

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)
2019 年第 1 季度报告

2019 年 3 月 31 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

报告送出日期：2019 年 4 月 18 日

§ 1 重要提示

融通通盈灵活配置混合型证券投资基金由原融通通盈保本混合型证券投资基金转型而来，转型后的基金合同生效日为 2019 年 3 月 21 日。

根据《融通通盈保本混合型证券投资基金基金合同》的约定，在保本周期届满时，因未能符合保本基金存续条件，经本基金管理人与基金托管人协商一致，“融通通盈保本混合型证券投资基金”将按照基金合同的约定转型为非保本的混合型基金，即“融通通盈灵活配置混合型证券投资基金”。基金的保本周期到期操作期间为 2019 年 3 月 15 日（含）起至 2019 年 3 月 20 日（含）止，在本基金保本周期到期操作期间截止日的次日，即 2019 年 3 月 21 日起“融通通盈保本混合型证券投资基金”将更名为“融通通盈灵活配置混合型证券投资基金”，融通通盈灵活配置混合型证券投资基金的基金合同及托管协议亦于该日同时生效。

详情请参阅本基金管理人于 2019 年 3 月 5 日发布的《融通通盈保本混合型证券投资基金保本周期到期安排及转型为融通通盈灵活配置混合型证券投资基金相关业务规则的公告》。

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责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 4 月 16 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 3 月 31 日止，其中：

转型前为 2019 年 1 月 1 日起至 3 月 20 日止，

转型后为 2019 年 3 月 21 日至 3 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

2.1 基金基本情况（转型后）

基金简称	融通通盈灵活配置混合
交易主代码	002415
基金运作方式	契约型开放式

基金合同生效日	2019 年 3 月 21 日
报告期末基金份额总额	86,454,143.91 份
投资目标	在严格控制风险的前提下，投资于优质上市公司，并结合积极的大类资产配置，谋求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金的资产配置策略主要是通过对宏观经济周期运行规律的研究，基于定量与定性相结合的宏观及市场分析，确定组合中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例，规避系统性风险。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×50%+中债综合全价（总值）指数收益率×50%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于中等预期收益和预期风险水平的投资品种。
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

注：本基金由原融通通盈保本混合型证券投资基金转型而来，上表中合同生效日为转型后本基金起始运作日。

2.1 基金基本情况（转型前）

基金简称	融通通盈保本混合
交易主代码	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
报告期末基金份额总额	140,648,683.51 份
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。
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
基金保证人	深圳市高新投集团有限公司

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标（转型后）

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2019 年 3 月 21 日 — 2019 年 3 月 31 日）
1. 本期已实现收益	1,389,953.19
2. 本期利润	337,612.02

3. 加权平均基金份额本期利润	0.0033
4. 期末基金资产净值	95,122,585.26
5. 期末基金份额净值	1.1003

注：（1）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。

（2）本报告所列示的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。

3.1 主要财务指标（转型前）

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2019年1月1日—2019年3月20日）
1. 本期已实现收益	4,905,918.84
2. 本期利润	5,069,582.29
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0113
4. 期末基金资产净值	154,248,977.02
5. 期末基金份额净值	1.097

注：（1）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。

（2）本报告所列示的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。

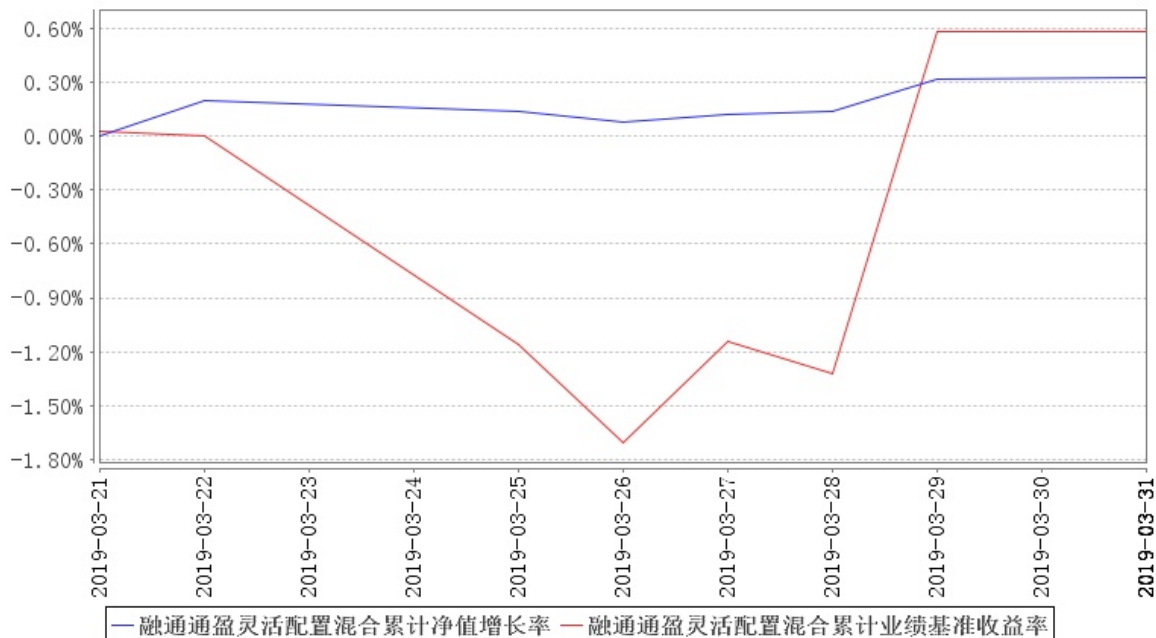
3.2 基金净值表现（转型后）

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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
2019年3月21日-2019年3月31日	0.30%	0.10%	0.59%	0.90%	-0.29%	-0.80%

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

融通通盈灵活配置混合累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金转型后的基金合同生效日为 2019 年 3 月 21 日，到报告期末基金转型未满一年。

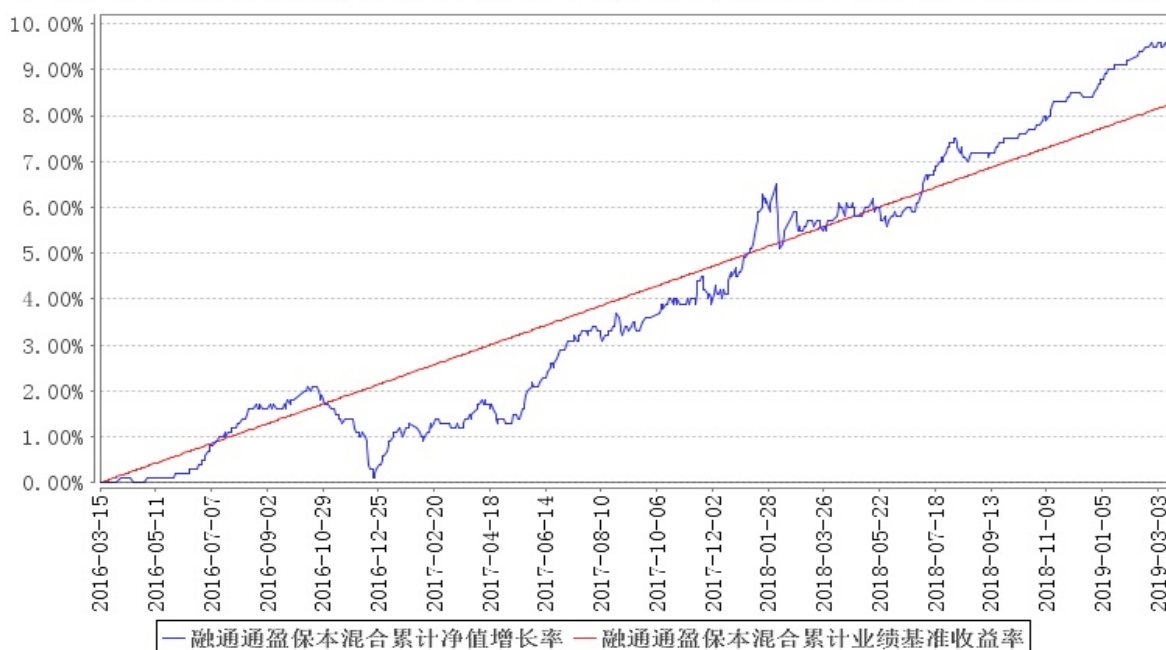
3.2 基金净值表现（转型前）

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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
自 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 3 月 20 日	1.01%	0.05%	0.60%	0.00%	0.41%	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

融通通盈保本混合累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介（转型后）

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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	2019年3月21日	-	13	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）。13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，现任融通通裕定期开放债券发起式、融通收益增强债券、融通通昊定期开放债券发起式、融通通源短融债券、融通通盈灵活配置混合基金的基金经理。

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。

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介（转型前）

姓名	职务	任本基金的基金经理期	证券从业	说明
----	----	------------	------	----

		限		年限	
		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	2019年3月20日	13	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，现任融通通盈保本混合、融通通裕定期开放债券发起式、融通收益增强债券、融通通昊定期开放债券发起式、融通通源短融债券基金的基金经理。

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

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 公平交易专项说明

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，并制定了相应的制度和流程，在授权、研究、决策、交易和业绩评估等各个环节保证公平交易制度的严格执行。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 报告期内基金投资策略和运作分析

债券市场方面，2019 年一季度，收益率先下后上，季末相比季初，除短端收益率有所下行外，其他期限段收益率变化不大。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。但一季度缺乏这样的催化剂，货币政策表现较为克制，经济数据表现好于此前市场悲观预期。

股票市场方面，一季度沪深 300 指数上涨 28.62%，创业板指上涨 35.43%，市场的反弹来源于风险偏好的大幅改善。1 月信贷社融数据强劲，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。

本基金一季度在债券方面，适度参与了利率债交易，持续降低杠杆储备流动性，顺利应对了保本期结束后的大规模赎回。在权益方面，维持低仓位应对赎回，待保本期结束后，规模稳定时再考虑择机加仓。

4.5 报告期内基金的业绩表现

转型后（2019 年 3 月 20 日-2019 年 3 月 31 日）：

截至本报告期末本基金份额净值为 1.1003 元；本报告期基金份额净值增长率为 0.30%，业绩比较基准收益率为 0.59%。

转型前（2019 年 1 月 1 日-2019 年 3 月 20 日）：

截至本报告期末本基金份额净值为元 1.097；本报告期基金份额净值增长率为 1.01%，业绩比较基准收益率为 0.60%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告（转型后）

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	3,614,016.40	3.64
	其中：股票	3,614,016.40	3.64
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	85,258,045.11	85.93
	其中：债券	85,258,045.11	85.93
	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	4,700,000.00	4.74
	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	2,013,035.44	2.03
8	其他资产	3,637,075.84	3.67
9	合计	99,222,172.79	100

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	970,216.40	1.02
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	1,298,200.00	1.36
G	交通运输、仓储和邮政业	990,000.00	1.04
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	355,600.00	0.37
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	3,614,016.40	3.80

5.3 报告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

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	002024	苏宁易购	100,000	1,255,000.00	1.32
2	600377	宁沪高速	100,000	990,000.00	1.04
3	601398	工商银行	50,000	278,500.00	0.29
4	300760	迈瑞医疗	1,978	265,645.40	0.28
5	600276	恒瑞医药	3,600	235,512.00	0.25
6	600585	海螺水泥	5,000	190,900.00	0.20
7	600887	伊利股份	5,000	145,550.00	0.15
8	600519	贵州茅台	100	85,399.00	0.09
9	601318	中国平安	1,000	77,100.00	0.08
10	000651	格力电器	1,000	47,210.00	0.05

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	5,400,540.00	5.68
	其中：政策性金融债	5,400,540.00	5.68
4	企业债券	23,716,776.40	24.93
5	企业短期融资券	-	-

6	中期票据	52,817,900.00	55.53
7	可转债（可交换债）	3,322,828.71	3.49
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	85,258,045.11	89.63

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量 (张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	101801185	18 南山集 MTN002	100,000	10,210,000.00	10.73
2	101553035	15 冀中 MTN002	100,000	10,185,000.00	10.71
3	122437	15 远洋 01	100,000	10,164,000.00	10.69
4	101775008	17 红狮 MTN004	100,000	10,116,000.00	10.63
5	101754074	17 滨建投 MTN004	70,000	7,050,400.00	7.41

5.6 报告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持有资产支持证券。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。

本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。

在法律法规许可时，本基金可基于谨慎原则运用其他相关金融工具对投资组合进行管理。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

为有效控制债券投资的系统性风险，本基金根据风险管理的原则，以套期保值为目的，适度

运用国债期货，提高投资组合的运作效率。

在国债期货投资时，本基金将首先分析国债期货各合约价格与最便宜可交割券的关系，选择定价合理的国债期货合约，其次，考虑国债期货各合约的流动性情况，最终确定与现货组合的合适匹配，以达到风险管理的目标。

5.10.2 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。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体报告期内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。

13 潞矿 01

本基金投资的前十名证券中的 13 潞矿 01，其发行主体为山西潞安矿业(集团)有限责任公司。

2018 年 5 月 15 日，公司收到长治市环境保护局行政处罚决定书（长环罚字[2018]006），对山西潞安矿业（集团）有限责任公司古城煤矿未按环保要求完成锅炉废气排放口在线监控设施的比对监测和验收备案工作、矿井水 COD 在线监测设备长期故障、在线监测站房建设及矿井水排放口在线监测点位不符合规范要求等违规行为依法查处，执行罚款 10 万元人民币。

投资决策说明：

此次罚款在潞安矿业 2018 年全年净利润中占比很小，该事件虽反映出潞安矿业废气监测等管理问题，但对潞安矿业整体的业务开展以及持续经营无重大不利影响，对该企业偿债能力影响微小。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	23,344.71
2	应收证券清算款	1,673,276.88
3	应收股利	-
4	应收利息	1,940,454.25
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,637,075.84

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告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。

§ 5 投资组合报告（转型前）

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	5,419,393.14	2.15
	其中：股票	5,419,393.14	2.15
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	152,177,173.54	60.35
	其中：债券	152,177,173.54	60.35
	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	7,700,000.00	3.05
	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	83,130,093.53	32.97
8	其他资产	3,725,133.89	1.48
9	合计	252,151,794.10	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	1,559,043.14	1.01
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	2,513,300.00	1.63
G	交通运输、仓储和邮政业	990,000.00	0.64
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	357,050.00	0.23
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	5,419,393.14	3.51

5.3 报告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

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	002024	苏宁易购	200,000	2,470,000.00	1.60
2	600377	宁沪高速	100,000	990,000.00	0.64
3	300760	迈瑞医疗	4,978	657,743.14	0.43
4	601398	工商银行	50,000	280,500.00	0.18
5	000651	格力电器	6,000	279,660.00	0.18
6	600276	恒瑞医药	3,000	218,160.00	0.14
7	600585	海螺水泥	5,000	184,400.00	0.12
8	600887	伊利股份	5,000	139,800.00	0.09
9	600519	贵州茅台	100	79,280.00	0.05
10	601318	中国平安	1,000	76,550.00	0.05

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	8,004,800.00	5.19
	其中：政策性金融债	8,004,800.00	5.19
4	企业债券	28,696,998.00	18.60
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	111,371,300.00	72.20
7	可转债（可交换债）	4,104,075.54	2.66
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	152,177,173.54	98.66

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	101651017	16 平安不动 MTN001	300,000	30,195,000.00	19.58
2	101763010	17 晋能 MTN003	100,000	10,266,000.00	6.66

3	101553035	15 冀中 MTN002	100,000	10,182,000.00	6.60
4	101801185	18 南山集 MTN002	100,000	10,164,000.00	6.59
5	122437	15 远洋 01	100,000	10,158,000.00	6.59

5.6 报告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持有资产支持证券。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。

本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。

在法律法规许可时，本基金可基于谨慎原则运用其他相关金融工具对投资组合进行管理。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

为有效控制债券投资的系统性风险，本基金根据风险管理的原则，以套期保值为目的，适度运用国债期货，提高投资组合的运作效率。

在国债期货投资时，本基金将首先分析国债期货各合约价格与最便宜可交割券的关系，选择定价合理的国债期货合约，其次，考虑国债期货各合约的流动性情况，最终确定与现货组合的合适匹配，以达到风险管理的目标。

5.10.2 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。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体报告期内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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	23,344.71
2	应收证券清算款	500,000.00
3	应收股利	-
4	应收利息	3,201,789.18
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,725,133.89

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告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。

§ 6 开放式基金份额变动（转型后）

单位：份

基金合同生效日（2019年3月21日）持有的基金份额	140,648,683.51
报告期期间基金总申购份额	7,024.90
减：报告期期间基金总赎回份额	54,201,564.50
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	86,454,143.91

§ 6 开放式基金份额变动（转型前）

单位：份

报告期期初基金份额总额	474,069,740.42
报告期期间基金总申购份额	1,309,238.30
减：报告期期间基金总赎回份额	334,730,295.21
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	140,648,683.51

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型后）

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型前）

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息（转型后）

无。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息（转型前）**8.1 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	20190101-20190315	99,999,000.00	-	99,999,000.00	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
当基金份额持有人占比过于集中时，可能存在因某单一基金份额持有人大额赎回而引起基金单位份额净值剧烈波动的风险及流动性风险。							

§ 9 备查文件目录**9.1 备查文件目录**

- （一）《融通通盈保本混合型证券投资基金保本周期到期安排及转型为融通通盈灵活配置混合型证券投资基金相关业务规则的公告》
- （二）《融通通盈灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- （三）《融通通盈灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- （四）《融通通盈灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- （五）《融通通盈灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》
- （六）中国证监会批融通通盈保本混合型证券投资基金设立的文件
- （七）《融通通盈保本混合型证券投资基金基金合同》

- (八) 《融通通盈保本混合型证券投资基金托管协议》
- (九) 《融通通盈保本混合型证券投资基金招募说明书》及其更新
- (十) 融通基金管理有限公司业务资格批件和营业执照
- (十一) 报告期内在指定报刊上披露的各项公告

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

9.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件，或登陆本基金管理人网站
<http://www.rtfund.com> 查询。

融通基金管理有限公司

2019 年 4 月 18 日