

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

报告送出日期:2019年07月19日

\$ 1 重要提示

基金管理人的董事、监事、高级管理人员及基金经理人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责任。本基金于2019年07月19日复权,其2019年01月01日至06月30日的财务指标、净值表现和投资组合报告等信息见2019年07月16日披露的《中融增鑫一年定期开放债券型证券投资基金2019年第1季度报告》。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,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,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

本基金的过往业绩并不代表未来表现,基金管理人管理的其他基金的过往业绩也不构成对本基金的业绩表现。

本报告期自2019年04月01日起至2019年06月30日止。

\$ 2 基金产品概况

基金名称 中融增鑫一年定期开放债券

基金代码 000940

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01日

报告期末基金资产总额 417,000,000.00

投资目标 在保持基金资产流动性相对稳定的前提下,力求获得超越业绩比较基准的稳定收益。

投资策略 1.资产配置策略  
2.债券投资组合策略  
3.利率风险管理策略  
4.期限价值策略  
5.债券选择策略  
6.信用风险管理策略  
7.中小企业私募债券投资策略  
8.回购策略

业绩比较基准 固定利率类:1.50%+1.50%\*1年期定期存款利率(税后)+1.25%

风险收益特征 本基金为债券型基金,其预期风险与预期收益低于货币市场基金,低于股票型基金和混合型基金。

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

下属分级基金的基金代码 000940 中融增鑫一年定期开放债券C

下属分级基金的基金简称 中融增鑫一年定期开放债券C

报告期末下属分级基金的份额 0,000,000.00 6,000,000.00

\$ 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(2019年04月01日—2019年06月30日) 中融增鑫一年定期开放债券A 中融增鑫一年定期开放债券C

1.本期已实现收益 143,430.19 18,402.60

2.本期利润 36,160.95 -2,364.01

3.期末可供分配基金份额利润 0.0010 -0.0003

4.期末基金资产净值 47,040,000.00 9,064,953.26

5.期末基金份额净值 1.00 1.022

1.本期已实现收益指本基金本期利息收入、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、赎回费用,计入费用后实际收益水平将低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本基金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

中融增鑫一年定期开放债券A净值表现

阶段 净值增长(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.00% 0.00% 0.08% 0.01% -0.01% 0.00%

5.3 本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

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,本公司通过建立科学、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、交易执行等各个环节,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。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金在异常交易行为。

报告期末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 报告期内基金的利润分配情况

4.4.1 本报告期内本基金未进行利润分配。

4.4.2 本报告期内本基金未进行利润分配。

4.4.3 本报告期内本基金未进行利润分配。

4.4.4 本报告期内本基金未进行利润分配。

4.4.5 本报告期内本基金未进行利润分配。

4.4.6 本报告期内本基金未进行利润分配。

4.4.7 本报告期内本基金未进行利润分配。

4.4.8 本报告期内本基金未进行利润分配。

4.4.9 本报告期内本基金未进行利润分配。

4.4.10 本报告期内本基金未进行利润分配。

4.4.11 本报告期内本基金未进行利润分配。

4.4.12 本报告期内本基金未进行利润分配。

4.4.13 本报告期内本基金未进行利润分配。

4.4.14 本报告期内本基金未进行利润分配。

4.4.15 本报告期内本基金未进行利润分配。

4.4.16 本报告期内本基金未进行利润分配。

4.4.17 本报告期内本基金未进行利润分配。

4.4.18 本报告期内本基金未进行利润分配。

4.4.19 本报告期内本基金未进行利润分配。

4.4.20 本报告期内本基金未进行利润分配。

4.4.21 本报告期内本基金未进行利润分配。

4.4.22 本报告期内本基金未进行利润分配。

4.4.23 本报告期内本基金未进行利润分配。

4.4.24 本报告期内本基金未进行利润分配。

4.4.25 本报告期内本基金未进行利润分配。

4.4.26 本报告期内本基金未进行利润分配。

4.4.27 本报告期内本基金未进行利润分配。

4.4.28 本报告期内本基金未进行利润分配。

4.4.29 本报告期内本基金未进行利润分配。

4.4.30 本报告期内本基金未进行利润分配。

4.4.31 本报告期内本基金未进行利润分配。

4.4.32 本报告期内本基金未进行利润分配。

4.4.33 本报告期内本基金未进行利润分配。

4.4.34 本报告期内本基金未进行利润分配。

4.4.35 本报告期内本基金未进行利润分配。

4.4.36 本报告期内本基金未进行利润分配。

4.4.37 本报告期内本基金未进行利润分配。

4.4.38 本报告期内本基金未进行利润分配。

4.4.39 本报告期内本基金未进行利润分配。

4.4.40 本报告期内本基金未进行利润分配。

4.4.41 本报告期内本基金未进行利润分配。

4.4.42 本报告期内本基金未进行利润分配。

4.4.43 本报告期内本基金未进行利润分配。

4.4.44 本报告期内本基金未进行利润分配。

4.4.45 本报告期内本基金未进行利润分配。

4.4.46 本报告期内本基金未进行利润分配。

4.4.47 本报告期内本基金未进行利润分配。

4.4.48 本报告期内本基金未进行利润分配。

4.4.49 本报告期内本基金未进行利润分配。

4.4.50 本报告期内本基金未进行利润分配。

4.4.51 本报告期内本基金未进行利润分配。

4.4.52 本报告期内本基金未进行利润分配。

4.4.53 本报告期内本基金未进行利润分配。

4.4.54 本报告期内本基金未进行利润分配。

4.4.55 本报告期内本基金未进行利润分配。

4.4.56 本报告期内本基金未进行利润分配。

4.4.57 本报告期内本基金未进行利润分配。

4.4.58 本报告期内本基金未进行利润分配。

4.4.59 本报告期内本基金未进行利润分配。

4.4.60 本报告期内本基金未进行利润分配。

4.4.61 本报告期内本基金未进行利润分配。

4.4.62 本报告期内本基金未进行利润分配。

4.4.63 本报告期内本基金未进行利润分配。

4.4.64 本报告期内本基金未进行利润分配。

4.4.65 本报告期内本基金未进行利润分配。

4.4.66 本报告期内本基金未进行利润分配。

4.4.67 本报告期内本基金未进行利润分配。

4.4.68 本报告期内本基金未进行利润分配。

4.4.69 本报告期内本基金未进行利润分配。

4.4.70 本报告期内本基金未进行利润分配。

4.4.71 本报告期内本基金未进行利润分配。

4.4.72 本报告期内本基金未进行利润分配。

4.4.73 本报告期内本基金未进行利润分配。

4.4.74 本报告期内本基金未进行利润分配。

4.4.75 本报告期内本基金未进行利润分配。

4.4.76 本报告期内本基金未进行利润分配。

4.4.77 本报告期内本基金未进行利润分配。

4.4.78 本报告期内本基金未进行利润分配。

4.4.79 本报告期内本基金未进行利润分配。

4.4.80 本报告期内本基金未进行利润分配。

4.4.81 本报告期内本基金未进行利润分配。

4.4.82 本报告期内本基金未进行利润分配。

4.4.83 本报告期内本基金未进行利润分配。

4.4.84 本报告期内本基金未进行利润分配。

4.4.85 本报告期内本基金未进行利润分配。

4.4.86 本报告期内本基金未进行利润分配。

4.4.87 本报告期内本基金未进行利润分配。

4.4.88 本报告期内本基金未进行利润分配。

4.4.89 本报告期内本基金未进行利润分配。

4.4.90 本报告期内本基金未进行利润分配。

4.4.91 本报告期内本基金未进行利润分配。

4.4.92 本报告期内本基金未进行利润分配。

4.4.93 本报告期内本基金未进行利润分配。

4.4.94 本报告期内本基金未进行利润分配。

4.4.95 本报告期内本基金未进行利润分配。

4.4.96 本报告期内本基金未进行利润分配。

4.4.97 本报告期内本基金未进行利润分配。

4.4.98 本报告期内本基金未进行利润分配。

4.4.99 本报告期内本基金未进行利润分配。

4.4.100 本报告期内本基金未进行利润分配。

4.4.101 本报告期内本基金未进行利润分配。

4.4.102 本报告期内本基金未进行利润分配。

4.4.103 本报告期内本基金未进行利润分配。

4.4.104 本报告期内本基金未进行利润分配。

4.4.105 本报告期内本基金未进行利润分配。

4.4.106 本报告期内本基金未进行利润分配。

4.4.107 本报告期内