

融通中国概念债券型证券投资基金（QDII）

2019 年半年度报告

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

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据融通中国概念债券型证券投资基金（QDII）（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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 境外投资顾问和境外资产托管人	6
2.5 信息披露方式	6
2.6 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	12
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	12
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	16
§ 7 投资组合报告	31
7.1 期末基金资产组合情况	31
7.2 期末按行业分类的权益投资组合	32
7.3 期末按债券信用等级分类的债券投资组合	32
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细	32
7.5 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细	32
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细	32
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基金投资明细	32
7.8 投资组合报告附注	33
§ 8 基金份额持有人信息	33
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	33
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	33

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	33
§ 9 开放式基金份额变动.....	34
§ 10 重大事件揭示.....	34
10.1 基金份额持有人大会决议	34
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	34
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	34
10.4 基金投资策略的改变	34
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	34
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	34
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	35
10.8 其他重大事件	38
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	40
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	40
§ 12 备查文件目录.....	40
12.1 备查文件目录	40
12.2 存放地点	40
12.3 查阅方式	40

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	融通中国概念债券型证券投资基金（QDII）
基金简称	融通中国概念债券（QDII）
基金主代码	005243
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 11 月 27 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	29,410,468.97 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于具有中国概念的债券资产，在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金在宏观层面，采取自上而下的资产配置策略；在微观层面，采取自下而上的证券优选策略。整体看，将宏观与微观分析相结合，在有效分散风险的基础上，寻找海外上市中国证券资产的价值洼地，提高基金资产的收益。
业绩比较基准	富时中国美元债券指数（FTSE Asian Broad Bond Index (ABBI) China Issuers Index in LCL terms）收益率。
风险收益特征	本基金为债券型基金，其长期平均预期风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。

注：本基金业绩比较基准由“花旗中国美元债券指数（Citi Asian Broad Bond Index (ABBI) China Issuers Index in LCL terms）收益率”更名为“富时中国美元债券指数（FTSE Asian Broad Bond Index (ABBI) China Issuers Index in LCL terms）收益率”。本次更名不涉及指数编制方法、计算发布时间、指数历史的变化，指数点位也将延续。具体内容详见本基金管理人于 2018 年 7 月 18 日在中国证券报及基金管理人网站上发布的公告。

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
	联系电话	(0755) 26948666
	电子邮箱	service@mail.rtfund.com
客户服务电话	400-883-8088、(0755) 26948088	(010) 67595096
传真	(0755) 26935005	(010) 66275853
注册地址	深圳市南山区华侨城汉唐大厦 13、14 层	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址	深圳市南山区华侨城汉唐大厦 13、14 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	518053	100033

法定代表人	高峰	田国立
-------	----	-----

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	中文	-	摩根大通
	英文	-	J. P. Morgan
注册地址		-	1111 Polaris Parkway, Columbus, OH 43240, U. S. A.
办公地址		-	270 Park Avenue, New York, New York 10017
邮政编码		-	010017

2.5 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
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

2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	融通基金管理有限公司	深圳市南山区华侨城汉唐大厦 13、14 层

§ 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	589,681.00
本期利润	1,372,436.68
加权平均基金份额本期利润	0.0584
本期加权平均净值利润率	5.13%
本期基金份额净值增长率	6.13%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)
期末可供分配利润	3,897,448.88
期末可供分配基金份额利润	0.1325
期末基金资产净值	34,311,867.93
期末基金份额净值	1.1667
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019年6月30日)
基金份额累计净值增长率	16.66%

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

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益;

3、期末可供分配基金份额利润=期末可供分配利润÷期末基金份额总额。其中期末可供分配

利润: 如果期末未分配利润的未实现部分为正数, 则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分, 如果期末未分配利润的未实现部分为负数, 则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润 (已实现部分扣除未实现部分)。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.63%	0.11%	0.93%	0.19%	-0.30%	-0.08%
过去三个月	2.14%	0.18%	4.83%	0.19%	-2.69%	-0.01%
过去六个月	6.13%	0.20%	7.82%	0.23%	-1.69%	-0.03%
过去一年	11.29%	0.20%	13.73%	0.25%	-2.44%	-0.05%
自基金合同生效起至今	16.66%	0.17%	12.02%	0.25%	4.64%	-0.08%

注: 同期业绩比较基准以人民币计价。

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

融通中国概念债券 (QDII) 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		
成涛	本基金的基金经理	2018 年 1 月 11 日	-	7	成涛先生,加拿大不列颠哥伦比亚大学理学硕士,7 年证券投资从业经历,具有基金从业资格。2012 年 5 月至 2015 年 10 月就职于国家外汇管理局中央外汇业务中心任交易员,2015 年 11 月至 2017 年 5 月就职于嘉实基金管理有限公司任外汇交易员。2017 年 6 月加入融通基金管理有限公司,曾任国际业务部专户投资经理,现任融通中国概念债券型证券投资基金(QDII)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遵规守信情况的说明

报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规和本基金合同的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金持有人谋求最大利益,无损害基金持有人利益的行为,本基金投资组合符合有关法律法规的规定及基金合同的约定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一直坚持公平对待旗下所有投资组合的原则,在授权、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

全球经济增长动能延续下降的势头。美国制造业周期拐点已经出现，我们判断该趋势具有持续性，将拖累美国实际增速大幅走低。同时，中美贸易战意外升级，美国进一步对中国商品加税，中方进行反制，使全球经济进一步承压。在财政刺激消退、外需疲弱和贸易战的大背景下，美国制造业数据已经开始加速下行。中国经济尽管短期仍然稳健，但面临不小的二次探底压力，除财政开支支撑基建投资外，制造业投资、房地产投资均承压，PMI 再次跌破 50，且随着出口产业链向外转移，就业也将受到冲击，尽管居民消费有望企稳，但消费的波动从来不是造成经济波动的主要原因，也并不是我们关注的主要矛盾。我们认为目前的货币和财政刺激力度仍然不足，后续仍会加码。欧洲经济仍处在筑底过程中，PMI、工业增加值等数据边际上有所企稳，但作为外向型经济体，欧洲经济更多是跟随全球总需求波动，也是自由贸易最受益的地区之一，贸易战的升级无疑将使欧洲继续承压。

货币政策方面，美联储和欧央行相继释放出降息信号以刺激经济，全球国债收益率大幅下行，十年德债收益率创历史新低，十年美债收益率测试 2.0% 关口，风险资产也受益于流动性的宽松而反弹。中国货币仍然维持着宽松的流动性，但边际上保持稳定，没有太多变化。

中概债方面，中资美元债一季度大幅反弹。便宜的估值水平、中国经济边际企稳、美元流动性重回宽松三者共振促成了本轮历史性反弹；二季度则是先抑后扬，投资级债券利差不变，高收益级债券利差小幅走阔，表现明显优于美国本土市场债券。面对未来的不确定性和股市的调整压力，资金持续涌入中资美元债市场。合理的估值水平、良好的供需关系、较低的尾部风险是我们认为支撑二季度的主要因素。人民币利率债收益率上半年先下后上，表现远不及其他主要经济体国债，低评级信用债在包商事件后受到冲击，高评级信用债利差则相对稳定。

人民币汇率方面，人民币对美元随着中国经济企稳和贸易谈判的顺利推进短暂升值，但贸易战的意外升级使人民币对美元再次快速贬值，最终稳定在 6.9 附近。我们认为汇率短期的能见度较低，将主要受到贸易谈判进程的影响。

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 1.1667 元；本报告期基金份额净值增长率为 6.13%，业绩比较基准收益率为 7.82%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们认为全球经济仍将继续下行。尽管 G20 后中美将恢复谈判，但谈判结果高度不确定，唯一确定的是谈判周期不会短，因此未来几个月内贸易战的不确定性仍将困扰市场，

影响企业的投资意愿和金融市场的价格走势，下半年的尾部风险明显上升。我们的中期判断自年初以来保持不变，美国私营企业的商业周期仍然处在下行趋势中，料将由于贸易战的原因加速下行，后期需要重点观察的是企业商业周期对居民就业和薪资的传导，一旦负面冲击影响到居民部门，美国陷入衰退的可能性将大幅上升。诚然，近期的非农数据再次彰显了美国经济的韧性，但就业、薪资从来都是滞后指标。我们认为周期永存，美国正在经历历史上最长的复苏周期，常识告诉我们衰退并不遥远。复苏的时间越长，积攒的势能也就越大，下一轮衰退到来时也就越猛烈。

中国经济二次探底的压力亦大幅增加，预计后续政策将加码，尽管高层多强调宽财政的重要性，但货币政策的配合至关重要，特别是包商事件后，金融系统的去杠杆压力明显上升，宽货币对冲去杠杆是中央银行家的常识，相信央行在近期将有动作。基于以上判断，我们认为美债和人民币国债收益率都会继续下行。

中资美元债方面，我们认为三季度中资美元债市场暂时无忧，主要基于两点：1. 美联储在下次议息会议降息几乎已成定局，历史上看，降息前后的一个月内美股均有不错的表现，相信这次也不会例外，而美股是全球风险资产的风向标；2. 贸易谈判的继续使短期出现冲突大幅升级的可能性明显下降。但我们仍然担忧三季度后的市场情况，主要源自对美国经济的担忧，一旦美股出现大幅调整，全球以美元计价的风险资产将不可避免的受到冲击。该情形下，高收益债将面临较大压力，投资级债券尽管利差将走阔，但也会受益于美国国债利率的下行，因此会净价相对稳定。

汇率方面，人民币在未来一段时间将主要被贸易谈判进程左右。在谈判期间，相信多空双方都会相对克制，在美元没有剧烈变化的情况下，人民币将围绕 6.9 展开区间震荡。若谈判顺利，双方取消关税，则人民币大概率将对美元大幅升值；反之，若双方继续加税，则人民币很可能难以守住整数关口。

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

截止本报告期末，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

本报告期内，本基金托管人在对融通中国概念债券型证券投资基金（QDII）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，融通中国概念债券型证券投资基金（QDII）的管理人——融通基金管理有限公司在融通中国概念债券型证券投资基金（QDII）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。

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

本托管人依法对融通基金管理有限公司编制和披露的融通中国概念债券型证券投资基金（QDII）2019 年半年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告 (未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体: 融通中国概念债券型证券投资基金 (QDII)

报告截止日: 2019 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

资产	附注号	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	6.4.7.1	2,057,026.21	827,427.14
结算备付金		505,598.80	13,821.32
存出保证金		2,224.61	8,570.38
交易性金融资产	6.4.7.2	31,641,612.84	17,058,070.10
其中: 股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		31,641,612.84	17,058,070.10
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	419,591.55
应收利息	6.4.7.5	460,150.87	202,795.03
应收股利		-	-
应收申购款		294,401.65	109,112.52
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		34,961,014.98	18,639,388.04
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
负债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		591,067.59	45,687.76
应付管理人报酬		27,512.20	21,158.53
应付托管费		6,878.05	5,289.66
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	-	-
应交税费		3,853.42	1,926.46
应付利息		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	19,835.79	50,000.00
负债合计		649,147.05	124,062.41
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	29,410,468.97	16,842,953.74
未分配利润	6.4.7.10	4,901,398.96	1,672,371.89
所有者权益合计		34,311,867.93	18,515,325.63
负债和所有者权益总计		34,961,014.98	18,639,388.04

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.1667 元，基金份额总额 29,410,468.97 份。

6.2 利润表

会计主体：融通中国概念债券型证券投资基金 (QDII)

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	附注号	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		1,570,562.98	1,049,330.17
1. 利息收入		640,323.01	523,744.06
其中：存款利息收入	6.4.7.11	14,079.91	24,675.35
债券利息收入		626,243.10	333,742.17
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	165,326.54
其他利息收入		-	-
2. 投资收益		141,313.21	95,704.25
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-	-
基金投资收益	6.4.7.13	-	-
债券投资收益	6.4.7.14	699,146.61	95,704.25
资产支持证券投资收益	6.4.7.14.1	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-557,833.40	-
股利收益	6.4.7.17	-	-
3. 公允价值变动收益	6.4.7.18	782,755.68	341,961.49
4. 汇兑收益		-35,074.97	11,148.16
5. 其他收入	6.4.7.19	41,246.05	76,772.21
减：二、费用		198,126.30	238,608.16
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	132,321.27	145,386.06
2. 托管费	6.4.10.2.2	33,080.30	36,346.56
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.20	4,786.08	598.99

5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		2,319.03	417.36
7. 其他费用	6.4.7.21	25,619.62	55,859.19
三、利润总额		1,372,436.68	810,722.01
减：所得税费用		-	-
四、净利润		1,372,436.68	810,722.01

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：融通中国概念债券型证券投资基金 (QDII)

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)	16,842,953.74	1,672,371.89	18,515,325.63
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	1,372,436.68	1,372,436.68
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	12,567,515.23	1,856,590.39	14,424,105.62
其中：1. 基金申购款	46,749,632.52	6,793,160.63	53,542,793.15
2. 基金赎回款	-34,182,117.29	-4,936,570.24	-39,118,687.53
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)	29,410,468.97	4,901,398.96	34,311,867.93
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)	37,046,012.22	292,920.74	37,338,932.96
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	810,722.01	810,722.01
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-19,190,631.25	-241,327.31	-19,431,958.56
其中：1. 基金申购款	55,269,966.32	1,016,509.04	56,286,475.36
2. 基金赎回款	-74,460,597.57	-1,257,836.35	-75,718,433.92
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)	17,855,380.97	862,315.44	18,717,696.41

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：

<u>张帆</u>	<u>颜锡廉</u>	<u>刘美丽</u>
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

融通中国概念债券型证券投资基金(QDII)(以下简称“本基金”)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[2017]1271号《关于准予融通中国概念债券型证券投资基金(QDII)注册的批复》核准,由融通基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《融通中国概念债券型证券投资基金(QDII)基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币234,719,075.87元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2017)第1037号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《融通中国概念债券型证券投资基金(QDII)基金合同》于2017年11月27日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为234,831,176.95份基金份额,其中认购资金利息折合112,101.08份基金份额。本基金的基金管理人为融通基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司,境外资产托管人为摩根大通银行(JPMorgan Chase Bank, National Association)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《融通中国概念债券型证券投资基金(QDII)基金合同》的有关规定,本基金主要投资于全球证券市场中具有良好流动性的金融工具,包括已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券市场挂牌交易的普通股、优先股、全球存托凭证和美国存托凭证、房地产信托凭证;银行存款、可转让存单、商业票据、回购协议、短期政府债券等货币市场工具;政府债券、公司债券、可转换债券、住房按揭支持证券、资产支持证券等及经中国证监会认可的国际金融组织发行的证券;在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的公募基金(包括ETF);与固定收益、股权、信用、商品指数、基金等标的物挂钩的结构性投资产品;远期合约、互换及在经中国证监会认可的境外交易所上市交易的权证、期权、期货等金融衍生产品及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他境外金融工具。本基金投资组合中,投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%,投资于“中国概念”债券资产的比例不低于非现金基金资产的80%;股票、权证等资产比例不超过基金资产的20%。每个交易日日终在扣除金融衍生品需缴纳的交易保证金后,保持现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准为:富时中国美元债券指数(FTSE Asian Broad Bond Index (ABBI) China Issuers Index in LCL terms,原花旗中国美元债券指数(Citi Asian Broad Bond Index (ABBI)

China Issuers Index in LCL terms)) 收益率。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《融通中国概念债券型证券投资基金(QDII)基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2019 年半年度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 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金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、会计估计与最近一期年度报告一致。

6.4.5 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。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《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》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《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》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关境内外财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品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，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以

产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从境内证券市场中取得的收入, 包括买卖债券的差价收入, 债券的利息收入及其他收入, 暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的源自于境内的企业债券利息收入, 应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。

(4) 目前基金取得的源自境外的差价收入, 其涉及的境外所得税税收政策, 按照相关国家或地区税收法律和法规执行, 在境内暂不征收企业所得税。

(5) 目前基金取得的源自境外的股利收益, 其涉及的境外所得税税收政策, 按照相关国家或地区税收法律和法规执行, 在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。

(6) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位: 人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
活期存款	2,057,026.21
定期存款	-
其中: 存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
合计	2,057,026.21

6.4.7.2 交易性金融资产

单位: 人民币元

项目	本期末 2019年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	12,069,199.48	12,092,097.20
	银行间市场	-	-
	OTC市场	18,787,633.62	19,549,515.64
	合计	30,856,833.10	31,641,612.84
资产支持证券	-	-	-

基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	30,856,833.10	31,641,612.84	784,779.74

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

无。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应收活期存款利息	943.96
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	2.20
应收债券利息	459,203.71
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	1.00
合计	460,150.87

6.4.7.6 其他资产

无。

6.4.7.7 应付交易费用

无。

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	19,835.79
合计	19,835.79

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2019年1月1日至2019年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	16,842,953.74	16,842,953.74
本期申购	46,749,632.52	46,749,632.52
本期赎回	-34,182,117.29	-34,182,117.29
本期末	29,410,468.97	29,410,468.97

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,666,280.45	6,091.44	1,672,371.89
本期利润	589,681.00	782,755.68	1,372,436.68
本期基金份额交易产生的变动数	1,641,487.43	215,102.96	1,856,590.39
其中：基金申购款	5,417,668.13	1,375,492.50	6,793,160.63
基金赎回款	-3,776,180.70	-1,160,389.54	-4,936,570.24
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,897,448.88	1,003,950.08	4,901,398.96

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2019年1月1日至2019年6月30日
活期存款利息收入	11,102.91
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	89.82
其他	2,887.18
合计	14,079.91

6.4.7.12 股票投资收益

无。

6.4.7.13 基金投资收益

无。

6.4.7.14 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2019年1月1日至2019年6月30日
卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成交总额	43,414,023.93
减：卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成本总额	42,015,464.47

减：应收利息总额	699,412.85
买卖债券差价收入	699,146.61

6.4.7.14.1 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.15 贵金属投资收益

无。

6.4.7.16 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2019年1月1日至2019年6月30日
外汇期货投资收益	-557,833.40

6.4.7.17 股利收益

无。

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
1. 交易性金融资产	782,755.68
股票投资	-
债券投资	782,755.68
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	782,755.68

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
基金赎回费收入	38,552.65
其他	2,693.40
合计	41,246.05

6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2019年1月1日至2019年6月30日
交易所市场交易费用	4,786.08
银行间市场交易费用	-
合计	4,786.08

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2019年1月1日至2019年6月30日
审计费用	19,835.79
信息披露费	-
银行费用	5,783.83
合计	25,619.62

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 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。

6.4.9.2 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
摩根大通银行	境外资产托管人

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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬**6.4.10.2.1 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	132,321.27	145,386.06
其中：支付销售机构的客户维护费	38,152.83	111,263.01

注：1、支付基金管理人融通基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.00% 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 × 1.00% / 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。

6.4.10.2.2 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	33,080.30	36,346.56

注：支付基金托管人中国建设银行的基金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：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况**6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

无。

6.4.10.4.2 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。

6.4.10.5 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	2,029,425.94	7,048.33	264,205.00	13,762.88
摩根大通银行	27,600.27	4,054.58	320,170.46	594.32

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行和境外资产托管人摩根大通银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

无。

6.4.12 期末(2019年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是债券型基金，其长期平均预期风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。本基金可投资于境外证券，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。

本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过管理及信息系统持续监控上述各类风险。本基金主要投资于具有中国概念的债券资产，在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金资产的长期稳健增值。本基金的基金管理人奉行内控优先和全员风险管理理念，高度重视风险管理的组织保障和制度保障，建立了完备的风险管理组织及相应的制度和流程，力争在风险最小化的前提下，确保基金份额持有人利益最大化。

董事会对有效的风险管理承担最终责任，负责确定公司风险管理总体目标，制定公司风险管理战略和风险应对策略；审议重大事件、重大决策的风险评估意见，审批重大风险的解决方案，批准公司基本风险管理制度；审议公司风险管理报告。在董事会下设立风险控制与审计委员会，履行相应风险管理和监督职责。

公司管理层对有效的风险管理承担直接责任，根据董事会的风险管理战略，制定与公司发展战略、整体风险承受能力相匹配的风险管理制度，并确保风险管理制度得以全面、有效执行。在公司管理层下设立风险管理委员会，负责指导、协调和监督各职能部门和个业务单元开展风险管理工作；制定相关风险控制政策，审批风险管理重要流程和风险限额，并与公司整体业务发展战略和风险承受能力相一致；识别公司各项业务所涉及各类重大风险，对重大风险、重大决策和重要业务流程的风险进行评估，制定重大风险的解决方案；识别和评估新产品、新业务的新增风险，并制定控制措施；重点关注内控机制薄弱环节和那些可能给公司带来重大损失的事件，提出控制措施和解决方案；协调突发性重大风险事件的处理；审定风险事件责任人的责任；根据公司风险管理总体策略和各职能部门与业务单元职责分工，组织实施风险应对方案。

各业务部门在执行业务事项时需遵守相关法律法规，遵守公司业务管理制度，执行风险管理的基本制度流程，定期对本部门的风险进行评估，对其风险管理制度和流程的有效性负责。公司所有员工是本岗位风险管理的直接责任人，各业务部门负责人是其部门风险管理的第一责任人，基金经理是相应投资组合风险管理的第一责任人。

风险管理部对公司风险管理承担独立评估、监控、检查和报告职责，负责执行公司的风险管

理战略和决策，拟定公司风险管理制度，并协同各业务部门制定风险管理流程、评估指标；对风险进行定性和定量评估，改进风险管理方法、技术和模型，组织推动建立、持续优化风险管理信息系统；对新产品、新业务进行独立监测和评估，提出风险防范和控制建议；负责督促相关部门落实风险管理委员会的各项决策和风险管理制度，并对风险管理决策和风险管理制度执行情况进行检查、评估和报告。

监察稽核部负责监察公司各业务部门在相关法律法规、规章制度和业务流程执行方面的情况，确保既定的风险管理措施得到有效的贯彻执行，发现内控缺失和管理漏洞，提出改进要求和建议，并报告法规和制度的执行情况。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国建设银行以及境外次托管人摩根大通银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，违约风险发生的可能性很小；在场外交易市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》以及债券评级机构标准普尔、穆迪、惠誉公司设定的标准统计及汇总。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	8,380,160.78	2,741,697.41
合计	8,380,160.78	2,741,697.41

注：未评级部分为美元债。债券信用评级取自第三方评级机构的评级。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末	上年度末
--------	-----	------

	2019 年 6 月 30 日	2018 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	15,454,174.35	7,923,756.56
未评级	7,807,277.71	6,392,616.13
合计	23,261,452.06	14,316,372.69

注：未评级部分为国债和美元债。债券信用评级取自第三方评级机构的评级。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于 2019 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制)，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场或 OTC 市场交易，部分

基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2019 年 6 月 30 日，本基金持有的流动性受限资产的估值未超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。截止 2019 年 6 月 30 日，本基金最后交易日的组合资产中 7 个工作日可变现资产账面金额与净赎回金额符合上述法规要求。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金主要投资于交易所、银行间及 OTC 市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

资产					
银行存款	2,057,026.21	-	-	-	2,057,026.21
结算备付金	505,598.80	-	-	-	505,598.80
存出保证金	2,224.61	-	-	-	2,224.61
交易性金融资产	9,731,658.05	8,189,541.36	13,720,413.43	-	31,641,612.84
应收利息	-	-	-	460,150.87	460,150.87
应收申购款	-	-	-	294,401.65	294,401.65
资产总计	12,296,507.67	8,189,541.36	13,720,413.43	754,552.52	34,961,014.98
负债					
应付赎回款	-	-	-	591,067.59	591,067.59
应付管理人报酬	-	-	-	27,512.20	27,512.20
应付托管费	-	-	-	6,878.05	6,878.05
应交税费	-	-	-	3,853.42	3,853.42
其他负债	-	-	-	19,835.79	19,835.79
负债总计	-	-	-	649,147.05	649,147.05
利率敏感度缺口	12,296,507.67	8,189,541.36	13,720,413.43	105,405.47	34,311,867.93
上年度末 2018 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	827,427.14	-	-	-	827,427.14
结算备付金	13,821.32	-	-	-	13,821.32
存出保证金	8,570.38	-	-	-	8,570.38
交易性金融资产	4,117,865.09	8,215,931.49	4,724,273.52	-	17,058,070.10
应收证券清算款	-	-	-	419,591.55	419,591.55
应收利息	-	-	-	202,795.03	202,795.03
应收申购款	-	-	-	109,112.52	109,112.52
资产总计	4,967,683.93	8,215,931.49	4,724,273.52	731,499.10	18,639,388.04
负债					
应付赎回款	-	-	-	45,687.76	45,687.76
应付管理人报酬	-	-	-	21,158.53	21,158.53
应付托管费	-	-	-	5,289.66	5,289.66
应交税费	-	-	-	1,926.46	1,926.46
其他负债	-	-	-	50,000.00	50,000.00
负债总计	-	-	-	124,062.41	124,062.41
利率敏感度缺口	4,967,683.93	8,215,931.49	4,724,273.52	607,436.69	18,515,325.63

注:表中所示为本基金资产及负债的账面价值,并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位:人民币元)

	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
1. 市场利率下降 25 个基点	364,891.84	211,453.61
2. 市场利率上升 25 个基点	-359,479.31	-207,052.63

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以不记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
银行存款	27,628.39	-	-	27,628.39
结算备付金	281,554.44	-	-	281,554.44
交易性金融资产	19,549,515.64	-	-	19,549,515.64
应收利息	279,279.89	-	-	279,279.89
资产合计	20,137,978.36	-	-	20,137,978.36
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	20,137,978.36	-	-	20,137,978.36
项目	上年度末 2018 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
银行存款	236,236.01	-	-	236,236.01
交易性金融资产	11,681,482.10	-	-	11,681,482.10
应收利息	139,639.36	-	-	139,639.36
应收证券清算款	58,337.20	-	-	58,337.20
资产合计	12,115,694.67	-	-	12,115,694.67
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	12,115,694.67	-	-	12,115,694.67

6.4.13.4.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额 (单位: 人民币元)	
		本期末 (2019 年 6 月 30 日)	上年度末 (2018 年 12 月 31 日)
	所有外币相对于人民币贬值 5%	-1,006,898.92	-605,784.73
	所有外币相对于人民币升值 5%	1,006,898.92	605,784.73

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场或 OTC 市场交易的固定收益品种, 因此无重大其他价格风险。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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	-	-
	其中: 普通股	-	-
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	31,641,612.84	90.51
	其中: 债券	31,641,612.84	90.51
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中: 远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中: 买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	2,562,625.01	7.33

8	其他各项资产	756,777.13	2.16
9	合计	34,961,014.98	100.00

7.2 期末按行业分类的权益投资组合

本基金本报告期末未持有权益资产。

7.3 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

债券信用等级	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
A1	4,497,552.49	13.11
Baa1	1,384,138.35	4.03
Ba1	1,336,799.16	3.90
BBB+	1,335,960.45	3.89
BBB	2,766,599.27	8.06
BBB-	1,351,566.02	3.94
BB-	1,430,061.34	4.17
B	1,351,497.27	3.94
未评级	16,187,438.49	47.18

注：本债券投资组合主要采用标准普尔、穆迪、惠誉等机构提供的债券信用评级信息，未评级部分为标准普尔、穆迪、惠誉未评级债券。

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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	019611	19 国债 01	7,000,000	6,994,400.00	20.38
2	019547	16 国债 19	3,792,000	3,475,747.20	10.13
3	018009	国开 1803	1,500,000	1,621,950.00	4.73
4	USG8450LAP97	CHGRID 4 1/4 05/02/28	1,374,940	1,507,002.99	4.39
5	XS1874715169	SOPOWZ 4 1/4 09/18/28	1,374,940	1,501,654.47	4.38

注：1、债券代码为 ISIN 码。

2、数量列示债券面值，外币按照期末估值汇率折为人民币，四舍五入保留整数。

7.5 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

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基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

7.8 投资组合报告附注

7.8.1 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。

7.8.2 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	2,224.61
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	460,150.87
5	应收申购款	294,401.65
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	756,777.13

7.8.3 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。

7.8.4 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

§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
2,035	14,452.32	0.00	0.00%	29,410,468.97	100.00%

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	3,118.43	0.0106%

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（2017 年 11 月 27 日）基金份额总额	234,831,176.95
本报告期期初基金份额总额	16,842,953.74
本报告期基金总申购份额	46,749,632.52
减：本报告期基金总赎回份额	34,182,117.29
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	29,410,468.97

§ 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，本基金的基金管理人无重大人事变动。

10.2.2 基金托管人的专门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），该事务所自基金合同生效日起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	
BARCLAYS	1	-	-	-	-	-
BOCHK	1	-	-	-	-	-
BOCI	1	-	-	-	-	-
CEBI	1	-	-	-	-	-
CICC	1	-	-	-	-	-
CITI	1	-	-	-	-	-
CITIC	1	-	-	-	-	-
CITIC BANK	1	-	-	-	-	-
Goldman Sachs	1	-	-	-	-	-
HAITONG INTERNATIONAL SECURITIES	1	-	-	-	-	-
ICBCI	1	-	-	-	-	-
JPMorgan	1	-	-	-	-	-
Morganstanley	1	-	-	-	-	-
NOMURA	1	-	-	-	-	-
SCB	1	-	-	-	-	-
SPDBI	1	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
东北证券	3	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
国泰君安(香港)	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
恒泰证券	2	-	-	-	-	-
华宝证券	2	-	-	-	-	-

华创证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
华信证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
瑞信方正	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
西藏东方财富	1	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-

注:1、针对境外投资业务涉及多个海外证券市场金融产品的投资特点，在对券商的选择上，着重考察以下因素：

- (1) 在全球范围内研究的综合实力；
- (2) 在单个国家（地区）证券市场的特色研究力量；
- (3) 在全球主要证券交易市场进行交易的便捷性和高效性。

2、券商选择的流程如下：

(1) 针对券商等级评分，由国际业务部提出券商候选名单，风险管理部进行尽职调查，并提出评估报告；

(2) 组合经理和交易员根据券商研究服务品质、交易执行能力等因素，定期对往来下单券商进行综合评分；

(3) 评分记录归档并送国际业务部备案。

3、交易单元变更情况

本报告期本基金交易单元均为本基金合同生效时新增。

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
BARCLAYS	2,702,472.36	2.78%	-	-	-	-	-	-
BOCHK	-	-	-	-	-	-	-	-
BOCI	2,761,059.84	2.84%	-	-	-	-	-	-
CEBI	-	-	-	-	-	-	-	-
CICC	17,009,803.13	17.50%	-	-	-	-	-	-
CITI	-	-	-	-	-	-	-	-
CITIC	6,566,454.45	6.76%	-	-	-	-	-	-
CITIC BANK	-	-	-	-	-	-	-	-
Goldman Sachs	10,911,383.28	11.23%	-	-	-	-	-	-
HAITONG INTERNATIONAL SECURITIES	4,005,415.29	4.12%	-	-	-	-	-	-
ICBCI	-	-	-	-	-	-	-	-
JPMorgan	8,188,301.27	8.43%	-	-	-	-	-	-
Morganstanley	5,602,244.38	5.76%	-	-	-	-	-	-
NOMURA	5,436,424.68	5.59%	-	-	-	-	-	-
SCB	-	-	-	-	-	-	-	-
SPDBI	-	-	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
财达证券	24,410,192.50	25.12%	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-

国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安(香港)	9,596,411.44	9.87%	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
瑞信方正	-	-	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西藏东方财富	-	-	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	融通基金管理有限公司关于旗下基金所持有的停牌股票估值方法调整的公告	上海证券报、管理人网站	2019-01-03
2	融通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增南京苏宁基金销售有限公司为销售机构及参加其费率优惠活动的公告	上海证券报、管理人网站	2019-01-26
3	融通关于旗下部分开放式基金新增上海凯石财富基金销售有限公司为销售机构及参加其费率	上海证券报、管理人网站	2019-01-30

	优惠活动的公告		
4	融通基金管理有限公司关于旗下基金所持有的停牌股票估值方法调整的公告	上海证券报、管理人网站	2019-02-26
5	融通关于旗下部分开放式基金分别参与上海陆金所基金销售有限公司、诺亚正行基金销售有限公司前端申购费率优惠活动的公告	上海证券报、管理人网站	2019-02-28
6	融通关于旗下部分开放式基金新增江苏汇林保大基金销售有限公司为销售机构的公告	上海证券报、管理人网站	2019-03-25
7	融通关于旗下部分开放式基金新增上海基煜基金销售有限公司为销售机构及参加其费率优惠活动的公告	上海证券报、管理人网站	2019-03-25
8	融通关于旗下部分开放式基金参加中国银行股份有限公司申购费率优惠活动的公告	上海证券报、管理人网站	2019-03-26
9	关于融通基金管理有限公司旗下部分开放式基金参加交通银行股份有限公司申购及定期定额投资业务费率优惠活动的公告	上海证券报、管理人网站	2019-03-30
10	融通基金管理有限公司关于新增东海证券股份有限公司为销售机构并开通定期定额投资业务、转换业务及参加其申购费率优惠活动的公告	上海证券报、管理人网站	2019-04-08
11	融通基金管理有限公司关于旗下基金所持有的停牌股票估值方法调整的公告	上海证券报、管理人网站	2019-04-08
12	融通关于旗下部分开放式基金参加上海长量基金销售有限公司申购费率优惠活动的公告	上海证券报、管理人网站	2019-04-26
13	融通基金管理有限公司关于公司旗下基金持有的停牌股票估值方法调整的公告	上海证券报、管理人网站	2019-05-07
14	融通关于旗下部分开放式基金参加方德保险代理有限公司申购费率优惠活动的公告	上海证券报、管理人网站	2019-05-15
15	融通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增阳光人寿保险股份有限公司为销售机构的公告	上海证券报、管理人网站	2019-05-15
16	融通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增民商基金销售(上海)有限公司为销售机构及参加其费率优惠活动的公告	上海证券报、管理人网站	2019-05-17
17	融通基金管理有限公司关于旗下基金所持有的停牌股票估值方法调整的公告	上海证券报、管理人网站	2019-06-26
18	融通关于旗下部分开放式基金参加中国银行股份有限公司定期定额申购费率优惠活动的公告	上海证券报、管理人网站	2019-06-28
19	融通基金管理有限公司关于公司旗下基金所持有的股票估值方法调整的公告	上海证券报、管理人网站	2019-07-05

§ 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	20190329-20190612	0.00	15,767,849.32	15,767,849.32	0.00	0.00
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。							

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会批准融通中国概念债券型证券投资基金（QDII）设立的文件
- (二) 《融通中国概念债券型证券投资基金（QDII）基金合同》
- (三) 《融通中国概念债券型证券投资基金（QDII）托管协议》
- (四) 《融通中国概念债券型证券投资基金（QDII）招募说明书》及其更新
- (五) 融通基金管理有限公司业务资格批件和营业执照
- (六) 报告期内在指定报刊上披露的各项公告

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

12.3 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> 查阅。

融通基金管理有限公司

2019 年 8 月 24 日