

中融智选红利股票型证券投资基金

2019 年半年度报告摘要

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:交通银行股份有限公司

送出日期:2019 年 08 月 26 日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本半年度报告已经全体独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 8 月 19 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 2019 年 6 月 30 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	中融智选红利股票	
基金主代码	005569	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018年03月30日	
基金管理人	中融基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	133,770,273.59份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中融智选红利股票A	中融智选红利股票C
下属分级基金的交易代码	005569	005570
报告期末下属分级基金的份额总额	128,118,402.47份	5,651,871.12份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过量化选股模型，精选现金股息率高、分红稳定的股票组合进行投资，在合理控制风险的前提下，力争长期稳定的获取超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	<ol style="list-style-type: none"> 1、资产配置策略 2、股票投资策略 <ol style="list-style-type: none"> (1) 量化选股模型 (2) 投资组合优化模型 3、债券投资策略 4、中小企业私募债券投资策略 5、资产支持证券投资策略 6、股指期货投资策略 7、权证投资策略
业绩比较基准	中证红利指数收益率×95%+同期银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		中融基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	周妹云	陆志俊
	联系电话	010-56517129	95559
	电子邮箱	zhoumeiyun@zrfunds.com.cn	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		400-160-6000; 010-5651729 9	95559
传真		010-56517001	021-62701216

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.zrfunds.com.cn/
基金半年度报告备置地点	北京朝阳区东风南路3号院中融信托北京园区C座4层、5层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019年01月01日-2019年06月30日)	
	中融智选红利股票A	中融智选红利股票C
本期已实现收益	43,288,091.15	2,862,460.04
本期利润	53,860,277.75	5,239,108.86
加权平均基金份额本期利润	0.2610	0.3339
本期基金份额净值增长率	17.87%	17.56%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年06月30日)	
期末可供分配基金份额利润	-0.0174	-0.0244
期末基金资产净值	125,890,151.31	5,513,851.84
期末基金份额净值	0.9826	0.9756

- 1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；
- 2、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；
- 3、期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数；

3.2 基金净值表现

3.2.1 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

中融智选红利股票A

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
过去一个月	2.07%	1.11%	-1.33%	0.96%	3.40%	0.15%
过去三个月	-4.23%	1.51%	-6.71%	1.34%	2.48%	0.17%
过去六个月	17.87%	1.41%	14.14%	1.30%	3.73%	0.11%
过去一年	5.49%	1.39%	5.11%	1.28%	0.38%	0.11%
自基金合同生效起至今	-1.74%	1.30%	-3.84%	1.22%	2.10%	0.08%

中融智选红利股票C

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
过去一个月	2.03%	1.11%	-1.33%	0.96%	3.36%	0.15%

过去三 个月	-4.33%	1.51%	-6.71%	1.34%	2.38%	0.17%
过去六 个月	17.56%	1.41%	14.14%	1.30%	3.42%	0.11%
过去一 年	4.89%	1.39%	5.11%	1.28%	-0.22%	0.11%
自基金 合同生 效起至 今	-2.44%	1.30%	-3.84%	1.22%	1.40%	0.08%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

中融智选红利股票A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2018年03月30日-2019年06月30日)



中融智选红利股票C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2018年03月30日-2019年06月30日)



注：按照基金合同和招募说明书的约定，本基金自合同生效日起 6 个月内为建仓期，建仓期结束时本基金的各项资产配置比例符合基金合同的有关约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为中融基金管理有限公司，成立于2013年5月31日，由中融国际信托有限公司与上海融晟投资有限公司共同出资，注册资金11.5亿元人民币。

截至2019年6月30日，中融基金管理有限公司共管理48只基金，包括中融增鑫一年定期开放债券型证券投资基金、中融货币市场基金、中融国企改革灵活配置混合型证券投资基金、中融融安灵活配置混合型证券投资基金、中融新机遇灵活配置混合型证券投资基金、中融中证一带一路主题指数分级证券投资基金、中融中证银行指数分级证券投资基金、中融鑫起点灵活配置混合型证券投资基金、中融国证钢铁行业指数分级证券投资基金、中融中证煤炭指数分级证券投资基金、中融融安二号灵活配置混合型证券投资基金、中融稳健添利债券型证券投资基金、中融新经济灵活配置混合型证券投资基金、中融日日盈交易型货币市场基金、中融产业升级灵活配置混合型证券投资基金、中融融裕双利债券型证券投资基金、中融竞争优势股票型证券投资基金、中融融信双盈债券型证券投资基金、中融现金增利货币市场基金、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年中高等级信用债指数发起式证券投资基金、中融恒泰纯债债券型证券投资基金、中融量化多因子混合型发起式证券投资基金、中融鑫思路灵活配置混合型证券投资基金、中融物联网主题灵活配置混合型证券投资基金、中融量化智选混合型证券投资基金、中融盈泽债券型证券投资基金、中融量化小盘股票型发起式证券投资基金、中融恒信纯债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、中融核心成长灵活配置混合型证券投资基金、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、中融聚商3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中融鑫价值灵活配置混合型证券投资基金、中融季季红定期开放债券型证券投资基金、中融智选红利股票型证券投资基金、中融聚安3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中融量化精选混合型基金中基金（FOF）、中融医疗健康精选混合型证券投资基金、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、中融聚明3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中融恒惠纯债债券型证券投资基金、中融央视财经50交易型开放式证券投资基金、中融央视财经50交易型开放式证券投资基金联接基金、中融策略优选混合型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
易海波	中融量化多因子混合型发起式证券投资基金、中融量化智选混合型证券投资基金、中融智选红利股票型证券投资基金、中融量化小盘股票型发起式证券投资基金的基金经理及公司副总裁。	2018-03-30	-	12	易海波先生, 中国国籍, 毕业于华中科技大学企业管理专业, 硕士研究生学历, 取得基金业从业人员资格, 证券从业年限12年。2007年4月至2016年11月曾就职于招商证券股份有限公司, 历任研究发展中心金融工程研究员、理财投资部量化投资经理、量化投资部总经理。2016年11月加入中融基金管理有限

					公司，现任公司副总裁。
--	--	--	--	--	-------------

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合规守信情况的说明

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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2019年上半年，A股经历了一季度的上涨和二季度的调整，上证综指上涨19.45%，沪深300上涨27.07%，中证500上涨18.77%，中小板指上涨20.75%，创业板指上涨20.87%。申万一级行业全面上涨，其中食品饮料、非银金融、农林牧渔行业涨幅居前，建筑装饰、钢铁、传媒行业涨幅居后。

期间，本基金运用量化智能选股模型，考察股票多维度的信息，精选现金股息率高、分红稳定的股票组合进行投资，通过合理的风格分散和个股分散，减少了非系统性风险，获得了稳定的超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末中融智选红利股票A基金份额净值为0.9826元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为17.87%，同期业绩比较基准收益率为14.14%；截至报告期末中融智选红利股票C基金份额净值为0.9756元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为17.56%，同期业绩比较基准收益率为14.14%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2019年上半年，国内经济短周期下行压力加剧，中长期潜在增速下行，中美关系和全球化规则正经历重塑。同时，逆周期政策持续出台，在保持稳健的货币政策下，财政政策结构性扩张，政府宣布全年减税降费2万亿，增加居民收入，提升居民消费，持续扩大内需，对冲投资下行的影响。国际方面，全球经济仍然维持弱势，全球主要经济体制造业PMI指数不断创下新低，促使美联储态度持续软化，降息预期逐渐升温，引发多国央行率先降息。展望2019年下半年，美联储将结束缩表并大概率降息，全球央行预计开启宽松周期。国内在稳增长、稳就业的权衡下，逆周期政策仍有腾挪空间，经济有望阶段性企稳，随着减税降费持续落地，企业的盈利预期触底回升，产业结构升级也将优化盈利结构；资产配置角度，A股估值处于历史低位，也是全球相对最便宜的市场之一，在当前利率水平下，具有很高的配置价值，资金有望通过保险、养老目标基金、银行理财等形式持续流入。

本基金将继续以多因子量化选股模型为基础，顺应市场变化，优化因子选择和因子配置，遵循模型驱动的纪律性投资、分散化投资，力争在控制主动风险的前提下，获取长期稳健的超额收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及基金合同约定，本基金管理人严格按照新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所所在估值调整导致基金资产净值的变化在0.25%以上时对所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人与基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

本基金管理人设立估值委员会，成员由高级管理人员、投资研究部门、基金运营部门、风险管理部门、法律合规部门人员组成，负责研究、指导基金估值业务。基金管理人估值委员和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经验。报告期内，基金经理参加

估值委员会会议，但不介入基金日常估值业务；参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突；与估值相关的机构包括上海、深圳证券交易所，中国证券登记结算有限责任公司，中央国债登记结算有限责任公司、中证指数有限公司以及中国证券业协会等。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，托管人在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，中融基金管理有限公司在本基金投资运作、基金资产净值的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配，符合基金合同的规定。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本报告期，中融基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关本基金的半年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：中融智选红利股票型证券投资基金

报告截止日：2019年06月30日

单位：人民币元

资 产	本期末 2019年06月30日	上年度末 2018年12月31日
资 产：		
银行存款	10,195,286.47	18,643,920.46

结算备付金	659,170.55	195,586.27
存出保证金	120,223.95	167,387.54
交易性金融资产	120,532,174.30	253,623,947.40
其中：股票投资	120,532,174.30	253,623,947.40
基金投资	-	-
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	1,195,933.56	259,495.99
应收利息	2,305.55	4,420.66
应收股利	-	-
应收申购款	3,546.27	3,914.63
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	132,708,640.65	272,898,672.95
负债和所有者权益	本期末	上年度末
	2019年06月30日	2018年12月31日
负 债：		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	665,220.82	382,724.37
应付管理人报酬	159,816.26	357,343.74
应付托管费	26,636.04	59,557.30
应付销售服务费	2,237.86	11,580.90
应付交易费用	377,207.84	457,285.68
应交税费	-	-

应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	73,518.68	124,206.29
负债合计	1,304,637.50	1,392,698.28
所有者权益：		
实收基金	133,770,273.59	325,835,018.11
未分配利润	-2,366,270.44	-54,329,043.44
所有者权益合计	131,404,003.15	271,505,974.67
负债和所有者权益总计	132,708,640.65	272,898,672.95

报告截止日2019年6月30日，基金份额总额133,770,273.59份，其中A类基金份额的份额总额为128,118,402.47份，份额净值0.9826元；C类基金份额的份额总额为5,651,871.12份，份额净值0.9756元。

6.2 利润表

会计主体：中融智选红利股票型证券投资基金

本报告期：2019年01月01日至2019年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期2019年01月01日 至2019年06月30日	上年度可比期间 2018年03月30日（基金合同生 效日）至2018年06月30日
一、收入	62,737,914.59	-25,273,635.14
1. 利息收入	67,004.19	1,750,383.06
其中：存款利息收入	67,004.19	1,306,665.71
债券利息收入	-	-
资产支持证券利息收 入	-	-
买入返售金融资产收 入	-	443,717.35
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填 列）	49,624,471.57	-2,466,893.38

其中：股票投资收益	46,976,688.80	-4,926,680.74
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	2,647,782.77	2,459,787.36
3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	12,948,835.42	-24,625,605.45
4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5. 其他收入(损失以“-”号填列)	97,603.41	68,480.63
减：二、费用	3,638,527.98	2,884,019.87
1. 管理人报酬	1,576,643.92	1,595,140.64
2. 托管费	262,773.97	265,856.77
3. 销售服务费	36,705.56	73,394.12
4. 交易费用	1,688,191.01	907,744.58
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 税金及附加	-	-
7. 其他费用	74,213.52	41,883.76
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	59,099,386.61	-28,157,655.01
减：所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	59,099,386.61	-28,157,655.01

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：中融智选红利股票型证券投资基金

本报告期：2019年01月01日至2019年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2019年01月01日至2019年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	325,835,018.1 1	-54,329,043.4 4	271,505,974.67
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	59,099,386.61	59,099,386.61
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-192,064,744. 52	-7,136,613.61	-199,201,358.13
其中：1. 基金申购款	3,404,067.13	28,305.74	3,432,372.87
2. 基金赎回款	-195,468,811. 65	-7,164,919.35	-202,633,731.00
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	133,770,273.5 9	-2,366,270.44	131,404,003.15
项 目	上年度可比期间 2018年03月30日(基金合同生效日)至2018年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	436,946,975.5 2	-	436,946,975.52
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-28,157,655.0 1	-28,157,655.01
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-38,872,483.8 0	815,932.80	-38,056,551.00
其中：1. 基金申购款	707,754.80	-18,647.30	689,107.50
2. 基金赎回款	-39,580,238.6 0	834,580.10	-38,745,658.50

四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	398,074,491.72	-27,341,722.21	370,732,769.51

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

王瑶

黎峰

李同庆

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

中融智选红利股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2017]2447号文《关于准予中融智选红利股票型证券投资基金注册的批复》批准,由中融基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《中融智选红利股票型证券投资基金基金合同》(“基金合同”)公开募集,于2018年3月30日募集成立。本基金的基金管理人为中融基金管理有限公司,基金托管人为交通银行股份有限公司。

本基金募集期为2018年2月28日至2018年3月27日,本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,本基金共募集有效净认购资金人民币436,791,467.06元,折合436,791,467.06份中融智选红利基金份额(其中:A类基金份额为372,050,933.08份;C类基金份额为64,740,533.98份)。有效认购资金在募集期间产生的利息为人民币155,508.46元,折合155,508.46份中融智选红利基金份额(其中:A类基金份额为135,756.17份;C类基金份额为19,752.29份),以上收到的实收基金共计人民币436,946,975.52元,折合436,946,975.52份中融智选红利股票基金份额,有效认购户数为4831户。本基金募集资金经上会会计师事务所(特殊普通合伙)验资。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和基金合同等有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板和其他经中国证监会核准发行上市的股票)、债券(包括国债、金融债券、地方政府债、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据、企业债券、公司债券、可转换公司债券(含可分离交易可转债)、可交换公司债券、中小企业私募债、次级债等)、债券回购、货币市场工具、银行存款、同业存单、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工

具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金业绩比较基准为：中证红利指数收益率 X95%+同期银行活期存款利率（税后）X5%

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日颁布的企业会计准则及相关规定（以下简称“企业会计准则”）及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2019年上半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2019年06月30日的财务状况以及2019年上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需说明的会计政策变更事项。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需说明的会计估计变更事项。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无差错事项。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局国家税务总局财税[1998]55号《关于证券投资基金税收问题的通知》、财税[2008]1号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》、财税[2016]46号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税

[2016]70号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、国发[1985]19号发布和国务院令[2011]第588号修订的《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例》、国务院令[2005]第448号《国务院关于修改〈征收教育费附加的暂行规定〉的决定》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

1、资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

2、对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不缴纳企业所得税。

3、对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴个人所得税，个人从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

4、对基金取得的债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税，暂不缴纳企业所得税。

5、基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

6、基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价，暂免于缴纳印花税、企业所得税和个人所得税。

7、本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方无发生变化的情况。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中融基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
交通银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构

以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易**6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易****6.4.8.1.1 股票交易**

无。

6.4.8.1.2 权证交易

无。

6.4.8.1.3 债券交易

无。

6.4.8.1.4 债券回购交易

无。

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

无。

6.4.8.2 关联方报酬**6.4.8.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2019年01月01日 至2019年06月30 日	上年度可比期间 2018年03月30日（基金合同 生效日）至2018年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,576,643.92	1,595,140.64

其中：支付销售机构的客户维护费	1,034,175.10	949,266.01
-----------------	--------------	------------

①支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值1.50%的年费率计提，每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.50% / 当年天数。

②客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019年01月01日至2019年06月30日	2018年03月30日（基金合同生效日）至2018年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	262,773.97	265,856.77

①支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提，每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值×0.25% / 当年天数。

6.4.8.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2019年01月01日至2019年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中融智选红利股票A	中融智选红利股票C	合计
中融基金管理有限公司	0.00	2,936.39	2,936.39
交通银行股份有限公司	0.00	3,964.87	3,964.87
合计	0.00	6,901.26	6,901.26
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2018年03月30日（基金合同生效日）至2018年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		

	中融智选红利股票A	中融智选红利股票C	合计
中融基金管理有限公司	0.00	6,248.80	6,248.80
交通银行股份有限公司	0.00	15,497.79	15,497.79
合计	0.00	21,746.59	21,746.59

支付基金销售机构的C类基金份额销售服务费按前一日C类基金资产净值0.50%的年费率计提，每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付给注册登记机构，再由注册登记机构代付给销售机构。A类基金份额不收取销售服务费。C类基金销售服务费的计算公式为：C类基金份额的日销售服务费=前一日C类基金资产净值×0.50%/当年天数。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年01月01日至20 19年06月30日		上年度可比期间 2018年03月30日（基金合同生效日） 至2018年06月30日	
	期末余额	当期利息 收入	期末余额	当期利息收入
交通银行股份有限公司	10,195,286.47	58,687.18	33,676,218.77	136,131.89

本基金的银行存款由基金托管人保管，按银行同业利率计息。本基金用于证券交易结算的资金通过托管人托管结算资金专用存款账户转存于中国证券登记结算有限责任公司，按银行同业利率计息。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

6.4.8.7.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.9 期末（2019年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
601236	红塔证券	2019-06-26	2019-07-05	新股申购	3.46	3.46	9,789	33,869.94	33,869.94	-
300788	中信出版	2019-06-27	2019-07-05	新股申购	14.85	14.85	1,556	23,106.60	23,106.60	-

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

1、公允价值

- (1) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值接近于公允价值。

(2) 以公允价值计量的金融工具

① 金融工具公允价值计量的方法

本基金以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债，其公允价值计量基于公允价值的输入值的可观察程度以及该等输入值对公允价值计量整体的重要性，被划分为三个层次：

第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。

② 各层级金融工具公允价值

本基金本报告期末持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币120,475,197.76元，属于第二层次的余额为人民币56,976.54元，无属于第三层次的余额。

③ 公允价值所属层级间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间及交易不活跃期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

本基金本报告期持有的以公允价值计量的金融工具，在第一层次和第二层次之间无重大转换。

2、除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	120,532,174.30	90.82
	其中：股票	120,532,174.30	90.82

2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	10,854,457.02	8.18
8	其他各项资产	1,322,009.33	1.00
9	合计	132,708,640.65	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

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	2,026,410.24	1.54
B	采矿业	9,702,736.55	7.38
C	制造业	41,274,516.39	31.41
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,820,038.90	5.19
E	建筑业	4,949,916.00	3.77
F	批发和零售业	2,343,003.62	1.78
G	交通运输、仓储和邮政业	4,687,933.00	3.57
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,526,210.40	1.92
J	金融业	22,610,662.34	17.21
K	房地产业	16,369,134.46	12.46
L	租赁和商务服务业	4,887,913.80	3.72
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	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	2,333,698.60	1.78
S	综合	-	-
	合计	120,532,174.30	91.73

7.3 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

金额单位：人民币元

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	601318	中国平安	36,000	3,189,960.00	2.43
2	600887	伊利股份	84,713	2,830,261.33	2.15
3	000877	天山股份	231,700	2,692,354.00	2.05
4	002081	金螳螂	254,800	2,626,988.00	2.00
5	600380	健康元	303,640	2,626,486.00	2.00
6	000157	中联重科	428,300	2,574,083.00	1.96
7	601838	成都银行	290,900	2,568,647.00	1.95
8	600466	蓝光发展	411,780	2,561,271.60	1.95
9	600720	祁连山	291,200	2,559,648.00	1.95
10	000789	万年青	254,800	2,553,096.00	1.94

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于 <http://www.zrfunds.com.cn/> 网站的半年度报告正文。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601225	陕西煤业	10,582,652.26	3.90

2	002538	司尔特	10,175,316.00	3.75
3	600090	同济堂	9,064,582.00	3.34
4	600188	兖州煤业	8,987,917.40	3.31
5	000338	潍柴动力	8,844,020.20	3.26
6	002068	黑猫股份	8,694,812.95	3.20
7	601006	大秦铁路	8,355,926.00	3.08
8	000951	中国重汽	8,193,241.00	3.02
9	600020	中原高速	8,177,838.57	3.01
10	601838	成都银行	8,017,978.00	2.95
11	600308	华泰股份	7,998,560.00	2.95
12	601288	农业银行	7,940,370.94	2.92
13	601398	工商银行	7,912,965.06	2.91
14	601988	中国银行	7,839,496.00	2.89
15	000789	万年青	7,742,873.45	2.85
16	002818	富森美	7,619,184.54	2.81
17	600873	梅花生物	7,495,868.00	2.76
18	600681	百川能源	7,475,469.00	2.75
19	000002	万科A	6,366,838.13	2.35
20	601877	正泰电器	5,923,433.90	2.18
21	002128	露天煤业	5,828,438.37	2.15
22	002626	金达威	5,806,398.38	2.14
23	000568	泸州老窖	5,632,054.00	2.07
24	000038	深大通	5,629,511.60	2.07
25	601229	上海银行	5,622,527.92	2.07
26	600743	华远地产	5,621,907.50	2.07
27	601238	广汽集团	5,592,484.54	2.06
28	000525	红太阳	5,578,151.02	2.05
29	002616	长青集团	5,525,038.00	2.03
30	000709	河钢股份	5,510,840.00	2.03
31	002705	新宝股份	5,509,564.61	2.03
32	000006	深振业A	5,508,056.00	2.03

33	000778	新兴铸管	5,472,292.58	2.02
34	600348	阳泉煤业	5,430,552.98	2.00

“买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600020	中原高速	15,066,767.20	5.55
2	601288	农业银行	13,426,268.00	4.95
3	000002	万科A	12,365,413.31	4.55
4	002051	中工国际	11,815,917.32	4.35
5	601877	正泰电器	11,513,491.67	4.24
6	601006	大秦铁路	11,264,302.00	4.15
7	002538	司尔特	11,143,198.65	4.10
8	601398	工商银行	11,086,790.00	4.08
9	601988	中国银行	10,815,616.00	3.98
10	601225	陕西煤业	10,655,344.64	3.92
11	600348	阳泉煤业	10,490,503.45	3.86
12	600123	兰花科创	9,947,544.70	3.66
13	000951	中国重汽	9,883,093.38	3.64
14	601088	中国神华	9,510,687.84	3.50
15	600090	同济堂	9,150,501.00	3.37
16	600261	阳光照明	9,121,563.49	3.36
17	603355	莱克电气	9,093,028.92	3.35
18	002128	露天煤业	8,996,970.00	3.31
19	600308	华泰股份	8,708,997.50	3.21
20	002068	黑猫股份	8,103,492.62	2.98
21	600873	梅花生物	7,541,987.00	2.78
22	000828	东莞控股	7,500,204.81	2.76
23	600585	海螺水泥	7,376,553.00	2.72

24	000338	潍柴动力	7,332,855.00	2.70
25	600649	城投控股	7,279,242.72	2.68
26	000789	万年青	7,241,009.75	2.67
27	000069	华侨城 A	7,232,138.00	2.66
28	600507	方大特钢	6,996,413.00	2.58
29	002091	江苏国泰	6,968,801.41	2.57
30	600704	物产中大	6,916,318.50	2.55
31	002146	荣盛发展	6,833,306.57	2.52
32	600188	兖州煤业	6,818,473.60	2.51
33	601169	北京银行	6,760,100.00	2.49
34	002626	金达威	6,739,596.62	2.48
35	000568	泸州老窖	6,720,243.00	2.48
36	600641	万业企业	6,708,485.19	2.47
37	601009	南京银行	6,670,575.54	2.46
38	000723	美锦能源	6,585,377.80	2.43
39	600567	山鹰纸业	6,537,178.00	2.41
40	601003	柳钢股份	6,491,254.00	2.39
41	600970	中材国际	6,488,180.16	2.39
42	002616	长青集团	6,465,615.00	2.38
43	002539	云图控股	6,460,774.93	2.38
44	000006	深振业 A	6,425,225.00	2.37
45	600056	中国医药	6,354,128.08	2.34
46	002572	索菲亚	6,341,693.68	2.34
47	002004	华邦健康	6,283,329.30	2.31
48	600028	中国石化	6,277,520.80	2.31
49	601998	中信银行	6,277,064.00	2.31
50	600036	招商银行	6,274,724.32	2.31
51	000038	深大通	6,252,037.16	2.30
52	000778	新兴铸管	6,190,368.91	2.28
53	002233	塔牌集团	6,141,452.15	2.26
54	603989	艾华集团	6,092,026.00	2.24

55	600660	福耀玻璃	6,082,805.00	2.24
56	600808	马钢股份	6,009,582.00	2.21
57	600919	江苏银行	5,966,038.00	2.20
58	601229	上海银行	5,946,138.80	2.19
59	000525	红太阳	5,890,986.04	2.17
60	600548	深高速	5,857,549.48	2.16
61	002705	新宝股份	5,817,759.78	2.14
62	600820	隧道股份	5,698,618.00	2.10
63	601838	成都银行	5,621,673.00	2.07
64	000709	河钢股份	5,616,621.00	2.07
65	600741	华域汽车	5,574,059.84	2.05
66	002818	富森美	5,563,206.44	2.05
67	601238	广汽集团	5,515,127.95	2.03

“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	506,996,899.80
卖出股票收入（成交）总额	700,014,197.12

“买入股票成本总额”和“卖出股票收入总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 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

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 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。

7.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 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。

7.10 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。

7.11 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

7.12.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	120,223.95
2	应收证券清算款	1,195,933.56
3	应收股利	-
4	应收利息	2,305.55
5	应收申购款	3,546.27
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,322,009.33

7.12.4 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。

7.12.5 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。

7.12.6 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
中融智选红利股票A	2,068	61,952.81	0.00	0.00%	128,118,402.47	100.00%
中融智选红利股票C	490	11,534.43	7,002.57	0.12%	5,644,868.55	99.88%
合计	2,558	52,294.87	7,002.57	0.01%	133,763,271.02	99.99%

分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	中融智选红利股票A	2,148.70	0.00%
	中融智选红利	11,313.72	0.20%

	股票C		
	合计	13,462.42	0.01%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

- 1、本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金；
- 2、本基金基金经理未持有本开放式基金。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	中融智选红利股票A	中融智选红利股票C
基金合同生效日(2018年03月30日)基金份额总额	372,186,689.25	64,760,286.27
本报告期期初基金份额总额	294,609,444.90	31,225,573.21
本报告期基金总申购份额	2,727,165.45	676,901.68
减：本报告期基金总赎回份额	169,218,207.88	26,250,603.77
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	128,118,402.47	5,651,871.12

申购含红利再投、转换入份额及金额，赎回含转换出份额及金额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

(1) 基金管理人的重大人事变动情况

本基金管理人于2019年1月10日发布《高级管理人员变更公告》，黄震先生担任中融基金管理有限公司副总裁。

本基金管理人于2019年2月13日发布《高级管理人员变更公告》，王瑶女士代任中融基金管理有限公司总经理，同时原总经理杨凯先生离职。

本基金管理人于2019年4月25日发布《高级管理人员变更公告》，曹健先生担任中融基金管理有限公司督察长，同时原督察长向祖荣先生离职。

本基金管理人于2019年6月28日发布《首席信息官任职公告》，黎峰先生担任中融

基金管理有限公司首席信息官。

(2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，为本基金进行审计的会计师事务所为上会会计师事务所（特殊普通合伙），本报告期内未变更为其提供审计服务的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期无管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
长城证券	1	-	-	-	-	-
网信证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	895,316,079.56	74.30%	654,742.48	74.30%	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	2	46,619,068.30	3.87%	34,093.04	3.87%	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-

东兴证券	2	136,861,997.79	11.36%	100,088.03	11.36%	-
渤海证券	2	-	-	-	-	新增2个交易日
西南证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	14,198,681.15	1.18%	10,383.31	1.18%	-
光大证券	2	109,334,404.59	9.07%	79,956.25	9.07%	-
中泰证券	2	2,730,527.12	0.23%	1,996.93	0.23%	-

①为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即：

- i 经营行为规范，在近一年内无重大违规行为。
- ii 公司财务状况良好。
- iii 有良好的内控制度，在业内有良好的声誉。
- iv 有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告。
- v 建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯和服务。

②券商专用交易单元选择程序：

- i 对交易单元候选券商的研究服务进行评估
本基金管理人组织相关人员依据交易单元选择标准对交易单元候选券商的服务质量和研究实力进行评估，确定选用交易单元的券商。
- ii 协议签署及通知托管人
本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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

本基金本报告期间无单一投资者持有基金份额达到或超过20%的情况。

11.2 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。

中融基金管理有限公司
二〇一九年八月二十六日