

信息披露Disclosure

中融增鑫一年定期开放债券型证券投资基金

2019年第三季度报告

4.3.1 公平交易制度的执行情况
根据《证券投资基金管理人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
二季度债市先抑后扬，整体呈现震荡行情。受超预期的经济数据和边际收紧的货币政策影响，四月份债市经历了较大的回调；五月中美贸易战升级，外围市场宽松预期高涨，美债步入下行通道，我国债市止跌回升；随后又经历了银行风险事件冲击，央行维稳等事件，债市行情多有起伏，最终收市整体小幅平坦化上移，资金面在维稳政策下后续料化宽松，信用风险现象明显；1年期国债上行18bp至2.73%，10年期上行18bp至3.63%，银行间R001价格大幅下行120bp至1.51%。
本基金根据市场动态调整配置策略，维持了适度的久期和杠杆水平。

4.5 报告期内基金的投资组合报告
截至报告期末中融增鑫定期开放债券A基金份额净值为1.351元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.07%，同期业绩比较基准收益率为0.68%；截至报告期末中融增鑫定期开放债券B基金份额净值为1.322元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.00%，同期业绩比较基准收益率为0.68%。

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	-	-
1.1	其中:股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	66,177,004.00	87.95
3.1	其中:债券	66,177,004.00	87.95
4	资产支持证券	-	-
5	贵金属投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
7	其他金融资产投资	-	-
8	其他	6,486,263.38	8.69
8.1	其中:买入返售金融资产	1,142,676.28	1.55
8.2	其他	5,343,587.10	7.19
9	合计	72,663,267.38	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

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	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
1.1	其中:股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	66,177,004.00	87.95
3.1	其中:债券	66,177,004.00	87.95
4	资产支持证券	-	-
5	贵金属投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
7	其他金融资产投资	-	-
8	其他	6,486,263.38	8.69
8.1	其中:买入返售金融资产	1,142,676.28	1.55
8.2	其他	5,343,587.10	7.19
9	合计	72,663,267.38	100.00

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	国债债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	63,000,600.00	33.62
4	企业债券	17,097,404.00	9.05
5	企业中期票据	20,080,000.00	10.72
6	中期票据	-	-
7	可转换债(可交换债)	-	-
8	其他债券	-	-
9	合计	100,177,004.00	100.13

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	49,424,236.00	51.72
1.1	其中:股票	49,424,236.00	51.72
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	6,060,600.00	6.28
3.1	其中:债券	6,060,600.00	6.28
4	资产支持证券	-	-
5	贵金属投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
7	其他金融资产投资	-	-
8	其他	-	-
9	合计	55,484,836.00	57.99

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	-	-
B	医药	13,369,676.61	13.72
C	制造业	29,077,560.04	30.30
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	1,286,000.00	1.30
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,040,263.76	4.21
J	金融业	2,387,309.94	2.39
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	国防军工	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	23,106.60	0.02
S	合计	49,424,236.00	51.68

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	000547	山东黄金	79,943	3,291,263.31	3.43
2	200927	招商局港口	40,000	1,361,280.00	1.42
3	000507	方大特钢	250,000	2,445,000.00	2.55
4	000746	恒泰实业	70,000	2,326,400.00	2.42
5	300025	通晟软件	100,000	2,273,280.00	2.37
6	002156	潮宏 jewelry	300,000	2,014,000.00	2.10
7	002227	恒顺股份	110,000	1,838,100.00	1.92
8	000898	华鲁恒升	100,000	1,774,000.00	1.85
9	300552	万福生科	40,000	1,727,400.00	1.80
10	001880	黄金珠宝	460,000	1,696,560.00	1.77

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	国债债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	6,060,600.00	6.28
4	企业债券	-	-
5	企业中期票据	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转换债(可交换债)	-	-
8	其他债券	-	-
9	合计	6,060,600.00	6.28

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	107,964,014.04	91.30
1.1	其中:股票	107,964,014.04	91.30
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	6,394,400.00	5.39
3.1	其中:债券	6,394,400.00	5.39
4	资产支持证券	-	-
5	贵金属投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
7	其他金融资产投资	-	-
8	其他	118,226,689.35	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	6,002,064.00	4.28
B	医药	31,408,000.00	20.76
C	制造业	6,394,400.00	4.54
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	1,102,240.00	0.79
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,266,000.00	0.90
J	金融业	58,110,144.04	41.27
K	房地产业	3,321,000.00	2.31
L	租赁和商务服务业	1,914,440.00	1.36
M	科学研究和技术服务业	59,264.00	0.07
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	国防军工	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	合计	107,964,014.04	91.42

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

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	000547	山东黄金	79,943	3,291,263.31	3.43
2	200927	招商局港口	40,000	1,361,280.00	1.42
3	000507	方大特钢	250,000	2,445,000.00	2.55
4	000746	恒泰实业	70,000	2,326,400.00	2.42
5	300025	通晟软件	100,000	2,273,280.00	2.37
6	002156	潮宏 jewelry	300,000	2,014,000.00	2.10
7	002227	恒顺股份	110,000	1,838,100.00	1.92
8	000898	华鲁恒升	100,000	1,774,000.00	1.85
9	300552	万福生科	40,000	1,727,400.00	1.80
10	001880	黄金珠宝	460,000	1,696,560.00	1.77

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	国债债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	6,060,600.00	6.28
4	企业债券	-	-
5	企业中期票据	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转换债(可交换债)	-	-
8	其他债券	-	-
9	合计	6,060,600.00	6.28

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	107,964,014.04	91.30
1.1	其中:股票	107,964,014.04	91.30
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	6,394,400.00	5.39
3.1	其中:债券	6,394,400.00	5.39
4	资产支持证券	-	-
5	贵金属投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
7	其他金融资产投资	-	-
8	其他	118,226,689.35	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	6,002,064.00	4.28
B	医药	31,408,000.00	20.76
C	制造业	6,394,400.00	4.54
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	1,102,240.00	0.79
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,266,000.00	0.90
J	金融业	58,110,144.04	41.27
K	房地产业	3,321,000.00	2.31
L	租赁和商务服务业	1,914,440.00	1.36
M	科学研究和技术服务业	59,264.00	0.07
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	国防军工	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	合计	107,964,014.04	91.42

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

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	000547	山东黄金	79,943	3,291,263.31	3.43
2	200927	招商局港口	40,000	1,361,280.00	1.42
3	000507	方大特钢	250,000	2,445,000.00	2.55
4	000746	恒泰实业	70,000	2,326,400.00	2.42
5	300025	通晟软件	100,000	2,273,280.00	2.37
6	002156	潮宏 jewelry	300,000	2,014,000.00	2.10
7	002227	恒顺股份	110,000	1,838,100.00	1.92
8	000898	华鲁恒升	100,000	1,774,000.00	1.85
9	300552	万福生科	40,000	1,727,400.00	1.80
10	001880	黄金珠宝	460,000	1,696,560.00	1.77

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	国债债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	6,060,600.00	6.28
4	企业债券	-	-
5	企业中期票据	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转换债(可交换债)	-	-
8	其他债券	-	-
9	合计	6,060,600.00	6.28

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	107,964,014.04	91.30
1.1	其中:股票	107,964,014.04	91.30
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	6,394,400.00	5.39
3.1	其中:债券	6,394,400.00	5.39
4	资产支持证券	-	-
5	贵金属投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
7	其他金融资产投资	-	-
8	其他	118,226,689.35	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	6,002,064.00	4.28
B	医药	31,408,000.00	20.76
C	制造业	6,394,400.00	4.54
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	1,102,240.00	0.79
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,266,000.00	0.90
J	金融业	58,110,144.04	41.27
K	房地产业	3,321,000.00	2.31
L	租赁和商务服务业	1,914,440.00	1.36
M	科学研究和技术服务业	59,264.00	0.07
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	国防军工	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	合计	107,964,014.04	91.42

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

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	000547	山东黄金	79,943	3,291,263.31	3.43
2	200927	招商局港口	40,000	1,361,280.00	1.42
3	000507	方大特钢	250,000	2,445,000.00	2.55
4	000746	恒泰实业	70,000	2,326,400.00	2.42
5	300025	通晟软件	100,000	2,273,280.00	2.37
6	002156	潮宏 jewelry	300,000	2,014,000.00	2.10
7	002227	恒顺股份	110,000	1,838,100.00	1.92
8	000898	华鲁恒升	100,000	1,774,000.00	1.85
9	300552	万福生科	40,000	1,727,400.00	1.80
10	001880	黄金珠宝	460,000	1,696,560.00	1.77

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	国债债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	6,060,600.00	6.28
4	企业债券	-	-
5	企业中期票据	-	-
6	中期票据		