中融量化精选混合型基金中基金（FOF）

2019年第二季度报告

2019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：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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2019年4月1日起至2019年6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	中融量化精选FOF
基金主代码	005758
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年05月04日
报告期末基金份额总额	44,570,450.75份
投资目标	本基金以数量化投资技术为基础，并与基本面研究紧密结合，努力把握市场投资机会，在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的持续稳健增长。
投资策略	1、大类资产配置策略 （1）战略资产配置 （2）战术资产配置 2、基金投资策略 3、股票投资策略 4、债券投资策略 5、资产支持证券投资策略 6. 权证投资策略
业绩比较基准	中证800指数收益率×20%＋中债综合财富指数收益率×75%＋同期银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为混合型基金中基金，其预期收益和风险高于货币市场基金、债市型基金中基金、债券型基金和债券型基金中基金，低于股票型基金和股票型基金中基金。本基金为风险收益特征相对稳健的基金中基金。
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简称	中融量化精选FOF（A）	中融量化精选FOF（C）
下属分级基金的交易代码	005758	005759
报告期末下属分级基金的份额总额	27,356,669.42份	17,213,781.33份

§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)	
	中融量化精选FOF（A）	中融量化精选FOF（C）
1.本期已实现收益	-214,569.68	-152,275.08
2.本期利润	-985,707.39	-643,043.64
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0353	-0.0363
4.期末基金资产净值	27,299,942.56	17,051,809.45
5.期末基金份额净值	0.9979	0.9906

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

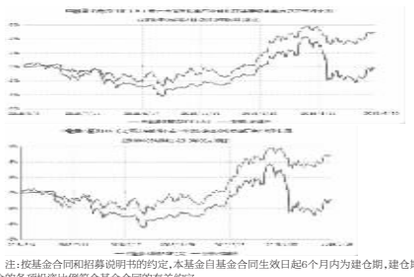
中融量化精选FOF（A）净值表现

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	-3.45%	0.57%	-0.12%	0.29%	-3.33%	0.28%

中融量化精选FOF（C）净值表现

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	-3.59%	0.57%	-0.12%	0.29%	-3.47%	0.28%

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



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		
哈图	中融量化精选混合型基金中基金（FOF）的基金经理。	2018-05-04	-	9	哈图先生，中国国籍，毕业于北京大学金融学专业，硕士研究生学历，具有基金从业资格，证券从业年限9年。2007年8月至2010年3月曾任职于天相投资顾问有限公司金融创新部，担任基金分析师；2010年4月至2012年1月曾任华夏人寿保险股份有限公司投资经理；2012年2月至2016年5月曾任英大资管投资经理、高级投资经理。2016年7月加入中融基金管理有限公司，现任策略投资部基金经理。

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。

（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遵规守信情况的说明

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

二季度经济呈现出“滞胀”迹象，一方面，受猪肉价格上涨影响，CPI同比涨幅大幅上行，通胀预期受到供给层面冲击开始升温，货币政策边际收紧，债券市场收益率震荡走高。同时，监管层对于场外资金监管趋严，政治局会议也表示对经济下行压力容忍度增加，政策重心转到解决结构性与体制性矛盾，加上中美贸易谈判出现反复，银行同业刚兑打破，市场风险偏好快速降低，从四月下旬开始权益市场出现了快速较大幅度的调整，5月份市场成交水平降至今年之前较高水平的一半左右。6月份，货币政策边际宽松，银行间可业流动性紧张得到有效控制，中美贸易谈判出现转机，美联储降息预期升温，数个经济体率先降息，股票与债券市场同时出现回暖，黄金价格4月飙涨，5、6月份，在中美谈判出现变数与美联储降息预期升温刺激下快速上涨，创出六年新高。

二季度初，降低了权益基金配置，增加了二级债基配置，在震荡环境中增加组合调整的灵活性。由于对于中美贸易谈判变化估计不足，在5月份市场的快速下跌中净值受到损失。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末中融量化精选FOF（A）基金份额净值为0.9979元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-3.45%，同期业绩比较基准收益率为-0.12%；截至报告期末中融量化精选FOF（C）基金份额净值为0.9906元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-3.59%，同期业绩比较基准收益率为-0.12%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内，本基金存在连续20个工作日基金资产净值低于5000万的情形。

§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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	41,700,074.58	93.30
3	固定收益投资	2,251,350.00	5.04
	其中：债券	2,251,350.00	5.04
	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	641,263.17	1.43
8	其他资产	103,361.90	0.23
9	合计	44,696,049.65	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

本基金本报告期末未持有股票。

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	2,251,350.00	5.08
	其中：政策性金融债	2,251,350.00	5.08
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）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,251,350.00	5.08

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	108603	国开1804	22,500	2,251,350.00	5.08

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，或在报告表编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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	45,908.95
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	56,953.25
5	应收申购款	499.70
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	103,361.90

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

本基金本报告期末未持有股票。

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 基金中基金

6.1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基金投资明细

序号	基金代码	基金名称	运作方式	持有份额（份）	公允价值	占基金资产净值比例(%)	是否属于基金管理人及管理人关联方所管理的基金
1	000191	富国信用债债券A/B	契约型开放式	3,800,000.00	4,007,100.00	9.03	否
2	519723	交银施罗德双轮动债券A/B	契约型开放式	3,700,000.00	3,977,500.00	8.97	否
3	217011	招商安心收益债券	契约型开放式	2,500,000.00	3,800,000.00	8.57	否
4	510500	500ETF	契约型开放式	600,000.00	3,199,200.00	7.21	否
5	518880	黄金ETF	契约型开放式	710,000.00	2,207,390.00	4.98	否
6	003218	前海开源祥和债券A	契约型开放式	1,862,054.83	2,201,135.01	4.96	否
7	159915	创业板	契约型开放式	1,500,000.00	2,185,500.00	4.93	否
8	510050	50ETF	契约型开放式	730,000.00	2,154,960.00	4.86	否
9	512800	银行ETF	契约型开放式	2,000,000.00	2,134,000.00	4.81	否
10	510300	300ETF	契约型开放式	550,000.00	2,122,450.00	4.79	否

6.2 当期交易及持有基金产生的费用

项目	本期费用2019年04月01日至2019年06月30日	其中：交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用
当期交易基金产生的申购费（元）	-	-
当期交易基金产生的赎回费（元）	17,952.14	-
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	11,460.54	-
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	55,733.99	-
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	14,705.34	4,960.96

当期持有基金产生的应支付销售服务费、应支付管理费、应支付托管费按照被投资基金基金合同约定已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，上表列示金额为按照本基金对被投资基金的实际持仓情况根据被投资基金基金合同约定的相应费率和计算方法计算得出。

根据相关法律法规及本基金合同的约定，基金管理人不得对基金中基金财产中持有的自身管理的基金部分收取基金中基金的管理费，基金托管人不得对基金中基金财产中持有的自身托管的基金部分收取基金中基金的托管费。基金管理人运用本基金财产中购自身管理的其他基金的（ETF除外），应当通过直销渠道申购且不收取申购费、赎回费（按照相关法规、基金招募说明书约定应当收取，并计入基金资产的赎回费用除外），销售服务费等销售费用，其中申购费、赎回费在实际申购、赎回时按上述规定执行，销售服务费由本基金管理人从被投资基金收取后返还至本基金基金资产。

6.3 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

本报告期持有的基金未发生重大影响事件。

§7 开放式基金份额变动

单位：份

	中融量化精选FOF（A）	中融量化精选FOF（C）
报告期期初基金份额总额	29,340,845.32	19,241,904.02
报告期期间基金总申购份额	131,093.05	243,592.86
减：报告期期间基金总赎回份额	2,115,268.95	2,271,715.55
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	0.00	0.00
报告期期末基金份额总额	27,356,669.42	17,213,781.33

§8 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

8.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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

投资者类别	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况	
			期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比	
机构	1	20190401－20190630	9,825,112.99	-	-	9,825,112.99	22.04%	
机构	2	20190401－20190630	20,004,400.00	-	-	20,004,400.00	44.88%	
产品特有风险								

本基金存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况，该类投资者大额赎回所持有的基金份额时，将可能产生流动性风险，即基金资产不能迅速变现，或者未能以合理的价格变现基金资产以支付投资者赎回款，对资产净值产生不利影响。

当开放式基金发生巨额赎回，基金管理人认为基金组合资产变现能力有限或认为因应对赎回导致的资产变现对基金单位份额净值产生较大的波动时，为了切实保护存量基金份额持有人的合法权益，可能出现延期支付赎回款等情形。同时为了公平对待所有投资者合法权益不受损害，管理人有权根据基金合同和招募说明书的约定，暂停或者拒绝申购、暂停赎回，基金份额持有人存在可能无法及时赎回持有的全部基金份额的风险。

9.2 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。

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

（1）中国证监会准予中融量化精选混合型基金中基金（FOF）募集的文件

（2）《中融量化精选混合型基金中基金（FOF）基金合同》

（3）《中融量化精选混合型基金中基金（FOF）招募说明书》

（4）《中融量化精选混合型基金中基金（FOF）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

10.2 存放地点

基金管理人或基金托管人的办公场所

10.3 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（免长途话费），（010）56517299。

网址：http://www.zrfunds.com.cn/

中融基金管理有限公司
2019年07月19日

中融聚明3个月定期开放债券型发起式证券投资基金

2019年第二季度报告

2019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：中国光大银行股份有限公司
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。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2019年4月1日起至2019年6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	中融聚明定期开放债券
基金主代码	006120
基金运作方式	契约型定期开放式
基金合同生效日	2018年12月07日
报告期末基金份额总额	1,002,269,355.42份
投资目标	本基金在追求基金资产长期稳定增值的基础上，力求获得超越业绩比较基准的稳定收益。
投资策略	1、封闭期投资策略 （1）资产配置策略 （2）债券投资组合策略 （3）信用类债券投资策略 （4）相对价值策略 （5）债券选择策略 （6）资产支持证券投资策略 （7）中小企业私募债券投资策略 （8）期限管理策略 （9）可转换债券投资策略 2、开放期投资策略
业绩比较基准	中债综合指数（全价）收益率
风险收益特征	本基金属于债券型证券投资基金，其预期风险收益水平低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。
基金管理人	中融基金管理有限公司
基金托管人	中国光大银行股份有限公司

§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（2019年04月01日－2019年06月30日）
1.本期已实现收益	8,104,810.72
2.本期利润	7,706,993.55
3.加权平均基金份额本期利润	0.0077
4.期末基金资产净值	1,028,869,052.06
5.期末基金份额净值	1.0265

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。

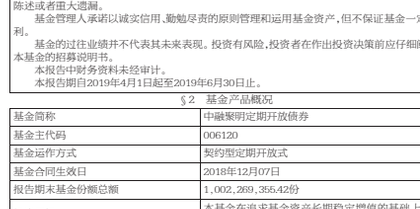
2、上述本基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，例如：基金的申购、赎回费等，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	0.76%	0.06%	-0.24%	0.06%	1.00%	0.00%

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



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		
王玥	中融恒信纯债债券型证券投资基金、中融季季红定期开放债券型证券投资基金、中融盈泽债券型证券投资基金、中融睿祥一年定期开放债券型证券投资基金、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、中融聚业3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中融恒裕纯债债券型证券投资基金、中融恒惠纯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的基金经理及固收投资部副总经理。	2018-12-28	-	8	王玥女士，中国国籍，北京大学经济学硕士，香港大学金融学硕士。具备基金从业资格，证券从业年限8年。2010年7月至2013年7月曾就职于中信建投证券股份有限公司固定收益部，任高级经理。2013年8月加入中融基金管理有限公司，现任固收投资部副总经理。

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。

（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遵规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵循《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

二季度经济增长继续放缓，通胀温和上升。工业增加值进一步走弱。固定资产投资增速回落至5.6%，主要依靠地产支撑；地产投资略有放缓，地产施工与建安投资呈现一定韧性；需求走弱压制制造业投资增速回落至2.7%；逆周期调节政策支持基建补短板，基建投资增速稳定在4%附近。减税降费促进社会消费品零售总额同比增速上升至8.6%。金融数据方面，信贷数据不强，非标融资平稳及低基数效应支撑社融增速。资金面整体保持宽松态势，5月底开始则出现流动性分层的现象。全球经济下行，美联储降息预期强烈，中美利差超过100BP。

二季度债券市场整体呈震荡行情。4月经济企稳概率增大，央行打消市场对降准的预期，债券收益率全面上行；5月中美贸易战升温，市场风险偏好下降，经济数据低于市场预期，收益率重回下行轨道；5月末银行同业破刚兑事件之后，信用分层现象明显，利率债和中高等级信用债收益震荡下行，低等级信用债则表现承压。具体来看，利率债方面，1年国开上行17BP，10年国开上行3BP，国开债收益率曲线平坦化上移；信用债方面，中高等级上行5BP左右，低等级信用债上行10BP左右。

组合以中高等级信用品种配置为主，二季度我们维持了中性的组合杠杆和较高久期，较好的分享了债券市场的上涨。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末中融聚明定期开放债券基金份额净值为1.0265元，本报告期内，基金份额净值增长率为0.76%，同期业绩比较基准收益率为-0.24%。

§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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,279,027,100.00	93.65
	其中：债券	1,279,027,100.00	93.65
	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	60,198,014.47	4.41
8	其他资产	26,545,014.93	1.94
9	合计	1,365,770,129.40	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

本基金本报告期末未持有股票。

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	748,425,100.00	72.74
	其中：政策性金融债	10,333,000.00	1.00
4	企业债券	482,412,000.00	46.89
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	48,190,000.00	4.68
9	其他	-	-
10	合计	1,279,027,100.00	124.31

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	1828006	18中国银行二级01	900,000	92,808,000.00	9.02
2	1720042	17华融湘江二级	900,000	91,638,000.00	8.91
3	112857	19广发03	800,000	80,112,000.00	7.79
4	136840	16华福G2	800,000	79,320,000.00	7.71
5	1828008	18中信银行二级01	500,000	51,440,000.00	5.00

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 报告期内基金投资的前十名证券除18中信银行二级01、18九江银行绿色金融01、18晋商银行、18浙商银行01外其他证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

央行南昌中心支行2018年9月28日发布对九江银行股份有限公司的行政处罚（南银罚字〔2018〕17号）；九江银监分局2018年10月29日发布对九江银行股份有限公司的行政处罚（浔银监罚决字〔2018〕18号）；江西银监局2018年11月20日发布对九江银行股份有限公司的行政处罚（赣银监罚决字〔2018〕34号）；银保监会2018年12月7日发布对浙商银行股份有限公司的行政处罚（银保监银罚决字〔2018〕11号）；银保监会2018年12月7日发布对中信银行股份有限公司的行政处罚（银保监银罚决字〔2018〕14号）；央行太原中心支行2018年12月17日发布对晋商银行股份有限公司的行政处罚（并银罚字〔2018〕第13号）；九江银保监分局2019年2月20日发布对九江银行股份有限公司的行政处罚（浔银保监罚决字〔2019〕1号）。

前述发行主体受到处罚未影响其正常业务运作，上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的规定。

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	29,608.34
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	26,515,406.59
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	26,545,014.93

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

本基金本报告期末未持有股票。

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	1,002,269,355.42
报告期期间基金总申购份额	-
减：报告期期间基金总赎回份额	-
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-