

国融融泰灵活配置混合型证券投资基金2019年第一季度报告

2019-03-31

基金管理人：国融融泰基金管理有限公司
基金托管人：江苏银行股份有限公司
报告送出日期：2019-04-22

重要提示

基金管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及连带责任。
基金管理人保证年度报告内容的真实性、准确性和完整性，且对于年度报告内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。
基金管理人保证年度报告内容的真实性、准确性和完整性，且对于年度报告内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金基本情况
基金名称：国融融泰混合
基金代码：006601
基金运作方式：契约型开放式
基金合同生效日：2019-01-30

主要财务指标

主要财务指标
主要财务指标 基金资产净值 期末基金资产净值 期初基金资产净值

基金净值表现

基金净值表现
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
本报告期末基金份额净值 1.0139

其他指标

其他指标
其他指标 报告期末基金份额净值 1.0139

基金经理简介

基金经理简介
姓名：曹晓波 职务：基金经理
姓名：曹晓波 职务：基金经理

公平交易专项说明

公平交易制度的执行情况
报告期内，本基金管理人严格执行了《公平交易管理制度》，公平对待不同投资组合，禁止不公平交易行为和利益输送。

报告期内基金的投资策略和运作分析

1、市场回顾与主要投资总结
2019年一季度，市场在经历了2018年底大幅下跌后，以科创板上市为契机，在国家系列政策支持下，包括科创板以及金融条件的宽松利好下更加明确，资本市场在政策推动下企稳回升。
2、未来投资展望及资产配置

报告期内基金的业绩表现

截至报告期末国融融泰混合基金份额净值为1.0139元。本报告期内，该基金份额净值增长率为1.39%，同期业绩比较基准收益率为0.89%。

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，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或基金资产净值低于五千万的情形。

投资组合报告

投资组合报告
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(%)

报告期末按行业分类的境内股权投资组合

报告期末按行业分类的境内股权投资组合
序号 行业类别 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

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

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(%)

报告期末按债券品种分类的债券投资组合

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(%)

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债券投资明细

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(%)

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

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
注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

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
注：本基金本报告期末未持有贵金属。

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

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
注：本基金本报告期末未持有权证。

报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
注：本基金本报告期末未持有股指期货。

报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
注：本基金本报告期末未持有国债期货。

投资组合报告附注

受处罚以及处罚情况
报告期内基金投资的前十名证券的发行主体未有被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

其他资产构成

其他资产构成
序号 名称 金额(元)
1 存出保证金 82,993.79

报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
序号 股票代码 债券名称 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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，各比例的分之和与各百分比之间可能存在尾差。

开放式基金份额变动

开放式基金份额变动
基金合同生效日基金总份额 349,976,176.29

基金管理人持有基金份额变动情况

基金管理人持有基金份额变动情况
项目 国融融泰混合 国融融泰混合A 国融融泰混合C

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
序号 交易方式 交易日期 交易金额(元) 交易金额(元) 适用费率

报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

报告期末发起式基金发起资金持有份额情况
项目 持有份额总数 持有份额占基金总份额比例 发起份额总数 发起份额占基金总份额比例

报告期末前十名投资者持有基金份额达到或超过10%的情况

报告期末前十名投资者持有基金份额达到或超过10%的情况
投资者类别 序号 持有基金份额数量达到或超过10%的持有时间(天) 期初份额 申购份额 赎回份额 持有期末持有基金份额 占基金资产净值比例

其他重要事项

(3) 中国证监会核准国融融泰灵活配置混合型证券投资基金注册文件；
(4) 国融融泰灵活配置混合型证券投资基金托管协议；
(5) 基金管理人基金投资策略报告。

备查文件目录

(1) 中国证监会核准国融融泰灵活配置混合型证券投资基金注册文件；
(2) 《国融融泰灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
(3) 《国融融泰灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
(4) 《国融融泰灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》；
(5) 基金管理人基金投资策略报告。

存放地点

《基金合同》、《托管协议》存放在基金管理人及基金托管人处；其余备查文件存放在基金管理人处。

查询方式

投资者可在营业时间免费查询或致电咨询，也可通过本机构网站查询。