

## 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

## 2019年第一季度报告

对价,未发生不公平的交易事项。

4.32 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。

报告期内未发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标的证券买卖情况。

4.4 报告期内基金管理人的投资策略和运作分析

2019年初经济开局较弱,工业生产表现疲软,1-2月工业增加值同比增5.3%,较2018年12月回落,并创下1992年以来新低,其中1-2月工业生产主要是因为基数较高,而需求端则受到中美贸易摩擦、国内经济下行压力以及春节因素的影响。

4.5 报告期内基金的业绩表现及与同期业绩比较基准收益率的比较

本基金因发起式基金规模较小,除债券资产之外其他各项资产配置比例符合基金合同规定。

4.6 投资组合报告

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时间 证书颁发日期 说明

王培女士,中国国籍,北京大学经济学学士,清华大学金融学硕士,具有基金从业资格,现任中融基金管理有限公司基金经理,从2010年7月至2013年7月曾任职于中融基金管理有限公司,任固定收益部基金经理;2013年7月加入中融基金管理有限公司,任固定收益部基金经理;2015年1月加入中融基金管理有限公司,任固定收益部基金经理;2016年1月加入中融基金管理有限公司,任固定收益部基金经理;2018年7月加入中融基金管理有限公司,任固定收益部基金经理。

4.2 报告期内基金管理人对本基金的估值政策及净值偏离情况的说明

报告期内,本基金的估值政策及净值偏离情况未有超过行业监管机构及自律组织的限制。

4.3 报告期内基金的业绩表现及与同期业绩比较基准收益率的比较

本基金因发起式基金规模较小,除债券资产之外其他各项资产配置比例符合基金合同规定。

4.4 报告期内基金的业绩表现及与同期业绩比较基准收益率的比较

本基金因发起式基金规模较小,除债券资产之外其他各项资产配置比例符合基金合同规定。

4.5 报告期内基金的业绩表现及与同期业绩比较基准收益率的比较

本基金因发起式基金规模较小,除债券资产之外其他各项资产配置比例符合基金合同规定。

4.6 投资组合报告

4.1 基金报告期末基金资产组合情况

序号 项目 金额(元) 占基金资产的比例(%)

1 权益投资 - -

2 固定收益投资 - -

3 国际化投资 - -

4 贵金属及珠宝投资 - -

5 其他投资 - -

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 10,000,000.00 1.00%

8 其他资产 271,361.74 0.00%

9 合计 11,261,361.74 100.00%

注:1. 上述数据为定期报告期末的数据,即报告期末的任一日日期填写。

2. (2) 证券从业的含义从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期末本基金运作遵循估值原则的说明

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》及其他各项法律法规、基金合同和其相关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理运用基金资产,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的规定和约定,没有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《公平交易管理制度》,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保证了公平对待所管理的投资组合,保证公平交易原则的实现。

4.3.2 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

待遇,不存在不公平的交易行为。

4.3.3 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

待遇,不存在不公平的交易行为。

4.3.4 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

待遇,不存在不公平的交易行为。

4.3.5 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

待遇,不存在不公平的交易行为。

4.3.6 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

待遇,不存在不公平的交易行为。

4.3.7 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

待遇,不存在不公平的交易行为。

4.3.8 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

待遇,不存在不公平的交易行为。

4.3.9 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

待遇,不存在不公平的交易行为。

4.3.10 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

待遇,不存在不公平的交易行为。

4.3.11 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

待遇,不存在不公平的交易行为。

4.3.12 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

待遇,不存在不公平的交易行为。

4.3.13 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

待遇,不存在不公平的交易行为。

4.3.14 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

待遇,不存在不公平的交易行为。

4.3.15 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

待遇,不存在不公平的交易行为。

4.3.16 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

待遇,不存在不公平的交易行为。

4.3.17 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

待遇,不存在不公平的交易行为。

4.3.18 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

待遇,不存在不公平的交易行为。

4.3.19 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

待遇,不存在不公平的交易行为。

4.3.20 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

待遇,不存在不公平的交易行为。

4.3.21 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

待遇,不存在不公平的交易行为。

4.3.22 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

待遇,不存在不公平的交易行为。

4.3.23 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

待遇,不存在不公平的交易行为。

4.3.24 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

待遇,不存在不公平的交易行为。

4.3.25 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

待遇,不存在不公平的交易行为。

4.3.26 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

待遇,不存在不公平的交易行为。

4.3.27 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

待遇,不存在不公平的交易行为。

4.3.28 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

待遇,不存在不公平的交易行为。

4.3.29 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

待遇,不存在不公平的交易行为。

4.3.30 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

待遇,不存在不公平的交易行为。

4.3.31 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

待遇,不存在不公平的交易行为。

4.3.32 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

待遇,不存在不公平的交易行为。

4.3.33 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

待遇,不存在不公平的交易行为。

4.3.34 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

待遇,不存在不公平的交易行为。

4.3.35 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

待遇,不存在不公平的交易行为。

4.3.36 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

待遇,不存在不公平的交易行为。

4.3.37 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

待遇,不存在不公平的交易行为。

4.3.38 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

待遇,不存在不公平的交易行为。

4.3.39 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

待遇,不存在不公平的交易行为。

4.3.40 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

待遇,不存在不公平的交易行为。

4.3.41 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

待遇,不存在不公平的交易行为。

4.3.42 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

待遇,不存在不公平的交易行为。

4.3.43 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

待遇,不存在不公平的交易行为。

4.3.44 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

待遇,不存在不公平的交易行为。

4.3.45 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

待遇,不存在不公平的交易行为。

4.3.46 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

待遇,不存在不公平的交易行为。

4.3.47 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

待遇,不存在不公平的交易行为。

4.3.48 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

待遇,不存在不公平的交易行为。

4.3.49 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

待遇,不存在不公平的交易行为。

4.3.50 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

待遇,不存在不公平的交易行为。

4.3.51 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

待遇,不存在不公平的交易行为。

4.3.52 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

待遇,不存在不公平的交易行为。

4.3.53 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

待遇,不存在不公平的交易行为。

4.3.54 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

待遇,不存在不公平的交易行为。

4.3.55 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

待遇,不存在不公平的交易行为。

4.3.56 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

待遇,不存在不公平的交易行为。

4.3.57 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

待遇,不存在不公平的交易行为。

4.3.58 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

待遇,不存在不公平的交易行为。

4.3.59 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

待遇,不存在不公平的交易行为。

4.3.60 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

待遇,不存在不公平的交易行为。

4.3.61 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

待遇,不存在不公平的交易行为。