超中发生的增稅和股稅行为,以或管产品管理人为增值稅的稅分,未獲的增稅 稅的,不再缴纳;已缴纳增值稅的,已納稅額从资管产品管理人以后月份的增值稅应稅稅稅申抵

縣。 芳证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免证增值税,对国债,地方政府 债以及金属而业往来利息收入亦处证增值税,营管产品管理人运营营管产品最佳的贷款服务, 以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017年12月31日前取得的基金。非货物朋货,可设是特定照实际买人价计算销售额,或者以2017

2017年12月31日前取得的基金。非货物期货。可以选整按照公库买入价计算销售额。或者以2017年是后一个全息目的基金给除你值、非货物期货结算的格件为买人价计算销售额。
(2) 对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股票的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,也不证收金业所得移。
(3) 对基金应取得的企业债券利息收入,应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息汇利所得,持股期限在个月以内含1个月。 其股息证利所得全衡计人应转停所得解,持股期限超过1年的,贯全而收入所得税。对基金持有的上市公司取售股份,经营已收入人所得税。对基金持有的上市公司取售股份,按参与限制的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额,持股制限超过1年的,暂全而收个人所得税。对基金持有的上市公司取售股份的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一遇用20%的税率计位个人所得税。
(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不证收股票交易印花税。(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费费按照实际缴纳增值税

7.4.7 关联方关系

基金管理人、基金注册登记机构、基金链性 中融基金管理有限公司 中国工商银行股份有限公司("中国工商银 基金托管人、基金销售机构

中融(北京)资产管理有限公司 基金管理人子 下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易 无。 7.4.8.1.2 权证交易

元。 7.4.8.1.3 债券交易

7.4.8.1.4 债券回购交易

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

其中·支付销售机构的客户维护费 114,736.08 246,027.51 ①支付基金管理人的管理人根侧按前一日基金资产净值0.70%的年费率计提,每日计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:日管理人报酬=前一日基金资产净值 × 0.70% / 当十六级。 ②客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务 及销售活动中产生的相关费用,该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支,不属于从基金

本期 上年度可比期间 2018年01月01日至2018年 2017年01月01日至2017年

12月31日 支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值0.20%的年费率计提,每日计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:日托管费=前一日基金资产净值 X 0.20% / 当年天数 单位:人民币元

获得销售服务费的各关联	本期 2018年01月01日至2018年12月31日				
方名称	当期发生的基金应支付的销售服务费				
	中融增鑫定期开放债券A	中融增鑫定期开放债券C	合计		
中国工商银行	-	55,050.93	55,050.93		
中融基金管理有限公司	-	7,413.66	7,413.66		
合计	-	62,464.59	62,464.59		
获得销售服务费的各关联		上年度可比期间 月01日至2017年12月31日			
方名称	当期发生的	基金应支付的销售服务费			
	中融增鑫定期开放债券A	中融增鑫定期开放债券C	合计		
中国工商银行	-	105,592.69	105,592.69		
合计	-	105,592.69	105,592.69		
支付基金销售机构的C类	基金份额销售服务费按	前一日C类基金资产净			

c 4.8.4 各关联方投资本基金的情况 4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况 元。 74.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。 74.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元 上年度可比期间 2017年01月01日至2017年12

帝等选择的人社會结算资金专用仔票基础与专证, 业利率计息。 748.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明 7.4.8.7.1 其他关联交易事项的说明

无 74.9 期末(2018年12月31日)本基金持有的流通受限证券 74.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。 7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。 7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券 7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购 截至本报告期末2018年12月31日止,本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回 参数全额最16 149 7万7元 早以加工基金处于民和

el ric	分級水拠定10	,149,775.77	6,定以如下饭	55TF/リ灰押:	3	金额单位:人民	币元
	债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量(张)	期末估值总额	
	041800084	18黄山城投 CP001	2019-01-02	101.20	10,000	1,012, 000.00	
	041800091	18 苏科技城 CP001	2019-01-02	101.25	80,000	8,100, 000.00	
	101800578	18振业集团 MTN001	2019-01-02	102.18	80,000	8,174, 400.00	
	合计				170,000	17,286, 400.00	

74.93.2 交易所市场债券止回购 截至本报告期末2018年12月31日止,本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款金额3,200,000.000元,截至2019年1月3日先后询明。该查支恩要求本基金转人质押挥的债券,按证券交易所规定的比例所第75%准券后,不低于债券回购交易的余额。74.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项(1公允价值)企融工具处价价值计量的方法公允价值计量结果所属的层次,由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的品在回次生活。

公允价值计量结果所属的层次,由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的 歷程展次决定: 第一层水:相同资产或负值在活跃市场上未经调整的报价。 第二层水:相同资产或负值的不可观察输入值。 第三层水:相关资产或负值的不可观察输入值。 (的持续的以公允价值计量的金融工具。)的各层水金融工具公允价值 十至018年12月31日、基础持有的以公允价值计量且其变动计人当期损益的金融资产中属 于第二层次的余额为132,931,478107元,无属于第一层次或第三层次的余额(2017年12月31日:第二层次水(6)第一层次或第三层次的余额(2017年12月31日:第二层次化(6)第一层次或第三层次的余额(2017年12月31日:第二层次化(6)第一层次或是一层次或第二层次的余额(2017年12月31日:第二层次的金额(2017年12月31日:第二层次、6)1400元,250,400

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额 无

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具 于2018年12月31日,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2017年12月31日:

同)。 (d)不以公允价值计量的金融工具 不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债,其账面价值与公 允价值相差很小。

			金额单位:/
序号	项目	金額	占基金总资产的比 (%)
1	权益投资	-	
	其中:股票	-	
2	基金投资	-	
3	固定收益投资	132,931,479.70	88.
	其中:债券	132,931,479.70	88.
	资产支持证券	-	
4	贵金属投资	-	
5	金融衍生品投资	-	
6	买人返售金融资产	_	
	其中:买断式回购的买人返售金融资	_	

			金额单位:人民
序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	951,392.90	1.02
2	央行票据	-	_
3	金融债券	22,781,900.00	24.43
	其中:政策性金融债	22,781,900.00	24.43
4	企业债券	54,638,286.80	58.60
5	企业短期融资券	29,225,800.00	31.34
6	中期票据	25,334,100.00	27.17
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	_
9	tzek		

) 前五名债券投资明纸

公允价值 90,000 9,058,500. 8振业集区

80,000 8,174,400,00 5 143343 17进数02 80,000 8,174,400,00 6 17 則未經公允价值上基金资产等值比例大分引序的前十名资产支持业券。 83 报告期末接公允价值上基金资产等值比例大分引序的前十名资产支持业券。 83 报告期末接公允价值上基金资产等值比例大分排序的前五名报金规投资 未基金未接管期末未持有股票未得的股票的 期末接公允价值人基金资产等值比例大分排序的前五名权证投资明细 水层金水保险制末共持有股票。 好。 争值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基企本程在原来表特有最新的原 8-11 报告期末未基金设势的国债制度交易情况谈明 本基金本报告期末共特有国缴购货。 8-12 投资自免债制注 8-12 投资自免债制注 8-12-11 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简 近级纳力发产生水利阳级被监督部门立案调查,或者在报告编制日前一年均受到公开通

8.12.2 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。 8.12.3 期末其他各项资产构成 单位:人民币

812.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分 由于四舍五人的原因,各比例的分项之和与合计项之间可能存在尾差。 ⑤ 9 基金份鄉持有人信息 9.1 期末基金份鄉持有人户数及持有人结构

	Advaded A	户均持有的基金	持有人结构				
份额级	持有人 户数		机构投资者		个人投资者		
別	(J ² 1)	份額	持有份 額	占总份 额比例	持有份 額	占总份额比例	
中融增 鑫定期 开放债 券A	129	448,602.10	47, 044, 177.89	81.29%	10, 825, 492.75	18.71%	
中融增 鑫定旗 开放债 券C	217	56,648.22	1,593, 356.69	12.96%	10, 699, 306.20	87.04%	
合计	346	202,781.31	48, 637, 534.58	69.32%	21, 524, 798.95	30.68%	

1)。 9-2期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 本指告期末,本基金管理人的从业人员未持有本基金。 9-3 期末基金管理人的从业人员未持有本基金。 1.本基金高级管理人员,基金投资和研究部门负责人未持有本基金; 2.本基金基金经理未持有本基金。 第10 开放式基金份额变动

中融增鑫定期开放债券A 中融增鑫定期开放债券C 147,817,578 297,892,000.4 本报告期期初基金份额总额 14,196,5443 k报告期基金拆分变动份額(份) ▷以"-"填列)

11. 基金份额持有人大会决议 本报告期内,本基金表召开基金份额持有人大会。 12. 基金管理人,基金长管、民的专门基金长管部门的重大人事变动 (1)基金管理人的重大人事变动情况 本基金管理人产2018年3月14日发布公告,王启道先生担任中脑基金管理有限公司副总经 本基金管理人于2018年6月30日发布公告,代宝香女士不再担任中融基金管理有限公司副

本極重管理八子母10年9758日及11日 切割。 他高管人民未变动。 公司其他高管人民争变动。 《2]基金托管人的专门基金托管部门市政生重大人事变动。 13. 涉及基金管理人,基金扩管。 本报告期无涉及本基金管理人,基金扩管。 基金托管部分的诉讼 本报告期无涉及本基金管理人,基金好管、基金托管业务的诉讼事项。

本基金本报告期投资策略未发生改变

115 为基金进行审计的会计师事务所情况 本报告期内,未改聘会计师事务所。该审计机构已经连续5年为本基 本基金应支付给会计师事务所引援酬为60,00000元人民币。 116 管理人,托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。 本报告期先官则人,托管人及请高级管理人员受稽查或处罚等情况。 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

备注 成交金額

兴业业券 2
(7)为了提彻中国证监会的有关规定,我公司制定了选择参商的标准,即: 1 经营行为规范,在近一年内大加大违规行为。
1 公司的多状况良好。
1 公司的多状况良好。
1 公司的多状况良好。在业内有良好的中龄。
1 有良好的时分形力,能及时、企面,定即提供即量较高的宏观,行业、公司和证券市场研究
1 并能根据基金位势的特殊要求。提供专门的研究报告。
2 建立了广泛的信息规格。是处于推伐准衡的信息受试和服务。
②李商专用交易单元选择程序。
1 对交易单元统选券籍的所字服务进行评估
本基金管理人组织相关人员依赖交易单元选择标准为交易单元类较商的服务质量和研
实力进行企业、成绩近常用交易单元的参通。

成交金 額

巨泰证为	ì	208, 392.54	51.82%	-	-		-	-	-	-
国泰君安		-	-	-	-		-	-	-	-
中信建投		-	-	-	-		-	-	-	-
*发证券		70, 848, 398.80	48.18%	3,78 376 000.	, 10	0.00%	-	-	-	-
设信证券		-	-	-	-		-	-	-	-
*业证券		-	-	-	-		-	-	-	-
.1 报告	期内		者持有基	金份		达到或	的重要信 留过20°	%的情况	de laboritor	ett A letve
报告期内持有基金份额变化情况 报告期末持有基									基金情况	
投资者 类别	序号	持有基金份额比例 到或者超过20%的 间区间			期初份额	申购 份額	赎回 份额	持有份额		份额占比
	- 1		201801	30 –	15,	0.00	0.00	15,6	73,	22.240/

全部基金份额

−中融基金管理有限公司 −○−五年三月二十八日