

# 融通通鑫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：渤海银行股份有限公司

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。

基金托管人渤海银行股份有限公司根据融通通鑫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 20 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。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                    |
|------------|--------------------|
| 基金简称       | 融通通鑫灵活配置混合         |
| 基金主代码      | 001470             |
| 基金运作方式     | 契约型开放式             |
| 基金合同生效日    | 2015 年 6 月 15 日    |
| 基金管理人      | 融通基金管理有限公司         |
| 基金托管人      | 渤海银行股份有限公司         |
| 报告期末基金份额总额 | 1,043,879,931.49 份 |
| 基金合同存续期    | 不定期                |

### 2.2 基金产品说明

|        |   |
|--------|---|
| 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）指数收益率×50%  |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金，其预期收益风险水平高于债券型基金与货币市场基金，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。 |
|--|-------|

### 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                   | 渤海银行股份有限公司          |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名   | 涂卫东                          | 阮劲松                 |
|             | 联系电话 | (0755) 26948666              | (010) 65110109      |
|             | 电子邮箱 | service@mail.rtfund.com      | js.ruan@cbhb.com.cn |
| 客户服务电话      |      | 400-883-8088、(0755) 26948088 | 4008888811/95541    |
| 传真          |      | (0755) 26935005              | (022) 58314791      |

### 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 | <a href="http://www.rtfund.com">http://www.rtfund.com</a> |
| 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       | 34,033,668.52             |
| 本期利润          | 68,004,613.72             |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0651                    |
| 本期基金份额净值增长率   | 6.19%                     |
| 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  | 0.0866                    |
| 期末基金资产净值      | 1,163,988,370.04          |
| 期末基金份额净值      | 1.115                     |

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

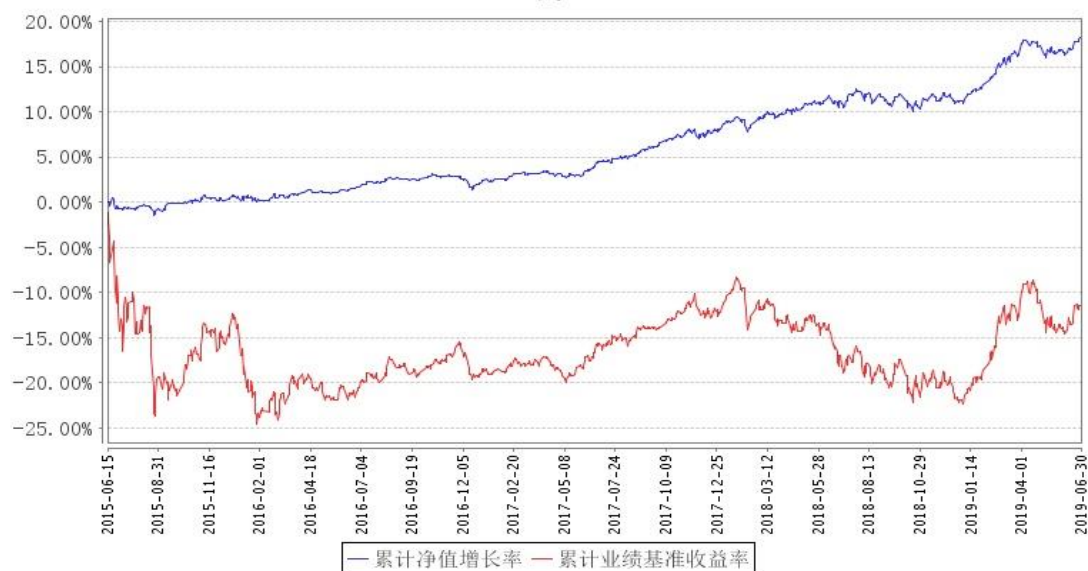
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段 | 份额净值 | 份额净值 | 业绩比较基 | 业绩比较基准 | ①—③ | ②—④ |
|----|------|------|-------|--------|-----|-----|
|----|------|------|-------|--------|-----|-----|

|                | 增长率①   | 增长率标准<br>差② | 准收益率③   | 收益率标准差<br>④ |        |        |
|----------------|--------|-------------|---------|-------------|--------|--------|
| 过去一个月          | 1.09%  | 0.17%       | 2.84%   | 0.57%       | -1.75% | -0.40% |
| 过去三个月          | 0.90%  | 0.23%       | -0.54%  | 0.75%       | 1.44%  | -0.52% |
| 过去六个月          | 6.19%  | 0.23%       | 13.28%  | 0.77%       | -7.09% | -0.54% |
| 过去一年           | 6.29%  | 0.23%       | 6.62%   | 0.76%       | -0.33% | -0.53% |
| 过去三年           | 16.17% | 0.18%       | 11.43%  | 0.55%       | 4.74%  | -0.37% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 18.15% | 0.17%       | -11.50% | 0.78%       | 29.65% | -0.61% |

### 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

融通通鑫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 |        |  |
| 余志勇 | 本基金的基金经理、研究部总监 | 2015年06月15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。 |

|     |          |             |   |   |   |
|-----|----------|-------------|---|---|---|
| 许富强 | 本基金的基金经理 | 2018年05月18日 | - | 8 | 许富强先生，北京大学经济学硕士，8年证券投资从业经历，具有基金从业资格。2011年7月加入融通基金管理有限公司，历任固定收益部研究员、专户投资经理、融通通穗债券型证券投资基金基金经理、融通增祥债券型证券投资基金基金经理，现任融通通鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理、融通增祥三个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理、融通通安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、融通通宸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。 |
|-----|----------|-------------|---|---|---|

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

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

A股资本市场 2019 年上半年波动幅度很大：1 季度大幅上涨，2 季度也出现了明显的调整。主要原因是国内外因素对市场风险偏好影响巨大：1 季度资本市场向上的主要推动力来自于政策呵护暖风、流动性改善和中美贸易关系缓和预期带来的风险偏好提升；2 季度的调整则是由于流

动性放松低于预期和中美贸易关系出现反复。

本基金的投资目标是绝对收益，同时为了保持基金净值增长率的平稳性，本基金保持了较低的仓位，并采取了组合投资和新股申购的投资策略。在权益投资策略上我们采取了相对均衡配置的阿尔法策略，力求在行业配置和个股选择上，获取持续稳定的超额收益  $\alpha$ 。主要配置思路有三：第一，在周期股中寻找供需竞争格局明显好转和行业周期波动性降低的龙头，例如重卡、工程机械等。第二，重点关注在新经济中具有中长期发展前景的细分板块龙头，例如 5G、云计算、新能源等。第三，消费板块中能长期保持竞争优势的企业，例如旅游、医药、食品饮料等。

二季度债券市场跌宕起伏，基本面和金融市场均经历了较大变化。从国内来看，在一季度的金融数据较快增长之后，社融和信贷数据有所回落，经济数据中地产投资数据一枝独秀，消费和进出口数据均有所走弱，通胀数据平稳。从外围来看，中美贸易谈判在二季度经历波折之后，在 6 月底重启谈判。全球经济面临新一轮放缓，各国央行货币政策均有宽松迹象。从市场表现来看，二季度债券市场多空因素交织，债市先抑后扬。一方面经济有进一步走弱迹象，流动性保持宽松，中美利差持续扩大均有利于国内债市收益率下行。另一方面，一季度社融的回暖，二季度包商银行被接管以及低资质主体融资持续困难等问题也对债市形成压制。展望后续行情，我们认为经济基本面对于债市的安全垫仍在，下半年依然存在结构性行情，未来低利率环境将维持较长时间才能真正迎来经济回暖。

债券策略上，组合采取利率债加中高等级信用债配置策略。组合将通过杠杆久期调整，严格的信评把控，在获取稳定的票息和套息基础上，博取超额的资本利得收益。

#### 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 1.115 元；本报告期基金份额净值增长率为 6.19%，业绩比较基准收益率为 13.28%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

尽管目前经济增长依然处于寻底过程中，但中国幅员辽阔、内需市场规模巨大、经济结构纵深较强，因此中国经济的韧性可能好于目前的市场预期。

整体上 A 股市场从极端悲观状态到边际改善的预期修复已经基本完成，现在处入相对均衡状态，市场波动大大降低。展望下半年我们对股市不悲观：首先，A 股市场整体估值已经处于历史较低的水平，即使与国际上一些主要资本市场相比，A 股市场的估值也有相对优势。其次，随着中国的一些主要政策措施出台，一定会带来新的增长动力，例如科创板的推出、减税政策的落地、中央基建力度的加大。

下半年我们看好的行业主要有：科技创新相关板块；减税措施和居民消费升级行为共同推动



的消费板块；存量经济特征日益明显的周期行业龙头。

展望下半年，我们认为宏观经济仍然面临诸多不确定因素。从经济基本面来看，经济仍然面临一定的下行压力。投资端，地产投资较快是上半年经济韧性的主要支撑，但随着整体建造链条前端开工数据的下行，预计下半年地产投资增速也将回落。上半年基建投资增速较低，但是趋势上有所回升，预计下半年基建投资将发挥更多稳经济的作用。出口端，全球经济放缓，总需求下行，加上此前贸易摩擦，关税影响，下半年的出口拉动作用将进一步下行。从政策面来看，央行货币政策的中性基调意味着总量政策大幅放松的概率较小，可能更加依靠在宽松流动性下通过结构和定向的方式维稳经济。财政政策一方面维持积极的基调，同时强调要加力提效，财政政策实施的空间和力度有待观察。

#### 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其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

本基金本报告期内未进行利润分配，符合法律法规和基金合同的规定。

#### 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

本报告期内，本基金托管人在对融通通鑫灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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，本基金托管人根据《证券投资基金法》等有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内，本基金未进行利润分配。

### 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

本托管人对融通基金管理有限公司编制和披露的融通通鑫灵活配置混合型证券投资基金 2019 年半年度报告中财务指标、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，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：融通通鑫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<br>2019 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2018 年 12 月 31 日 |
|-------------|------------------------|--------------------------|
| <b>资 产：</b> |                        |                          |
| 银行存款        | 50,163,916.03          | 50,884,582.44            |
| 结算备付金       | 1,179,393.49           | 586,596.89               |
| 存出保证金       | 129,583.63             | 71,484.53                |
| 交易性金融资产     | 1,002,691,752.32       | 937,355,593.14           |
| 其中：股票投资     | 155,589,942.62         | 134,096,565.51           |
| 基金投资        | -                      | -                        |
| 债券投资        | 847,101,809.70         | 803,259,027.63           |
| 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        | 92,030,567.05     | 92,000,572.00      |
| 应收证券清算款         | 854,981.17        | -                  |
| 应收利息            | 17,972,127.25     | 16,477,716.12      |
| 应收股利            | -                 | -                  |
| 应收申购款           | -                 | -                  |
| 递延所得税资产         | -                 | -                  |
| 其他资产            | -                 | -                  |
| 资产总计            | 1,165,022,320.94  | 1,097,376,545.12   |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>本期末</b>        | <b>上年度末</b>        |
|                 | <b>2019年6月30日</b> | <b>2018年12月31日</b> |
| <b>负债：</b>      |                   |                    |
| 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         | -                 | -                  |
| 应付赎回款           | -                 | -                  |
| 应付管理人报酬         | 569,018.08        | 559,850.44         |
| 应付托管费           | 142,254.55        | 139,962.62         |
| 应付销售服务费         | -                 | -                  |
| 应付交易费用          | 132,594.57        | 102,477.49         |
| 应交税费            | 74,172.84         | 59,886.82          |
| 应付利息            | -                 | -                  |
| 应付利润            | -                 | -                  |
| 递延所得税负债         | -                 | -                  |
| 其他负债            | 115,910.86        | 100,000.00         |
| 负债合计            | 1,033,950.90      | 962,177.37         |
| <b>所有者权益：</b>   |                   |                    |
| 实收基金            | 1,043,879,931.49  | 1,044,272,926.92   |
| 未分配利润           | 120,108,438.55    | 52,141,440.83      |
| 所有者权益合计         | 1,163,988,370.04  | 1,096,414,367.75   |
| 负债和所有者权益总计      | 1,165,022,320.94  | 1,097,376,545.12   |

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.115 元，基金份额总额 1,043,879,931.49 份。

## 6.2 利润表

会计主体：融通通鑫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          | 72,927,687.04 | 34,675,512.48 |
| 1. 利息收入       | 20,351,314.31 | 19,705,105.33 |
| 其中：存款利息收入     | 456,015.92    | 1,354,334.77  |
| 债券利息收入        | 19,203,740.81 | 17,205,333.78 |
| 资产支持证券利息收入    | -             | -             |
| 买入返售金融资产收入    | 691,557.58    | 1,145,436.78  |
| 其他利息收入        | -             | -             |
| 2. 投资收益       | 18,604,173.38 | 17,251,841.77 |
| 其中：股票投资收益     | 12,272,218.18 | 15,525,115.23 |
| 基金投资收益        | -             | -             |
| 债券投资收益        | 5,144,995.64  | 562,372.34    |
| 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          | 1,186,959.56  | 1,164,354.20  |
| 3. 公允价值变动收益   | 33,970,945.20 | -2,281,534.46 |
| 4. 汇兑收益       | -             | -             |
| 5. 其他收入       | 1,254.15      | 99.84         |
| 减：二、费用        | 4,923,073.32  | 4,690,275.80  |
| 1. 管理人报酬      | 3,387,670.51  | 3,222,471.49  |
| 2. 托管费        | 846,917.64    | 805,617.94    |
| 3. 销售服务费      | -             | -             |
| 4. 交易费用       | 498,795.08    | 412,567.44    |
| 5. 利息支出       | -             | -             |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | -             | -             |
| 6. 税金及附加      | 55,179.23     | 32,462.84     |
| 7. 其他费用       | 134,510.86    | 217,156.09    |
| 三、利润总额        | 68,004,613.72 | 29,985,236.68 |
| 减：所得税费用       | -             | -             |
| 四、净利润         | 68,004,613.72 | 29,985,236.68 |

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：融通通鑫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<br>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） | 1,044,272,926.92                      | 52,141,440.83 | 1,096,414,367.75 |
| 二、本期经营活动产生的基金净  | -                                     | 68,004,613.72 | 68,004,613.72    |

|                           |  |                |                  |
|---------------------------|--|----------------|------------------|
| 值变动数（本期利润）                |  |                |                  |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数      | -392,995.43                                | -37,616.00     | -430,611.43      |
| 其中：1. 基金申购款               | 116,757.39                                 | 8,159.94       | 124,917.33       |
| 2. 基金赎回款                  | -509,752.82                                | -45,775.94     | -555,528.76      |
| 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）           | 1,043,879,931.49                           | 120,108,438.55 | 1,163,988,370.04 |
| 项目                        | 上年度可比期间<br>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）           | 1,044,605,239.08                           | 31,256,069.94  | 1,075,861,309.02 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）  | -  | 29,985,236.68  | 29,985,236.68    |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数      | -413,923.16                                | -14,769.89     | -428,693.05      |
| 其中：1. 基金申购款               | 125,714.51                                 | 3,225.16       | 128,939.67       |
| 2. 基金赎回款                  | -539,637.67                                | -17,995.05     | -557,632.72      |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动 | -  | -10,446,052.52 | -10,446,052.52   |
| 五、期末所有者权益（基金净值）           | 1,044,191,315.92                           | 50,780,484.21  | 1,094,971,800.13 |

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、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 |
| 渤海银行股份有限公司（“渤海银行”） | 基金托管人、基金销售机构        |

注：以下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<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6<br>月 30 日 | 上年度可比期间<br>2018 年 1 月 1 日至 2018 年<br>6 月 30 日 |
|-----------------|--|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 3,387,670.51                             | 3,222,471.49                                  |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 748.43                                   | 840.21  |

注：1、于 2018 年度，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 基金托管费

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 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 846,917.64                      | 805,617.94                      |

注：支付基金托管人渤海银行的托管费按前一日基金资产净值 0.15% 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 × 0.15% / 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

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                              |           | 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 |           |
|       | 期末余额                            | 当期利息收入    | 期末余额                            | 当期利息收入    |
| 渤海银行  | 163,916.03                      | 27,904.68 | 5,329,505.92                    | 30,645.92 |

注：本基金的银行存款由基金托管人渤海银行保管，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：股票 |      |                 |                |        |       |        |          |           |           |    |
|----------------------|------|-----------------|----------------|--------|-------|--------|----------|-----------|-----------|----|
| 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:股) | 期末成本总额    | 期末估值总额    | 备注 |
| 300788               | 中信出版 | 2019 年 6 月 27 日 | 2019 年 7 月 5 日 | 新股流通受限 | 14.85 | 14.85  | 1,556    | 23,106.60 | 23,106.60 | -  |
| 601236               | 红塔证  | 2019 年          | 2019 年         | 新股流通   | 3.46  | 3.46   | 9,789    | 33,869.94 | 33,869.94 | -  |

|   |       |      |    |  |  |  |  |  |  |
|---|-------|------|----|--|--|--|--|--|--|
| 券 | 6月26日 | 7月5日 | 受限 |  |  |  |  |  |  |
|---|-------|------|----|--|--|--|--|--|--|

## 7.4.12.1.2 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<br>(单位：张) | 期末成本总额     | 期末估值总额     | 备注 |
|--------|------|------------|-----------|--------|--------|--------|--------------|------------|------------|----|
| 113028 | 环境转债 | 2019年6月20日 | 2019年7月8日 | 新债流通受限 | 100.00 | 100.00 | 3,060        | 305,997.32 | 305,997.32 | -  |
| 123027 | 蓝晓转债 | 2019年6月11日 | 2019年7月4日 | 新债流通受限 | 100.00 | 100.00 | 384          | 38,399.58  | 38,399.58  |    |

## 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

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              | 155,589,942.62   | 13.36         |
|    | 其中：股票             | 155,589,942.62   | 13.36         |
| 2  | 基金投资              | -                | -             |
| 3  | 固定收益投资            | 847,101,809.70   | 72.71         |
|    | 其中：债券             | 847,101,809.70   | 72.71         |
|    | 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          | 92,030,567.05    | 7.90          |
|    | 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      | 51,343,309.52    | 4.41          |
| 8  | 其他各项资产            | 18,956,692.05    | 1.63          |
| 9  | 合计                | 1,165,022,320.94 | 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         | 2,546,060.00   | 0.22         |
| B  | 采矿业              | 363,431.25     | 0.03         |
| C  | 制造业              | 94,859,493.86  | 8.15         |
| 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           | 6,296,802.00   | 0.54         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 2,611,418.80   | 0.22         |
| H  | 住宿和餐饮业           | -              | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 10,428,475.96  | 0.90         |
| J  | 金融业              | 14,367,744.94  | 1.23         |
| K  | 房地产业             | 7,127,693.00   | 0.61         |
| L  | 租赁和商务服务业         | 14,034,536.10  | 1.21         |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 1,162,204.68   | 0.10         |
| 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          | 1,768,975.43   | 0.15         |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | 23,106.60      | -            |
| S  | 综合               | -              | -            |
|    | 合计               | 155,589,942.62 | 13.37        |

### 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  | 601888 | 中国国旅 | 158,314 | 14,034,536.10 | 1.21         |
| 2  | 600031 | 三一重工 | 533,500 | 6,978,180.00  | 0.60         |
| 3  | 000338 | 潍柴动力 | 514,500 | 6,323,205.00  | 0.54         |
| 4  | 600801 | 华新水泥 | 310,750 | 6,292,687.50  | 0.54         |
| 5  | 300630 | 普利制药 | 79,425  | 4,576,468.50  | 0.39         |
| 6  | 601933 | 永辉超市 | 400,000 | 4,084,000.00  | 0.35         |
| 7  | 600887 | 伊利股份 | 116,600 | 3,895,606.00  | 0.33         |
| 8  | 000568 | 泸州老窖 | 47,600  | 3,847,508.00  | 0.33         |
| 9  | 600585 | 海螺水泥 | 92,100  | 3,822,150.00  | 0.33         |
| 10 | 002157 | 正邦科技 | 215,900 | 3,596,894.00  | 0.31         |

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  | 601888 | 中国国旅 | 14,763,487.43 | 1.35           |
| 2  | 601933 | 永辉超市 | 4,922,350.00  | 0.45           |
| 3  | 002475 | 立讯精密 | 3,878,409.00  | 0.35           |
| 4  | 600887 | 伊利股份 | 3,482,396.00  | 0.32           |
| 5  | 002142 | 宁波银行 | 2,993,541.42  | 0.27           |
| 6  | 000568 | 泸州老窖 | 2,918,906.00  | 0.27           |
| 7  | 002157 | 正邦科技 | 2,917,192.00  | 0.27           |
| 8  | 000651 | 格力电器 | 2,834,460.00  | 0.26           |
| 9  | 000031 | 大悦城  | 2,369,675.00  | 0.22           |
| 10 | 000543 | 皖能电力 | 2,334,987.00  | 0.21           |
| 11 | 300498 | 温氏股份 | 2,159,938.00  | 0.20           |
| 12 | 002439 | 启明星辰 | 2,042,252.00  | 0.19           |
| 13 | 603160 | 汇顶科技 | 2,008,968.88  | 0.18           |
| 14 | 601628 | 中国人寿 | 2,001,707.52  | 0.18           |
| 15 | 000002 | 万科A  | 1,997,584.00  | 0.18           |
| 16 | 601601 | 中国太保 | 1,969,046.28  | 0.18           |
| 17 | 601398 | 工商银行 | 1,915,732.00  | 0.17           |
| 18 | 600547 | 山东黄金 | 1,794,903.00  | 0.16           |
| 19 | 300232 | 洲明科技 | 1,770,168.80  | 0.16           |
| 20 | 002353 | 杰瑞股份 | 1,766,647.66  | 0.16           |

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  | 601888 | 中国国旅 | 14,326,284.98 | 1.31           |
| 2  | 600276 | 恒瑞医药 | 4,713,323.56  | 0.43           |
| 3  | 600801 | 华新水泥 | 4,644,034.00  | 0.42           |
| 4  | 601318 | 中国平安 | 4,580,843.90  | 0.42           |
| 5  | 601138 | 工业富联 | 3,390,736.32  | 0.31           |
| 6  | 002410 | 广联达  | 3,288,646.00  | 0.30           |
| 7  | 000333 | 美的集团 | 3,178,282.00  | 0.29           |
| 8  | 002557 | 洽洽食品 | 3,081,793.00  | 0.28           |
| 9  | 002157 | 正邦科技 | 3,002,456.00  | 0.27           |
| 10 | 601288 | 农业银行 | 2,936,585.00  | 0.27           |
| 11 | 600036 | 招商银行 | 2,907,593.00  | 0.27           |
| 12 | 002475 | 立讯精密 | 2,880,797.00  | 0.26           |
| 13 | 600271 | 航天信息 | 2,849,270.16  | 0.26           |

|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 14 | 600048 | 保利地产 | 2,835,699.00 | 0.26 |
| 15 | 300630 | 普利制药 | 2,704,749.00 | 0.25 |
| 16 | 000543 | 皖能电力 | 2,604,421.00 | 0.24 |
| 17 | 601336 | 新华保险 | 2,543,537.00 | 0.23 |
| 18 | 600027 | 华电国际 | 2,530,186.00 | 0.23 |
| 19 | 002110 | 三钢闽光 | 2,469,604.00 | 0.23 |
| 20 | 002304 | 洋河股份 | 2,378,132.00 | 0.22 |

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 | 144,230,635.06 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 174,981,118.69 |

注：表中“买入股票成本（成交）总额”及“卖出股票收入（成交）总额”均指成交金额，即成交单价乘以成交数量，相关交易费用不考虑。

#### 7.5 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      | 156,332,389.30 | 13.43        |
|    | 其中：政策性金融债 | 85,410,389.30  | 7.34         |
| 4  | 企业债券      | 155,919,026.30 | 13.40        |
| 5  | 企业短期融资券   | 50,272,000.00  | 4.32         |
| 6  | 中期票据      | 462,616,000.00 | 39.74        |
| 7  | 可转债（可交换债） | 21,962,394.10  | 1.89         |
| 8  | 同业存单      | -              | -            |
| 9  | 其他        | -              | -            |
| 10 | 合计        | 847,101,809.70 | 72.78        |

#### 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  | 136775    | 16 中船 02      | 500,000 | 49,365,000.00 | 4.24         |
| 2  | 190201    | 19 国开 01      | 400,000 | 39,984,000.00 | 3.44         |
| 3  | 1820009   | 18 宁波银行 01    | 300,000 | 30,942,000.00 | 2.66         |
| 4  | 101761041 | 17 南山集 MTN002 | 300,000 | 30,435,000.00 | 2.61         |
| 5  | 101900282 | 19 鞍钢 MTN001  | 300,000 | 30,246,000.00 | 2.60         |

#### 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。**

**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   | 129,583.63    |
| 2  | 应收证券清算款 | 854,981.17    |
| 3  | 应收股利    | -             |
| 4  | 应收利息    | 17,972,127.25 |
| 5  | 应收申购款   | -             |
| 6  | 其他应收款   | -             |
| 7  | 待摊费用    | -             |

|   |    |               |
|---|----|---------------|
| 8 | 其他 | -             |
| 9 | 合计 | 18,956,692.05 |

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码   | 债券名称     | 公允价值         | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|----------|--------------|---------------|
| 1  | 132006 | 16 皖新 EB | 6,280,800.00 | 0.54          |
| 2  | 110050 | 佳都转债     | 1,752,380.00 | 0.15          |
| 3  | 113515 | 高能转债     | 1,266,540.00 | 0.11          |
| 4  | 128047 | 光电转债     | 924,960.00   | 0.08          |
| 5  | 128030 | 天康转债     | 191,895.00   | 0.02          |
| 6  | 128045 | 机电转债     | 114,150.40   | 0.01          |
| 7  | 113011 | 光大转债     | 108,400.00   | 0.01          |

#### 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 |
| 213       | 4,900,844.75 | 1,043,016,933.04 | 99.92% | 862,998.45 | 0.08%  |

#### 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 | 97.94      | 0.0000%  |

#### 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、基金投资和相关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（2015 年 6 月 15 日）<br>基金份额总额 | 209,472,505.28   |
| 本报告期期初基金份额总额                       | 1,044,272,926.92 |
| 本报告期基金总申购份额                        | 116,757.39       |
| 减：本报告期基金总赎回份额                      | 509,752.82       |
| 本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）           | -                |
| 本报告期期末基金份额总额                       | 1,043,879,931.49 |

## § 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

#### (1) 基金管理人的重大变动

本报告期基金管理人无重大人事变动。

#### (2) 本报告期基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

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，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 |    |
| 中信建投 | 2      | 317,057,370.57 | 100.00%      | 288,924.89 | 100.00%    | -  |

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) 财力雄厚, 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, 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

本基金交易单元无变更。

## 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 |
| 中信建投 | 120,077,617.75 | 100.00%      | 1,204,000,000.00 | 100.00%        | -    | -            |

## § 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              | 2019-1-1~2019-6-30      | 1,043,016,933.04 | -    | -    | 1,043,016,933.04 | 99.92    |
| 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