融通可转债债券型证券投资基金 2018年半年度报告摘要

基金管理人:融通基金管理有限公司

基金托管人:中国农业银行股份有限公司

送出日期:2018年8月27日

§1 重要提示

基金管理人的董事会、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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据融通可转债债券型证券投资基金(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、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	融通可转债债券	
基金主代码	161624	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016年12月9日	
基金管理人	融通基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	78,296,222.06份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	融通可转债债券A	融通可转债债券C
下属分级基金的交易代码:	161624	161625
报告期末下属分级基金的份额总额	4,119,599.74份	74,175,622.31份

2.2 基金产品说明

投资目标	在合理控制信用风险、保持适当流动性的基础上,以可转债为主要投资标的,力争取得超越基金业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金的具体投资策略包括资产配置策略、固定收益类资产投资策略、股票投资策略、权证投资策略以及国债期货投资策略等部分。
业绩比较基准	中证可转换债券指数收益率*70%+中债综合全价(总值)指数收益率*20%+沪深300指数收益率*10%
风险收益特征	本基金为债券型基金,其长期平均预期风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金,高于货币市场基金。

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		融通基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	徐卫东	贺萌
	联系电话	(0755)26948966	(010)66060069
	电子邮箱	service@rmail.rtfund.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-883-8088,(0755)26948088	95599
传真		(0755)26935005	(010)68121816

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	基金管理人处、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

基金级别	融通可转债债券A	融通可转债债券C
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)	报告期(2018年1月1日-2018年6月30日)
本期已实现收益	21,356.14	136,549.36
本期利润	-189,265.06	-3,799,017.09
加权平均基金份额本期利润	-0.0402	-0.0526
本期基金份额净值增长率	-5.53%	-5.72%
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	-0.2115	-0.2226
期末基金资产净值	3,248,317.69	57,663,496.69
期末基金份额净值	0.7885	0.7774

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

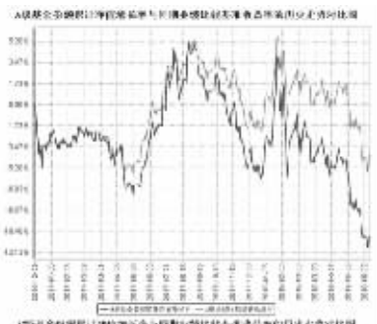
融通可转债债券A

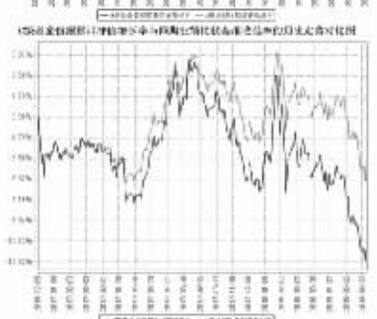
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-3.37%	0.54%	-2.87%	0.67%	-0.50%	-0.13%
过去三个月	-7.16%	0.53%	-4.88%	0.65%	-2.28%	-0.02%
过去六个月	-5.53%	0.81%	-2.37%	0.63%	-3.16%	0.18%
过去一年	-8.70%	0.69%	-3.50%	0.53%	-5.20%	0.16%
自基金合同生效起至今	-10.97%	0.62%	-4.20%	0.49%	-6.77%	0.13%

融通可转债债券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	-3.39%	0.54%	-2.87%	0.67%	-0.52%	-0.13%
过去三个月	-7.24%	0.53%	-4.88%	0.65%	-2.36%	-0.02%
过去六个月	-5.72%	0.81%	-2.37%	0.63%	-3.35%	0.18%
过去一年	-9.07%	0.69%	-3.50%	0.53%	-5.57%	0.16%
自基金合同生效起至今	-11.54%	0.62%	-4.20%	0.49%	-7.34%	0.13%

3.2.2 自基金转型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





注:本基金由原融通标普中国可转债指数增强型证券投资基金转型而来,转型日期为2016年12月9日。

§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(ODII-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		
许富强	本基金的基金经理	2018年5月18日	-	7	许富强先生,北京大学经济学硕士,7年证券投资从业经历,具有基金从业资格。2011年7月加入融通基金管理有限公司,历任研究员助理研究员、投资总监,现任融通通灵达配置混合、融通稳祥债券、融通通优债券、融通可转债债券(由原融通标普中国可转债指数基金转型而来)、融通通安债券、融通通宸债券、融通通穗债券基金的基金经理。
王超	本基金的基金经理、固定收益部总监	2016年12月9日	2018年5月18日	11	王超先生,金融工程硕士,经济学、数学双学士,11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部总监。历任深圳发展银行(现更名为平安银行)债券自营交易自投资与理财投资管理经理。2012年3月加入融通基金管理有限公司。现任融通债券、融通四季添利债券(LOF)、融通岁岁添利定期开放债券、融通增鑫债券、融通增益债券、融通增祥债券、融通稳利债券、融通通泰保本、融通现金宝货币、融通通福债券基金的基金经理。

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

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,在授权、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

今年上半年,债券收益率在社融等经济数据走弱以及贸易战导致的避险情绪升温的利好下继续下行,债券市场迎来一波小牛市。在去杠杆和贸易战升温的背景下,国内投资者风险偏好下降,权益、转债和信用品种等风险资产的表现较差。

转债指数上证综指走势相似度高,上半年上证综指跌幅超过13%,可转债指数跌幅超过15%。5月下旬以来,在信用风险加剧和中美贸易战升级的冲击下,可转债指数下跌了13.3%(5月21日至6月29日),创下两年新低。组合持仓主要为可转债资产,在此轮下跌中受损比较严重。我们在下跌过程中积极应对,降低了组合转债持仓比例,卖出了部分流动性较好的券种。展望后市,我们认为经历前段时间的下跌,转债的平价溢价率走高,纯债溢价率下降,转债作为债券性质的特征开始逐步高于权益资产的特征,优质公司的转债已经具备了配置价值。转债作为一个进可攻,退可守的品种,左侧配置的策略值得关注。我们后续将对信用风险和经济政策保持密切关注,做好组合策略的预判和应对。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末融通可转债债券A基金份额净值为0.7885元,本报告期基金份额净值增长率为-5.53%;截至本报告期末融通可转债债券C基金份额净值为0.7774元,本报告期基金份额净值增长率为-5.72%;同期业绩比较基准收益率为-2.37%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

回顾上半年,各项指标显示宏观经济在二季度开始出现明显走弱迹象。从三驾马车来看,消费、投资和净出口均有一定程度下滑,经济整体走弱迹象比较明显。虽然投资分项中房地产投资韧性较强,但是随着销售数据下滑,下半年地产投资趋弱的可能性很高。货币政策方面,在外围冲击的加强和国内经济趋弱的情况下,央行货币政策基调为保持流动性合理充裕,资金面利好债券市场。政策面上,二季度金融去杠杆继续推进,债券市场信用事件频发,推高了信用利差。在经济走弱,流动性宽松,信用趋紧的格局下,债券市场走出了结构性行情。上半年,国债和证金债收益率有较大幅度下行,收益率曲线变陡,信用债级间利差扩大,低等级信用债流动性丧失。

展望后市,经济下行及流动性层面维持宽松的概率较高,风险因素主要来自于政策的调整以及外围经济的变化。目前来看,投资、消费和净出口三驾马车驱动力都在走弱,后续经济下行的压力较明显。在这种情况下,央行货币政策将着眼国内经济,服务于去杠杆以及稳增长的需求,后续流动性预计维持在整体宽松态势。在经济基本面趋弱的情况下,下半年财政政策发力的可能性较高,对经济下行将起到一定的托底作用。在外围风险不确定的情况下,未来去杠杆的节奏和力度也可能发生变化。目前看来,贸易摩擦的走向和国内政策应对是下半年主要不确定因素。

因此,我们认为市场将延续上半年的结构性行情,无风险收益率有望继续走低,但是在去杠杆和外围不确定冲击消失之前,投资者的风险偏好短期内难以恢复,风险资产的表现仍需等待。

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

在托管本基金的过程中,本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定,对本基金基金管理人—融通基金管理有限公司 2018 年 1 月 1 日至 2018年6月30日基金的投资运作,进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督,认真履行了托管人的义务,没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为,融通基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上,不存在损害基金份额持有人利益的行为;在报告期内,严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认为,融通基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定,基金管理人所编制和披露的本基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整,未发现有损害基金持有人利益的行为。

§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:融通可转债债券型证券投资基金

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	1,685,426.17	239,798.79
结算备付金	75,036.31	1,127,877.56
存出保证金	9,498.92	13,492.94
交易性金融资产	52,679,391.65	66,046,815.95
其中:股票投资	694,120.00	2,562,200.00
基金投资	-	-
债券投资	51,985,271.65	63,484,615.95
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	7,500,000.00	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	163,769.89	184,394.49
应收股利	-	-
应收申购款	808.84	18,483.07
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	62,113,930.78	67,630,852.79
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	-	6,000,000.00
应付证券清算款	994,692.26	9,839.68
应付赎回款	79,937.17	7,854.83
应付管理人报酬	35,724.29	36,812.21
应付托管费	10,206.94	10,517.80
应付销售服务费	19,300.06	19,477.51
应付交易费用	2,234.44	8,628.86
应交税费	563.93	-
应付利息	-	-2,469.92
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	59,507.37	40,003.18
负债合计	1,202,166.40	6,130,674.15
所有者权益:		
实收基金	78,296,222.06	74,517,116.97
未分配利润	-17,383,457.67	-13,016,938.33
所有者权益合计	60,911,814.38	61,500,178.64
负债和所有者权益总计	62,113,930.78	67,630,852.79

注:报告截止日2018年6月30日,融通可转债债券A基金份额净值0.7885元,基金份额总额4,119,599.74份;融通可转债债券C基金份额净值0.7774元,基金份额总额74,175,622.31份。融通可转债债券份额总额合计为78,295,222.05份。

6.2 利润表

会计主体:融通可转债债券型证券投资基金

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	-3,362,962.54	848,037.15
1.利息收入	244,169.60	192,851.10
其中:存款利息收入	10,774.40	8,698.79
债券利息收入	217,775.81	178,086.81
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	15,619.28	6,066.50
其他利息收入	-	-
2.投资收益	542,800.94	-170,913.81
其中:股票投资收益	-369,096.57	177,204.79
基金投资收益	-	-
债券投资收益	912,800.51	-281,128.60
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	-	3,010.00
3.公允价值变动收益	-4,146,189.55	825,225.92
4.汇兑收益	-	-
5.其他收入	6,262.57	873.94
减:二、费用	635,330.51	482,041.66
1. 管理人报酬	223,399.16	216,324.48
2. 托管费	63,828.35	61,807.06
3. 销售服务费	119,717.46	115,370.25
4. 交易费用	29,101.36	9,076.06
5. 利息支出	118,500.24	85.48
其中:卖出回购金融资产支出	118,500.24	85.48
6.税金及附加	406.06	-
7. 其他费用	80,377.89	79,378.33
三、利润总额	-3,988,283.05	365,995.49
减:所得税费用	-	-
四、净利润	-3,988,283.05	365,995.49

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:融通可转债债券型证券投资基金

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)	74,517,116.97	-13,016,938.33	61,500,178.64
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-3,988,283.05	-3,988,283.05
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	3,778,105.08	-378,186.29	3,399,918.79
其中:1.基金申购款	17,491,850.11	-2,210,384.98	15,281,465.13
2.基金赎回款	-13,713,745.03	1,832,198.69	-11,881,546.34
四、本期向基金分配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)	78,295,222.05	-17,383,407.67	60,911,814.38
项目	上年度可比期间 2017年1月1日至2017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)	74,880,966.04	-11,196,525.74	63,684,440.30
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	365,995.49	365,995.49
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-2,068,132.66	301,513.86	-1,766,618.80
其中:1.基金申购款	3,030,279.28	-445,792.75	2,584,486.53
2.基金赎回款	-5,098,411.93	747,306.61	-4,351,105.32
四、本期向基金分配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)	72,812,833.49	-10,529,016.39	62,283,817.10

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

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

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	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司(“中国农业银行”)	基金托管人、基金代销机构
新时代证券股份有限公司(“新时代证券”)	基金管理人的股东、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

6.4.4.1.1 股票交易

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股票交易。

6.4.4.1.2 债券交易

金额单位: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	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
新时代证券	521,452.00	0.56%	-	-

6.4.4.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

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	223,399.16	216,324.48
其中:支付销售机构的客户维护费	20,783.63	21,144.57

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0.70%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×0.70% / 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	63,828.35	61,807.06

注:支付基金托管人中国农业银行的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:

日托管费=前一日基金资产净值× 0.20% / 当年天数。

6.4.4.2.3 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 2018年1月1日至2018年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	融通可转债债券A	融通可转债债券C	合计
融通基金管理有限公司	-	102,809.16	102,809.16
中国农业银行	-	2,214.69	2,214.69
合计	-	105,023.85	105,023.85
获得销售服务费的各关联方名称	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销售服务费		
	融通可转债债券A	融通可转债债券C	合计
融通基金管理有限公司	-	97,923.88	97,923.88
中国农业银行	-	2,727.78	2,727.78
合计	-	100,651.66	100,651.66

注:支付基金销售机构的销售服务费按前一日C类基金资产净值0.40%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:

日销售服务费=前一日C类基金资产净值×0.40%/ 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

本基金本期无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

本报告期末,基金管理人的主要股东及其控制的机构未持有本基金份额。

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
中国农业银行	1,685,426.17	3,847.84	4,526,351.60	7,973.53

注:本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管,按适用利率计息。

6.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内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。

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/增发证券流通受限股票。

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

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购,因此没有在债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购,因此没有在债券正回购交易中作为抵押的债券。

§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	694,120.00	1.12
	其中:股票	694,120.00	1.12
2	固定收益投资	51,985,271.65	83.69
	其中:债券	51,985,271.65	83.69
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	7,500,000.00	12.07
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	1,760,461.48	2.83
7	其他各项资产	174,077.65	0.28
8	合计	62,113,930.78	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	296,920.00	0.49
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	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	397,200.00	0.65
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	-	-
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	694,120.00	1.14

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	600115	东方航空	60,000	397,200.00	0.65
2	600026	石大胜华	13,000	296,920.00	0.49

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	600547	山东黄金	670,784.00	1.09
2	601398	工商银行	612,000.00	1.00
3	600887	伊利股份	586,850.00	0.95
4	600030	中信证券	586,746.27	0.95
5	601668	中国建筑	521,000.00	0.85
6	002508	老板电器	506,606.00	0.82
7	600115	东方航空	488,400.00	0.79
8	002271	东方雨虹	482,938.00	0.79
9	600487	亨通光电	406,199.00	0.66
10	600566	济川药业	394,756.00	0.64
11	603288	海天味业	391,700.00	0.64
12	601222	林洋能源	376,370.00	0.61
13	600006	宇通客车	357,750.00	0.58
14	600104	上汽集团	343,842.00	0.56
15	601766	中国中车	313,300.00	0.51
16	601318	中国平安	310,711.00	0.51
17	603026	石大胜华	308,819.00	0.50
18	603816	顺丰控股	308,801.00	0.50
19	002415	海康威视	306,000.00	0.50

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	601186	中国铁建	2,660,400.00	4.33
2	601398	工商银行	635,739.00	1.03
3	600547	山东黄金	625,745.00	1.02
4	600030	中信证券	565,676.00	0.92
5	600887	伊利股份	515,100.00	0.84
6	002271	东方雨虹	498,050.00	0.81
7	600566	济川药业	452,976.00	0.74
8	601668	中国建筑	449,000.00	0.73
9	601222	林洋能源	430,000.00	0.70
10	603288	海天味业	382,354.00	0.62
11	603816	顺丰控股	363,210.00	0.59
12	600066	宇通客车	357,750.00	0.58