融通四季添利债券型证券投资基金(LOF) 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:中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据融通四季添利债券型证券投资基金(LOF)(以下简称“本基金”)基金合同规定,于2019年8月23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。

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

场内简称	融通添利
基金主代码	161614
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年3月1日
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
报告期末基金份额总额	843,132,691.84份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2012年4月6日

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制投资风险的基础上,追求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金将在基金合同约定的投资范围内,通过对宏观经济运行状况的研究,积极的调整和优化固定收益类金融工具的资产比例配置。在有效控制风险的基础上,获得基金资产的稳定增值。
业绩比较基准	中债综合指数
风险收益特征	本基金属于债券基金,其预期风险和预期收益高于货币市场基金,低于混合型基金、股票型基金。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	徐卫东	郭明
	联系电话	(0755)26948666	(010)66105799
	电子邮箱	service@mail.rtfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-883-8088、(0755)26948088	95588
传真		(0755)26935005	(010)66105798

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、深圳证券交易所

§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)
本期已实现收益	19,920,623.42
本期利润	12,475,380.31
加权平均基金份额本期利润	0.0145
本期基金份额净值增长率	1.40%
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	0.0258
期末基金资产净值	895,356,683.04
期末基金份额净值	1.062

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;

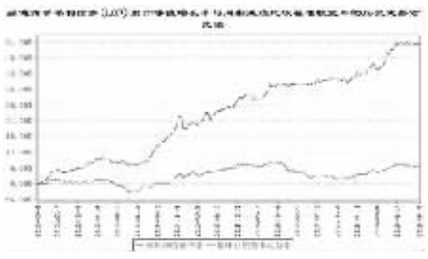
(3)期末可供分配基金份额利润=期末可供分配利润÷期末基金份额总额。其中期末可供分配利润:如果期末未分配利润的未实现部分为正数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分,如果期末未分配利润的未实现部分为负数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润(已实现部分扣除未实现部分)。

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	0.09%	0.06%	0.28%	0.03%	-0.19%	0.03%
过去三个月	-0.09%	0.07%	-0.24%	0.06%	0.15%	0.01%
过去六个月	1.40%	0.08%	0.24%	0.06%	1.16%	0.02%
过去一年	7.57%	0.11%	2.82%	0.06%	4.75%	0.05%
过去三年	15.59%	0.10%	0.03%	0.08%	15.56%	0.02%
自基金合同生效起至今	53.70%	0.13%	6.93%	0.08%	46.77%	0.05%

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(NikkoAssetManagementCo.,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、融通通瑞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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
王超	本基金的基金经理、固定收益部总监	2015年3月14日	-	11	王超先生,厦门大学金融工程硕士,11年证券投资从业经历,具有基金从业资格。2007年7月至2012年8月就职于平安银行金融市场产品部从事债券投资研究工作。2012年8月加入融通基金管理有限公司,历任投资经理、融通汇财宝货币市场基金基金经理、融通通源短融债券型证券投资基金基金经理、融通通瑞债券型证券投资基金基金经理、融通增裕债券型证券投资基金基金经理、融通增丰债券型证券投资基金基金经理、融通现金宝货币市场基金基金经理、融通稳利债券型证券投资基金基金经理、融通可转债债券型证券投资基金基金经理,现任固定收益部总监、融通债券投资基金基金经理、融通四季添利债券型证券投资基金(LOF)基金经理、融通岁岁添利定期开放债券型证券投资基金基金经理、融通增鑫债券型证券投资基金基金经理、融通增益债券型证券投资基金基金经理、融通通泰保本混合型证券投资基金基金经理、融通汇财宝货币市场基金基金经理、融通易支付货币市场证券投资基金基金经理、融通通宸债券型证券投资基金基金经理、融通超短债债券型证券投资基金基金经理。
余志勇	本基金的基金经理、研究部总监	2016年10月28日	-	19	余志勇先生,武汉大学金融学硕士,19年证券投资从业经历,具有基金从业资格。1992年7月至1997年9月就职于湖北省农业厅任研究员,2000年7月至2004年7月就职于闽发证券公司任研究员,2004年7月至2007年4月就职于招商证券股份有限公司任研究员。2007年4月加入融通基金管理有限公司,历任研究部行业研究员、行业研究组组长、融通领先成长混合型证券投资基金(LOF)基金经理、融通通泽灵活配置混合基金基金经理、融通增裕债券型证券投资基金基金经理、融通增丰债券型证券投资基金基金经理、融通通景灵活配置混合型证券投资基金基金经理、融通通尚灵活配置混合型证券投资基金基金经理、融通新优选灵活配置混合型证券投资基金基金经理、融通通润债券型证券投资基金基金经理、融通通颐定期开放债券型证券投资基金基金经理、融通通新动力灵活配置混合型证券投资基金基金经理,现任公司研究部总监、融通通泰保本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、融通沪港深智慧生活灵活配置混合型证券投资基金基金经理、融通通优选灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

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的工作时间为计算标准。

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

2019年上半年,债券市场维持区间震荡的走势。1月份市场延续了去年年末的牛市情绪,收益率快速下降,随后受社融大幅提升及经济数据转暖的影响,债券持续调整,3月份发布的2月份社融腰斩,且股市在此期间维持震荡走势,环境有利于债市,债券市场小幅上涨。4月份发布的3月份社融及经济数据表现强劲,债券市场受此影响大幅下跌。随后随着国内高频数据走弱、外围市场风险偏好下降及美国对中国对美出口的2000亿商品关税税率提升至25%,投资者对经济走势心存忧虑,债券市场在此期间转而上涨。5月下旬市场受“包商银行托管”事件冲击,投资者开始关注银行间市场回购业务的风险,各类型投资者的融资成本出现分化,结构性的资金紧张局面出现,带动债券市场下跌;随后监管方面对市场进行了指导,央行在公开市场上投放了资金,市场信心提振,债市重回上涨。

组合在上半年降低了利率债占比,提升了信用债占比,同时逐渐降低了组合久期,并适度参与了转债投资。

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1.062元;本报告期基金份额净值增长率为1.40%,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

展望后市,我们认为债券市场目前对经济不利方面的信息反应较多。截至5月份社融同比依然保持了非常高的增长,由于滞后效应存在,短期内并未立即体现在经济数据上。在大的去杠杆背景下,央行的最优策略将是保持货币松紧适度,既不能太松也不可太紧,在目前的利率水平上社融已然能得到有效修复,预计银行间货币市场最宽松的时点已过,预计债券市场将延续上半年的走势,继续维持区间震荡的态势。我们将持续跟踪研判市场走势,灵活调整组合的杠杆和久期,努力提升组合收益。

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

本基金于2019年1月16日实施2018年第4次利润分配,以2018年12月31日的可分配收益为基准,每10份基金份额派发现金红利0.16元。

本基金于2019年4月18日实施2019年第1次利润分配,以2019年3月31日的可分配收益为基准,每10份基金份额派发现金红利0.12元。

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

本报告期内,本基金托管人在对融通四季添利债券型证券投资基金(LOF)的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何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

本报告期内,融通四季添利债券型证券投资基金(LOF)的管理人——融通基金管理有限公司在融通四季添利债券型证券投资基金(LOF)的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内,融通四季添利债券型证券投资基金(LOF)对基金份额持有人进行了2次利润分配,分配金额为24,095,015.14元。

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

本托管人依法对融通基金管理有限公司编制和披露的融通四季添利债券型证券投资基金(LOF)2019年半年度报告中财务指标、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进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

§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:融通四季添利债券型证券投资基金(LOF)

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	2,448,277.14	1,317,094.86
结算备付金	8,364,450.80	1,991,294.62
存出保证金	40,976.96	28,842.00
交易性金融资产	913,952,453.38	1,226,397,565.36
其中:股票投资	2,830,000.00	14,831,892.95
基金投资	-	-
债券投资	911,122,453.38	1,211,565,672.41
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	-	288,436.32
应收利息	17,548,978.07	23,828,042.82
应收股利	-	-
应收申购款	7,612.84	273,762.24
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	942,362,749.19	1,254,125,038.22

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	44,000,000.00	342,999,425.00
应付证券清算款	1,989,868.25	-
应付赎回款	163,863.49	569,824.42
应付管理人报酬	441,749.85	459,310.08
应付托管费	147,249.96	153,103.37
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	9,531.08	26,750.61
应交税费	112,422.35	71,225.17
应付利息	-	460,791.03
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	141,381.17	82,108.77
负债合计	47,006,066.15	344,822,538.45
所有者权益:		
实收基金	843,132,691.84	845,735,255.50
未分配利润	52,223,991.20	63,567,244.27
所有者权益合计	895,356,683.04	909,302,499.77
负债和所有者权益总计	942,362,749.19	1,254,125,038.22

注:报告截止日2019年6月30日,基金份额净值1.062元,基金份额总额843,132,691.84份。

6.2 利润表

会计主体:融通四季添利债券型证券投资基金(LOF)

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	18,602,794.50	29,726,834.30
1.利息收入	22,993,931.86	19,713,119.02
其中:存款利息收入	78,856.39	73,591.45
债券利息收入	22,825,607.04	19,432,882.69
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	89,468.43	206,644.88
其他利息收入	-	-
2.投资收益	2,951,256.13	1,546,841.47
其中:股票投资收益	-11,616,779.60	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	14,463,424.08	1,277,682.31
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	59,611.65	-
股利收益	45,000.00	269,159.16
3.公允价值变动收益	-7,445,243.11	8,459,776.90
4.汇兑收益	-	-
5.其他收入	102,849.62	7,096.91
减:二、费用	6,127,414.19	7,584,946.54
1. 管理人报酬	2,727,890.95	2,551,740.83
2. 托管费	909,297.02	850,580.28
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	37,451.69	11,355.80
5. 利息支出	2,212,034.95	3,831,778.14
其中:卖出回购金融资产支出	2,212,034.95	3,831,778.14
6. 税金及附加	74,030.34	44,220.05
7. 其他费用	166,709.24	295,271.44
三、利润总额	12,475,380.31	22,141,887.76
减:所得税费用	-	-
四、净利润	12,475,380.31	22,141,887.76

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:融通四季添利债券型证券投资基金(LOF)

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)	845,735,255.50	63,567,244.27	909,302,499.77
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	12,475,380.31	12,475,380.31
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-2,602,563.66	276,381.76	-2,326,181.90
其中:1.基金申购款	68,232,108.48	5,251,831.50	73,483,939.98
2.基金赎回款	-70,834,672.14	-4,975,449.74	-75,810,121.88
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-24,095,015.14	-24,095,015.14
五、期末所有者权益(基金净值)	843,132,691.84	52,223,991.20	895,356,683.04

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)	835,840,594.15	25,296,787.07	861,137,381.22
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	22,141,887.76	22,141,887.76
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-13,718,150.04	-488,957.12	-14,207,107.16
其中:1.基金申购款	763,952.65	27,653.63	791,606.28
2.基金赎回款	-14,482,102.69	-516,610.75	-14,998,713.44
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-9,916,204.80	-9,916,204.80
五、期末所有者权益(基金净值)	822,122,444.11	37,033,512.91	859,155,957.02

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
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	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

6.4.4.1.1 股票交易

无。

6.4.4.1.2 权证交易

无。

6.4.4.1.3 应支付关联方的佣金

无。

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	2,727,890.95	2,551,740.83
其中:支付销售机构的客户维护费	100,018.62	61,884.21

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0.60%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×0.60%/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	909,297.02	850,580.28

注:支付基金托管人中国工商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

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	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
报告期初持有的基金份额	11,800,952.00	11,800,952.00
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减:报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	11,800,952.00	11,800,952.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.40%	1.44%

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
中国工商银行	2,448,277.14	35,658.28	2,386,407.76	30,322.39

注:本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管,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

无。

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,本基金从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额44,000,000.00元,其中44,000,000.00元于2019年7月1日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券,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	2,830,000.00	0.30
	其中:股票	2,830,000.00	0.30
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	911,122,453.38	96.68
	其中:债券	911,122,453.38	96.68
	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	10,812,727.94	1.15
8	其他各项资产	17,597,567.87	1.87
9	合计	942,362,749.19	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	2,830,000.00	0.32
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	-	-
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	2,830,000.00	0.32

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	000903	云内动力	1,000,000	2,830,000.00	0.32

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

本基金本报告期未发生股票买入。

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	000903	云内动力	7,966,101.75	0.88
2	002344	海宁皮城	4,861,306.35	0.53

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	-
卖出股票收入(成交)总额	12,827,408.10

注:“买入股票成本(成交)总额”和“卖出股票收入(成交)总额”均按成交单价乘以成交数量填列,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	4,092,863.40	0.46
2	央行票据	-	-
3	金融债券	50,164,150.50	5.60
	其中:政策性金融债	50,164,150.50	5.60
4	企业债券	457,292,807.58	51.07
5	企业短期融资券	78,598,150.00	8.78
6	中期票据	275,763,000.00	30.80
7	可转债(可交换债)	45,211,481.90	5.05
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	911,122,453.38	101.76

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	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	101754077	17河钢集MTN010	500,000	51,330,000.00	5.73
2	101801325	18兖矿MTN014	500,000	51,140,000.00	5.71
3	136417	16万达02	310,000	31,244,900.00	3.49
4	1880072	18温岭债01	300,000	30,981,000.00	3.46
5	101801263	18鞍钢MTN001	300,000	30,615,000.00	3.42

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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国债期货交易情况说明

7.10.1 本期国债期货投资政策

本基金在进行国债期货投资时,将根据风险管理原则,以套期保值为目的,采用流动性好、交易活跃的期货合约,通过对债券市场和期货市场运行趋势的研究,结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平,与现货资产进行匹配,通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险性特征,运用国债期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险,如大额申购赎回等;利用金融衍生品的杠杆作用,以达到降低投资组合的整体风险的目的。

7.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.10.3 本期国债期货投资评价

本报告期间,本基金管理人根据投资策略进行了国债期货操作,主要目的在于套期保值。

通过对宏观经济、债券市场和流动性的研究,结合不同品种和期限的国债期货的定价,选择合适的套保品种,管理资产的利率风险。在充分考虑国债期货收益和风险的基础上,灵活利用其杠杆和方向特征,降低投资组合的整体波动性。

本报告期内,本基金产品投资国债期货符合既定的投资政策和投资目的。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体报告期内未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。

7.11.2 本基金投资的前十名股票未超出本基金合同规定的备选股票库。

7.11.3 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	40,976.96
2	应收