

融通沪港深智慧生活灵活配置混合型证券
投资基金
2019 年半年度报告摘要

2019 年 6 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

送出日期：2019 年 8 月 24 日

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沪港深智慧生活灵活配置混合型证券投资基金（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。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	融通沪港深智慧生活灵活配置混合
基金主代码	003279
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 11 月 8 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	259,899,149.39 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金重点投资于属于智慧生活主题的公司，在合理控制投资风险的基础上，力争把握该主题公司的投资机会，获取基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金的资产配置策略包括大类资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、权证投资策略、金融衍生工具投资策略等部分。
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×40%+中证香港 100 指数收益率×10%。
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。本基金如果投资港股通标的股票，需承担汇率风险以及境外市场的风险。

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	涂卫东	田青
	联系电话	(0755) 26948666	(010) 67595096
	电子邮箱	service@mail.rtfund.com	tianqingl.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

§ 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	2,981,634.59
本期利润	7,726,712.58
加权平均基金份额本期利润	0.1749
本期基金份额净值增长率	5.52%
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	0.0024
期末基金资产净值	260,513,062.57
期末基金份额净值	1.0024

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	3.75%	0.63%	3.39%	0.64%	0.36%	-0.01%
过去三个月	-3.14%	0.96%	-0.48%	0.81%	-2.66%	0.15%
过去六个月	5.52%	0.91%	14.32%	0.83%	-8.80%	0.08%
过去一年	-1.72%	0.99%	6.46%	0.84%	-8.18%	0.15%

自基金合同生效起至今	0.24%	0.91%	10.57%	0.64%	-10.33%	0.27%
------------	-------	-------	--------	-------	---------	-------

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

融通沪港深智慧生活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



§ 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金字[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 Asset Management 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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
何博	本基金的基金经理	2018 年 01 月 05 日	-	7	何博女士, 上海财经大学金融学硕士, 7 年证券投资从业经历, 具有基金从业资格。2012 年 7 月加入融通基金管理有限公司, 历任 QDII 研究员、国际业务部专

					户投资经理，现任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、融通核心价值混合型证券投资基金（QDII）基金经理。
余志勇	本基金的基金经理、研究部总监	2019 年 06 月 11 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、融通通裕债券型证券投资基金基金经理、融通通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、融通通四季添利债券型证券投资基金 (LOF) 基金经理、融通通慧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。

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合规守信情况的说明

本报告期内，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

年初以来，全球风险资产共振。A 股表现领涨全球，报告期内上证指数、中小板指数、创业板指数分别上涨 19.45%、20.75%和 20.87%；港股市场表现尽管跑输 A 股，重点指数仍录得不俗开局，报告期内恒生指数、恒生国企指数分别上涨 10.43%和 7.48%，港币中间价上涨 0.39%。

年初至 4 月中旬的估值扩张是 A 股及港股表现的核心驱动力。主要原因包括：1) 美国 FED 加息指引及流动性紧缩预期均转向鸽派，提振市场风险偏好出现边际回升；2) 中美贸易摩擦缓和；3) 国内刺激政策力度加码，出台了包括减税降费、货币宽松、鼓励消费等一系列政策。4 月下旬，市场波动性骤升，在国内经济下行压力凸显，中美贸易谈判再起波澜，人民币快速贬值和包商银行被接管引发市场对中小金融机构流动性风险的担忧等内外部环境变化下，市场大幅回调。6 月份 G20 会议前后中美贸易摩擦出现缓和，市场小幅反弹。

报告期内，基金配置逐步向 A 股倾斜，在政策与盈利赛跑的市场环境下，相对看好 A 股，同时降低了组合整体仓位。截至报告期末，基金在非银金融、银行、食品饮料板块配置比例较高。

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 1.0024 元；本报告期基金份额净值增长率为 5.52%，业绩比较基准收益率为 14.32%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

报告期内国内经济数据在短暂反弹后重回下行区间，整体盈利增速继续放缓，随着全球经济增长放缓、贸易摩擦对经济的负面影响渐显，加上内需疲弱，下半年经济下行压力有所上升，企业盈利恐难见明显改善，但在逆周期政策调节下，预期盈利不会出现失速下行情形。

目前，A 股估值已调整至历史中低位水平。整体而言，对下半年行情谨慎乐观，短期市场缺

乏明确催化剂，预计将维持震荡格局。中美贸易摩擦、国内金融去杠杆、进一步的逆周期政策及改革开放政策的出台是驱动市场表现的核心变量。长期看好消费升级和产业升级两条市场主线。

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应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

本基金本报告期末未进行利润分配，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

截止 2019 年 6 月 21 日，本基金存在连续六十个工作日以上基金资产净值低于五千万的情形。本基金管理人已经按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》向中国证监会报告并提出解决方案。

本基金本报告期内未发生连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人的情形。

§ 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关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：融通沪港深智慧生活灵活配置混合型证券投资基金

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	104,238,227.06	3,665,220.27
结算备付金	-	119,130.79
存出保证金	-	7,220.01
交易性金融资产	76,009,543.00	15,952,741.20
其中：股票投资	76,009,543.00	15,952,741.20
基金投资	-	-
债券投资	-	-
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	15,000,000.00	8,100,000.00
应收证券清算款	65,645,473.15	-
应收利息	20,158.57	11,933.21
应收股利	48,856.74	109.35
应收申购款	413.08	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	260,962,671.60	27,856,354.83
负债和所有者权益	本期末	上年度末

	2019 年 6 月 30 日	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	-	-
应付证券清算款	-	3.45
应付赎回款	10,895.36	-
应付管理人报酬	152,504.55	35,844.73
应付托管费	25,417.43	5,974.14
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	230,007.76	2,083.89
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	30,783.93	40,000.00
负债合计	449,609.03	83,906.21
所有者权益:		
实收基金	259,899,149.39	29,232,857.10
未分配利润	613,913.18	-1,460,408.48
所有者权益合计	260,513,062.57	27,772,448.62
负债和所有者权益总计	260,962,671.60	27,856,354.83

注： 报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0024 元，基金份额总额 259,899,149.39 份。

6.2 利润表

会计主体： 融通沪港深智慧生活灵活配置混合型证券投资基金

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	上年度可比期间
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
一、收入	8,505,125.10	-824,495.98
1. 利息收入	67,604.22	33,374.88
其中：存款利息收入	64,382.86	28,784.19
债券利息收入	-	193.97
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	3,221.36	4,396.72
其他利息收入	-	-
2. 投资收益	3,687,809.51	1,359,309.62
其中：股票投资收益	2,835,419.15	1,016,568.08

基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-1,200.00
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	852,390.36	343,941.54
3. 公允价值变动收益	4,745,077.99	-2,387,604.60
4. 汇兑收益	-	-
5. 其他收入	4,633.38	170,424.12
减：二、费用	778,412.52	479,491.60
1. 管理人报酬	318,927.19	290,048.22
2. 托管费	53,154.51	48,341.39
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	374,058.19	79,609.16
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 税金及附加	-	-
7. 其他费用	32,272.63	61,492.83
三、利润总额	7,726,712.58	-1,303,987.58
减：所得税费用	-	-
四、净利润	7,726,712.58	-1,303,987.58

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：融通沪港深智慧生活灵活配置混合型证券投资基金

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）	29,232,857.10	-1,460,408.48	27,772,448.62
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	7,726,712.58	7,726,712.58
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	230,666,292.29	-5,652,390.92	225,013,901.37
其中：1. 基金申购款	237,887,622.13	-5,470,988.70	232,416,633.43
2. 基金赎回款	-7,221,329.84	-181,402.22	-7,402,732.06
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）	259,899,149.39	613,913.18	260,513,062.57
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）	57,360,816.29	5,088,312.68	62,449,128.97
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-1,303,987.58	-1,303,987.58
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-27,638,213.05	-3,191,421.21	-30,829,634.26
其中：1. 基金申购款	22,418,508.69	1,225,921.73	23,644,430.42
2. 基金赎回款	-50,056,721.74	-4,417,342.94	-54,474,064.68
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）	29,722,603.24	592,903.89	30,315,507.13

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和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
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	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

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	318,927.19	290,048.22
其中：支付销售机构的客户维护费	94,390.17	139,624.97

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 1.50% 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 × 1.50% / 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	53,154.51	48,341.39

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数}。$$

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

无。

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
中国建设银行	104,238,227.06	61,886.93	3,897,454.05	25,144.78

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，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

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

无。

§ 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	76,009,543.00	29.13
	其中：股票	76,009,543.00	29.13
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	15,000,000.00	5.75
	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	104,238,227.06	39.94
8	其他各项资产	65,714,901.54	25.18
9	合计	260,962,671.60	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

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	2,734,407.00	1.05
C	制造业	21,267,973.00	8.16
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	3,477,263.00	1.33
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	674,726.00	0.26
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	821,744.00	0.32
J	金融业	43,720,249.00	16.78
K	房地产业	2,074,839.00	0.80

L	租赁和商务服务业	1,116,990.00	0.43
M	科学研究和技术服务业	121,352.00	0.05
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	76,009,543.00	29.18

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港股通投资股票。

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	601318	中国平安	83,600	7,407,796.00	2.84
2	600519	贵州茅台	6,600	6,494,400.00	2.49
3	600036	招商银行	142,000	5,109,160.00	1.96
4	600030	中信证券	142,800	3,400,068.00	1.31
5	601601	中国太保	90,500	3,304,155.00	1.27
6	600000	浦发银行	260,100	3,037,968.00	1.17
7	600887	伊利股份	84,300	2,816,463.00	1.08
8	601328	交通银行	389,900	2,386,188.00	0.92
9	601288	农业银行	656,000	2,361,600.00	0.91
10	601628	中国人寿	82,400	2,333,568.00	0.90

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

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	601318	中国平安	14,799,220.28	53.29
2	600519	贵州茅台	12,986,910.08	46.76
3	600036	招商银行	10,293,234.00	37.06
4	600030	中信证券	6,866,821.11	24.73
5	601601	中国太保	6,539,732.00	23.55
6	600000	浦发银行	6,089,030.00	21.92
7	600887	伊利股份	5,625,480.88	20.26

8	601328	交通银行	4,773,695.36	17.19
9	601288	农业银行	4,734,224.00	17.05
10	601628	中国人寿	4,708,323.00	16.95
11	601336	新华保险	4,700,642.25	16.93
12	600276	恒瑞医药	4,539,063.00	16.34
13	600016	民生银行	4,421,735.00	15.92
14	601398	工商银行	4,280,109.00	15.41
15	601229	上海银行	3,964,438.47	14.27
16	601818	光大银行	3,939,486.00	14.18
17	601668	中国建筑	3,560,874.40	12.82
18	600837	海通证券	2,944,161.00	10.60
19	600048	保利地产	2,618,163.00	9.43
20	600104	上汽集团	2,443,482.00	8.80
21	601988	中国银行	2,345,530.12	8.45
22	600585	海螺水泥	2,294,948.00	8.26
23	601766	中国中车	2,264,131.00	8.15
24	601888	中国国旅	2,158,800.34	7.77
25	600031	三一重工	2,105,779.00	7.58
26	600028	中国石化	1,954,637.00	7.04
27	600309	万华化学	1,801,277.00	6.49
28	601688	华泰证券	1,797,229.00	6.47
29	600690	海尔智家	1,714,923.70	6.17
30	600050	中国联通	1,663,238.00	5.99
31	601857	中国石油	1,630,301.00	5.87
32	600019	宝钢股份	1,628,002.00	5.86
33	600340	华夏幸福	1,565,447.00	5.64
34	601390	中国中铁	1,404,242.00	5.06
35	601989	中国重工	1,360,927.00	4.90
36	601186	中国铁建	1,319,080.00	4.75
37	02338	潍柴动力	1,143,337.08	4.12
38	601088	中国神华	1,064,861.07	3.83
39	03323	中国建材	829,027.29	2.99
40	603993	洛阳钼业	814,223.00	2.93
41	00763	中兴通讯	786,327.23	2.83
42	600703	三安光电	774,703.00	2.79
43	601800	中国交建	763,941.00	2.75
44	00788	中国铁塔	749,234.52	2.70
45	00345	VITASOY INT'L	718,284.69	2.59
46	600029	南方航空	707,585.00	2.55
47	600196	复星医药	660,926.00	2.38
48	601111	中国国航	646,824.00	2.33
49	01787	山东黄金	624,410.39	2.25

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	601318	中国平安	8,909,531.62	32.08
2	600519	贵州茅台	7,373,326.00	26.55
3	600036	招商银行	5,371,614.93	19.34
4	600030	中信证券	4,433,048.55	15.96
5	601601	中国太保	3,491,821.46	12.57
6	600887	伊利股份	3,053,395.43	10.99
7	600000	浦发银行	2,961,286.00	10.66
8	601336	新华保险	2,766,555.00	9.96
9	601628	中国人寿	2,654,307.78	9.56
10	600276	恒瑞医药	2,589,707.00	9.32
11	601328	交通银行	2,335,893.00	8.41
12	600016	民生银行	2,257,144.00	8.13
13	601398	工商银行	2,239,896.00	8.07
14	601288	农业银行	2,140,560.00	7.71
15	601229	上海银行	2,053,506.76	7.39
16	601668	中国建筑	1,843,211.00	6.64
17	601818	光大银行	1,838,984.00	6.62
18	00700	腾讯控股	1,792,646.41	6.45
19	600837	海通证券	1,749,114.00	6.30
20	01398	工商银行	1,634,975.53	5.89
21	01288	农业银行	1,628,936.10	5.87
22	00388	香港交易所	1,347,399.55	4.85
23	600104	上汽集团	1,338,913.00	4.82
24	600048	保利地产	1,301,266.00	4.69
25	601888	中国国旅	1,224,880.00	4.41
26	00688	中国海外发展	1,189,921.98	4.28
27	601988	中国银行	1,174,552.00	4.23
28	600585	海螺水泥	1,174,521.00	4.23
29	02338	潍柴动力	1,165,675.92	4.20
30	601688	华泰证券	1,152,548.00	4.15
31	601766	中国中车	1,141,285.00	4.11
32	600309	万华化学	1,096,568.00	3.95
33	01970	IMAX CHINA	1,088,004.78	3.92
34	600028	中国石化	1,048,669.00	3.78
35	00345	VITASOY INT'L	992,144.04	3.57

36	600690	海尔智家	963,885.00	3.47
37	01336	新华保险	939,189.72	3.38
38	00788	中国铁塔	928,635.24	3.34
39	600340	华夏幸福	916,646.27	3.30
40	600050	中国联通	854,350.00	3.08
41	600019	宝钢股份	836,868.00	3.01
42	601857	中国石油	785,942.00	2.83
43	01918	融创中国	783,100.18	2.82
44	06886	HTSC	762,861.66	2.75
45	601989	中国重工	740,560.00	2.67
46	00288	万洲国际	735,924.73	2.65
47	601390	中国中铁	705,394.00	2.54
48	00763	中兴通讯	699,540.88	2.52
49	03323	中国建材	697,979.05	2.51
50	01530	三生制药	663,965.17	2.39
51	601186	中国铁建	658,195.00	2.37
52	00586	海螺创业	638,893.45	2.30
53	03883	中国奥园	601,392.07	2.17
54	02020	安踏体育	568,482.52	2.05
55	00386	中国石油化工 股份	566,000.01	2.04

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	157,664,869.67
卖出股票收入（成交）总额	105,188,565.01

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

在法律法规允许的范围内，本基金可基于谨慎原则运用股指期货等相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险，提高投资效率。本基金主要采用流动性好、交易活跃的衍生品合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

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

本基金本报告期末未持有国债期货。

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。

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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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、处罚的情况：

本基金投资的前十名证券中的中国人寿，其发行主体为中国人寿保险股份有限公司。

2018 年 7 月 29 日，公司公告公司收到《中国人民银行行政处罚决定书》（银反洗罚决字〔2018〕第 5 号），对中国人寿保险股份有限公司于 2015 年 7 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日期间，未按照规定保存客户身份资料和交易记录以及未按照规定报送大额交易报告和可疑交易报告的行为依法查处，执行罚款人民币 70 万元。

投资决策说明：

中国人寿保险股份有限公司（下称“公司”）因未按照规定保存客户身份资料和交易记录以及未按照规定报送大额交易报告和可疑交易报告，被处以行政处罚人民币 70 万元罚款。罚款金额在公司 2018 年全年净利润中占比约 0.006%。公司在接受中国人民银行现场检查期间即立查立改、边查边改。截至公告日，公司已完善反洗钱制度，建立了新一代反洗钱系统，细化了客户身份识别、交易记录保存、大额交易和可疑交易报告等工作流程。该事件虽反映出公司对保存客户

身份资料和交易记录及报送大额交易报告和可疑交易报告不当等问题，但公司已及时整改，对公司整体业务开展以及持续经营无重大不利影响，对公司资金周转和债务偿还影响较小。

7.12.2 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。

7.12.3 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	-
2	应收证券清算款	65,645,473.15
3	应收股利	48,856.74
4	应收利息	20,158.57
5	应收申购款	413.08
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	65,714,901.54

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。

§ 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

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
971	267,661.33	237,242,578.92	91.28%	22,656,570.47	8.72%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	223.60	0.0001%

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	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	0

本基金基金经理持有本开放式基金	0
-----------------	---

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2016 年 11 月 8 日） 基金份额总额	343,327,288.20
本报告期期初基金份额总额	29,232,857.10
本报告期基金总申购份额	237,887,622.13
减：本报告期基金总赎回份额	7,221,329.84
本报告期末基金份额总额	259,899,149.39

§ 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，本基金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

10.2.1 基金管理人的重大变动

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

10.2.2 基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

托管人中国建设银行 2019 年 6 月 4 日发布公告，聘任蔡亚蓉为中国建设银行股份有限公司资产托管业务部总经理。

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，无涉及基金管理人、基金财产及基金托管业务的诉讼事项。

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

本基金聘请的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙），该事务所自本基金合同生效以来为本基金提供审计服务至今。

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，本基金的基金管理人、托管人的托管业务部门及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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	
招商证券	1	118,172,561.90	44.96%	102,483.53	43.62%	-
兴业证券	1	80,733,369.42	30.71%	75,187.01	32.00%	-
银河证券	1	49,374,181.02	18.78%	45,981.54	19.57%	-
中信证券	1	6,624,384.19	2.52%	4,637.11	1.97%	-
东吴证券	2	5,761,628.00	2.19%	5,365.92	2.28%	-
广发证券	1	2,187,310.15	0.83%	1,312.38	0.56%	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
恒泰证券	2	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	2	-	-	-	-	-
瑞信方正	1	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
华信证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	2	-	-	-	-	-

西藏东方财富	1	-	-	-	-	-
东北证券	3	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	3	-	-	-	-	-

注：1、本基金选择代理本公司所管理的基金进行证券买卖业务的证券经营机构的标准包括以下六个方面：

- (1) 资质雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币；
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (3) 经营行为规范，最近两年未因重大违规行为而受到中国证监会和中国人民银行处罚；
- (4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- (5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需，并能为本基金提供全面的信息服；

(6) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告及其他专门报告，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告。

2、选择代理本公司所管理的基金进行证券买卖业务的证券经营机构的程序包括以下四个步骤：

- (1) 券商服务评价；

- (2) 拟定租用对象。由研究部根据以上评价结果拟定备选的券商；
- (3) 上报批准。研究部将拟定租用对象上报分管副总经理批准；
- (4) 签约。在获得批准后，按公司签约程序代表公司与确定券商签约。

3、交易单元变更情况

本报告期内，新增中金证券交易单元 1 个。

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	
	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
招商证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	15,000,000.00	100.00%	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
瑞信方正	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
华信证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-

西藏东方财富	-	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-

§ 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	20190614-20190630	0.00	85,815,358.52	0.00	85,815,358.52	33.02
	2	20190614-20190630	0.00	84,239,550.92	0.00	84,239,550.92	32.41
	3	20190614, 20190618-20190630	0.00	67,187,669.48	0.00	67,187,669.48	25.85
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。							

融通基金管理有限公司

2019 年 8 月 24 日