（上接B061版）

客服电话:400-804-8688

75)深圳前海财厚基金销售有限公司

住所:深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）

办公地址:深圳市南山区南山大道1088号南园枫叶大厦15层15K室

法定代表人:杨艳平

客服电话:0755-86575665

76)泰诚财富基金销售（大连）有限公司

住所:辽宁省大连市沙河口区星海中龙园3号

办公地址:辽宁省大连市沙河口区星海中龙园3号

法定代表人:李春光

电话:0411-88891212

联系人:徐江

客服电话:400-0411-001

77)上海万得基金销售有限公司

住所:中国（上海）自由贸易试验区福山路33号11楼B座

办公地址:上海市浦东新区福山路33号8楼

法定代表人:黄祎

电话:021-51327185

联系人:徐亚丹

客服电话:400-799-1888

78)北京汇成基金销售有限公司

住所：北京市海淀区中关村大街11号E世界财富中心A座11层1108号

办公地址:北京市海淀区中关村大街11号E世界财富中心A座11层

法定代表人:王伟刚

客服电话:400-619-9059

79)深圳市金斧子基金销售有限公司

住所：深圳市南山区粤海街道科技园中区科苑路15号科兴科学园B栋3单元11层1108

办公地址:深圳市南山区粤海街道科技园中区科苑路15号科兴科学园B栋3单元11层1108

法定代表人:赖任军

电话:0755-29330513

联系人:刘昕霞

客服电话:400-930-0660

80)北京肯特瑞基金销售有限公司

住所:北京市海淀区中关村东路66号1号楼22层2603-06

办公地址:北京市大兴区亦庄经济开发区科创十一街18号院京东集团总部

法定代表人:江卉

客服电话:95118

81)北京辉腾汇富基金销售有限公司

住所:北京市东城区朝阳门北大街8号2-2-1

法定代表人:许宁

电话:010-51455516

联系人:周雯

客服电话:400-829-1218

82)万家财富基金销售（天津）有限公司

住所:天津自贸区（中心商务区）迎宾大道1988号滨海浙商大厦公寓2-2413室

办公地址:北京市西城区丰盛胡同28号太平洋保险大厦5层

法定代表人:张军

电话:010-5901384

联系人:王芳芳

客服电话:010-59013842

83)上海大智慧基金销售有限公司

住所:中国（上海）自由贸易试验区杨高南路428号1号楼1102单元

办公地址:上海市浦东新区杨高南路428号1号楼1102、1103单元

法定代表人:申健

电话:021-20219988

联系人:张蜓

客服电话:021-20292031

84)和讯信息科技有限公司

住所:北京市朝阳区朝外大街22号1002室

办公地址:北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层

法定代表人:王莉

客服电话:400-920-0022

85)上海基煜基金销售有限公司

住所:上海市崇明县长兴镇路潘园公路1800号2号楼6153室（上海泰和经济发展区）

办公地址：上海市浦东新区银城中路488号的太平金融大厦1503-1504室

法定代表人:王翔

电话:021-65370077-209

联系人:俞申莉

客服电话:400-820-5369

86)凤凰金信（银川）基金销售有限公司

住所:宁夏银川市金凤区阅海湾中央商务区万寿路142号14层1402办公用房

办公地址:北京市朝阳区紫月路18号院朝来高科技产业园18号楼

法定代表人:张旭

客服电话:400-810-5919

87)南京苏宁基金销售有限公司

住所:南京市玄武区苏宁大道1-5号

办公地址:南京市玄武区苏宁大道1-5号

法定代表人:王锋

客服电话:95177

88)深圳盈信基金销售有限公司

住所：深圳市福田区莲花街道商报东路英龙商务大厦8楼A-1（811-812）

办公地址:大连市中山区南山1910小区A3-1

法定代表人:苗宏升

电话:0411-66661322

联系人:王清臣

客服电话:4007-903-688

89)乾道盈泰基金销售（北京）有限公司

住所:北京市西城区德胜门外大街13号院1号楼1302

办公地址:北京市西城区德胜门外大街合生财富广场1302室

法定代表人:董云巍

客服电话:400-088-8080

90)北京蛋卷基金销售有限公司

住所:北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507

办公地址:北京市朝阳区创远路34号院融新科技中心C座17层

法定代表人:钟斐斐

电话:010-61840688

联系人:戚晓强

客服电话:400-159-9288

91)武汉市伯嘉基金销售有限公司

住所:武汉市江汉区台北一路17-19号环亚大厦B座601室

办公地址:武汉市江汉区台北一路17-19号环亚大厦B座601室

法定代表人:陶捷

客服电话:400-027-9899

92)天津国美基金销售有限公司

住所:天津经济技术开发区第一大街79号MSDC1-28层2801

办公地址:北京市朝阳区霄云路26号鹏润大厦B座9层

法定代表人:丁东华

电话:010-59287105

联系人:许艳

客服电话:400-111-0889

93)北京格上富信基金销售有限公司

住所:北京市朝阳区东三环北路19号楼701内09室

办公地址:北京市朝阳区东三环北路19号楼701内09室

法定代表人:叶精一

电话:010-85594745

联系人:张林

客服电话:400-066-8586

94)上海挖财基金销售有限公司

住所:中国（上海）自由贸易试验区杨高南路799号5层01、02、03室

办公地址:中国（上海）自由贸易试验区杨高南路799号5层01、02、03室

法定代表人:冷飞

客服电话:021-50810673

95)上海华夏财富投资管理有限公司

住所:上海市虹口区东大名路687号1幢2楼268室

办公地址:北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座16层

法定代表人:毛淮平

客服电话:400-817-5666

96)中民财富基金销售（上海）有限公司

住所:上海市黄浦区中山南路100号7层05单元

办公地址：上海市浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼27层

法定代表人:弭洪军

客服电话:400-876-5716

97)深圳信诚基金销售有限公司

住所:深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）

办公地址:深圳市福田区时代财富大厦第49A单元

法定代表人:周文

客服电话:0755-23946579

98)喜鹊财富基金销售有限公司

住所:西藏拉萨市柳梧新区柳梧大厦1513室

办公地址:西藏拉萨市柳梧新区柳梧大厦1513室

法定代表人:陈皓

客服电话:4006997719

99)通华财富（上海）基金销售有限公司

住所:上海市虹口区同丰路667弄107号201室

办公地址:上海市浦东新区陆家嘴世纪金融广场杨高南路799号3号楼9楼

法定代表人:沈丹义

客服电话:4001019301 / 95193

100)沈阳麟龙投资顾问有限公司

住所:辽宁省沈阳市东陵区白塔二南街18-2号B座601

办公地址:辽宁省沈阳市东陵区白塔二南街18-2号B座601

法定代表人:朱荣晖

客服电话:400-003-5811

101)厦门市鑫鼎盛控股有限公司

住所:厦门市思明区鹭江道2号厦门第一广场西座1501-1504室

法定代表人:陈洪生

客服电话:400-918-0808

102)中证金牛（北京）投资咨询有限公司

住所:北京市丰台区东管头1号2号楼2-45室

办公地址:北京市西城区宣武门外大街甲1号环球财讯中心A座5层

法定代表人:钱昊旻

客服电话:4008-909-998

103)贵州省贵文文化基金销售有限公司

住所：贵州省贵阳市南明区龙洞堡电子商务港太升国际A栋2单元5层17号

办公地址:贵州省贵阳市南明区兴业西路CCDI大楼一楼

法定代表人:陈成

客服电话:0851-85407888

104)济安财富（北京）基金销售有限公司

住所:北京市朝阳区太阳宫中路16号院1号楼3层307

办公地址:北京市朝阳区太阳宫中路16号院1号楼3层307

法定代表人:杨健

电话:010-65309516

联系人:李海燕

客服电话:400-673-7010

105)嘉实财富管理有限公司

住所:中国（上海）自由贸易试验区世纪大道8号上海国金中心办公楼二期53层5312-15单元

办公地址:北京市朝阳区建国路91号金地中心A座6层

法定代表人:赵学军

电话:010-85097570

联系人:余永键

客服电话:400-021-8850

106)宜信普泽（北京）基金销售有限公司

住所:北京市朝阳区建国路88号9号楼15层1809

办公地址:北京市朝阳区建国路88号SOHO现代城C座1809

法定代表人:戎兵

电话:010-52858244

联系人:魏晨

客服电话:400-6099-200

107)和耕传承基金销售有限公司

住所:河南自贸试验区郑州片区（郑东）东风东路东、康宁街北6号楼6楼602、603房间

办公地址:北京市朝阳区酒仙桥路6号国际电子城360大厦A座

法定代表人:王旋

客服电话:4000-555-671

108)民商基金销售（上海）有限公司

办公地址:上海市浦东新区张杨路707号生命人寿大厦32楼

法定代表人:贲惠琴

客服电话:021-50206003

109)大河财富基金销售有限公司

住所：贵州省贵阳市南明区新华路110-134号富中国际广场1栋20层1.2号

法定代表人:王荻

客服电话:0851-88235678

110)大连网金基金销售有限公司

住所:辽宁省大连市沙河口区体坛路22号诺德大厦2层202室

法定代表人:樊怀东

客服电话:4000899100

111)成都华羿恒信基金销售有限公司

住所:中国（四川）自由贸易试验区成都高新区蜀锦路88号1号楼32楼2号

法定代表人:赵壁

客服电话:400-8010-009

112)江苏汇林保大基金销售有限公司

住所:南京市高淳区经济开发区古檀大道47号

法定代表人:吴言林

客服电话:025-56663409

113)泰信财富基金销售有限公司

住所:北京市朝阳区建国路甲92号-4至24层内18层1804

法定代表人:张虎

客服电话:400-004-8821

114)海银基金销售有限公司

住所:中国（上海）自由贸易试验区银城中路8号402室

法定代表人:惠晓川

客户服务电话:400-808-1016

115)中信期货有限公司

住所:深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座13层1301-1305室、14层

办公地址:深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座13层1301-1305室、14层

法定代表人:张皓

电话:13718246886/010-60834022

联系人:刘宏莹

客服电话:400-990-8826

116)东海期货有限责任公司

住所:江苏省常州市延陵西路23、25、27、29号

办公地址:上海市浦东新区东方路1928号东海证券大厦8楼

法定代表人:陈太康

客服电话:95531/4008888588

117)大有期货有限公司

住所:湖南省长沙市天心区芙蓉南路二段128号现代广场三、四楼

办公地址:湖南省长沙市天心区芙蓉南路二段128号现代广场三、四楼

法定代表人:颜如意

电话:0731-84409106、0731-84409130

联系人:马科、王霞

客服电话:4006-365-058

118)阳光人寿保险股份有限公司

住所:海南省三亚市迎宾路360-1号三亚阳光金融广场16层

法定代表人:李科

客服电话:95510

119)玄元保险代理有限公司

住所:中国（上海）自由贸易试验区张杨路707号1105室

法定代表人:马永谙

客服电话:021-50701082

基金管理人可以根据相关法律法规要求,选择其他符合要求的其他机构销售本基金,并及时公告。

二、登记机构

名称:中融基金管理有限公司

住所：深圳市福田区福田街道岗厦社区金田路3088号中洲大厦3202、3203B

办公地址: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

法定代表人:王瑶

电话:010-56517000

传真:010-56517001

联系人:李同庆

网址:www.zrfunds.com.cn

三、出具法律意见书的律师事务所

名称:上海市通力律师事务所

住所:上海市银城中路68号时代金融中心19楼

办公地址:上海市银城中路68号时代金融中心19楼

负责人:俞卫锋

电话：021-31358666

传真：021-31358600

联系人:安冬

经办律师:安冬、陆奇

四、审计基金资产的会计师事务所

名称:上会会计师事务所

住所:上海市静安区威海路755号文新报业大厦25楼

办公地址:上海市静安区威海路755号文新报业大厦25楼

执行事务合伙人:张晓荣（首席合伙人）

电话:021-52920000

传真:021-52921369

经办注册会计师:陈大愚、江嘉炜

联系人:杨伟平

第四部分　基金的名称

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

第五部分　基金类型、运作方式与存续期间

1. 基金类型:债券型。
2. 基金的运作方式:契约型开放式。
3. 基金存续期间:不定期。

第六部分　基金的投资目标

本基金采用被动式指数化投资,通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理手段,以实现对标的指数的有效跟踪。

第七部分　基金的投资范围

本基金主要投资于标的指数成分券及其备选成分券。为了更好地实现投资目标,本基金还可以投资于国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、可转换公司债券（含可分离交易可转债）的纯债部分、可交换公司债券的纯债部分、短期融资券、超短期融资券、中期票据、公司债、资产支持证券、债券回购、逆回购、同业存单、银行存款等,以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

基金的投资组合比例为:本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%,其中标的指数成份券、备选成份券的比例不低于本基金非现金基金资产的80%;现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

第八部分　基金的投资策略

本基金为被动式指数基金,采用最优复制法,主要以标的指数的成份券构成为基础,综合考虑跟踪效果、操作风险等因素构建组合,并根据本基金资产规模、日常申购赎回情况、市场流动性以及银行间和交易所债券交易特性及交易惯例等情况,进行取整和替代优化,以保证对标的指数的有效跟踪。

当预期成份券发生调整时,或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时,或因市场流动性不足时,或因债券交易特性及交易惯例等因素影响跟踪标的指数效果时,或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时,基金管理人将对投资组合管理进行适当变通和调整,构建替代组合。由于本基金资产规模、日常申购赎回情况、市场流动性、债券交易特性及交易惯例等因素的影响,本基金组合中个券权重和券种与标的指数成份券和券种间将存在差异。

在正常市场情况下,力争本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.30%,年跟踪误差不超过3%。如因指数编制规则或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围,基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

（一）资产配置策略

本基金将采用最优复制法，主要以标的指数的成份券构成为基础,综合考虑跟踪效果、操作风险等因素构建组合,并根据本基金资产规模、日常申购赎回情况、市场流动性以及银行间和交易所债券交易特性及交易惯例等情况,进行取整和替代优化,以保证对标的指数的有效跟踪。

（二）债券投资策略

本基金通过最优复制法进行被动式指数化投资,在力求跟踪误差最小化的前提下,本基金可采取适当方法对基金资产进行调整,降低交易成本,以期在规定的风险承受限度之内,尽量缩小跟踪误差。

1. 债券投资组合的构建

本基金在建仓期内,将按照标的指数各成份券构成,并综合考虑本基金资产规模、市场流动性和交易成本等因素对其逐步买入。当遇到成份券流动性不足、价格严重偏离合理估值、单只成份券交易量不符合市场交易惯例等其他市场因素及预期标的指数的成份券即将调整或其他影响指数复制的因素时,本基金可以根据市场情况,结合经验判断,对个券权重和券种进行适当调整,以期在规定的风险承受限度之内,尽量缩小跟踪误差。

当基金规模过小时,根据债券市场成交惯例,基金可能只能购买部分成份券;当基金规模过大时,受到市场流动性和法规限制等影响,基金将从备选成份券中挑选替代债券或替代组合满足跟踪需求。

2. 债券投资组合的调整

（1）定期调整

本基金所构建的指数化投资组合将定期根据所跟踪的标的指数对其成份券的调整而进行相应调整。

（2）不定期调整

1）当成份券发行量变动，本基金将根据指数的新构成进行相应调整;

2）本基金处理日常申购赎回时,资金量可能无法按照标的指数构成交易相应成份券。本基金将综合考虑交易规模、交易惯例和成份券（或备选成份券）的流动性等因素,对债券投资组合进行动态调整;

3）若成份券遇到退市、流动性不足、法规限制或组合优化需要等情况,基金管理人将综合考虑跟踪误差最小化和投资者利益,决定部分持有现金或买入相关的替代性组合。

（3）替代组合构建方法

由于定期和不定期的调整需求,基金管理人可构建替代组合。构建替代组合的方法如下:

1）按照与被替代债券久期、信用评级相似和交易市场相同的原则,选择标的指数成份券和备选成份券作为备选库;

2）采用备选库中各债券过去较长一段时间的历史数据,分析其与被替代债券的相关性,选择正相关度较高的债券进一步考察;

3）考察备选券的流动性，综合流动性和相关度两个指标挑选替代券,并使得替代组合与被替代债券的跟踪误差最小化。

（三）资产支持证券投资策略

资产支持证券主要包括资产抵押贷款支持证券（ABS）、住房抵押贷款支持证券（MBS）等证券品种。本基金将重点对市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等影响资产支持证券价值的因素进行分析，并辅助采用数量化定价模型,评估资产支持证券的相对投资价值并做出相应的投资决策。

（四）债券回购策略

基金份额的申购赎回会导致基金资产中现金比例的变化。

对于基金资产组合中持有的现金超出规定比例部分,基金管理人可进行债券逆回购操作,以提高基金整体收益。在发生基金份额大额赎回时,基金管理人可进行债券正回购操作,以提高基金资产中现金的比例,应对投资者的赎回要求。

（五）银行存款及同业存单投资策略

本基金在向交易对手银行进行询价的基础上,选取报价较高的银行进行存款投资,在投资过程中注重对交易对手信用风险的评估和选择。

第九部分　基金的业绩比较基准

1. 标的指数

上海清算所银行间1-3年高等级信用债指数

上海清算所银行间高等级信用债指数（SHCH High Grade Credit Bond Index）是反映银行间债券市场高等级信用债整体价格走势的分类指数,该指数包括4个待偿期分段指数,待偿期分段区间分别为1年以下、1至3年（包含1年）、3至5年（包含3年）、5至7年（包含5年）。本基金选用待偿期1至3年（包含1年）分段指数作为标的指数（即“上海清算所银行间1-3年高等级信用债指数”）。

指数成分券选取规则为:（1）流通场所:银行间市场;（2）债券品种:短期融资券、超短期融资券、中期票据、证券公司短期融资券;（3）发行方式:公募;（4）剩余期限:一天以上（包含一天）;（5）债券币种:人民币;（6）利率类型:固定利率;（7）付息方式:附息式固定利率、贴现式、利随本清;（8）含权情况:不包括含选择权条款债券;（9）信用级别:AAA（含）及以上;（10）债券评级:发行期限1年及以内的按主体评级,发行期限1年以上的按债项评级。

指数成分券原则上每日调整,符合条件的债券自上海清算所提供估值数据的第二个工作日起进入指数，不符合条件的债券当日即退出指数。

2. 业绩比较基准

上海清算所银行间1-3年高等级信用债指数收益率×95% + 银行活期存款利率（税后）×5%

如果今后法律法规发生变化,或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,或者是指数编制单位变更或停止标的指数的编制、发布或授权,或市场上出现更加适合用于本基金的业绩比较基准的指数时,本基金可以在与基金托管人协商同意后变更标的指数、业绩比较基准并及时公告。若变更标的指数、业绩比较基准涉及本基金投资范围或投资策略等实质性变更,则基金管理人应就变更标的指数、业绩比较基准召开基金份额持有人大会,并报中国证监会备案且在指定媒介公告。若变更标的指数、业绩比较基准对基金投资范围和投资策略等无实质性影响（包括但不限于指数编制单位变更、指数更名等事项）,本基金可以在与本基金托管人协商同意后变更标的指数、业绩比较基准并及时公告,而无需基金份额持有人大会审议。

第十部分　基金的风险收益特征

本基金为债券型基金，其长期平均风险和预期收益率低于股票基金、混合基金,高于货币市场基金。本基金为指数型基金,具有与标的指数、以及标的指数所代表的债券市场相似的风险收益特征。

第十一部分　基金的投资组合报告

本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。

本基金的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18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。

本投资组合报告所载数据截至2019年3月31日，本报告中所列财务数据未经审计。

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	10,700,254.20	96.18
	其中:债券	10,700,254.20	96.18
	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	153,861.73	1.38
8	其他资产	271,351.74	2.44
9	合计	11,125,467.67	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

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投资。

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投资。

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	999,600.00	9.01
2	央行票据	-	-
3	金融债券	2,797,736.90	25.21
	其中:政策性金融债	2,797,736.90	25.21
4	企业债券	6,902,917.30	62.20
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	10,700,254.20	96.42

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	136415	16华建01	10,040	1,004,000.00	9.05
2	136879	16国电资	10,000	1,002,800.00	9.04
3	122147	12华新02	10,000	1,002,500.00	9.03
4	136865	16新恩01	10,000	1,000,700.00	9.02
5	124662	14京投债	10,000	1,000,000.00	9.01

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投资。

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投资。

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。

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。

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。

11、投资组合报告附注

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,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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。

11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	455.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	270,896.74
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	271,351.74

11.4 报告期未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。

11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限的情况。

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。

第十二部分　基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。基金业绩数据截至2019年3月31日。

本基金合同生效日为2016年12月22日,基金合同生效以来基金投资业绩与同期业绩比较基准的比较如下表所示:

一、本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中融银行间1-3年高等级信用债指数A净值表现

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
2016年12月22日-2017年6月30日	0.97%	0.01%	1.90%	0.05%	-0.93%	-0.04%
2017年7月1日-2017年12月31日	1.11%	0.01%	1.11%	0.04%	0.00%	-0.03%
2018年1月1日-2018年6月30日	0.64%	0.02%	3.57%	0.05%	-2.93%	-0.03%
2018年7月1日-2018年12月31日	1.93%	0.06%	3.95%	0.05%	-2.02%	0.01%
2019年1月1日-2019年3月31日	0.44%	0.06%	1.49%	0.04%	-1.05%	0.02%

中融银行间1-3年高等级信用债指数C净值表现

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
2016年12月22日至2017年6月30日	0.81%	0.01%	1.90%	0.05%	-1.09%	-0.04%
2017年7月1日至2017年12月31日	0.92%	0.01%	1.11%	0.04%	-0.19%	-0.03%
2018年1月1日-2018年6月30日	0.40%	0.02%	3.57%	0.05%	-3.17%	-0.03%
2018年7月1日-2018年12月31日	1.77%	0.06%	3.95%	0.05%	-2.18%	0.01%
2019年1月1日-2019年3月31日	0.38%	0.06%	1.49%	0.04%	-1.11%	0.02%

二、自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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

第十三部分　基金的费用与税收

一、基金费用的种类

1. 基金管理人的管理费;
2. 基金托管人的托管费;
3. 基金合同生效后的标的指数许可使用费;
4. 本基金从C类份额的基金财产中计提的销售服务费;
5. 基金合同生效后与基金相关的信息披露费用;
6. 基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费;
7. 基金份额持有人大会费用;
8. 基金的证券交易费用;
9. 基金的银行汇划费用;
10. 基金的开户费用、账户维护费用;
11. 按照国家有关规定和基金合同约定,可以在基金财产中列支的其他费用。

二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1. 基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.30%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H＝E×0.30%÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,基金管理人与基金托管人核对一致后，以双方认可的方式于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。费用自动扣划后,基金管理人应进行核对,如发现数据不符,及时联系基金托管人协商解决。

2. 基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.10%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

H＝E×0.10%÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,基金管理人与基金托管人核对一致后，以双方认可的方式于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。费用自动扣划后,基金管理人应进行核对,如发现数据不符,及时联系基金托管人协商解决。

3. C类份额的销售服务费

本基金A类份额不收取销售服务费，基金C类基金份额的销售服务费率为年费率0.30%。

C类基金份额的销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值的0.30%年费率计提。计算方法如下:

H＝E×0.30%÷当年天数

H 为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为C类基金份额前一日基金资产净值

C类份额销售服务费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,基金管理人与基金托管人核对一致后，以双方认可的方式于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给登记机构,经登记机构分别支付给各个基金销售机构。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,支付日期顺延。

C类份额的销售服务费将专门用于本基金的推广、销售与基金份额持有人服务。

4. 基金合同生效后的标的指数许可使用费

本基金作为指数基金,需根据与指数所有人银行间市场清算所股份有限公司签署的指数许可使用协议的约定向银行间市场清算所股份有限公司支付指数许可使用费。如上述指数许可使用协议约定的费率发生变更,本条下的指数许可使用费将相应变更,基金管理人将在更新的招募说明书或公告中予以披露,而无需召开基金份额持有人大会。

通常情况下，指数许可使用费按前一日基金资产净值的0.02%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×年费率/当年天数

H为每日应计提的指数许可使用费

E为前一日的基金资产净值

指数许可使用费的收取下限为每季度人民币4万元（大写：肆万圆整）。计费期间不足一季度的,根据实际天数按比例计算。

指数许可使用费按前一日基金资产净值每日计算,逐日累计。标的指数许可使用费的支付方式为每季支付一次,基金合同生效后,由基金管理人向基金托管人发送指数许可使用费划付指令,经基金托管人复核后,于每年1月、4月、7月、10月的最后一个工作日前从基金财产中一次性支付给银行间市场清算所股份有限公司上一季度的标的指数许可使用费。

上述“一、基金费用的种类中第5-11项费用”,根据有关法规及相应协议规定,按费用实际支出金额列入当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。

三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用:

1. 基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失;
2. 基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;
3. 基金合同生效前的相关费用;
4. 其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

四、基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

第十四部分　对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他有关法律法规的要求,对本基金的招募说明书进行了更新,主要更新内容如下:

（一）更新了“第三部分　基金管理人”中的相关内容。

（二）更新了“第五部分　相关服务机构”中的相关内容。

（三）更新了“第二十一部分对基金份额持有人的服务”中的相关内容。

（四）更新了“第二十二部分　其他应披露事项”中的相关内容。

中融基金管理有限公司

2019年9月11日

中融基金管理有限公司关于中融沪港深大消费主题灵活配置混合型发起式证券投资基金暂停申购、赎回、定期定额投资业务的公告

公告送出日期:2019年9月11日

1. 公告基本信息

基金名称		中融沪港深大消费主题灵活配置混合型发起式证券投资基金
基金简称		中融沪港深大消费主题
基金主代码		005142
基金管理人名称		中融基金管理有限公司
公告依据		《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《中融沪港深大消费主题灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》、《中融沪港深大消费主题灵活配置混合型发起式证券投资基金招募说明书》的有关规定,以及港股通的休市安排。
暂停相关业务的起始日及原因说明	暂停申购起始日	2019年9月11日
	暂停赎回起始日	2019年9月11日
	暂停定期定额投资起始日	2019年9月11日
	暂停申购、赎回、定期定额投资的原因说明	2019年9月11日（星期三）至2019年9月15日（星期日）港股通休市
恢复相关业务的日期及原因说明	恢复申购日	2019年9月16日
	恢复赎回日	2019年9月16日
	恢复定期定额投资日	2019年9月16日
	恢复申购、赎回、定期定额投资的原因说明	2019年9月16日（星期一）起港股通恢复正常交易
下属基金份额类别的基金简称		中融沪港深大消费主题A	中融沪港深大消费主题C
下属基金份额类别的交易代码		005142	005143
该基金份额类别是否暂停申购、赎回、定期定额投资		是	是

注:（1）中融沪港深大消费主题灵活配置混合型发起式证券投资基金以下简称“本基金”;

（2）中融基金管理有限公司以下简称“本基金管理人”。

2. 其他需要提示的事项

（1）2019年9月16日（含当日）起,本基金恢复日常申购、赎回及定期定额投资业务,届时将不再另行公告。

（2）咨询办法:如有疑问，请拨打本基金管理人客户服务电话400-160-6000,010-56517299或登录本公司网站（www.zrfunds.com.cn）获取相关信息。

（3）风险提示:本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,也不保证最低收益。敬请投资者留意投资风险。

特此公告。

中融基金管理有限公司

2019年9月11日

中融基金管理有限公司基金经理变更公告

公告送出日期:2019年9月11日

一、公告基本信息

基金名称	中融日日盈交易型货币市场基金
基金简称	中融日盈
基金主代码	511930
基金管理人名称	中融基金管理有限公司
公告依据	《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《基金管理公司投资管理人员管理指导意见》等有关法规的规定。
基金经理变更类型	解聘基金经理
共同管理本基金的其他基金经理姓名	朱柏蓉
离任基金经理名称	李倩

二、离任基金经理的相关信息

离任基金经理姓名	李倩
离任原因	工作安排
离任日期	2019年9月9日
转任本公司其他工作岗位的说明	-
是否已按规定在中国基金业协会办理变更手续	是

三、其他需要说明的事项

上述事项已按有关规定在中国证券投资基金业协会完成变更手续。

中融基金管理有限公司

2019年9月11日

中融基金管理有限公司基金经理变更公告

公告送出日期:2019年9月11日

一、公告基本信息

基金名称	中融融安二号灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	中融融安二号混合
基金主代码	001739
基金管理人名称	中融基金管理有限公司
公告依据	《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《基金管理公司投资管理人员管理指导意见》等有关法规的规定。
基金经理变更类型	解聘基金经理
共同管理本基金的其他基金经理姓名	解静
离任基金经理名称	李倩

二、离任基金经理的相关信息

离任基金经理姓名	李倩
离任原因	工作安排
离任日期	2019年9月9日
转任本公司其他工作岗位的说明	-
是否已按规定在中国基金业协会办理变更手续	是

三、其他需要说明的事项