

基金管理人:融通基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

报告送出日期:2018年7月19日

§ 1 重要提示

融通利系列证券投资基金由融通债基投资资金、融通深证100指数证券投资资金和融通蓝筹成长证券投资基金共同构成。本报告为融通利系列证券投资基金之子基金金融债基(以下简称“本基金”)2018年第2季度报告。

基金管理人的董事会及董事保证本报告中所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其中内容的真实性、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2018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。

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2018年4月1日起至2018年6月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	融通债基
交易代码	161003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2003年9月30日
报告期末基金份额总额	101,731,331.67份
投资目标	在谨慎控制风险的前提下，追求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	以价值化为基本准则，利用收益曲线模型和债券品种的定价模型，在获取较好的稳定性收益的基础上，把握市场出现的短期投资机会。
业绩比较基准	中债综合全价(总值)指数收益率
风险收益特征	属于相对低风险的基金品种
基金管理人	融通基金管理有限公司
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	融通债基A/B
下属分级基金的交易代码	161003 161093
下属分级基金的前端交易代码	161003 161093
下属分级基金的份额总额	17,477,836.04份 27,563,501.03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(2018年4月1日 - 2018年6月30日)
1.本期已实现收益	1,103,891.10
2.本期利润	3,366,746.36
3.加权平均基金份额本期利润	0.0302
4.期末基金份额净值	96,206,210.01
5.期末基金份额总额	1,282

注: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.本报告所列示的基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计人费用后实际收益水平要低于所列数据。

融通通利系列证券投资基金之融通债券投资基金

2018年第二季度报告

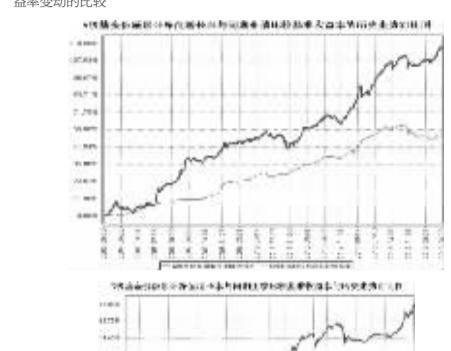
3.2 基金净值表现

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

融通债基A/B	
阶段	净值增长率 标准差①
过去三个月	3.47% 0.22%

融通债基C	
阶段	净值增长率 标准差①
过去三个月	3.46% 0.23%

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:任免日期根据基金管理人对外披露的任免日期填写;证券从业年限以从事证券业务相关的工作时间为计算标准。

4.1 管理人对报告期内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守《证券投资基金法》等有关法律法规和本基金合同的规定,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,为基金持有人谋求最大利益,无损害基金持有人利益的行为,本基金投资组合符合有关法律法规的规定及基金合同的约定。

4.2 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一直坚持公平对待旗下所有投资组合的原则,并制定了相应的制度和流程。在授权、研究、决策、交易和业绩评估等各个环节保证公平交易制度的严格执行。报告期内,基金管理人严格执行了公平交易的原则和制度。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金报告期内未发生异常交易。

4.4 报告期内基金投资策略和操作分析

报告期内,本基金管理人严格按照法律法规及基金合同的规定及基金合同的约定进行投资操作。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为1.282元,本报告期基金份额净值增长率为

注:1.本基金A类基金份额业绩比较基准项目分段计算,其中:2009年12月31日(含此日)之前采用“银行间债券综合指数”,2010年1月1日起至2015年9月30日(含此日)采用“中信标普全债指数收益率”,2015年10月1日起采用新基准“中债综合全价(总值)指数收益率”;本基金C类基金份额业绩比较基准项目分段计算,其中:2012年2月20日(含此日)之前采用“中信标普全债指数收益率”,2015年10月1日起采用新基准“中债综合全价(总值)指数收益率”。

4.6 管理人报告

截至报告期末,本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五十万元的情形。

4.7 投资组合报告

截至报告期末,本基金投资组合资产配置比例为:债券95.00%,银行存款及其他资产5.00%。

4.8 备查文件目录

(一) 中国证监会准予本基金募集注册的文件

(二) 《融通利系列证券投资基金基金合同》

(三) 《融通利系列证券投资基金招募说明书》

(四) 《融通利系列证券投资基金投资说明书》及更新

(五) 融通基金管理有限公司业务资格批件和营业执照

(六) 报告期内在指定报刊上披露的各项公告

(七) 报告期内在指定报刊上披露的各份报告

(八) 其他备查文件

注:任免日期根据基金管理人对外披露的任免日期填写;证券从业年限以从事证券业务相关的工作时间为计算标准。

4.9 公平交易专项说明

报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规和本基金合同的规定,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,为基金持有人谋求最大利益,无损害基金持有人利益的行为,本基金投资组合符合有关法律法规的规定及基金合同的约定。

4.10 管理人对报告期内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守《证券投资基金法》等有关法律法规和本基金合同的规定,并勤勉尽责地履行了基金管理人的职责,没有损害基金份额持有人的利益。

本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2018年4月1日起至6月30日止。

§ 2 基金产品概况

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2018年4月1日 - 2018年6月30日)
1.本期已实现收益	-18,125,404.07
2.本期利润	-62,073,670.08
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0952
4.期末基金份额净值	1,224,944.09/0.03
5.期末基金份额总额	1,0149

注: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.本报告所列示的基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计人费用后实际收益水平要低于所列数据。

3.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

融通债基A/B	
阶段	净值增长率 标准差①
过去三个月	-4.93% 1.26%

融通债基C	
阶段	净值增长率 标准差①
过去三个月	-4.52% 0.97%

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:任免日期根据基金管理人对外披露的任免日期填写;证券从业年限以从事证券业务相关的工作时间为计算标准。

4.1 管理人对报告期内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守《证券投资基金法》等有关法律法规和本基金合同的规定,并勤勉尽责地履行了基金管理人的职责,没有损害基金份额持有人的利益。

本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2018年4月1日起至6月30日止。

§ 2 基金产品概况

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2018年4月1日 - 2018年6月30日)
1.本期已实现收益	9,139,106.07
2.本期利润	12,560,230.70
3.加权平均基金份额本期利润	0.0351
4.期末基金份额净值	1,560,334.29/0.30
5.期末基金份额总额	1,0218

注: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.本报告所列示的基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计人费用后实际收益水平要低于所列数据。

3.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

融通债基A/B	

<tbl_r cells="2" ix="2"