融通通盈保本混合型证券投资基金 2018年半年度报告摘要

2018年6月30日

基金管理人:融通基金管理有限公司

基金托管人:中国建设银行股份有限公司

送出日期:2018年8月27日

§1 重要提示

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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据融通通盈保本混合型证券投资基金(以下简称"本基金")基金合同规定,于2018年8月22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及其更新。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年1月1日起至6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	融通通盈保本混合
基金主代码	002415
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年3月15日
基金管理人	融通基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	508,731,052.59份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	通过固定收益类资产与权益类资产的动态配置和有效的组合管理,在确保保本周期到期时本金安全的基础上,力争实现基金资产的稳定增值。
投资策略	本基金采用时间不变性投资组合保险策略(TIPP,Time Invariant Portfolio Protection),通过量化技术动态调整资产配置比例,以达到保证本金安全的基本目标。
业绩比较基准	三年期银行定期存款税后收益率
风险收益特征	本基金为保本混合型基金,属于证券投资基金中的低风险品种,预期收益和预期风险高于货币市场基金和债券型基金,低于股票型基金和非保本混合型基金。

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		融通基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	徐卫东	田青
	联系电话	(0755)26948666	(010)67595096
	电子邮箱	service@mail.rtfund.com	tianqing1zh@ccb.com
客户服务电话		400-883-8088/(0755)26948088	(010)67595096
传真		(0755)26935005	(010)66275853

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.rtfund.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

§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(2018年1月1日-2018年6月30日)
本期已实现收益	5,265,969.57
本期利润	8,690,263.06
加权平均基金份额本期利润	0.0154
本期基金份额净值增长率	1.43%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.0587
期末基金资产净值	539,727,275.93
期末基金份额净值	1.061

注: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;

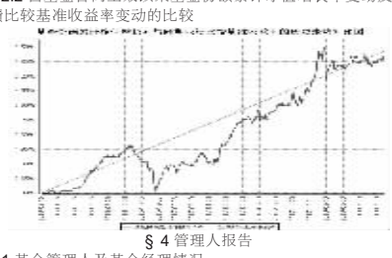
3、期末可供分配基金份额利润=期末可供分配利润÷期末基金份额总额。其中期末可供分配利润:如果期末未分配利润的未实现部分为正数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分,如果期末未分配利润的未实现部分为负数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润(已实现部分扣除未实现部分)。

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

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	0.38%	0.06%	0.23%	0.00%	0.15%	0.06%
过去三个月	0.38%	0.09%	0.69%	0.00%	-0.31%	0.09%
过去六个月	1.43%	0.12%	1.36%	0.00%	0.07%	0.12%
过去一年	3.11%	0.11%	2.75%	0.00%	0.36%	0.11%
自基金合同生效起至今	6.10%	0.09%	6.31%	0.00%	-0.21%	0.09%

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



§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

融通基金管理有限公司(以下简称"本公司")经中国证监会证监基字[2001]8号文批准,于2001年5月22日成立,公司注册资本12500万元人民币。本公司的股东及其出资比例为:新时代证券股份有限公司60%、日兴资产管理有限公司(Nikko AssetManagement Co., Ltd.)40%。

截至2018年6月30日,公司共管理六十六只开放式基金:即融通新蓝筹混合基金、融通债券基金、融通深证100指数基金、融通蓝筹成长混合基金、融通行业景气混合基金、融通巨潮100指数基金(LOF)、融通易支付货币基金、融通动力先锋混合基金、融通领先成长混合基金(LOF)、融通内需驱动混合基金、融通深证成份指数基金、融通四季添利债券基金、融通创业板指数基金、融通医疗保健混合基金、融通岁岁添利定期开放债券基金、融通丰利四分法(QDII-FOF)基金、融通汇财宝货币基金、融通可转债债券基金、融通通泰保本混合基金、融通通福债券基金(LOF)、融通通源短融债券基金、融通通瑞债券基金、融通月月添利定期开放债券基金、融通健康产业混合基金、融通转型三动力混合基金、融通互联网传媒混合基金、融通新区域新经济混合基金、融通通鑫混合基金、融通新能源混合基金、融通军工分级指数基金、融通证券分级指数基金、融通跨界成长混合基金、融通新机遇混合基金、融通成长30混合基金、融通中国风1号混合基金、融通通盈保本混合基金、融通增利债券基金、融通增裕债券基金、融通增鑫债券基金、融通增益债券基金、融通增祥债券基金、融通新消费混合基金、融通通安债券基金、融通通优债券基金、融通通乾研究精选混合基金、融通新趋势混合基金、融通国企改革新机遇混合基金、融通通和债券基金、融通沪港深智慧生活混合基金、融通现金宝货币基金、融通通祺债券基金、融通稳利债券基金、融通通宸债券基金、融通通玺债券基金、融通通穗债券基金、融通通润债券基金、融通通颐定期开放债券基金、融通人工智能指数基金(LOF)、融通新动力混合基金、融通收益增强债券基金、融通中国概念债券基金(QDII)、融通逆向策略混合基金、融通通裕定期开放债券发起式基金、融通红利机会主题精选混合基金、融通通昊定期开放债券发起式基金、融通新能源汽车主题精选混合基金。其中,融通债券基金、融通深证100指数基金和融通蓝筹成长混合基金同属融通通利系列证券投资基金。此外,公司还开展了特定客户资产管理业务。

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		
张一格	本基金的基金经理、固定收益投资总监	2016年3月15日	-	12	张一格先生,中国人民银行研究生部经济学硕士、南开大学法学学士、美国特许金融分析师(CFA)、12年证券投资从业经历,具有基金从业资格,现任融通基金管理有限公司固定收益投资总监。历任兴业银行资金营运中心投资经理、国泰基金管理有限公司国泰民安增利债券等基金的基金经理。2015年6月加入融通基金管理有限公司,现任融通通盈保本、融通增祥债券、融通通优债券、融通通鑫灵活配置混合、融通新机遇灵活配置混合、融通通裕债券、融通收益增强债券基金、融通通昊定期开放债券发起式基金的基金经理。

注:任免日期指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工作的时间为计算标准。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,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。

4.3 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

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,在投权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等各个环节保证公平交易制度的严格执行。

本基金管理人对报告期内不同时间窗下(日内、3日内、5日内)公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行了分析,各投资组合的同向交易价差均处于合理范围之内。

报告期内,本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 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

2018年上半年,债券市场呈现上涨走势。年初受到美债收益率走高、油价上涨、流动性不松等因素的影响,债券收益率上行突破前期高位。之后,央行在公开市场上投放力度加大,流动性表现平稳,4月份央行启动了首次降准,对冲MLF,市场给予了正面解读。6月份,中美贸易摩擦愈演愈烈,美国加息后中国央行没有在公开市场上调利率加之随后货币政策委员会对货币政策基调表述的改变、降准政策的公布,市场再次迎来一轮无风险利率的下行。但信用债出现了大幅分化,资质较弱的债券或者基本面有瑕疵的行业,收益率不降反升。

股票市场方面,上半年沪深300指数下跌12.90%,创业板指下跌8.33%,波动率相比去年大幅提高。一季度尚表现出结构分化的特点,以上证50为代表的龙头白马没能延续2017年亮眼表现,之前机构配置比例较低的计算机、军工、医药等板块表现较好。但二季度,受中美贸易摩擦、信用事件发酵的影响,股市呈现普跌格局。

本基金在债券方面,考虑到距离保本期结束只有1年左右的时间,从流动性匹配的角度,配置上维持了短久期的思路。此外,在6月份债市格局相对清晰的时候,加大杠杆增持了1-5年金融债,用于交易增强收益。在权益方面,上半年股票一定程度上拖累了组合收益,主要是在一季度,账户中的龙头白马未能及时获利了结,5月份时,基于对内外部因素的担忧,大幅降低了股票仓位,较好地回避了随后的系统性下跌。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为1.061元;本报告期基金份额净值增长率为1.43%,业绩比较基准收益率为1.36%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

权益方面,在经历了二季度的下跌后,无论是从估值看还是从市场交易特征看,当前指数呈现出底部特征。但主导二季度走势的贸易战和信用风险两大因素目前尚看不出见底迹象,预计指数层面还很难立即走出反转走势。不过自下而上的选股层面,可以开始积极发掘一些中长期向好的个股。

债券方面,在"双支柱"中的宏观审慎管理这一支柱补充完善后,货币政策在去杠杆上的任务可以逐渐弱化,因此适度微调是符合最优去杠杆路径的。在此基础上,债券市场可能会继续延续今年以来的走势。但信用风险的传染值得担忧,在一个信息不对称市场上,市场机制是否能充分发挥作用值得怀疑。

接下来本基金根据保本基金的期限和风险特点,在债券配置方面将采用中短久期、高评级的策略。在权益方面,加强自下而上的选股,阶段性寻找相对确定的机会进行投资。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内,本基金的估值业务严格按照《融通基金管理有限公司证券投资基金估值业务原则和程序》进行,公司设立由研究部、风险管理部、登记清算部、固定收益部、国际业务部和监察稽核部共同组成的估值委员会,通过参考行业协会估值意见、参考独立第三方估值服务机构的估值数据等一种或多种方式的有效结合,减少或避免估值偏差的发生。估值委员会的相关成员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经历,估值委员会成员不包含本基金基金经理。

估值委员会定期对经济环境是否发生重大变化、证券发行机构是否发生影响证券价格的重大事件以及估值政策和程序进行评价,在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后及时修订估值方法,以保证其持续适用。估值政策和程序的修订须经公司总经理办公会议审批后方可实施。基金在采用新投资策略或投资新品种时,应评价现有估值政策和程序的适用性。其中研究部负责定期对经济环境是否发生重大变化、证券发行机构是否发生影响证券价格的重大事件以及估值政策和程序进行评价,金融工程小组负责估值方法的研究、价格的计算及复核,登记清算部进行具体的估值核算并与基金托管人核对,同时负责对外进行信息披露。监察稽核部负责基金估值业务的事前、事中及事后的审核工作。本基金基金经理不参与估值决定,参与估值流程各方之间亦不存在任何重大利益冲突。

截至本报告期末,本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司、中证指数有限公司签订服务协议,由其提供相关债券品种和流通受限股票的估值参考数据。

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。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内,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五千万的情形。

§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,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

§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:融通通盈保本混合型证券投资基金

报告截止日:2018年6月30日

单位:人民币元

资产	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
资产:		
银行存款	248,408.28	458,696.02
结算备付金	4,140,939.48	1,636,806.05
存出保证金	45,235.33	41,290.78
交易性金融资产	771,812,930.80	730,115,987.85
其中:股票投资	10,334,446.00	61,024,988.85
基金投资	-	-
债券投资	761,478,484.80	667,836,999.00
资产支持证券投资	-	1,254,000.00
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	55,010,282.52	52,998,275.00
应收证券清算款	3,467,723.64	946,919.90
应收利息	8,621,036.40	13,357,980.47
应收股利	-	-
应收申购款	299.64	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	843,346,856.09	799,555,956.07
负债和所有者权益	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017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	297,921,179.36	138,100,000.00
应付证券清算款	-	620,740.42
应付赎回款	4,253,539.97	768,463.09
应付管理人报酬	539,287.31	676,700.94
应付托管费	89,881.22	112,783.48
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	120,904.67	117,955.69
应交税费	30,181.44	-
应付利息	373,976.29	184,013.68
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	290,629.90	483,664.86
负债合计	303,619,580.16	141,064,322.16
所有者权益:		
实收基金	508,731,052.59	629,324,549.56
未分配利润	30,996,223.34	29,167,084.35
所有者权益合计	539,727,275.93	658,491,633.91
负债和所有者权益总计	843,346,856.09	799,555,956.07

注:报告期截止日2018年6月30日,基金份额净值为1.061,基金份额总额为508,731,052.59份。

6.2 利润表

会计主体:融通通盈保本混合型证券投资基金

本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
一、收入	14,865,740.72	30,970,719.40
1.利息收入	12,282,307.78	22,134,919.92
其中:存款利息收入	45,055.61	1,408,578.60
债券利息收入	11,938,083.48	20,382,585.78
资产支持证券利息收入	11,926.98	340,637.70
买入返售金融资产收入	287,241.71	3,117.84
其他利息收入	-	-
2.投资收益	-1,218,693.98	5,550,892.78
其中:股票投资收益	741,297.49	8,278,135.74
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-2,225,941.33	-2,548,821.41
资产支持证券投资收益	6,837.60	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-338,910.00
股利收益	259,112.26	160,488.45
3.公允价值变动收益	3,424,293.49	2,503,169.86
4.汇兑收益	-	-
5.其他收入	377,833.43	781,736.84
减:二、费用	6,175,477.66	12,275,558.43
1. 管理人报酬	3,547,260.43	5,072,523.79
2. 托管费	591,210.02	845,420.62
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	364,498.59	482,938.48
5. 利息支出	1,437,076.13	5,641,322.89
其中:卖出回购金融资产支出	1,437,076.13	5,641,322.89
6. 税金及附加	20,809.95	
7. 其他费用	214,622.54	233,352.65
三、利润总额	8,690,263.06	18,695,160.97
减:所得税费用	-	-
四、净利润	8,690,263.06	18,695,160.97

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:融通通盈保本混合型证券投资基金

本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6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)	629,324,549.56	29,167,084.35	658,491,633.91
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	8,690,263.06	8,690,263.06
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-120,593,496.97	-6,861,124.07	-127,454,621.04
其中:1.基金申购款	57,354.12	3,244.28	60,598.40
2.基金赎回款	-120,650,851.09	-6,864,368.35	-127,515,219.44
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	508,731,052.59	30,996,223.34	539,727,275.93
	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日		
项目	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)	934,508,051.53	5,764,924.64	940,272,976.17
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	18,695,160.97	18,695,160.97
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-177,825,048.54	-2,499,961.66	-180,325,010.20
其中:1.基金申购款	198,808.70	3,507.96	202,316.66
2.基金赎回款	-178,023,857.24	-2,503,469.62	-180,527,326.86
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	756,683,002.99	21,960,123.95	778,643,126.94

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:

_____张帆 _____ _____颜锡廉 _____ _____刘美丽 _____

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 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。

6.4.2 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.3 关联方关系

6.4.3.1 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

本报告期与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.3.2 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
融通基金管理有限公司("融通基金")	基金管理人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司("中国建设银行")	基金托管人、基金销售机构

注:下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.4.2 关联方报酬

6.4.4.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	3,547,260.43	5,072,523.79
其中:支付销售机构的客户维护费	1,170,398.94	2,045,283.79

注:1、支付基金管理人融通基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值1.20%的年费率计提,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×1.20%/当年天数。

2、客户维护费是基金管理人与基金销售机构约定的依据销售机构销售基金的保有量提取一定比例的费用,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。

6.4.4.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	591,210.02	845,420.62

注:支付基金托管人中国建设银行的基金托管费按前一日基金资产净值0.20%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。

其计算公式为:日基金托管费=前一日基金资产净值×0.20%÷当年天数。

6.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期及上年度可比期间基金管理人均未运用固有资金投资本基金。

6.4.4.4.2 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

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人以外的其他关联方未投资本基金。

6.4.4.5 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 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	248,408.28	10,096.55	2,886,824.48	18,297.20

注:本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管,按银行同业利率计息。

6.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.4.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间均无其他关联交易事项的说明。

6.4.5 期末(2018年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本期末未持有因认购新发/增发证券而持有的流通受限证券。

6.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

银行间市场债券正回购截至本报告期末2018年6月30日止,本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额200,421,179.36元,是以如下债券作为质押:

金额单位:人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量(张)	期末估值总额
111899403	18广州农村商业银行CD044	2018年7月3日	96.86	495,000	47,945,700.00
111894136	18贵州银行CD016	2018年7月4日	95.48	172,000	16,422,560.00
111899405	18重庆农村商行CD058	2018年7月4日	96.85	200,000	19,370,000.00
111899434	18郑州银行CD079	2018年7月4日	96.85	200,000	19,370,000.00
111899481	18江苏江南农村商业银行CD076	2018年7月4日	96.82	200,000	19,364,000.00
150317	15进出17	2018年7月5日	99.90	30,000	2,997,000.00
180409	18农发09	2018年7月5日	100.38	800,000	80,304,000.00
合计				2,097,000	205,773,260.00

6.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2018年6月30日止,本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额97,500,000.00元,其中42,500,000.00元于2018年7月2日到期,55,000,000.00元于2018年7月4日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

§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	10,334,446.00	1.23
	其中:股票	10,334,446.00	1.23
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	761,478,484.80	90.29
	其中:债券	761,478,484.80	90.29
	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	55,010,282.52	6.52
	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	4,389,347.76	0.52
8	其他各项资产	12,134,295.01	1.44
9	合计	843,346,856.09	100.00

7.2 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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	3,394,246.00	0.63
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	38,200.00	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	1,324,000.00	0.25
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	5,578,000.00	1.03
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	10,334,446.00	1.91

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	占基金资产净值比例(%)
1	601398	工商银行	800,000	4,256,000.00	0.79
2	600887	伊利股份	50,000	1,395,000.00	0.26
3	600115	东方航空	200,000	1,324,000.00	0.25
4	600036	招商银行	50,000	1,322,000.00	0.24
5	600019	宝钢股份	150,000	1,168,500.00	0.22
6	600276	恒瑞医药	10,000	757,600.00	0.14
7	600519	贵州茅台	100	73,146.00	0.01
8	601933	永辉超市	5,000	38,200.00	0.01

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于基金管理人融通基金管理有限公司网站(http://www.rtfund.com)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	603026	石大胜华	7,856,665.40	1.19
2	600048	保利地产	7,032,644.00	1.07
3	601009	南京银行	6,704,527.00	1.02
4	600585	海螺水泥	6,584,789.00	1.00
5	601166	兴业银行	6,425,910.00	0.98
6	600036	招商银行	5,908,126.05	0.90
7	600115	东方航空	5,447,075.00	0.83
8	603833	欧派家居	4,494,292.00	0.68
9	600258	首旅酒店	4,415,188.00	0.67
10	600884	杉杉股份	3,663,041.00	0.56
11	300365	恒华科技	3,368,075.00	0.51
12	600566	济川药业	3,336,300.00	0.51
13	601222	林洋能源	3,116,550.00	0.47
14	600377	宁沪高速	2,963,136.60	0.45
15	601111	中国国航	2,783,610.00	0.42
16	601766	中国中车	2,542,015.00	0.39
17	600019	宝钢股份	2,336,612.00	0.35
18	600029	南方航空	2,149,246.00	0.33
19	000963	华东医药	2,027,654.00	0.31
20	603883	老百姓	1,980,554.00	0.30

注:"买入金额"是指买入股票成交金额,即成交单价乘以成交数量,相关交易费用不考虑。

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	601288	农业银行	14,339,340.00	2.18
2	601111	中国国航	9,893,786.00	1.50
3	600029	南方航空	7,778,497.00	1.18
4	603026	石大胜华	7,084,346.52	1.08
5	601009	南京银行	6,769,580.46	1.03
6	601318	中国平安	6,740,302.70	1.02
7	603833	欧派家居	6,483,075.60	0.98
8	601166	兴业银行	6,420,000.00	0.97
9	600048	保利地产	6,392,502.00	0.97
10	600585	海螺水泥	6,067,676.89	0.92
11	601766	中国中车	5,543,795.31	0.84
12	600887	伊利股份	5,206,349.37	0.79
13	600258	首旅酒店	4,660,755.95	0.71
14	601398	工商银行	4,338,608.00	0.66
15	600036	招商银行	4,274,556.50	0.65
16	600566	济川药业	3,950,012.00	0.60
17	600115	东方航空	3,627,469.00	0.55
18	600884	杉杉股份	3,321,883.96	0.50
19	300365	恒华科技	3,256,397.00	0.49
20	600377	宁沪高速	2,765,254.00	0.42

注:"卖出金额"是指卖出股票成交金额,即成交单价乘以成交数量,相关交易费用不考虑。

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	88,797,269.75
卖出股票收入(成交)总额	134,534,098.85

注:表中"买入股票成本(成交)总额"及"卖出股票收入(成交)总额"均指成交金额,即成交单价乘以成交数量,相关交易费用不考虑。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	259,915,000.00	48.16
	其中:政策性金融债	259,915,000.00	48.16
4	企业债券	152,230,132.80	28.21
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	118,257,800.00	21.91
7	可转债(可交换债)	588,752.00	0.11
8	同业存单	230,486,800.00	42.70
9	其他	-	-
10	合计	761,478,484.80	141.09

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

金额单位:人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名