融通收益增强债券型证券投资基金 2019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:中国建设银行股份有限公司
送出日期:2019年8月24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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据融通收益增强债券型证券投资基金(以下简称"本基金")基金合同规定,于2019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2019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	融通收益增强债券	
基金主代码	004025	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017年8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	
报告期末基金份额总额	279,498,951.83份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	融通收益增强债券A	融通收益增强债券C
下属分级基金的交易代码	004025	004026
报告期末下属分级基金的份额总额	165,809,075.82份	113,689,876.01份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于债券资产,通过精选信用债券,并适度参与权益类品种投资,在承担合理风险和保持资产流动性的基础上,力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金将密切关注股票、债券市场的运行状况与风险收益特征,通过自上而下的定性分析和定量分析,综合分析宏观经济形势、国家政策、市场流动性和估值水平等因素,判断金融市场运行趋势和不同资产类别在经济周期的不同阶段的相对投资价值,对各大类资产的风险收益特征进行评估,从而确定固定收益类资产和权益类资产的配置比例,并依据各因素的动态变化进行及时调整。
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	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	tianqing1.zh@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	基金管理人处、基金托管人处

2.5 其他相关资料

§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1月1日-2019年6月30日)	
	融通收益增强债券A	融通收益增强债券C
本期已实现收益	2,830,691.39	1,667,616.56
本期利润	2,608,058.49	1,120,231.81
加权平均基金份额本期利润	0.0694	0.0548
本期基金份额净值增长率	5.91%	5.70%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)	
期末可供分配基金份额利润	0.1325	0.1242
期末基金资产净值	188,958,547.01	128,617,714.54
期末基金份额净值	1.1396	1.1313

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。

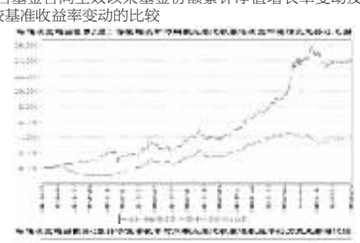
3、期末可供分配基金份额利润=期末可供分配利润÷期末基金份额总额。其中期末可供分配利润:如果期末未分配利润的未实现部分为正数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分,如果期末未分配利润的未实现部分为负数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润(已实现部分扣除未实现部分)。

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

融通收益增强债券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	0.06%	0.06%	0.28%	0.03%	-0.22%	0.03%
过去三个月	-0.58%	0.19%	-0.24%	0.06%	-0.34%	0.13%
过去六个月	5.91%	0.26%	0.24%	0.06%	5.67%	0.20%
过去一年	10.44%	0.20%	2.82%	0.06%	7.62%	0.14%
自基金合同生效起至今	13.96%	0.17%	4.00%	0.06%	9.96%	0.11%
融通收益增强债券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	0.03%	0.06%	0.28%	0.03%	-0.25%	0.03%
过去三个月	-0.68%	0.19%	-0.24%	0.06%	-0.44%	0.13%
过去六个月	5.70%	0.26%	0.24%	0.06%	5.46%	0.20%
过去一年	10.00%	0.20%	2.82%	0.06%	7.18%	0.14%
自基金合同生效起至今	13.13%	0.17%	4.00%	0.06%	9.13%	0.11%

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2019年6月30日,公司共管理六十六只开放式基金:即融通新蓝筹证券投资基金、融通债券投资基金、融通蓝筹成长证券投资基金、融通深证100指数证券投资基金、融通行业景气证券投资基金、融通巨潮100指数证券投资基金(LOF)、融通易支付货币市场证券投资基金、融通动力先锋混合型证券投资基金、融通领先成长混合型证券投资基金(LOF)、融通内需驱动混合型证券投资基金、融通深证成份指数证券投资基金、融通四季添利债券型证券投资基金(LOF)、融通创业板指数增强型证券投资基金、融通医疗保健行业混合型证券投资基金、融通岁岁添利定期开放债券型证券投资基金、融通通泰保本混合型证券投资基金、融通通源短融债券型证券投资基金、融通通福债券型证券投资基金、融通月月添利定期开放债券型证券投资基金、融通健康产业灵活配置混合型证券投资基金、融通转型三动力灵活配置混合型证券投资基金、融通互联网传媒灵活配置混合型证券投资基金、融通新区域新经济灵活配置混合型证券投资基金、融通通鑫灵活配置混合型证券投资基金、融通新能源灵活配置混合型证券投资基金、融通中证军工指数分级证券投资基金、融通中证全指证券公司指数分级证券投资基金、融通跨界成长灵活配置混合型证券投资基金、融通新机遇灵活配置混合型证券投资基金、融通成长30灵活配置混合型证券投资基金、融通汇财宝货币市场基金、融通中国风1号灵活配置混合型证券投资基金、融通增利债券型证券投资基金、融通增鑫债券型证券投资基金、融通增益债券型证券投资基金、融通增祥债券型证券投资基金、融通新消费灵活配置混合型证券投资基金、融通通安债券型证券投资基金、融通通优债券型证券投资基金、融通通乾研究精选灵活配置混合型证券投资基金、融通新趋势灵活配置混合型证券投资基金、融通通和债券型证券投资基金、融通沪港深智慧生活灵活配置混合型证券投资基金、融通现金宝货币市场基金、融通通祺债券型证券投资基金、融通可转债债券型证券投资基金、融通通福债券型证券投资基金(LOF)、融通通宸债券型证券投资基金、融通通玺债券型证券投资基金、融通通润债券型证券投资基金、融通中证人工智能主题指数证券投资基金(LOF)、融通收益增强债券型证券投资基金、融通中国概念债券型证券投资基金(QDII)、融通逆向策略灵活配置混合型证券投资基金、融通通裕定期开放债券型发起式证券投资基金、融通红利机会主题精选灵活配置混合型证券投资基金、融通通昊定期开放债券型发起式证券投资基金、融通新能源汽车主题精选灵活配置混合型证券投资基金、融通增辉定期开放债券型发起式证券投资基金、融通增悦债券型证券投资基金、融通通捷债券型证券投资基金、融通研究优选混合型证券投资基金、融通核心价值混合型证券投资基金(QDII)(原融通丰利四分法证券投资基金(QDII)转型而来)、融通超短债债券型证券投资基金、融通通盈灵活配置混合型证券投资基金(原融通通盈保本混合型证券投资基金转型而来)、融通通慧混合型证券投资基金(原融通国企改革新机遇灵活配置混合型证券投资基金转型而来)。其中,融通债券投资基金、融通深证100指数证券投资基金和融通蓝筹成长证券投资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	2017年8月30日	-	13	张一格先生,中国人民银行研究生部经济学硕士,特许金融分析师(CFA),13年证券投资从业经历,具有基金从业资格。2006年6月至2012年8月就职于兴业银行资金营运中心任投资经理,2012年8月至2015年6月就职于国泰基金管理有限公司任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,历任固定收益部总经理、融通易支付货币市场证券投资基金基金经理、融通通盈保本混合型证券投资基金基金经理、融通增裕债券型证券投资基金、融通岁岁添利定期开放债券型证券投资基金、融通通祥债券型证券投资基金基金经理、融通通瑞债券型证券投资基金基金经理、融通通优债券型证券投资基金基金经理、融通月月添利定期开放债券型证券投资基金基金经理、融通通福债券型证券投资基金基金经理、融通通顺灵活配置混合型证券投资基金基金经理、融通通鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理、融通新机遇灵活配置混合型证券投资基金基金经理、现任公司固定收益投资总监、融通收益增强债券型证券投资基金基金经理、融通通裕定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理、融通通昊定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理、融通通源短融债券型证券投资基金基金经理。

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

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

2019年上半年,债券市场呈现震荡走势。在经历了2018年的上涨后,债市收益率处于历史较低水平,进一步的下行需要更强的催化剂,但货币政策表现较为中性,经济数据好于此前市场悲观预期,收益率在3-4月份出现一定程度的反弹。5月份公布的信贷社融数据开始有所走弱,市场对宽信用的乐观预期有所修正,同时海外主要经济体再次宽松的预期升温,这些因素共同助推了5-6月债市收益率的再次下行。

股票市场方面,上半年沪深300指数上涨27.07%,创业板指上涨20.87%,市场的反弹来源于风险偏好的大幅改善。一季度信贷社融数据强劲,市场流动性处于宽松状态,中美贸易谈判释放乐观信号都助推了风险偏好。但进入4月份以后,政治局会议的政策措辞出现轻微变化,5月中美贸易谈判出现反复,市场情绪有所压制,指数出现一定程度的调整。

本基金在债券方面,在1月份逐步清仓了利率债,降低组合久期,在上半年坚持了以信用债配置为主的思路,并在一季度较大力度参与了转债交易。在权益方面,1-2月份较大力度增配了权益资产,并随后在4-5月逐步降低了仓位。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末融通收益增强债券A基金份额净值为1.1396元,本报告期基金份额净值增长率为5.91%;截至本报告期末融通收益增强债券C基金份额净值为1.1313元,本报告期基金份额净值增长率为5.70%;同期业绩比较基准收益率为0.24%。

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,6月末G20会议期间中美元首的谈判略超市场预期,有助于提升短期市场风险偏好,但应该认识到中美的博弈将是长期的,贸易谈判也依然存在反复的可能,这一因素未来可能持续对市场形成扰动。在内部因素方面,我们比较担心两方面,一是作为经济引擎之一的房地产投资的下降,宏观经济面临下行压力,二是包商银行被接管后,市场对于信用出现分层,中小银行在去杠杆的压力下有信用收缩的可能。有利的方面在于当前整体估值依然处于低位,市场自身具备一定的抗风险能力,从中长期看我们也相信在当前估值下有部分优质企业具备穿越周期的能力。因此,在个股选择上,我们将聚焦在受中美关系直接影响小且有一定的抗周期波动能力的行业中。

债券方面,我们预计基本面因素在三季度乃至下半年对债券市场都将发挥正面作用,除了前面提到的房地产投资和中小银行信用收缩外,海外主要经济体货币政策再次进入宽松周期也为我们提供了一个良好的外部环境。但市场收益率能否突破前低存在不确定性,需要视相关经济数据下行的速度而定。基于我们债券牛市处于下半场的中期判断,债市的安全边际是在逐步降低的,在这种情况下,收益率的突破都需要某个重要因素大变化的推动。

接下来,本基金在债券配置方面将继续重视信用债的配置价值,关注重大因素的变化可能对市场的影响,对利率债采用灵活的操作策略。在权益方面,重视自下而上的选股,淡化宏观判断,对受外围因素小、有望穿越周期的个股保持关注。

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。

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:融通收益增强债券型证券投资基金

报告截止日:2019年6月30日

单位:人民币元

资 产	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
资 产:		
银行存款	200,563,611.52	357,259.47
结算备付金	282,333.31	838,150.27
存出保证金	25,784.75	12,920.24
交易性金融资产	150,696,216.38	63,767,903.88
其中:股票投资	1,995,651.90	1,319,440.00
基金投资	-	-
债券投资	148,700,564.48	62,448,463.88
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	19,900,269.85	-
应收证券清算款	-	12,812,826.58
应收利息	2,738,602.74	924,922.73
应收股利	-	-
应收申购款	53,764,850.65	15,597.62
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	427,971,669.20	78,729,580.79
负债和所有者权益	本期末 2019年6月30日	上年度末 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	11,300,000.00	20,416,000.00
应付证券清算款	98,641,627.92	-
应付赎回款	272,640.21	209,226.55
应付管理人报酬	41,760.21	34,996.62
应付托管费	11,931.50	9,999.04
应付销售服务费	8,656.19	2,963.37
应付交易费用	32,072.62	23,577.94
应交税费	5,914.73	9,058.15
应付利息	10,061.61	8,288.26
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	70,742.66	49,048.61
负债合计	110,395,407.65	20,763,158.54
所有者权益:		
实收基金	279,498,951.83	53,915,039.23
未分配利润	38,077,309.72	4,051,383.02
所有者权益合计	317,576,261.55	57,966,422.25
负债和所有者权益总计	427,971,669.20	78,729,580.79

注:报告截止日2019年6月30日,基金份额总额279,498,951.83份,其中融通收益增强债券A基金份额总额为165,809,075.82份,基金份额净值1.1396元;融通收益增强债券C基金份额总额为113,689,876.01份,基金份额净值1.1313元。

6.2 利润表

会计主体:融通收益增强债券型证券投资基金

本报告期:2019年1月1日至2019年6月30日

单位:人民币元

项 目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
一、收入	4,428,369.90	4,368,762.34
1.利息收入	1,288,130.14	3,705,646.82
其中:存款利息收入	27,306.14	15,574.84
债券利息收入	1,233,058.88	3,232,990.81
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	27,765.12	457,081.17
其他利息收入	-	-
2.投资收益	3,901,163.69	-190,522.71
其中:股票投资收益	1,509,762.90	-1,571,424.28
基金投资收益	-	-
债券投资收益	2,381,990.89	1,342,101.57
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	9,409.90	38,800.00
3.公允价值变动收益	-770,017.65	823,295.79
4.汇兑收益	-	-
5.其他收入	9,093.72	30,342.44
减:二、费用	700,079.60	1,341,892.50
1、管理人报酬	228,939.05	537,335.02
2、托管费	65,411.19	153,524.25
3、销售服务费	45,977.96	40,574.66
4、交易费用	142,254.28	99,065.12
5、利息支出	127,421.40	353,103.90
其中:卖出回购金融资产支出	127,421.40	353,103.90
6、税金及附加	3,999.46	7,361.16
7、其他费用	86,076.26	150,928.39
三、利润总额	3,728,290.30	3,026,869.84
减:所得税费用	-	-
四、净利润	3,728,290.30	3,026,869.84

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:融通收益增强债券型证券投资基金

本报告期:2019年1月1日至2019年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019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)	53,915,039.23	4,051,383.02	57,966,422.25
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	3,728,290.30	3,728,290.30
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	225,583,912.60	30,297,636.40	255,881,549.00
其中:1.基金申购款	282,651,568.57	37,741,606.31	320,393,174.88
2.基金赎回款	-57,067,655.97	-7,443,969.91	-64,511,625.88
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)	279,498,951.83	38,077,309.72	317,576,261.55
项目	上年度可比期间 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)	235,554,161.49	2,865,109.06	238,419,270.55
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	3,026,869.84	3,026,869.84
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-137,677,090.21	-2,804,922.95	-140,482,013.16
其中:1.基金申购款	3,239,304.39	58,905.79	3,298,210.18
2.基金赎回款	-140,916,394.60	-2,863,828.74	-143,780,223.34
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)	97,877,071.28	3,087,055.95	100,964,127.23

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、注册登记机构、基金销售机构
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
中国建设银行股份有限公司(“建设银行”)	基金托管人、基金销售机构

注:上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

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)	成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)
新时代证券	16,284,272.93	18.10	-	-

6.4.4.1.2 债券交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018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	16,170,303.24	12.89	-	-

6.4.4.1.3 债券回购交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)
新时代证券	88,300,000.00	9.41	-	-

6.4.4.1.4 权证交易

无。

6.4.4.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例(%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例(%)
新时代证券	15,165.25	18.32	10,980.60	37.05
	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日			
关联方名称	当期佣金	占当期佣金总量的比例(%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例(%)
新时代证券	-	-	-	-

注:1.上述佣金按市场佣金率计算,以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2.该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

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 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	228,939.05	537,335.02
其中:支付销售机构的客户维护费	100,489.18	484,068.49

注:1、支付基金管理人融通基金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 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	65,411.19	153,524.25

注:支付基金托管人建设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

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	融通收益增强债券A类	融通收益增强债券C类	合计
建设银行	-	16,437.68	16,437.68
融通基金	-	3,011.20	3,011.20
合计	-	19,448.88	19,448.88
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 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		
	融通收益增强债券A类	融通收益增强债券C类	合计
建设银行	-	40,150.14	40,150.14
融通基金	-	4.82	4.82
合计	-	40,154.96	40,154.96

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,按月支付给融通基金,再由融通基金计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为:C类日销售服务费=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

无。

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

份额单位:份

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
	融通收益增强债券A	融通收益增强债券C
基金合同生效日(2017年8月30日)持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	2,897,430.94	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	2,897,430.94	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.04%	-
项目	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
	融通收益增强债券A	融通收益增强债券C
基金合同生效日(2017年8月30日)持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	-	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	-	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

注:基金管理人投资本基金的适用费率符合本基金招募说明书和相关公告的规定。

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

无。

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 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018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
建设银行	200,563,611.52	19,126.41	135,238.64	10,477.37

注:本基金的银行存款由基金托管人建设银行保管,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

无。

6.4.4.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.5 期末(2019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

金额单位:人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别:债券									
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:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113028	环境转债	2019-06-20	2019-07-10	新债流通受限	100.00	100.00	150	14,999.80	14,999.80	-

6.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

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

无。

6.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2019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11,300,000.00元,于2019年7月1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	1,995,651.90	0.47
	其中:股票	1,995,651.90	0.47
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	148,700,564.48	34.75
	其中:债券	148,700,564.48	34.75
	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	19,900,269.85	4.65
	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	200,845,944.83	46.93
8	其他各项资产	56,529,238.14	13.21
9	合计	427,971,669.20	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,452,351.90	0.46
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	53,700.00	0.02
H	住宿和餐饮