

融通通泰保本混合型证券投资基金

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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据融通通泰保本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 23 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

|   |           |
|---|-----------|
| <b>§ 1 重要提示及目录</b> .....                      | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示 .....                                | 2         |
| 1.2 目录 .....                                  | 3         |
| <b>§ 2 基金简介</b> .....                         | <b>5</b>  |
| 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 信息披露方式 .....                              | 6         |
| 2.5 其他相关资料 .....                              | 6         |
| <b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....                | <b>6</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标 .....                         | 6         |
| 3.2 基金净值表现 .....                              | 7         |
| <b>§ 4 管理人报告</b> .....                        | <b>9</b>  |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况 .....                        | 9         |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....              | 11        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....                 | 11        |
| 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 .....             | 12        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....             | 12        |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....                | 12        |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....                 | 13        |
| 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 .....       | 13        |
| <b>§ 5 托管人报告</b> .....                        | <b>13</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....                  | 13        |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 ..... | 13        |
| 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 .....     | 13        |
| <b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....              | <b>14</b> |
| 6.1 资产负债表 .....                               | 14        |
| 6.2 利润表 .....                                 | 15        |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表 .....                      | 16        |
| 6.4 报表附注 .....                                | 17        |
| <b>§ 7 投资组合报告</b> .....                       | <b>35</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况 .....                          | 35        |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....                    | 36        |
| 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 .....       | 36        |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....                     | 39        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....                    | 40        |
| 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 .....      | 40        |
| 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....   | 40        |
| 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 .....   | 41        |

|  |           |
|--|-----------|
| 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 ..... | 41        |
| 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....          | 41        |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....          | 41        |
| 7.12 投资组合报告附注 .....                      | 41        |
| <b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>               | <b>42</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....              | 42        |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....           | 42        |
| 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 .....   | 42        |
| <b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>               | <b>42</b> |
| <b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>                 | <b>43</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 .....                   | 43        |
| 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 .....   | 43        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....        | 43        |
| 10.4 基金投资策略的改变 .....                     | 43        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....              | 43        |
| 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 .....      | 43        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....             | 43        |
| 10.8 其他重大事件 .....                        | 46        |
| <b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>         | <b>47</b> |
| 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 ..... | 47        |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....                | 47        |
| <b>§ 12 备查文件目录 .....</b>                 | <b>48</b> |
| 12.1 备查文件目录 .....                        | 48        |
| 12.2 存放地点 .....                          | 48        |
| 12.3 查阅方式 .....                          | 48        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                  |                |
|-----------------|------------------|----------------|
| 基金名称            | 融通通泰保本混合型证券投资基金  |                |
| 基金简称            | 融通通泰保本           |                |
| 基金主代码           | 000142           |                |
| 基金运作方式          | 契约型开放式           |                |
| 基金合同生效日         | 2013 年 5 月 30 日  |                |
| 基金管理人           | 融通基金管理有限公司       |                |
| 基金托管人           | 中国工商银行股份有限公司     |                |
| 报告期末基金份额总额      | 968,299,907.25 份 |                |
| 基金合同存续期         | 不定期              |                |
| 下属分级基金的基金简称     | 融通通泰保本混合 A       | 融通通泰保本混合 C     |
| 下属分级基金的交易代码     | 000142           | 001124         |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 964,196,793.40 份 | 4,103,113.85 份 |

注:本基金的第一个保本周期自 2013 年 5 月 30 日至 2016 年 5 月 30 日止, 本基金第一个保本周期到期操作期间自 2016 年 5 月 30 日(含)至 2016 年 6 月 6 日(含)。第一个保本周期到期日和第二个保本周期开始日之间设置过渡期, 过渡期自 2016 年 6 月 7 日至 2016 年 7 月 6 日, 过渡期最后一个工作日即 2016 年 7 月 6 日为基金份额折算日, 本基金第二个保本周期起始日为 2016 年 7 月 7 日, 保本周期到期日为保本周期起始日 3 个公历年后对应日, 即 2019 年 7 月 7 日(若该日为非工作日, 则顺延至下一个工作日)。重庆进出口信用担保有限公司担任本基金的第二个保本周期的担保人。

### 2.2 基金产品说明

|        |  |
|--------|--|
| 投资目标   | 通过运用组合保险策略, 在为符合保本条件的投资金额提供保本保障的基础上, 追求基金资产的长期增值。  |
| 投资策略   | 本基金采用时间不变性投资组合保险策略(TIPP, Time Invariant Portfolio Protection)和基于期权的组合保险策略(OBPI, Option-Based Portfolio Insurance)相结合的投资策略, 通过量化技术动态调整资产配置比例, 以达到保证本金安全的基本目标。 |
| 业绩比较基准 | 三年期银行定期存款税后收益率   |
| 风险收益特征 | 本基金属保本混合型基金, 在证券投资基金中属于低风险品种。  |

### 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 | 中国工商银行股份有限公司 |

|             |      |                              |                      |
|-------------|------|------------------------------|----------------------|
| 信息披露<br>负责人 | 姓名   | 涂卫东                          | 郭明                   |
|             | 联系电话 | (0755) 26948666              | (010) 66105799       |
|             | 电子邮箱 | service@mail.rtfund.com      | custody@icbc.com.cn  |
| 客户服务电话      |      | 400-883-8088、(0755) 26948088 | 95588                |
| 传真          |      | (0755) 26935005              | (010) 66105798       |
| 注册地址        |      | 深圳市南山区华侨城汉唐大厦<br>13、14 层     | 北京市西城区复兴门内大街 55<br>号 |
| 办公地址        |      | 深圳市南山区华侨城汉唐大厦<br>13、14 层     | 北京市西城区复兴门内大街 55<br>号 |
| 邮政编码        |      | 518053                       | 100140               |
| 法定代表人       |      | 高峰                           | 陈四清                  |

## 2.4 信息披露方式

|                      |                       |
|----------------------|-----------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称       | 证券时报                  |
| 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         |

## 2.5 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         |
| 基金保证人  | 重庆进出口信用担保有限公司 | 重庆市北部新区黄山大道中段 68 号山顶总部基地 11 栋 |

## § 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) |              |
|---------------|-------------------------------------|--------------|
|               | 融通通泰保本混合 A                          | 融通通泰保本混合 C   |
| 本期已实现收益       | 14,139,359.78                       | 44,578.00    |
| 本期利润          | 26,806,857.25                       | 95,210.55    |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0272                              | 0.0232       |
| 本期加权平均净值利润率   | 2.60%                               | 2.30%        |
| 本期基金份额净值增长率   | 2.72%                               | 2.41%        |
| 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      | 196,706,113.62                      | 707,039.63   |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.2040                              | 0.1723       |
| 期末基金资产净值      | 1,017,709,812.17                    | 4,179,374.55 |
| 期末基金份额净值      | 1.056                               | 1.019        |

|              |                  |       |
|--------------|------------------|-------|
| 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  | 32.45%           | 9.23% |

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

融通通泰保本混合 A

| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③    | ②-④   |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去一个月      | 0.48%    | 0.08%       | 0.23%      | 0.00%         | 0.25%  | 0.08% |
| 过去三个月      | 0.48%    | 0.10%       | 0.69%      | 0.00%         | -0.21% | 0.10% |
| 过去六个月      | 2.72%    | 0.10%       | 1.36%      | 0.00%         | 1.36%  | 0.10% |
| 过去一年       | 1.83%    | 0.15%       | 2.75%      | 0.00%         | -0.92% | 0.15% |
| 过去三年       | 5.70%    | 0.13%       | 8.24%      | 0.00%         | -2.54% | 0.13% |
| 自基金合同生效起至今 | 32.45%   | 0.15%       | 19.72%     | 0.00%         | 12.73% | 0.15% |

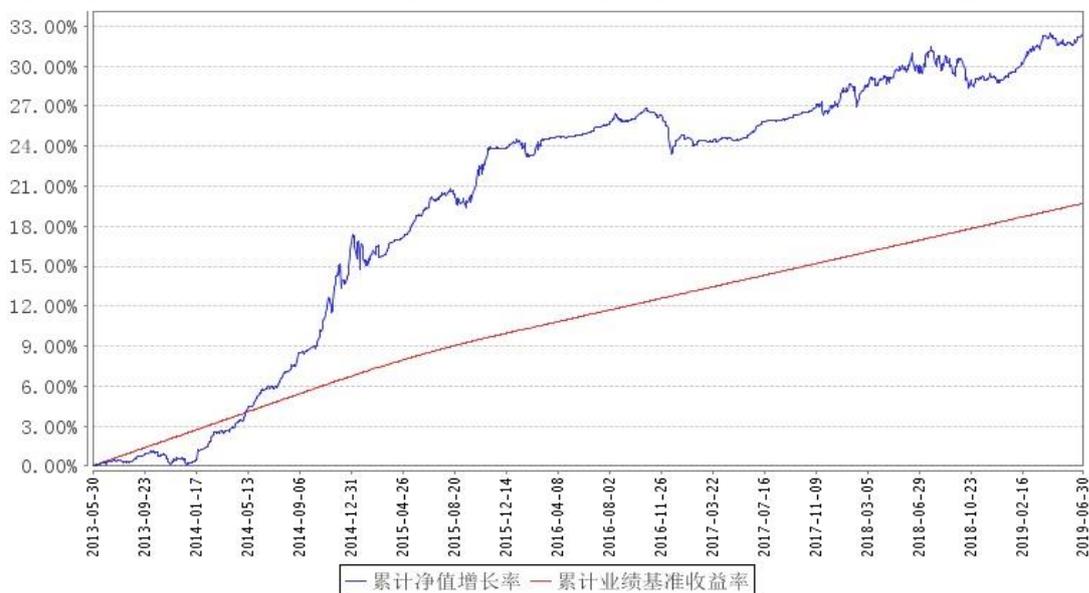
融通通泰保本混合 C

| 阶段    | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③    | ②-④   |
|-------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去一个月 | 0.39%    | 0.08%       | 0.23%      | 0.00%         | 0.16%  | 0.08% |
| 过去三个月 | 0.30%    | 0.10%       | 0.69%      | 0.00%         | -0.39% | 0.10% |
| 过去六个月 | 2.41%    | 0.10%       | 1.36%      | 0.00%         | 1.05%  | 0.10% |
| 过去一年  | 1.19%    | 0.15%       | 2.75%      | 0.00%         | -1.56% | 0.15% |
| 过去三年  | 2.00%    | 0.14%       | 8.24%      | 0.00%         | -6.24% | 0.14% |

|              |       |       |        |       |        |       |
|--------------|-------|-------|--------|-------|--------|-------|
| 2015年3月5日起至今 | 9.23% | 0.14% | 12.29% | 0.00% | -3.06% | 0.14% |
|--------------|-------|-------|--------|-------|--------|-------|

### 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

融通通泰保本混合A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



融通通泰保本混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金于 2015 年 3 月 5 日增加 C 类份额，本基金 C 类份额的统计区间为 2015 年 3 月 5 日至本报告期末。

## § 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 |        |   |
| 余志勇 | 本基金的基金经理、研究部总监 | 2015 年 3 月 17 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。 |

|    |                  |                 |   |    |   |
|----|------------------|-----------------|---|----|---|
| 王超 | 本基金的基金经理、固定收益部总监 | 2016 年 5 月 13 日 | - | 11 | 王超先生，厦门大学金融工程硕士，11 年证券投资从业经历，具有基金从业资格。2007 年 7 月至 2012 年 8 月就职于平安银行金融市场产品部从事债券投资研究工作。2012 年 8 月加入融通基金管理有限公司，历任投资经理、融通汇财宝货币市场基金基金经理、融通通源短融债券型证券投资基金基金经理、融通通瑞债券型证券投资基金基金经理、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、融通现金宝货币市场基金基金经理、融通稳利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，现任固定收益部总监、融通债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、融通岁岁添利定期开放债券型证券投资基金基金经理、融通增鑫债券型证券投资基金基金经理、融通增益债券型证券投资基金基金经理、融通通泰保本混合型证券投资基金基金经理、融通汇财宝货币市场基金基金经理、融通易支付货币市场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、融通通优债券型证券投资基金基金经理、融通超短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

2019 年上半年, 债券市场维持区间震荡的走势。1 月份市场延续了去年年末的牛市情绪, 收益率快速下降, 随后受社融大幅提升及经济数据转暖的影响, 债券持续调整, 3 月份发布的 2 月份社融腰斩, 且股市在此期间维持震荡走势, 环境有利于债市, 债券市场小幅上涨。4 月份发布的 3 月份社融及经济数据表现强劲, 债券市场受此影响大幅下跌。随后随着国内高频数据走弱、外围市场风险偏好下降及美国对中国对美出口的 2000 亿商品关税税率提升至 25%, 投资者对经济走势心存忧虑, 债券市场在此期间转而上涨。5 月下旬市场受“包商银行托管”事件冲击, 投资者开始关注银行间市场回购业务的风险, 各类型投资者的融资成本出现分化, 结构性的资金紧张局面出现, 带动债券市场下跌; 随后监管方面对市场进行了指导, 央行在公开市场上投放了资金, 市场信心提振, 债市重回上涨。

在上半年, 债券组合久期逐渐下降; 权益组合仓位稳定, 结构随市场变化而调整。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末融通通泰保本混合 A 基金份额净值为 1.056 元, 本报告期基金份额净值增长率为 2.72%; 截至本报告期末融通通泰保本混合 C 基金份额净值为 1.019 元, 本报告期基金份额净值增长率为 2.41%; 同期业绩比较基准收益率为 1.36%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市, 我们认为债券市场目前对经济不利方面的信息反应较多。截至 5 月份社融同比依然保持了非常高的增长, 由于滞后效应存在, 短期内并未立即体现在经济数据上。在大的去杠杆背景下, 央行的最优策略将是保持货币松紧适度, 既不能太松也不可太紧, 在目前的利率水平上社融已然能得到有效修复, 预计银行间货币市场最宽松的时点已过, 预计债券市场将延续上半年的走势, 继续维持区间震荡的态势。我们将持续跟踪研判市场走势, 灵活调整组合的杠杆和久期, 努力提升组合收益。

#### 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、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泰保本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，融通通泰保本混合型证券投资基金的管理人——融通基金管理有限公司在融通通泰保本混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，融通通泰保本混合型证券投资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通泰保本混合型证券投资基金 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：融通通泰保本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              | 附注号        | 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            | 6.4.7.1    | 4,408,716.57                   | 3,683,763.58                     |
| 结算备付金           |            | 44,281.45                      | 291,336.73                       |
| 存出保证金           |            | 16,056.34                      | 36,054.29                        |
| 交易性金融资产         | 6.4.7.2    | 317,851,376.77                 | 1,401,970,741.30                 |
| 其中：股票投资         |            | 48,300,426.90                  | 55,948,818.28                    |
| 基金投资            |            | -                              | -                                |
| 债券投资            |            | 269,550,949.87                 | 1,346,021,923.02                 |
| 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    | 694,802,383.20                 | -                                |
| 应收证券清算款         |            | 262,785.56                     | 2,902,932.13                     |
| 应收利息            | 6.4.7.5    | 7,587,793.04                   | 28,345,166.41                    |
| 应收股利            |            | -                              | -                                |
| 应收申购款           |            | -                              | 3.96                             |
| 递延所得税资产         |            | -                              | -                                |
| 其他资产            | 6.4.7.6    | -                              | -                                |
| 资产总计            |            | 1,024,973,392.93               | 1,437,229,998.40                 |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2019 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>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          | 6.4.7.3    | -                              | -                                |
| 卖出回购金融资产款       |            | -                              | 405,393,694.70                   |
| 应付证券清算款         |            | -                              | -                                |
| 应付赎回款           |            | 1,707,219.38                   | 584,318.71                       |
| 应付管理人报酬         |            | 1,012,928.59                   | 1,052,795.11                     |
| 应付托管费           |            | 168,821.43                     | 175,465.86                       |
| 应付销售服务费         |            | 2,054.58                       | 2,083.04                         |
| 应付交易费用          | 6.4.7.7    | 69,486.91                      | 151,540.34                       |
| 应交税费            |            | 3,805.90                       | 5,758.99                         |

|               |          |                  |                  |
|---------------|----------|------------------|------------------|
| 应付利息          |          | -                | 596,239.20       |
| 应付利润          |          | -                | -                |
| 递延所得税负债       |          | -                | -                |
| 其他负债          | 6.4.7.8  | 119,889.42       | 105,335.20       |
| 负债合计          |          | 3,084,206.21     | 408,067,231.15   |
| <b>所有者权益：</b> |          |                  |                  |
| 实收基金          | 6.4.7.9  | 772,005,641.25   | 797,984,323.45   |
| 未分配利润         | 6.4.7.10 | 249,883,545.47   | 231,178,443.80   |
| 所有者权益合计       |          | 1,021,889,186.72 | 1,029,162,767.25 |
| 负债和所有者权益总计    |          | 1,024,973,392.93 | 1,437,229,998.40 |

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额总额为 968,299,907.25 份，其中 A 类基金份额净值为 1.056 元，A 类基金份额为 964,196,793.40 份；C 类基金份额净值为 1.019 元，C 类基金份额为 4,103,113.85 份。

## 6.2 利润表

会计主体：融通通泰保本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          | 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        |            | 36,639,869.77                   | 36,113,746.73                   |
| 1. 利息收入     |            | 19,827,996.76                   | 24,960,735.05                   |
| 其中：存款利息收入   | 6.4.7.11   | 32,061.04                       | 45,637.74                       |
| 债券利息收入      |            | 17,784,858.96                   | 24,473,978.97                   |
| 资产支持证券利息收入  |            | -                               | 17,465.16                       |
| 买入返售金融资产收入  |            | 2,011,076.76                    | 423,653.18                      |
| 其他利息收入      |            | -                               | -                               |
| 2. 投资收益     |            | 4,003,098.64                    | 5,689,228.82                    |
| 其中：股票投资收益   | 6.4.7.12   | 2,905,012.66                    | 5,085,580.16                    |
| 基金投资收益      |            | -                               | -                               |
| 债券投资收益      | 6.4.7.13   | 724,761.70                      | -553,286.24                     |
| 资产支持证券投资收益  |            | -                               | -75.39                          |
| 贵金属投资收益     | 6.4.7.14   | -                               | -                               |
| 衍生工具收益      | 6.4.7.15   | -                               | -                               |
| 股利收益        | 6.4.7.16   | 373,324.28                      | 1,157,010.29                    |
| 3. 公允价值变动收益 | 6.4.7.17   | 12,718,130.02                   | 5,282,522.55                    |
| 4. 汇兑收益     |            | -                               | -                               |
| 5. 其他收入     | 6.4.7.18   | 90,644.35                       | 181,260.31                      |
| 减：二、费用      |            | 9,737,801.97                    | 10,666,466.29                   |
| 1. 管理人报酬    | 6.4.10.2.1 | 6,152,329.28                    | 6,786,659.72                    |
| 2. 托管费      | 6.4.10.2.2 | 1,025,388.20                    | 1,131,109.94                    |

|               |            |               |               |
|---------------|------------|---------------|---------------|
| 3. 销售服务费      | 6.4.10.2.3 | 12,336.05     | 179,469.27    |
| 4. 交易费用       | 6.4.7.19   | 167,805.83    | 372,126.37    |
| 5. 利息支出       |            | 2,235,253.39  | 1,962,786.81  |
| 其中：卖出回购金融资产支出 |            | 2,235,253.39  | 1,962,786.81  |
| 6. 税金及附加      |            | 3,406.24      | 7,528.68      |
| 7. 其他费用       | 6.4.7.20   | 141,282.98    | 226,785.50    |
| 三、利润总额        |            | 26,902,067.80 | 25,447,280.44 |
| 减：所得税费用       |            | -             | -             |
| 四、净利润         |            | 26,902,067.80 | 25,447,280.44 |

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：融通通泰保本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）           | 797,984,323.45                             | 231,178,443.80 | 1,029,162,767.25 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）  | -  | 26,902,067.80  | 26,902,067.80    |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数      | -25,978,682.20                             | -8,196,966.13  | -34,175,648.33   |
| 其中：1. 基金申购款               | 1,659,056.78                               | 521,537.90     | 2,180,594.68     |
| 2. 基金赎回款                  | -27,637,738.98                             | -8,718,504.03  | -36,356,243.01   |
| 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）           | 772,005,641.25                             | 249,883,545.47 | 1,021,889,186.72 |
| 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）           | 875,113,338.02                             | 238,068,608.62 | 1,113,181,946.64 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）  | -  | 25,447,280.44  | 25,447,280.44    |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数      | -51,700,861.69                             | -15,835,284.05 | -67,536,145.74   |
| 其中：1. 基金申购款               | 158,862,475.79                             | 41,862,099.59  | 200,724,575.38   |
| 2. 基金赎回款                  | -210,563,337.48                            | -57,697,383.64 | -268,260,721.12  |
| 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） | 823,412,476.33 | 247,680,605.01 | 1,071,093,081.34 |

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 基金基本情况

融通通泰保本混合型证券投资基金(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[2013]219号《关于核准融通通泰保本混合型证券投资基金募集的批复》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《融通通泰保本混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金自2013年5月8日起至2013年5月28日止期间内向社会公开募集首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币528,443,473.21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(2013)第322号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《融通通泰保本混合型证券投资基金基金合同》于2013年5月30日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为528,653,648.94份基金份额,其中认购资金利息折合210,175.73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,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据本基金的基金管理人于2015年3月5日发布的《融通基金管理有限公司关于融通通泰保本混合型证券投资基金份额分类及相关事项的公告》,自2015年3月5日起对本基金进行份额分类,原有基金份额为A类份额,增设C类份额。在投资者申购时收取申购费用的份额,称为A类份额;不收取申购费用,而是从本类别基金资产中计提销售服务费并按照持有期限收取赎回费的份额,称为C类份额。本基金分类后,本基金原有基金份额将自动划归为本基金A类基金份额,对本基金的持有、赎回或转换无任何变化,利益不受任何影响。

根据《融通通泰保本混合型证券投资基金基金合同》的有关约定,本基金的保本周期每三年为一个周期。本基金第一个保本周期自基金合同生效之日起至三个公历年后对应日止,如该对应日为非工作日,则保本周期到期日顺延至下一个工作日。本基金第一个保本周期由中国投资担保有限公司担任保证人,为本基金的保本提供不可撤销的连带责任保证。第一个保本期届满时,在符合保本基金存续条件下,本基金继续存续并进入下一保本期。如第一个保本期到期后,本基金

未能符合保本基金存续条件，则将变更为非保本的“融通增强收益债券型证券投资基金”。

根据本基金的基金管理人 2016 年 5 月 23 日的《关于融通通泰保本混合型证券投资基金第一个保本周期到期及转入第二个保本周期相关规则的公告》和 2016 年 7 月 8 日的《关于融通通泰保本混合型证券投资基金转入第二个保本周期过渡期折算结果的公告》的相关规定，在第一个保本周期到期日和第二个保本周期开始日之间设置过渡期，过渡期自 2016 年 6 月 7 日至 2016 年 7 月 6 日，过渡期最后一个工作日即 2016 年 7 月 6 日为基金份额折算日。折算后基金份额净值调整为 1.00 元。在保持基金份额持有人所持基金资产净值总额不变的前提下，基金份额数将按折算比例相应调整并进行变更登记，以调整后的基金份额作为自动计入本基金第二个保本周期的基金份额数。本基金第二个保本周期为三年，自 2016 年 7 月 7 日起至 2019 年 7 月 7 日止。如保本周期到期日为非工作日，则保本周期到期日顺延至下一个工作日。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《融通通泰保本混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，可分为风险资产和保本资产两类，其中风险资产包括国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证以及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其它权益类资产；保本资产包括债券（包含国债、央行票据、中期票据、金融债、企业债、公司债、短期融资券、资产支持债券、债券回购等）、银行存款、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其它固定收益类资产。本基金的投资组合比例为：本基金的投资组合比例由保本策略决定，并对比例范围有如下限制：股票、权证等风险资产占基金资产的比例不超过 40%；债券、货币市场工具及其它资产的比例合计不低于基金资产的 60%，其中基金保留的现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）以及投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。本基金业绩比较基准为三年期银行定期存款税后收益率。

#### 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》、《融通通泰保本混合型证券投资基金基金合同》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 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需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[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、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。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得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。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%

计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 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<br>2019 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款           | 4,408,716.57           |
| 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             | 4,408,716.57           |

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2019 年 6 月 30 日 |                |                |
|---------------|------------------------|----------------|----------------|
|               | 成本                     | 公允价值           | 公允价值变动         |
| 股票            | 39,240,821.53          | 48,300,426.90  | 9,059,605.37   |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | -                      | -              | -              |
| 债券            | 交易所市场                  | 4,352,154.54   | 4,317,949.87   |
|               | 银行间市场                  | 264,949,350.00 | 265,233,000.00 |
|               | 合计                     | 269,301,504.54 | 269,550,949.87 |
| 资产支持证券        | -                      | -              | -              |
| 基金            | -                      | -              | -              |
| 其他            | -                      | -              | -              |
| 合计            | 308,542,326.07         | 317,851,376.77 | 9,309,050.70   |

##### 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

## 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

| 项目    | 本期末<br>2019年6月30日 |           |
|-------|-------------------|-----------|
|       | 账面余额              | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | 306,000,000.00    | -         |
| 银行间市场 | 388,802,383.20    | -         |
| 合计    | 694,802,383.20    | -         |

## 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

## 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目         | 本期末<br>2019年6月30日 |
|------------|-------------------|
| 应收活期存款利息   | 3,116.37          |
| 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  | 18.00             |
| 应收债券利息     | 7,228,491.83      |
| 应收资产支持证券利息 | -                 |
| 应收买入返售证券利息 | 356,160.36        |
| 应收申购款利息    | -                 |
| 应收黄金合约拆借孳息 | -                 |
| 其他         | 6.48              |
| 合计         | 7,587,793.04      |

## 6.4.7.6 其他资产

无。

## 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2019年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 50,961.83         |
| 银行间市场应付交易费用 | 18,525.08         |
| 合计          | 69,486.91         |

## 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       | 3,978.56        |
| 预提费用        | 115,910.86      |
| 合计          | 119,889.42      |

## 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

## 融通通泰保本混合 A

| 项目   | 本期<br>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 | 996,780,308.32                        | 794,731,311.20 |
| 本期申购 | 2,080,707.03                          | 1,659,056.78   |
| 本期赎回 | -34,664,221.95                        | -27,637,738.98 |
| 本期末  | 964,196,793.40                        | 768,752,629.00 |

## 融通通泰保本混合 C

| 项目   | 本期<br>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 | 4,103,113.85                          | 3,253,012.25 |
| 本期申购 | -                                     | -            |
| 本期赎回 | -                                     | -            |
| 本期末  | 4,103,113.85                          | 3,253,012.25 |

## 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 融通通泰保本混合 A     |                |               |                |
|----------------|----------------|---------------|----------------|
| 项目             | 已实现部分          | 未实现部分         | 未分配利润合计        |
| 上年度末           | 189,046,192.38 | 41,301,099.67 | 230,347,292.05 |
| 本期利润           | 14,139,359.78  | 12,667,497.47 | 26,806,857.25  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -6,479,438.54  | -1,717,527.59 | -8,196,966.13  |
| 其中：基金申购款       | 409,105.11     | 112,432.79    | 521,537.90     |
| 基金赎回款          | -6,888,543.65  | -1,829,960.38 | -8,718,504.03  |
| 本期已分配利润        | -              | -             | -              |
| 本期末            | 196,706,113.62 | 52,251,069.55 | 248,957,183.17 |
| 融通通泰保本混合 C     |                |               |                |
| 项目             | 已实现部分          | 未实现部分         | 未分配利润合计        |
| 上年度末           | 662,461.63     | 168,690.12    | 831,151.75     |
| 本期利润           | 44,578.00      | 50,632.55     | 95,210.55      |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -              | -             | -              |
| 其中：基金申购款       | -              | -             | -              |

|         |            |            |            |
|---------|------------|------------|------------|
| 基金赎回款   | -          | -          | -          |
| 本期已分配利润 | -          | -          | -          |
| 本期末     | 707,039.63 | 219,322.67 | 926,362.30 |

注:A类份额申购含转换入份额;赎回含转换出份额。C类份额暂不开通转换业务。

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位:人民币元

| 项目        | 本期<br>2019年1月1日至2019年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 活期存款利息收入  | 30,207.66                  |
| 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 | 1,611.63                   |
| 其他        | 241.75                     |
| 合计        | 32,061.04                  |

#### 6.4.7.12 股票投资收益

单位:人民币元

| 项目         | 本期<br>2019年1月1日至2019年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 63,526,486.98              |
| 减:卖出股票成本总额 | 60,621,474.32              |
| 买卖股票差价收入   | 2,905,012.66               |

#### 6.4.7.13 债券投资收益

单位:人民币元

| 项目                     | 本期<br>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   | 1,234,975,380.04           |
| 减:卖出债券(债转股及债券到期兑付)成本总额 | 1,193,362,188.25           |
| 减:应收利息总额               | 40,888,430.09              |
| 买卖债券差价收入               | 724,761.70                 |

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

无。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

无。

#### 6.4.7.16 股利收益

单位:人民币元

| 项目          | 本期<br>2019年1月1日至2019年6月30日 |
|-------------|----------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 373,324.28                 |
| 基金投资产生的股利收益 | -                          |
| 合计          | 373,324.28                 |

## 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称                   | 本期<br>2019年1月1日至2019年6月30日 |
|------------------------|----------------------------|
| 1. 交易性金融资产             | 12,718,130.02              |
| 股票投资                   | 14,397,792.58              |
| 债券投资                   | -1,679,662.56              |
| 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                     | 12,718,130.02              |

## 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2019年1月1日至2019年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 基金赎回费收入 | 77,585.09                  |
| 基金转换费收入 | 13,059.26                  |
| 合计      | 90,644.35                  |

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，其中 A 类份额不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产，C 类份额的赎回费全额计入基金资产。

2. 本基金 A 类份额转换收取转换费和补差费，其中不低于转换费的 25% 归入转出基金的基金资产。

## 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2019年1月1日至2019年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 164,705.83                 |
| 银行间市场交易费用 | 3,100.00                   |
| 合计        | 167,805.83                 |

## 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目    | 本期<br>2019年1月1日至2019年6月30日 |
|-------|----------------------------|
| 审计费用  | 49,588.57                  |
| 信息披露费 | 57,322.29                  |
| 银行费用  | 6,748.12                   |

|         |            |
|---------|------------|
| 债券账户维护费 | 27,000.00  |
| 其他      | 624.00     |
| 合计      | 141,282.98 |

#### 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

因未能符合保本基金存续条件，经本基金管理人与基金托管人协商一致，本基金将按照《基金合同》的约定转型为非保本的混合型基金，即融通通泰保本混合型证券投资基金自 2019 年 7 月 16 日起转型为融通增强收益债券型证券投资基金，具体情况详见本基金管理人于 2019 年 6 月 15 日发布的《融通通泰保本混合型证券投资基金保本期到期安排及转型为融通增强收益债券型证券投资基金相关业务规则的公告》。

#### 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 |
| 中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”） | 基金托管人、基金销售机构        |
| 新时代证券股份有限公司（“新时代证券”）   | 基金管理人的股东、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。

#### 6.4.10 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

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2019年1月1日至2019年6月30日 |                         | 上年度可比期间<br>2018年1月1日至2018年6月30日 |                     |
|-------|----------------------------|-------------------------|---------------------------------|---------------------|
|       | 成交金额                       | 占当期股票<br>成交总额的比例<br>(%) | 成交金额                            | 占当期股票<br>成交总额的比例(%) |
| 新时代证券 | 1,020,325.71               | 1.02                    | -                               | -                   |

## 6.4.10.1.2 权证交易

无。

## 6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2019年1月1日至2019年6月30日      |                    |              |                      |
|-------|---------------------------------|--------------------|--------------|----------------------|
|       | 当期<br>佣金                        | 占当期佣金总量<br>的比例 (%) | 期末应付佣金余<br>额 | 占期末应付佣金<br>总额的比例 (%) |
| 新时代证券 | 948.87                          | 1.03               | -            | -                    |
| 关联方名称 | 上年度可比期间<br>2018年1月1日至2018年6月30日 |                    |              |                      |
|       | 当期<br>佣金                        | 占当期佣金总量<br>的比例 (%) | 期末应付佣金余<br>额 | 占期末应付佣金<br>总额的比例 (%) |
| 新时代证券 | -                               | -                  | -            | -                    |

## 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<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                 | 6,152,329.28                        |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 449,735.98                     | 605,065.51                          |

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 1.20% 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 × 1.20% / 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<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托管费                 | 1,025,388.20                        |

注:支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20%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:

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.20\% / \text{当年天数}。$$

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位:人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期<br>2019年1月1日至2019年6月30日      |            |            |
|----------------|---------------------------------|------------|------------|
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                |            |            |
|                | 融通通泰保本混合 A                      | 融通通泰保本混合 C | 合计         |
| 融通基金管理有限公司     | -                               | 12,336.05  | 12,336.05  |
| 合计             | -                               | 12,336.05  | 12,336.05  |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间<br>2018年1月1日至2018年6月30日 |            |            |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                |            |            |
|                | 融通通泰保本混合 A                      | 融通通泰保本混合 C | 合计         |
| 融通基金管理有限公司     | -                               | 179,469.27 | 179,469.27 |
| 合计             | -                               | 179,469.27 | 179,469.27 |

注:支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值 0.60%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付给融通基金,再由融通基金计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为:

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日 C 类基金资产净值} \times 0.60\% / \text{当年天数}。$$

#### 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

单位:人民币元

| 银行间市场交易的各关联方名称 | 本期<br>2019年1月1日至2019年6月30日      |      |       |      |               |          |
|----------------|---------------------------------|------|-------|------|---------------|----------|
|                | 债券交易金额                          |      | 基金逆回购 |      | 基金正回购         |          |
|                | 基金买入                            | 基金卖出 | 交易金额  | 利息收入 | 交易金额          | 利息支出     |
| -              | -                               | -    | -     | -    | -             | -        |
| 银行间市场交易的各关联方名称 | 上年度可比期间<br>2018年1月1日至2018年6月30日 |      |       |      |               |          |
|                | 债券交易金额                          |      | 基金逆回购 |      | 基金正回购         |          |
|                | 基金买入                            | 基金卖出 | 交易金额  | 利息收入 | 交易金额          | 利息支出     |
| 中国工商银行         | -                               | -    | -     | -    | 29,000,000.00 | 2,701.37 |

## 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自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<br>2019年1月1日至2019年6月30日 |           | 上年度可比期间<br>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    |
| 中国工商银行 | 4,408,716.57               | 30,207.66 | 904,068.90                      | 35,988.73 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

## 6.4.10.6 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

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<br>(单位:股) | 期末成本总额    | 期末估值总额    | 备注 |
| 300788               | 中信出版 | 2019-6-27 | 2019-7-5 | 新股流通受限 | 14.85  | 14.85  | 1,556        | 23,106.60 | 23,106.60 | -  |
| 601236               | 红塔证券 | 2019-6-26 | 2019-7-5 | 新股流通受限 | 3.46   | 3.46   | 9,789        | 33,869.94 | 33,869.94 | -  |
| 6.4.12.1.2 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 |
| 123027               | 蓝晓   | 2019-6-11 | 2019-7-4 | 新债流    | 100.00 | 100.00 | 115          | 11,499.87 | 11,499.87 | -  |

|  |    |  |     |  |  |  |  |  |  |
|--|----|--|-----|--|--|--|--|--|--|
|  | 转债 |  | 通受限 |  |  |  |  |  |  |
|--|----|--|-----|--|--|--|--|--|--|

#### 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

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

本基金为保本混合型基金。本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本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。本基金通过运用组合保险策略，在为符合保本条件的投资金额提供保本保障的基础上，追求基金资产的长期增值。

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工商银行，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以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业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》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<br>2019年6月30日 | 上年度末<br>2018年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| A-1    | 20,178,000.00     | 20,120,000.00       |
| A-1 以下 | -                 | -                   |
| 未评级    | 50,015,000.00     | 50,215,000.00       |
| 合计     | 70,193,000.00     | 70,335,000.00       |

注：未评级债券为国债和政策性金融债。债券信用评级取自第三方评级机构的评级。

## 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

## 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2019年6月30日 | 上年度末<br>2018年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| A-1    | -                 | -                   |
| A-1 以下 | -                 | -                   |
| 未评级    | 195,040,000.00    | 1,218,115,000.00    |
| 合计     | 195,040,000.00    | 1,218,115,000.00    |

注：债券信用评级取自第三方评级机构的评级。

## 6.4.13.2.4 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<br>2019年6月30日 | 上年度末<br>2018年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| AAA    | 4,306,450.00      | 57,571,923.02       |
| AAA 以下 | 11,499.87         | -                   |
| 未评级    | -                 | -                   |
| 合计     | 4,317,949.87      | 57,571,923.02       |

注：债券信用评级取自第三方评级机构的评级。

## 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

## 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

## 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，本基金所承担的其他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，因此账面余额约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上市公司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%，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%(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上述比例限制)。

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。

本基金投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种比重较大，此外还持有银行存款、结算备付金、存出保证金和买入返售金融资产等利率敏感性资产，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<br>2019年6月30<br>日 | 1年以内           | 1-5年 | 5年以上      | 不计息           | 合计               |
|-----------------------|----------------|------|-----------|---------------|------------------|
| 资产                    |                |      |           |               |                  |
| 银行存款                  | 4,408,716.57   | -    | -         | -             | 4,408,716.57     |
| 结算备付金                 | 44,281.45      | -    | -         | -             | 44,281.45        |
| 存出保证金                 | 16,056.34      | -    | -         | -             | 16,056.34        |
| 交易性金融资产               | 269,539,450.00 | -    | 11,499.87 | 48,300,426.90 | 317,851,376.77   |
| 买入返售金融资产              | 694,802,383.20 | -    | -         | -             | 694,802,383.20   |
| 应收利息                  | -              | -    | -         | 7,587,793.04  | 7,587,793.04     |
| 应收证券清算款               | -              | -    | -         | 262,785.56    | 262,785.56       |
| 资产总计                  | 968,810,887.56 | -    | 11,499.87 | 56,151,005.50 | 1,024,973,392.93 |
| 负债                    |                |      |           |               |                  |
| 应付赎回款                 | -              | -    | -         | 1,707,219.38  | 1,707,219.38     |
| 应付管理人报酬               | -              | -    | -         | 1,012,928.59  | 1,012,928.59     |
| 应付托管费                 | -              | -    | -         | 168,821.43    | 168,821.43       |
| 应付销售服务费               | -              | -    | -         | 2,054.58      | 2,054.58         |

|                             |                  |              |            |               |                  |
|-----------------------------|------------------|--------------|------------|---------------|------------------|
| 应付交易费用                      | -                | -            | -          | 69,486.91     | 69,486.91        |
| 应交税费                        | -                | -            | -          | 3,805.90      | 3,805.90         |
| 其他负债                        | -                | -            | -          | 119,889.42    | 119,889.42       |
| 负债总计                        | -                | -            | -          | 3,084,206.21  | 3,084,206.21     |
| 利率敏感度缺口                     | 968,810,887.56   | -            | 11,499.87  | 53,066,799.29 | 1,021,889,186.72 |
| 上年度末<br>2018 年 12 月 31<br>日 | 1 年以内            | 1-5 年        | 5 年以上      | 不计息           | 合计               |
| 资产                          |                  |              |            |               |                  |
| 银行存款                        | 3,683,763.58     | -            | -          | -             | 3,683,763.58     |
| 结算备付金                       | 291,336.73       | -            | -          | -             | 291,336.73       |
| 存出保证金                       | 36,054.29        | -            | -          | -             | 36,054.29        |
| 交易性金融资产                     | 1,342,601,930.00 | 2,889,000.00 | 530,993.02 | 55,948,818.28 | 1,401,970,741.30 |
| 应收证券清算款                     | -                | -            | -          | 2,902,932.13  | 2,902,932.13     |
| 应收利息                        | -                | -            | -          | 28,345,166.41 | 28,345,166.41    |
| 应收申购款                       | -                | -            | -          | 3.96          | 3.96             |
| 资产总计                        | 1,346,613,084.60 | 2,889,000.00 | 530,993.02 | 87,196,920.78 | 1,437,229,998.40 |
| 负债                          |                  |              |            |               |                  |
| 卖出回购金融资产款                   | 405,393,694.70   | -            | -          | -             | 405,393,694.70   |
| 应付赎回款                       | -                | -            | -          | 584,318.71    | 584,318.71       |
| 应付管理人报酬                     | -                | -            | -          | 1,052,795.11  | 1,052,795.11     |
| 应付托管费                       | -                | -            | -          | 175,465.86    | 175,465.86       |
| 应付销售服务费                     | -                | -            | -          | 2,083.04      | 2,083.04         |
| 应付交易费用                      | -                | -            | -          | 151,540.34    | 151,540.34       |
| 应付利息                        | -                | -            | -          | 596,239.20    | 596,239.20       |
| 应交税费                        | -                | -            | -          | 5,758.99      | 5,758.99         |
| 其他负债                        | -                | -            | -          | 105,335.20    | 105,335.20       |
| 负债总计                        | 405,393,694.70   | -            | -          | 2,673,536.45  | 408,067,231.15   |
| 利率敏感度缺口                     | 941,219,389.90   | 2,889,000.00 | 530,993.02 | 84,523,384.33 | 1,029,162,767.25 |

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 |                                 |                          |
|----|--------------------|---------------------------------|--------------------------|
|    | 相关风险变量的变动          | 对资产负债表日基金资产净值的<br>影响金额(单位:人民币元) |                          |
|    |                    | 本期末<br>2019 年 6 月 30 日          | 上年度末<br>2018 年 12 月 31 日 |
| 分析 | 市场利率下降 25 个基点      | 34,493.86                       | 1,347,203.15             |
|    | 市场利率上升 25 个基点      | -34,481.16                      | -1,343,880.00            |

#### 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。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 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。本基金主要投资于交易所及银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2019年6月30日 |               | 上年度末<br>2018年12月31日 |               |
|---------------|-------------------|---------------|---------------------|---------------|
|               | 公允价值              | 占基金资产净值比例 (%) | 公允价值                | 占基金资产净值比例 (%) |
| 交易性金融资产—股票投资  | 48,300,426.90     | 4.73          | 55,948,818.28       | 5.44          |
| 交易性金融资产—基金投资  | —                 | —             | —                   | —             |
| 交易性金融资产—贵金属投资 | —                 | —             | —                   | —             |
| 衍生金融资产—权证投资   | —                 | —             | —                   | —             |
| 其他            | —                 | —             | —                   | —             |
| 合计            | 48,300,426.90     | 4.73          | 55,948,818.28       | 5.44          |

##### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2019 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性权益类投资公允价值占基金资产净值的比例为 4.73% (2018 年 12 月 31 日：5.44%)，因此除市场利率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响 (2018 年 12 月 31 日：同)。

#### 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  | 48,300,426.90 | 4.71          |
|    | 其中：股票 | 48,300,426.90 | 4.71          |

|   |                   |                  |        |
|---|-------------------|------------------|--------|
| 2 | 基金投资              | -                | -      |
| 3 | 固定收益投资            | 269,550,949.87   | 26.30  |
|   | 其中：债券             | 269,550,949.87   | 26.30  |
|   | 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          | 694,802,383.20   | 67.79  |
|   | 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      | 4,452,998.02     | 0.43   |
| 8 | 其他各项资产            | 7,866,634.94     | 0.77   |
| 9 | 合计                | 1,024,973,392.93 | 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         | 763,818.00    | 0.07         |
| B  | 采矿业              | 363,431.25    | 0.04         |
| C  | 制造业              | 30,662,377.33 | 3.00         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -             | -            |
| E  | 建筑业              | -             | -            |
| F  | 批发和零售业           | 1,878,939.00  | 0.18         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 783,307.00    | 0.08         |
| H  | 住宿和餐饮业           | -             | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 3,123,777.76  | 0.31         |
| J  | 金融业              | 3,676,469.06  | 0.36         |
| K  | 房地产业             | 2,115,682.00  | 0.21         |
| L  | 租赁和商务服务业         | 4,033,575.00  | 0.39         |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 348,524.80    | 0.03         |
| 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          | 527,419.10    | 0.05         |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | 23,106.60     | 0.00         |
| S  | 综合               | -             | -            |
|    | 合计               | 48,300,426.90 | 4.73         |

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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 | 45,500  | 4,033,575.00 | 0.39 |
| 2  | 601138 | 工业富联 | 200,000 | 2,410,000.00 | 0.24 |
| 3  | 000338 | 潍柴动力 | 173,400 | 2,131,086.00 | 0.21 |
| 4  | 600031 | 三一重工 | 160,000 | 2,092,800.00 | 0.20 |
| 5  | 600801 | 华新水泥 | 93,200  | 1,887,300.00 | 0.18 |
| 6  | 300630 | 普利制药 | 23,100  | 1,331,022.00 | 0.13 |
| 7  | 601933 | 永辉超市 | 120,000 | 1,225,200.00 | 0.12 |
| 8  | 600887 | 伊利股份 | 34,900  | 1,166,009.00 | 0.11 |
| 9  | 600585 | 海螺水泥 | 27,700  | 1,149,550.00 | 0.11 |
| 10 | 000568 | 泸州老窖 | 14,200  | 1,147,786.00 | 0.11 |
| 11 | 002157 | 正邦科技 | 61,600  | 1,026,256.00 | 0.10 |
| 12 | 000661 | 长春高新 | 3,000   | 1,014,000.00 | 0.10 |
| 13 | 000002 | 万科A  | 35,400  | 984,474.00   | 0.10 |
| 14 | 002475 | 立讯精密 | 39,200  | 971,768.00   | 0.10 |
| 15 | 002142 | 宁波银行 | 38,100  | 923,544.00   | 0.09 |
| 16 | 601318 | 中国平安 | 9,792   | 867,669.12   | 0.08 |
| 17 | 000651 | 格力电器 | 15,500  | 852,500.00   | 0.08 |
| 18 | 000063 | 中兴通讯 | 24,900  | 809,997.00   | 0.08 |
| 19 | 600276 | 恒瑞医药 | 12,140  | 801,240.00   | 0.08 |
| 20 | 002353 | 杰瑞股份 | 34,122  | 788,218.20   | 0.08 |
| 21 | 300498 | 温氏股份 | 21,300  | 763,818.00   | 0.07 |
| 22 | 601100 | 恒立液压 | 23,700  | 743,706.00   | 0.07 |
| 23 | 600030 | 中信证券 | 29,000  | 690,490.00   | 0.07 |
| 24 | 000860 | 顺鑫农业 | 14,690  | 685,288.50   | 0.07 |
| 25 | 600570 | 恒生电子 | 9,750   | 664,462.50   | 0.07 |
| 26 | 000031 | 大悦城  | 102,200 | 656,124.00   | 0.06 |
| 27 | 002410 | 广联达  | 18,900  | 621,621.00   | 0.06 |
| 28 | 601012 | 隆基股份 | 26,500  | 612,415.00   | 0.06 |
| 29 | 002439 | 启明星辰 | 22,400  | 602,560.00   | 0.06 |
| 30 | 600305 | 恒顺醋业 | 31,700  | 583,914.00   | 0.06 |
| 31 | 002463 | 沪电股份 | 41,183  | 560,912.46   | 0.05 |
| 32 | 300015 | 爱尔眼科 | 17,030  | 527,419.10   | 0.05 |
| 33 | 601688 | 华泰证券 | 21,800  | 486,576.00   | 0.05 |
| 34 | 603160 | 汇顶科技 | 3,400   | 471,920.00   | 0.05 |
| 35 | 603986 | 兆易创新 | 5,400   | 468,180.00   | 0.05 |
| 36 | 603711 | 香飘飘  | 13,600  | 461,992.00   | 0.05 |
| 37 | 601128 | 常熟银行 | 58,000  | 447,760.00   | 0.04 |
| 38 | 300470 | 日机密封 | 17,858  | 443,592.72   | 0.04 |
| 39 | 002798 | 帝欧家居 | 24,000  | 439,440.00   | 0.04 |
| 40 | 002511 | 中顺洁柔 | 32,000  | 392,960.00   | 0.04 |
| 41 | 300122 | 智飞生物 | 9,000   | 387,900.00   | 0.04 |

|    |        |      |         |            |      |
|----|--------|------|---------|------------|------|
| 42 | 603737 | 三棵树  | 8,400   | 365,736.00 | 0.04 |
| 43 | 600968 | 海油发展 | 102,375 | 363,431.25 | 0.04 |
| 44 | 002508 | 老板电器 | 13,200  | 358,248.00 | 0.04 |
| 45 | 603885 | 吉祥航空 | 26,900  | 352,390.00 | 0.03 |
| 46 | 300284 | 苏交科  | 37,760  | 348,524.80 | 0.03 |
| 47 | 300770 | 新媒股份 | 3,900   | 337,350.00 | 0.03 |
| 48 | 603939 | 益丰药房 | 4,700   | 328,953.00 | 0.03 |
| 49 | 002572 | 索菲亚  | 17,700  | 328,512.00 | 0.03 |
| 50 | 002727 | 一心堂  | 11,400  | 324,786.00 | 0.03 |
| 51 | 002555 | 三七互娱 | 23,300  | 315,715.00 | 0.03 |
| 52 | 300525 | 博思软件 | 14,550  | 315,007.50 | 0.03 |
| 53 | 600989 | 宝丰能源 | 24,356  | 287,644.36 | 0.03 |
| 54 | 601155 | 新城控股 | 6,800   | 270,708.00 | 0.03 |
| 55 | 002449 | 国星光电 | 19,300  | 256,304.00 | 0.03 |
| 56 | 601111 | 中国国航 | 24,800  | 237,336.00 | 0.02 |
| 57 | 300593 | 新雷能  | 14,840  | 231,504.00 | 0.02 |
| 58 | 600438 | 通威股份 | 16,400  | 230,584.00 | 0.02 |
| 59 | 603019 | 中科曙光 | 6,500   | 228,150.00 | 0.02 |
| 60 | 600996 | 贵广网络 | 21,100  | 227,458.00 | 0.02 |
| 61 | 601628 | 中国人寿 | 8,000   | 226,560.00 | 0.02 |
| 62 | 000915 | 山大华特 | 11,000  | 224,950.00 | 0.02 |
| 63 | 601799 | 星宇股份 | 2,800   | 221,088.00 | 0.02 |
| 64 | 300487 | 蓝晓科技 | 7,000   | 220,640.00 | 0.02 |
| 65 | 300575 | 中旗股份 | 7,560   | 215,913.60 | 0.02 |
| 66 | 601966 | 玲珑轮胎 | 12,600  | 214,200.00 | 0.02 |
| 67 | 002179 | 中航光电 | 6,300   | 210,798.00 | 0.02 |
| 68 | 002583 | 海能达  | 24,400  | 204,716.00 | 0.02 |
| 69 | 000961 | 中南建设 | 23,600  | 204,376.00 | 0.02 |
| 70 | 601877 | 正泰电器 | 8,800   | 203,192.00 | 0.02 |
| 71 | 002601 | 龙鳞佰利 | 13,600  | 201,688.00 | 0.02 |
| 72 | 300450 | 先导智能 | 5,800   | 194,880.00 | 0.02 |
| 73 | 600233 | 圆通速递 | 15,700  | 193,581.00 | 0.02 |
| 74 | 002595 | 豪迈科技 | 5,800   | 121,858.00 | 0.01 |
| 75 | 300782 | 卓胜微  | 743     | 80,927.56  | 0.01 |
| 76 | 002791 | 坚朗五金 | 4,700   | 74,401.00  | 0.01 |
| 77 | 603915 | 国茂股份 | 2,523   | 58,710.21  | 0.01 |
| 78 | 601698 | 中国卫通 | 10,103  | 39,603.76  | 0.00 |
| 79 | 603863 | 松炆资源 | 1,612   | 37,204.96  | 0.00 |
| 80 | 601236 | 红塔证券 | 9,789   | 33,869.94  | 0.00 |
| 81 | 300594 | 朗进科技 | 721     | 31,803.31  | 0.00 |
| 82 | 603867 | 新化股份 | 1,045   | 26,971.45  | 0.00 |
| 83 | 300788 | 中信出版 | 1,556   | 23,106.60  | 0.00 |

## 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 | 3,836,334.00 | 0.37           |
| 2  | 601933 | 永辉超市 | 1,480,668.00 | 0.14           |
| 3  | 002475 | 立讯精密 | 1,143,733.00 | 0.11           |
| 4  | 600887 | 伊利股份 | 1,044,741.90 | 0.10           |
| 5  | 002142 | 宁波银行 | 908,982.62   | 0.09           |
| 6  | 000651 | 格力电器 | 809,100.00   | 0.08           |
| 7  | 002157 | 正邦科技 | 791,555.00   | 0.08           |
| 8  | 000543 | 皖能电力 | 769,769.00   | 0.07           |
| 9  | 000568 | 泸州老窖 | 766,134.00   | 0.07           |
| 10 | 002439 | 启明星辰 | 699,101.00   | 0.07           |
| 11 | 002798 | 帝欧家居 | 657,716.00   | 0.06           |
| 12 | 601601 | 中国太保 | 632,596.00   | 0.06           |
| 13 | 300232 | 洲明科技 | 622,304.00   | 0.06           |
| 14 | 601328 | 交通银行 | 615,565.00   | 0.06           |
| 15 | 300498 | 温氏股份 | 578,294.00   | 0.06           |
| 16 | 603160 | 汇顶科技 | 571,940.00   | 0.06           |
| 17 | 600547 | 山东黄金 | 561,800.00   | 0.05           |
| 18 | 603019 | 中科曙光 | 506,827.00   | 0.05           |
| 19 | 002353 | 杰瑞股份 | 489,580.00   | 0.05           |
| 20 | 002572 | 索菲亚  | 472,322.00   | 0.05           |

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 | 4,808,835.44 | 0.47           |
| 2  | 601138 | 工业富联 | 4,212,256.72 | 0.41           |
| 3  | 600801 | 华新水泥 | 2,224,797.00 | 0.22           |
| 4  | 600276 | 恒瑞医药 | 1,937,019.27 | 0.19           |
| 5  | 601318 | 中国平安 | 1,800,275.60 | 0.17           |
| 6  | 002157 | 正邦科技 | 1,195,210.00 | 0.12           |
| 7  | 300630 | 普利制药 | 1,177,324.16 | 0.11           |
| 8  | 600036 | 招商银行 | 1,140,193.00 | 0.11           |
| 9  | 601288 | 农业银行 | 1,128,620.00 | 0.11           |
| 10 | 600048 | 保利地产 | 1,081,481.00 | 0.11           |
| 11 | 600271 | 航天信息 | 1,080,562.48 | 0.10           |
| 12 | 002410 | 广联达  | 1,013,648.00 | 0.10           |
| 13 | 000333 | 美的集团 | 1,013,207.00 | 0.10           |

|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 14 | 002557 | 洽洽食品 | 1,009,750.00 | 0.10 |
| 15 | 002110 | 三钢闽光 | 931,661.00   | 0.09 |
| 16 | 600027 | 华电国际 | 930,535.00   | 0.09 |
| 17 | 002304 | 洋河股份 | 929,659.00   | 0.09 |
| 18 | 000661 | 长春高新 | 837,396.00   | 0.08 |
| 19 | 000543 | 皖能电力 | 836,901.00   | 0.08 |
| 20 | 300015 | 爱尔眼科 | 836,550.00   | 0.08 |

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 | 38,575,290.36 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 63,526,486.98 |

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      | 50,015,000.00  | 4.89         |
|    | 其中：政策性金融债 | 50,015,000.00  | 4.89         |
| 4  | 企业债券      | 4,306,450.00   | 0.42         |
| 5  | 企业短期融资券   | 20,178,000.00  | 1.97         |
| 6  | 中期票据      | -              | -            |
| 7  | 可转债（可交换债） | 11,499.87      | 0.00         |
| 8  | 同业存单      | 195,040,000.00 | 19.09        |
| 9  | 其他        | -              | -            |
| 10 | 合计        | 269,550,949.87 | 26.38        |

#### 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  | 111809320 | 18 浦发银行 CD320 | 1,000,000 | 97,520,000.00 | 9.54         |
| 2  | 111818293 | 18 华夏银行 CD293 | 1,000,000 | 97,520,000.00 | 9.54         |
| 3  | 180209    | 18 国开 09      | 500,000   | 50,015,000.00 | 4.89         |
| 4  | 041800272 | 18 晋江城投 CP002 | 200,000   | 20,178,000.00 | 1.97         |
| 5  | 112419    | 16 河钢 01      | 43,000    | 4,306,450.00  | 0.42         |

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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。

**7.8 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**

本基金本报告期末未持有股指期货。

**7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明****7.11.1 本期国债期货投资政策**

本基金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   | 16,056.34    |
| 2  | 应收证券清算款 | 262,785.56   |
| 3  | 应收股利    | -            |
| 4  | 应收利息    | 7,587,793.04 |
| 5  | 应收申购款   | -            |
| 6  | 其他应收款   | -            |
| 7  | 待摊费用    | -            |
| 8  | 其他      | -            |
| 9  | 合计      | 7,866,634.94 |

**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

| 份额级别       | 持有人户数 (户) | 户均持有的基金份额    | 持有人结构          |            |                |            |
|------------|-----------|--------------|----------------|------------|----------------|------------|
|            |           |              | 机构投资者          |            | 个人投资者          |            |
|            |           |              | 持有份额           | 占总份额比例 (%) | 持有份额           | 占总份额比例 (%) |
| 融通通泰保本混合 A | 1,669     | 577,709.28   | 800,548,638.46 | 83.03      | 163,648,154.94 | 16.97      |
| 融通通泰保本混合 C | 1         | 4,103,113.85 | 4,103,113.85   | 100.00     | 0.00           | 0.00       |
| 合计         | 1,670     | 579,820.30   | 804,651,752.31 | 83.10      | 163,648,154.94 | 16.90      |

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 份额级别       | 持有份额总数 (份) | 占基金总份额比例 (%) |
|------------------|------------|------------|--------------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 融通通泰保本混合 A | 306.14     | 0.0000       |
|                  | 融通通泰保本混合 C | 0.00       | 0.0000       |
|                  | 合计         | 306.14     | 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                             | 份额级别       | 持有基金份额总量的数量区间 (万份) |
|--------------------------------|------------|--------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金 | 融通通泰保本混合 A | 0                  |
|                                | 融通通泰保本混合 C | 0                  |
|                                | 合计         | 0                  |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 融通通泰保本混合 A | 0                  |
|                                | 融通通泰保本混合 C | 0                  |
|                                | 合计         | 0                  |

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                               | 融通通泰保本混合 A     | 融通通泰保本混合 C   |
|----------------------------------|----------------|--------------|
| 基金合同生效日 (2013 年 5 月 30 日) 基金份额总额 | 528,653,648.94 | -            |
| 本报告期期初基金份额总额                     | 996,780,308.32 | 4,103,113.85 |
| 本报告期基金总申购份额                      | 2,080,707.03   | -            |

|               |                |              |
|---------------|----------------|--------------|
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 34,664,221.95  | -            |
| 本报告期期末基金份额总额  | 964,196,793.40 | 4,103,113.85 |

## § 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

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、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 |    |
| 申万宏源 | 1      | 28,855,204.16 | 28.76%       | 26,858.40 | 29.19%     | -  |
| 中泰证券 | 4      | 18,388,150.19 | 18.33%       | 16,757.56 | 18.21%     | -  |
| 长江证券 | 1      | 18,347,835.88 | 18.29%       | 16,719.58 | 18.17%     | -  |
| 西部证券 | 3      | 12,567,834.75 | 12.53%       | 11,453.39 | 12.45%     | -  |
| 平安证券 | 2      | 9,870,481.78  | 9.84%        | 8,995.29  | 9.78%      | -  |

|        |   |              |       |          |       |   |
|--------|---|--------------|-------|----------|-------|---|
| 光大证券   | 1 | 7,200,114.00 | 7.18% | 6,561.32 | 7.13% | - |
| 海通证券   | 1 | 3,828,511.69 | 3.82% | 3,489.29 | 3.79% | - |
| 新时代证券  | 1 | 1,020,325.71 | 1.02% | 948.87   | 1.03% | - |
| 中金公司   | 1 | 244,030.62   | 0.24% | 222.41   | 0.24% | - |
| 安信证券   | 2 | -            | -     | -        | -     | - |
| 渤海证券   | 1 | -            | -     | -        | -     | - |
| 长城证券   | 1 | -            | -     | -        | -     | - |
| 东北证券   | 1 | -            | -     | -        | -     | - |
| 东兴证券   | 1 | -            | -     | -        | -     | - |
| 广州证券   | 2 | -            | -     | -        | -     | - |
| 恒泰证券   | 1 | -            | -     | -        | -     | - |
| 华安证券   | 1 | -            | -     | -        | -     | - |
| 华泰证券   | 1 | -            | -     | -        | -     | - |
| 华西证券   | 2 | -            | -     | -        | -     | - |
| 华鑫证券   | 1 | -            | -     | -        | -     | - |
| 天风证券   | 2 | -            | -     | -        | -     | - |
| 西藏东方财富 | 1 | -            | -     | -        | -     | - |
| 浙商证券   | 2 | -            | -     | -        | -     | - |
| 中信建投   | 1 | -            | -     | -        | -     | - |
| 中信证券   | 1 | -            | -     | -        | -     | - |

注:1、基金专用交易单元的选择标准和程序:

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  
需要, 并能为本基金提供全面的信息服务;

(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、本基金本报告期新增中泰证券交易单元 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 |
| 申万宏源  | 67,426,918.16 | 92.12%       | 937,000,000.00 | 91.64%         | -    | -            |
| 中泰证券  | 1,019,144.31  | 1.39%        | 39,000,000.00  | 3.81%          | -    | -            |
| 长江证券  | 612,024.00    | 0.84%        | -              | -              | -    | -            |
| 西部证券  | -             | -            | 7,000,000.00   | 0.68%          | -    | -            |
| 平安证券  | -             | -            | -              | -              | -    | -            |
| 光大证券  | -             | -            | -              | -              | -    | -            |
| 海通证券  | 2,943,655.47  | 4.02%        | -              | -              | -    | -            |
| 新时代证券 | 237,833.90    | 0.32%        | 39,500,000.00  | 3.86%          | -    | -            |
| 中金公司  | 957,432.59    | 1.31%        | -              | -              | -    | -            |
| 安信证券  | -             | -            | -              | -              | -    | -            |
| 渤海证券  | -             | -            | -              | -              | -    | -            |
| 长城证券  | -             | -            | -              | -              | -    | -            |
| 东北证券  | -             | -            | -              | -              | -    | -            |
| 东兴证券  | -             | -            | -              | -              | -    | -            |
| 广州证券  | -             | -            | -              | -              | -    | -            |
| 恒泰证券  | -             | -            | -              | -              | -    | -            |
| 华安证券  | -             | -            | -              | -              | -    | -            |
| 华泰证券  | -             | -            | -              | -              | -    | -            |
| 华西证券  | -             | -            | -              | -              | -    | -            |
| 华鑫证券  | -             | -            | -              | -              | -    | -            |

|        |   |   |   |   |   |   |
|--------|---|---|---|---|---|---|
| 天风证券   | - | - | - | - | - | - |
| 西藏东方财富 | - | - | - | - | - | - |
| 浙商证券   | - | - | - | - | - | - |
| 中信建投   | - | - | - | - | - | - |
| 中信证券   | - | - | - | - | - | - |

### 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       | 证券时报、管理人网站 | 2019-01-26 |
| 2  | 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优惠活动的公告              | 证券时报、管理人网站 | 2019-01-30 |
| 3  | 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                        | 证券时报、管理人网站 | 2019-03-25 |
| 4  | 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                | 证券时报、管理人网站 | 2019-03-25 |
| 5  | 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                         | 证券时报、管理人网站 | 2019-03-26 |
| 6  | 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        | 证券时报、管理人网站 | 2019-03-30 |
| 7  | 关于融通基金管理有限公司旗下部分开放式基金参加中国工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告             | 证券时报、管理人网站 | 2019-03-30 |
| 8  | 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 | 证券时报、管理人网站 | 2019-04-08 |
| 9  | 融通关于旗下部分开放式基金在上海好买基金销售有限公司开通基金转换业务的公告                        | 证券时报、管理人网站 | 2019-04-17 |
| 10 | 融通关于旗下部分开放式基金参加北京植信基金销售有限公司申购费率优惠活动的公告                       | 证券时报、管理人网站 | 2019-04-19 |
| 11 | 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                       | 证券时报、管理人网站 | 2019-04-26 |
| 12 | 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                         | 证券时报、管理人网站 | 2019-05-15 |
| 13 | 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                  | 证券时报、管理人网站 | 2019-05-15 |
| 14 | 关于融通旗下部分开放式基金参加中国民生银行直销银行“基金通”申购费率优惠活动的公告                    | 证券时报、管理人网站 | 2019-05-16 |
| 15 | 融通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基   | 证券时报、管理人网站 | 2019-05-17 |

|    |  |                             |            |
|----|--|-----------------------------|------------|
|    | 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                      |                             |            |
| 16 | 融通通泰保本混合型证券投资基金保本期到期安排及转型为融通增强收益债券型证券投资基金相关业务规则的公告       | 证券时报、管理人网站                  | 2019-06-15 |
| 17 | 关于融通通泰保本混合型证券投资基金修改基金合同的公告                               | 证券时报、管理人网站                  | 2019-06-15 |
| 18 | 融通通泰保本混合型证券投资基金保本期到期安排及转型为融通增强收益债券型证券投资基金相关业务规则的第二次提示性公告 | 证券时报、管理人网站                  | 2019-06-18 |
| 19 | 融通基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资科创板股票的公告                            | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、管理人网站 | 2019-06-22 |

### § 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              | 20190101-20190630       | 500,492,817.99 | -    | -    | 500,492,817.99 | 51.69    |
|  | 2              | 20190101-20190630       | 300,055,820.47 | -    | -    | 300,055,820.47 | 30.99    |
| 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。 |                |                         |                |      |      |                |          |

#### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

2019 年 6 月 15 日,本基金管理人发布了《融通通泰保本混合型证券投资基金保本期到期安排及转型为融通增强收益债券型证券投资基金相关业务规则的公告》。因未能符合保本基金存续条件,经本基金管理人与基金托管人协商一致,本基金将按照《基金合同》的约定转型为非保本的混合型基金,即“融通增强收益债券型证券投资基金”。本基金的保本周期到期操作期间为 2019 年 7 月 8 日(含)起至 2019 年 7 月 15 日(含)止。基金份额持有人可在保本期到期操作期间的交易时间里进行到期操作。在本基金保本期到期操作期间截止日的次日,即 2019 年 7 月 16 日起“融通通泰保本混合型证券投资基金”将更名为“融通增强收益债券型证券投资基金”,融通增强收益债券型证券投资基金的基金合同及托管协议亦于该日同时生效。

## § 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通泰保本混合型证券投资基金设立的文件
- (二) 《融通通泰保本混合型证券投资基金基金合同》
- (三) 《融通通泰保本混合型证券投资基金托管协议》
- (四) 《融通通泰保本混合型证券投资基金招募说明书》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