财通纯债债券型证券投资基金 2018年半年度报告摘要

2018年06月30日
基金管理人:财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:2018年08月29日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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本基金合同规定,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。

财通纯债分级债券型证券投资基金分级运作期届满日为2016年1月18日,根据法律法规及业务规则要求,在满足基金合同约定的存续条件下,本基金于2016年1月19日转转换为不分级的开放式债券型基金,基金名称变更为"财通纯债债券型证券投资基金"。同时,基金的投资目标、投资范围、投资管理程序等保持不变。

基金管理人于2017年4月14日起对本基金增设收取销售服务费的C类份额,基金简称:财通纯债债券C,基金代码:003542,基金份额持有人持有的原份额变更为A类份额,基金简称:财通纯债债券A,基金代码:000497。

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	财通纯债债券	
场内简称	-	
基金主代码	000497	
交易代码	-	
基金运作方式	契约型、开放式	
基金合同生效日	2014年01月17日	
基金管理人	财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	524,314,781.29份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	财通纯债债券A	财通纯债债券C
下属分级基金的场内简称	-	-
下属分级基金的交易代码	000497	003542
报告期末下属分级基金的份额总额	524,309,757.17份	5,024.12份

注:(1)本基金合同生效日为2014年1月17日,根据基金合同规定,本基金分级运作期满日为2016年1月18日,于2016年1月19日正式转型为财通纯债债券型证券投资基金;

(2)本基金自2017年4月14日起增设收取销售服务费的C类份额,原份额变更为A类份额;

2.2基金产品说明

投资目标	在追求本金安全、保持资产流动性以及有效控制风险的基础上,通过积极主动的投资管理,力争持续稳定地实现超越业绩比较基准的组合收益。	
投资策略	本基金通过对宏观经济增长、通货膨胀、利率走势和货币政策四个方面的分析和预测,确定经济变量的变动对不同券种收益率、信用趋势和风险的潜在影响。注重组合的流动性,在分析和判断国内外宏观经济形势、市场利率走势、信用利差状况和债券市场供求关系等因素的基础上,自上而下确定大类债券资产配置和信用债券类属配置,动态调整组合久期和信用债券的结构,依然坚持自下而上精选个券的策略,在获取持有期收益的基础上,优化组合的流动性。	
业绩比较基准	中债综合(全价)指数收益率。	
风险收益特征	本基金为债券型基金,属于证券投资基金中预期收益和预期风险较低的基金品种,其风险收益预期高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。	
下属分级基金的风险收益特征	本基金为债券型基金,属于证券投资基金中预期收益和预期风险较低的基金品种,其风险收益预期高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。	本基金为债券型基金,属于证券投资基金中预期收益和预期风险较低的基金品种,其风险收益预期高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。

注:本基金自2017年4月14日起增设收取销售服务费的C类份额,原份额变更为A类份额。

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		财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	武祎	郭明
	联系电话	021-20537888	010-66105798
	电子邮箱	service@ctfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-820-9888	95588
传真		021-20537999	010-66105799

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.ctfund.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人办公地址

§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01月01日 - 2018年06月30日)	
	财通纯债债券A	财通纯债债券C
本期已实现收益	12,277,973.11	133.86
本期利润	16,227,423.53	192.03
加权平均基金份额本期利润	0.0309	0.0289
本期基金份额净值增长率	2.97%	2.75%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年06月30日)	
期末可供分配基金份额利润	0.0375	0.0133
期末基金资产净值	543,671,585.13	5,105.21
期末基金份额净值	1.0369	1.0161

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)期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数(为期末余额,不是当期发生数);

(4)本基金于2016年1月19日正式转型为财通纯债债券型证券投资基金;

(5)本基金自2017年4月14日起将各类基金份额净值计算保留到小数点后的位数更改为4位。

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

财通纯债债券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	0.31%	0.03%	0.34%	0.06%	-0.03%	-0.03%
过去三个月	1.10%	0.04%	1.01%	0.10%	0.09%	-0.05%
过去六个月	2.97%	0.04%	2.16%	0.08%	0.81%	-0.04%
过去一年	3.80%	0.04%	0.83%	0.06%	2.97%	-0.02%
自基金合同生效起至今(2016年01月19日-2018年06月30日)	7.25%	0.08%	-3.31%	0.08%	10.56%	0.00%

财通纯债债券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	0.28%	0.03%	0.34%	0.06%	-0.06%	-0.03%
过去三个月	0.99%	0.04%	1.01%	0.10%	-0.02%	-0.06%
过去六个月	2.75%	0.04%	2.16%	0.08%	0.59%	-0.04%
过去一年	2.84%	0.03%	0.83%	0.06%	2.01%	-0.03%
自份额成立日起至今(2017年04月14日-2018年06月30日)	2.84%	0.03%	0.03%	0.07%	2.81%	-0.04%

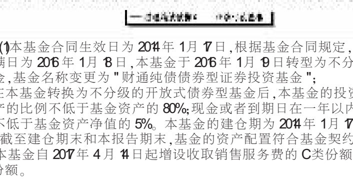
注:(1)上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字;

(2)本基金业绩比较基准为:中债综合(全价)指数收益率;

(3本基金自2017年4月14日起增设收取销售服务费的C类份额,原份额变更为A类份额。

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

财通纯债债券型证券投资基金A
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2016年1月19日-2018年6月30日)

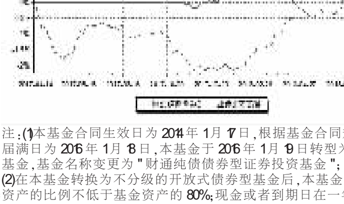


注:(1)本基金合同生效日为2014年1月17日,根据基金合同规定,本基金分级运作期届满日为2016年1月18日,本基金于2016年1月19日转型为不分级的开放式债券型基金,基金名称变更为"财通纯债债券型证券投资基金";

(2)在本基金转换为不分级的开放式债券型基金后,本基金的投资组合比例为:债券资产的比例不低于基金资产的80%;现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%。本基金的建仓期为2014年1月17日至2014年7月17日;截至建仓期末和本报告期末,基金的资产配置符合基金契约的相关要求;

(3)本基金自2017年4月14日起增设收取销售服务费的C类份额,原份额变更为A类份额。

财通纯债债券型证券投资基金C
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2017年4月14日-2018年6月30日)



注:(1)本基金合同生效日为2014年1月17日,根据基金合同规定,本基金分级运作期届满日为2016年1月18日,本基金于2016年1月19日转型为不分级的开放式债券型基金,基金名称变更为"财通纯债债券型证券投资基金";

(2)在本基金转换为不分级的开放式债券型基金后,本基金的投资组合比例为:债券资产的比例不低于基金资产的80%;现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%。本基金的建仓期为2014年1月17日至2014年7月17日;截至建仓期末和本报告期末,基金的资产配置符合基金契约的相关要求;

(3)本基金自2017年4月14日起增设收取销售服务费的C类份额,原份额变更为A类份额。

§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

财通基金管理有限公司成立于2011年6月,由财通证券股份有限公司、杭州市实业投资集团有限公司和浙江瀚叶股份有限公司共同发起设立,财通证券股份有限公司为第一大股东,出资比例40%。公司注册资本2亿元人民币,注册地上海,经营范围为基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其它业务。

财通基金始终秉承"持有人利益至上"的核心价值观,致力于为客户提供专业优质的资产管理服务。在公募业务方面,公司坚持以客户利益为出发点设计产品,逐步建立起覆盖各种投资标的、各种风险收益特征的产品线,获得一定市场口碑;公司将特定客户资产管理业务作为重要发展战略之一,形成玉泉系列、富春系列等多个子品牌,产品具有追求绝对收益、标的丰富、方案灵活等特点,为机构客户、高端个人客户提供个性化的理财选择。

公司现有员工180人,管理人员和主要业务骨干的证券、基金从业平均年限在10年以上。通过提供多维度、人性化的客户服务,财通基金始终与持有人保持信息透明;通过建立完备的风险控制体系,财通基金最大限度地保证客户的利益。公司将以专业的投资能力、规范的公司治理、诚信至上的服务、力求创新的精神为广大投资者创造价值。

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		
张亦博	本基金的基金经理	2015年08月27日	-	7年	澳大利亚莫纳什大学风险管理学硕士,特许金融分析师(CFA)。历任德邦证券有限责任公司研究所研究员,东吴证券股份有限公司资产管理总部债券研究员、债券投资经理助理,华宝证券有限责任公司资产管理部固定收益投资经理。2015年8月加入财通基金管理有限公司,任固定收益部基金经理。
罗晓倩	本基金的基金经理助理	2016年07月28日	-	5年	复旦大学投资学硕士,先后就职于友邦保险、国华人寿、汇添富基金、华福基金,2015年5月加入东吴证券,担任东吴证券资产管理总部投资经理。2016年5月加入财通基金固定收益部。

注:(1)基金的首任基金经理,其"任职日期"为基金合同生效日,其"离职日期"为根据公司决议确定的解聘日期;

(2)非首任基金经理,其"任职日期"和"离任日期"分别指根据公司决议确定的聘任日期和解聘日期;

(3)证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

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《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》、基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定,依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产,在认真控制投资风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,没有发生损害基金份额持有人利益的行为。

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

本基金管理人以价值投资为理念,致力于建设合理的组织架构和科学的投资决策体系,营造公平交易的执行环境。公司通过严格的内控制度和授权体系,确保投资、研究、交易等各个环节的独立性。公司将投资管理职能和交易执行职能相隔离,实行集中交易,并建立了公平的交易分配制度,确保在场内、场外各类交易中,各投资组合都享有公平的交易执行机会。

同时,公司逐步建立健全公司各投资组合均可参考的投资对象备选库和交易对手备选库,在此平台上共享研究成果,并对各组合提供无倾向性支持;在公用备选库的基础上,各投资组合经理根据不同投资组合的投资目标、投资风格、投资范围和关联交易限制等,建立不同投资组合的投资对象备选库和交易对手备选库,进而根据投资授权构建具体的投资组合。在确保投资组合间信息隔离、权限明晰的基础上,形成信息公开、资源共享的公平投资管理环境。

公司建立了专门的公平交易制度,并在交易系统中适当启用公平交易模块,保证公平交易的严格执行。对异常交易的监控包括事前、事中和事后等环节,特殊情况会经过严格的报告和审批程序,会定期针对旗下所有组合的交易记录进行了交易时机和价差的专项统计分析,以排查异常交易。

报告期内,本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《财通基金管理有限公司公平交易制度》的规定,未发现组合间存在违背公平交易原则的行为或异常交易行为。

4.3.2异常交易行为的专项说明

本公司原则上禁止不同投资组合之间(完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的投资组合及短期国债回购交易除外)或同一投资组合在同一交易日内进行反向交易。如果因应对大额赎回等特殊情况需要进行反向交易的,则需经公司领导严格审批并留痕备查。

本投资组合为主动型开放式基金。本报告期内,本投资组合与本公司管理的其他主动型投资组合未发生过同日反向交易(短期国债回购交易除外)的情况,也未发生影响市场价格的临近日同向或反向交易。

经过事前制度约束、事中严密监控,以及事后的统计排查,本报告期内各笔交易的市场成交比例、成交均价等交易结果数据表明,本期基金运作未对市场产生有违公允性的影响,亦未发现本基金存在异常交易行为。

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

上半年受益于宽松的货币政策,市场流动性整体宽松。国内经济承压和贸易战等因素导致利率债表现良好。但同时国内经济承压和信贷收缩使得信用风险事件爆发频出,违约增加,信用利差扩大,中低等级信用债下跌较快。 上半年本基金策略上以利率和中高等级信用债为主,适当增加久期和杠杆。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至报告期末财通纯债债券A基金份额净值为1.0369元;本报告期内,基金份额净值增长率为2.97%,同期业绩比较基准收益率为2.16%;截至报告期末财通纯债债券C基金份额净值为1.0161元;本报告期内,基金份额净值增长率为2.75%,同期业绩比较基准收益率为2.16%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

预计整体信用环境较上半年度有所改善,但信用风险仍是干扰信用环境修复的最大羁绊。上半年违约债券291.87亿,新增多家违约主体。加上紧信用背景下,信用再融资风险压力较大,导致上半年信用债分化。

央行6月初增加MLF担保品范围,窗口指导银行持有低评级AA+以下债券。体现出监管修复信用环境的意图,但恢复需时间。边际上还需要有更宽松的货币政策,去杠杆更进一步的放松,信用利差才可能收窄。

本基金持仓上仍将以中高等级为主,监测信用环境变化,适度增配中低等级;同时,市场上错杀的中低等级个券,可以加强研究,增厚收益。策略上,利率债进入下半场但依然有空间,下半年依然以利率和中短期中高等级信用债为主,同时保持市场杠杆水平。

4.6管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证券监督管理委员会《关于证券投资基金估值业务的指导意见》和中国证券业协会基金估值工作小组《关于停牌股票估值的参考方法》等法律法规的有关规定,本基金管理人设立估值委员会并制定估值委员会制度。

估值委员会成员由总经理、督察长、基金投资部、专户投资部、固定收益部、研究部、风险管理部、监察稽核部、基金清算部等部门负责人、基金清算部相关业务人员、涉及的相关基金经理或投资经理或实际履行前述部门相当职责的部门负责人或人员组成。估值委员会成员均具有会计核算经验、行业分析经验、金融工具应用等丰富的证券投资基金行业从业经验和专业能力,且之间不存在任何重大利益冲突。基金经理如果认为某证券有更能准确反应其公允价值的估值方法,可以向估值委员会申请对其进行专项评估。新的证券价格需经估值委员会和托管行同意后才能采纳,否则不改变用来进行证券估值的初始价格。

估值委员会职责:根据相关估值原则研究相关估值政策和估值模型,拟定公司的估值政策、估值方法和估值程序,确保公司各基金产品净值计算的公允性,以维护广大投资者的利益。

基金管理人与中国工商银行股份有限公司于2013年9月签订了《基金估值核算业务外包协议》,截至报告期末,基金管理人未对旗下公开募集证券投资基金及特定客户资产管理计划估值业务实行外包。

根据中国证券投资基金业协会《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》(中基协发[2017]6号),基金管理人与中证指数有限公司签订了《流通受限股票流动性折扣委托计算协议》,委托中证指数有限公司计算并提供流通受限股票流动性折扣。

4.7管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金的收益分配原则如下:

(1)在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为6次,每份基金份额每次收益分配比例不得低于该次收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的二分之一;

(2)本基金收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资,投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资;若投资者不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红;

(3)基金收益分配后基金份额净值不能低于面值,即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值;

(4)每一基金份额享有同等分配权;

(5)法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

根据相关法律法规及《基金合同》的要求,结合本基金运作情况,本报告期内本基金未进行利润分配。

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

报告期内,本基金未有连续20个工作日基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元的情况出现。

§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,本基金托管人在对财通纯债债券型证券投资基金的托管过程中,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,财通纯债债券型证券投资基金的管理人——财通基金管理有限公司在财通纯债债券型证券投资基金的投资运作、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,财通纯债债券型证券投资基金对基金份额持有人进行了1次利润分配,分配金额为18,623,105.45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

本托管人依法对财通基金管理有限公司编制和披露的财通纯债债券型证券投资基金2018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:财通纯债债券型证券投资基金
报告截止日:2018年06月30日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2018年06月30日	上年度末 2017年12月31日
资产:			
银行存款		20,155,712.35	20,823.49
结算备付金		-	454.90
存出保证金		192.86	5,816.50
交易性金融资产		728,801,937.50	694,231,217.00
其中:股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		728,801,937.50	694,231,217.00
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		-	-
应收利息		15,082,982.87	14,018,324.52
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		764,040,825.58	708,276,636.41

负债和所有者权益	附注号	本期末 2018年06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		200,956,898.57	160,991,558.51
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		138,010.69	139,075.51
应付托管费		46,003.58	46,358.50
应付销售服务费		1.88	2.79
应付交易费用		15,288.43	19,337.20
应交税费		83,025.33	-
应付利息		175,765.50	216,512.52
应付利润		18,610,211.34	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		338,929.92	460,000.00
负债合计		220,364,135.24	161,872,845.03
所有者权益:			
实收基金		524,019,790.19	524,333,396.17
未分配利润		19,656,900.15	22,070,395.21
所有者权益合计		543,676,690.34	546,403,791.38
负债和所有者权益总计		764,040,825.58	708,276,636.41

注:(1)后附会计报表附注为本会计报表的组成部分;

(2)报告截止日2018年6月30日,基金份额净值1.0369元,基金份额总额524,314,781.29份。其中A类基金份额净值1.0369元,A类基金份额总额524,309,757.17份,C类基金份额净值1.0161元,C类基金份额总额5,024.12份。

6.2利润表

会计主体:财通纯债债券型证券投资基金
本报告期:2018年01月01日至2018年06月30日

单位:人民币元

项目	附注号	本期2018年01月01日至2018年06月30日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06月30日
一、收入		21,026,292.14	5,982,802.07
1.利息收入		18,399,275.69	19,688,107.09
其中:存款利息收入		11,416.59	745,852.11
债券利息收入		18,371,979.34	18,222,391.49
资产支持证券利息收入		-	98,439.75
买入返售金融资产收入		15,879.76	621,423.74
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		-1,322,506.87	-19,554,055.50
其中:股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-1,322,506.87	-19,551,836.46
资产支持证券投资收益		-	-2,219.04
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		-	-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		3,949,508.59	5,773,423.96
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		14.73	75,326.52
减:二、费用		4,798,676.58	3,657,674.91
1. 管理人报酬		826,333.54	1,846,971.30
2. 托管费		275,444.50	738,788.47
3. 销售服务费		13.85	-
4. 交易费用		9,825.14	17,287.40
5. 利息支出		3,359,140.29	891,343.96
其中:卖出回购金融资产支出		3,359,140.29	891,343.96
6. 税金及附加		171,022.77	-
7. 其他费用		156,896.49	163,283.78
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		16,227,615.56	2,325,127.16
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		16,227,615.56	2,325,127.16

注:后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

6.3所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:财通纯债债券型证券投资基金
本报告期:2018年01月01日至2018年06月30日

单位:人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年06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)	524,333,396.17	22,070,395.21	546,403,791.38
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	16,227,615.56	16,227,615.56
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-313,605.98	-18,005.17	-331,611.15
其中:1.基金申购款	68,707.28	4,372.26	73,079.54
2.基金赎回款	-382,313.26	-22,377.43	-404,690.69
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-18,623,105.45	-18,623,105.45
五、期末所有者权益(基金净值)	524,019,790.19	19,656,900.15	543,676,690.34

项目	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06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)	406,974,364.27	11,572,011.11	418,546,375.38
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	2,325,127.16	2,325,127.16
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	191,104,777.75	6,290,864.68	197,395,642.43
其中:1.基金申购款	485,069,176.30	14,948,907.71	500,018,084.01
2.基金赎回款	-293,964,398.55	-8,658,043.03	-302,622,441.58
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	598,079,142.02	20,188,002.95	618,267,144.97

注:本期申购款金额包含基金拆分/折算调整金额;
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:

王家俊	王家俊	许志雄
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基金基本情况

财通纯债分级债券型证券投资基金(现已变更为"财通纯债债券型证券投资基金",以下简称"本基金"),系经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监许可[2013]1590号文《关于核准财通纯债分级债券型证券投资基金募集的批复》的核准,由基金管理人财通基金管理有限公司于2014年1月8日至2014年1月15日向社会公开募集,其中财通纯债分级债券型证券投资基金之纯债A份额(以下简称"纯债A")的发售时间为2014年1月8日至2014年1月10日,财通纯债分级债券型证券投资基金之纯债B份额(以下简称"纯债B")的发售时间为2014年1月10日至2014年1月15日。募集期结束经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)验证并出具安永华明(2014)验字第60951782_B13号验资报告后,向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2014年1月17日生效。本基金运作方式为契约型,本基金分级运作期内,纯债A自基金合同生效之日起每满3个月开放一次(纯债A第八次开放时,只开放赎回,不开放申购),纯债B封闭运作,且不上市交易;分级运作期届满,本基金转换为不分级的开放式债券型基金。财通纯债分级债券型证券投资基金设立时募集的扣除认购费后的实收基金(本金)为人民币215,629,255.22元,折合215,629,255.22份基金份额,其中纯债A150,629,255.22份,纯债B65,000,000.00份,募集资金在募集期间产生的利息为人民币10,432.89元,折合10,432.89份基金份额,其中纯债A10,432.89份,纯债B0.00份。以上收到的实收基金(本息)合计为人民币215,639,688.11元,折合215,639,688.11份基金份额。其中纯债A150,639,688.11份,纯债B65,000,000.00份。本基金的基金管理人为财通基金管理有限公司,注册登记机构为财通基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的债券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金主要投资于国债、地方政府债、央行票据、金融债、次级债、企业债、公司债、短期融资券、中期票据、中小企业私募债、资产支持证券、债券回购、通知存款、银行定期存款、协议存款等固定收益类资产。本基金的投资组合比例为:债券资产的比例不低于基金资产的80%;现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。本基金不直接从二级市场买入股票、权证、可转换债券等,也不参与一级市场的新股、可转换债券申购或增发新股。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

本基金业绩比较基准:中债综合(全价)指数收益率。

财通纯债分级债券型证券投资基金分级运作期届满日为2016年1月18日,根据法律法规及业务规则要求,在满足基金合同约定的存续条件下,本基金于2016年1月19日转转换为不分级的开放式债券型基金,基金名称变更为"财通纯债债券型证券投资基金"。同时,基金的投资目标、投资范围、投资管理程序等保持不变。

6.4.2会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则-基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定(以下统称"企业会计准则")编制,同时,对于在具体会计核算和信息披露方面,也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金于2018年6月30日的财务状况以及2018年1月1日至2018年6月30日止期间的经营成果和净值变动情况等有关信息。

6.4.4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、其他会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5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。

6.4.6税项

1印花税

经国务院批准,财政部、国家税务总局研究决定,自2008年4月24日起,调整证券(股票)交易印花税税率,由原先的3‰调整为1‰;

经国务院批准,财政部、国家税务总局研究决定,自2008年9月19日起,调整由出让方按证券(股票)交易印花税税率缴纳印花税,受让方不再征收,税率不变;

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让,暂免征收印花税。

2增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定,经国务院批准,自2016年5月1日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点,金融业纳入试点范围,由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税;国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税;存款利息收入不征收增值税;

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定,金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入;

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定,金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入;

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定,本基金运营过程中发生的增值税应税行为,以本基金的基金管理人为增值税纳税人;

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定,自2018年1月1日起,本基金的基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为,暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税。对本基金在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为,未缴纳增值税的,不再缴纳;已缴纳增值税的,已纳税额从本基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

3城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例(2011年修订)》、《征收教育费附加的暂行规定(2011年修订)》及相关地方教育附加的征收规定,凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人,都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加(除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外)及地方教育费附加。本基金的具体缴纳标准如下:

城市维护建设税 - 按实际缴纳的流转税的7%计缴。

教育费附加 - 按实际缴纳的流转税的3%计缴。

地方教育附加 - 按实际缴纳的流转税的2%计缴。

4企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定,自2004年1月1日起,对证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入,继续免征企业所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入,暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定,对证券投资基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

6.4.7关联方关系

6.4.7.1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

本基金本报告期不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。

6.4.7.2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
财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
中国工商银行股份有限公司("中国工商银行")	基金托管人、基金代销机构

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。

6.4.8本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.8.1.2权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.8.1.3债券交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2018年01月01日至2018年06月30日		上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06月30日	
	成交金额	占当期债券买卖成交总额的比例	成交金额	占当期债券买卖成交总额的比例
财通证券	-	-	81,134,688.40	28.30%

6.4.8.1.4债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.8.1.5应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

6.4.8.2关联方报酬

6.4.8.2.1基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年06月30日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	826,333.54	1,846,971.30
其中:支付销售机构的客户维护费	1.15	2.28

注:(1)本基金于2017年1月1日至2017年11月19日的管理费按前一日基金资产净值的0.5%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×0.5%÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令,基金托管人复核后于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延;

(2)本基金于2017年11月20日起管理费按前一日基金资产净值的0.3%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×0.3%÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令,基金托管人复核后于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延;

(3)客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的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;

6.4.8.2.2基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年06月30日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	275,444.50	738,788.47

注:(1)本基金于2017年1月1日至2017年11月19日的托管费按前一日基金资产净值的0.2%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

H=E×0.2%÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令,基金托管人复核后于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延;

(2)本基金于2017年11月20日起托管费按前一日基金资产净值的0.1%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×0.1%÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令,基金托管人复核后于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延;

6.4.8.2.3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01月01日至2018年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	财通纯债债券A	财通纯债债券C	合计
财通基金管理有限公司	-	13.85	13.85
合计	-	13.85	13.85

获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2017年04月14日至2017年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	财通纯债债券A	财通纯债债券C	合计
财通基金管理有限公司	-	-	-
合计	-	-	-

注:(1)本基金于2017年4月14日增设收取销售服务费的C类份额;

(2)基金销售服务费按前一日C类基金份额资产净值的0.4%年费率计提,每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划款指令,基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人,由基金管理人支付给销售机构。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延;

(3)销售服务费计提的计算公式为:每日应计提的基金销售服务费=前一日C类基金份额的基金资产净值×0.4%÷当年天数。

6.4.8.3与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.8.4各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期及上年度可比期间内基金管理人均未运用固有资金投资本基金。

6.4.8.4.2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

份额单位:份

关联方名称		本期末 2018年06月30日		上年度末 2017年12月31日	
		持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
财通纯债债券A	财通证券	32,874,571.67	6.27%	32,874,571.67	6.27%

注:财通证券股份有限公司("财通证券")于认购期内运用固有资金65,000,000.00元认购本基金份额65,000,000.00份,其中募集期间产生的利息为0元,纯债A、纯债B均不收取认购费。上述份额根据《基金合同》的规定于2016年1月18日、2016年1月19日折算,折算比例分别为1.352048441,0.999902404。

6.4.8.5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01月01日至2018年06月30日		上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行活期存款	20,155,712.35	11,392.30	12,774,010.10	46,976.93

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;

6.4.8.6本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末在承销期内直接购入关联方承销的证券。

6.4.8.7其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无其他关联交易事项的说明。

6.4.9期末(2018年06月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.9.2期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有临时停牌等流通受限股票。

6.4.9.3期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1银行间市场债券正回购

截至本报告期末2018年6月30日止,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人民币200,956,898.57元,于2018年7月3日、2018年7月4日到期。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
041764021	17秦交通CP001	2018-07-03	100.79	200,000	20,158,000.00
041800021	18曲文投CP001	2018-07-03	100.49	114,000	11,455,860.00
011800186	18鲁晨鸣SCP003	2018-07-03	100.00	300,000	30,000,000.00
041758035	17新港东区CP002	2018-07-03	100.73	200,000	20,146,000.00
041800035	18淮北建投CP001	2018-07-03	100.19	143,000	14,327,170.00
041800013	18连云交通CP001	2018-07-03	100.68	200,000	20,136,000.00
011764126	17汾湖投资SCP002	2018-07-04	100.62	200,000	20,124,000.00
011758148	17宏泰国资SCP001	2018-07-04	100.73	200,000	20,146,000.00
011800157	18滁州同创SCP001	2018-07-04	100.57	104,000	10,459,280.00
011801039	18汾湖投资SCP003	2018-07-04	100.07	200,000	20,014,000.00
101800120	18远洋集团MTN002	2018-07-04	102.80	24,000	2,467,200.00
101800526	18中金集MTN001BC	2018-07-04	100.36	200,000	20,072,000.00
合计				2,085,000	209,505,510.00

6.4.9.3.2交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有因交易所市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.10有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

1、公允价值

1)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括贷款和应收款项以及其他金融负债,其因剩余期限不长,公允价值与账面价值相若。

2)以公允价值计量的金融工具

(1)各层次金融工具公允价值

于2018年6月30日,本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第二层次的余额为人民币728,801,937.50元,无属于第一层次、第三层次的余额。

于2017年12月31日,本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第二层次的余额为人民币694,231,217.00元,无属于第一层次、第三层次的余额。

(2)公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券,若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况,本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关股票和可转换债券的公允价值列入第一层次;并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。

(3)第三层次公允价值余额和本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具第三层次公允价值本期未发生变动。

2、承诺事项

截至资产负债表日,本基金无需要说明的承诺事项。

3、其他事项

截至资产负债表日,本基金无需要说明的其他重要事项。

§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	-	-
	其中:股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	728,801,937.50	95.39
	其中:债券	728,801,937.50	95.39
	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	20,155,712.35	2.64
8	其他各项资产	15,083,175.73	1.97
9	合计	764,040,825.58	100.00

7.2报告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

本基金本报告期末未持有股票。

7.2.2报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过沪港通机制投资的港股。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末买入股票。

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

本基金本报告期末卖出股票。

7.4.3买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期末投资股票。

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	51,013,000.00	9.38
	其中:政策性金融债	51,013,000.00	9.38
4	企业债券	76,424,937.50	14.06
5	企业短期融资券	422,016,000.00	77.62
6	中期票据	179,348,000.00	32.99
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	728,801,937.50	134.05

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	041800012	18北大荒CP001	300,000	30,177,000.00	5.55
2	170211	17国开11	300,000	30,039,000.00	5.53
3	011800186	18鲁晨鸣SCP003	300,000	30,000,000.00	5.52
4	1580021	15汇丰投资债	300,000	24,063,000.00	4.43
5	180205	18国开05	200,000	20,974,000.00	3.86

7.7期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未投资资产支持证券。

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投资贵金属。

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股指期货交易情况说明

7.10.1报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

7.10.2本基金投资股指期货的投资政策

本基金不投资股指期货。

7.11报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1本期国债期货投资政策

本基金暂不投资国债期货。

7.11.2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合约。

7.11.3本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

7.12投资组合报告附注

7.12.1报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情形。

7.12.2报告期内,本基金投资的前十名股票中,没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

7.12.3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	192.86
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	15,082,982.87
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	15,083,175.73

7.12.4期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,本报告中涉及比例计算的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
财通纯债债券A	1,905	275,228.22	518,310,494.00	98.86%	5,999,263.17	1.14%
财通纯债债券C	5	1,004.82	-	-	5,024.12	100.00%
合计	1,910	274,510.36	518,310,494.00	98.85%	6,004,287.29	1.15%

注:分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例中,对下属分级基金,比例的分母采用各自级别的份额,对合计数,比例的分母采用期末基金份额总额,特此说明。

8.2期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金各类份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	财通纯债债券A	1,107.48	0.0002%
	财通纯债债券C	4,024.12	80.10%
	合计	5,131.60	0.0010%

8.3期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	财通纯债债券A	0
	财通纯债债券C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	财通纯债债券A	0
	财通纯债债券C	0
	合计	0

注:(1)本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间为0;

(2)本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为0。

§9 开放式基金份额变动

单位:份

	财通纯债债券A	财通纯债债券C
基金合同生效日(2014年01月17日)基金份额总额	104,588,639.11	-
本报告期期初基金份额总额	524,620,559.68	8,000.00
本报告期基金总申购份额	68,721.09	24.12
减:本报告期基金总赎回份额	379,523.60	3,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	524,309,757.17	5,024.12

注:总申购份额含红利再投、转换入份额;总赎回份额含转换出份额。

§10 重大事件揭示

10.1基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本报告期内,基金管理人于2018年6月29日增聘武祎先生担任公司督察长职务,原督察长黄惠女士于2018年6月29日离任;

2、本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内,为本基金进行审计的机构未发生变化,为安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)。

10.6管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内未发生基金管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情形。

10.7基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
长城证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
联讯证券	2	-	-	-	-	-
东海证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
山西证券	2	-	-	-	-	-
华融证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
湘财证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	2	-	-	-	-	-
高华证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
中信建投证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
民族证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
申银万国	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
财通证券	3	-	-	-	-	-
东兴证券	3	-	-	-	-	-
安信证券	4	-	-	-	-	-
长江证券	4	-	-	-	-	-
招商证券	4	-	-	-	-	-

10.7.2基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
长城证券	-	-	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
联讯证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	702,776.38	27.91%	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	29,081.10	1.15%	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-	-	-
民族证券	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	200,000.00	100.00%	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	1,623,114.35	64.46%	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
安信证券	163,144.65	6.48%	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2017-01-09至2018-06-30	485,435,922.33	0	0	485,435,922.33	92.58%

产品特有风险

本基金是由财通纯债分级债券型证券投资基金于分级运作期届满转型而来。转型为不分级的开放式基金,基金类型为债券型。原纯债A、纯债B基金份额持有人所持有的基金份额面临风险收益特征变化的风险。纯债B将不再内含杠杆机制;原有纯债B的基金份额持有人持有的转换后的基金份额,可能会因其业务办理所在证券公司的业务资格等方面的原因,不能顺利赎回。

在报告期内,本基金单一投资者持有的基金份额已达到或超过20%,可能对基金运作造成如下风险:

(1)赎回申请延缓支付的风险

该等投资者大额赎回时易构成本基金发生巨额赎回,中小投资者可能面临小额赎回申请也需要与该等投资者按同比例延缓支付赎回款项的风险。

(2)基金净值大幅波动的风险

该等投资者大额赎回时,基金管理人进行基金财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动;

(3)基金规模过小导致的风险

该等投资者赎回后,很可能导致基金规模过小。基金可能会面临投资银行间债券、交易所债券时交易困难的情形,实现基金投资目标存在一定的不确定性。

11.2影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期未有影响投资者决策的其他重要信息。

财通基金管理有限公司
二〇一八年八月二十九日