

融通增强收益债券型证券投资基金(原融通通泰保本混合型证券投资基金)

2019 年第 3 季度报告

2019 年 9 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

报告送出日期：2019 年 10 月 25 日

§ 1 重要提示

融通增强收益债券型证券投资基金由原融通通泰保本混合型证券投资基金转型而来，转型后的基金合同生效日为 2019 年 7 月 16 日。

根据《融通通泰保本混合型证券投资基金基金合同》的约定，在保本周期届满时，因未能符合保本基金存续条件，经本基金管理人与基金托管人协商一致，“融通通泰保本混合型证券投资基金”将按照基金合同的约定转型为非保本的混合型基金，即“融通增强收益债券型证券投资基金”。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，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。

详情请参阅本基金管理人于 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》。

基金管理人的董事会及董事保证本报告中所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 10 月 18 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止，其中：

转型前为 2019 年 7 月 1 日起至 7 月 15 日止，

转型后为 2019 年 7 月 16 日起至 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

2.1 基金基本情况（转型后）

基金简称	融通增强收益债券
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	2019 年 7 月 16 日

报告期末基金份额总额	50,710,065.99 份	
投资目标	在适度承担风险并保持资产流动性的基础上,通过配置债券等固定收益类金融工具,追求基金资产的长期稳定增值,通过适量投资权益类资产力争获取增强回报。	
投资策略	依据宏观经济数据和金融运行数据、货币政策、财政政策,以及债券市场和股票市场风险收益特征,分析判断市场利率水平变动趋势和股票市场走势。并根据宏观经济、基准利率水平、股票市场整体估值水平,预测债券、可转债、新股申购等大类资产下一阶段的预期收益率水平,结合各类别资产的波动性以及流动性状况分析,进行大类资产配置。	
业绩比较基准	中债综合全价(总值)指数收益率	
风险收益特征	该债券基金预期收益和预期风险高于货币市场基金,低于一般混合型基金和股票型基金。	
基金管理人	融通基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	融通增强收益债券 A	融通增强收益债券 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	46,606,952.14 份	4,103,113.85 份

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

2.1 基金基本情况(转型前)

基金简称	融通通泰保本
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
报告期末基金份额总额	84,118,665.34 份
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。	
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	
基金保证人	重庆进出口信用担保有限公司	
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	80,015,551.49 份	4,103,113.85 份

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标 (转型后)

单位: 人民币元

主要财务指标	报告期 (2019 年 7 月 16 日-2019 年 9 月 30 日)	
	融通通泰保本混合 A	融通通泰保本混合 C
1. 本期已实现收益	1,298,457.44	86,272.12
2. 本期利润	932,695.47	62,761.61
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0165	0.0153
4. 期末基金资产净值	50,188,634.32	4,256,986.28
5. 期末基金份额净值	1.0768	1.0375

注: 1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入 (不含公允价值变动收益) 扣除相关费用后的余额, 本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益;

2、本报告所列示的基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用, 计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.1 主要财务指标 (转型前)

单位: 人民币元

主要财务指标	报告期 (2019 年 7 月 1 日-2019 年 7 月 15 日)	
	融通通泰保本混合 A	融通通泰保本混合 C
1. 本期已实现收益	7,181,565.01	131,861.93
2. 本期利润	503,122.65	14,850.12
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0007	0.0036
4. 期末基金资产净值	84,830,086.07	4,194,224.67
5. 期末基金份额净值	1.060	1.022

注:1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

2、本报告所列示的基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现（转型后）

3.2.1 自基金转型以来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

融通增强收益债券 A

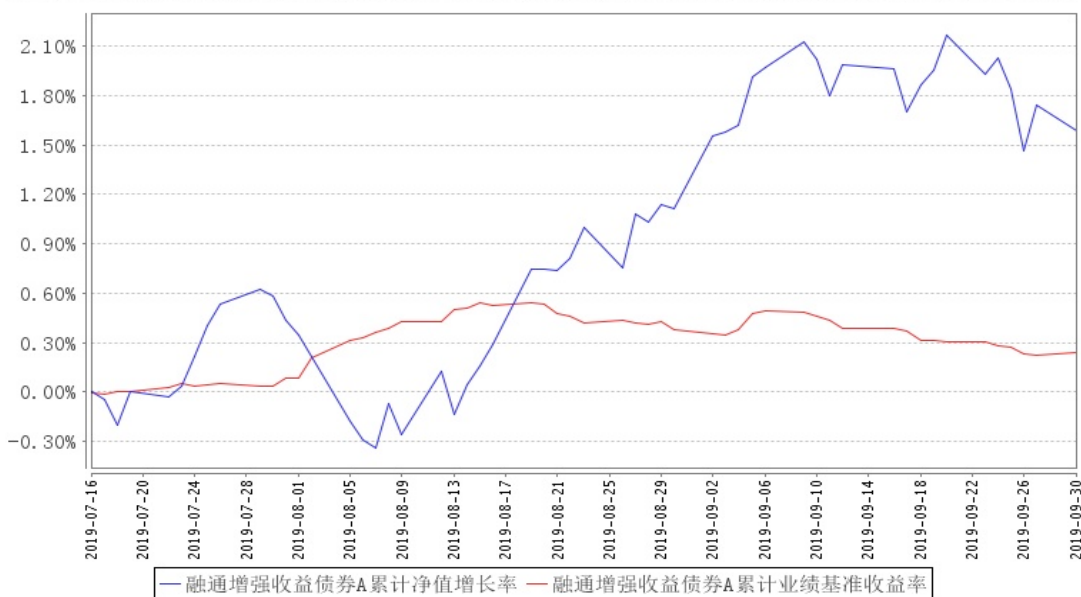
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
自 2019 年 7 月 16 日 -2019 年 9 月 30 日	1.58%	0.20%	0.24%	0.18%	1.34%	0.02%

融通增强收益债券 C

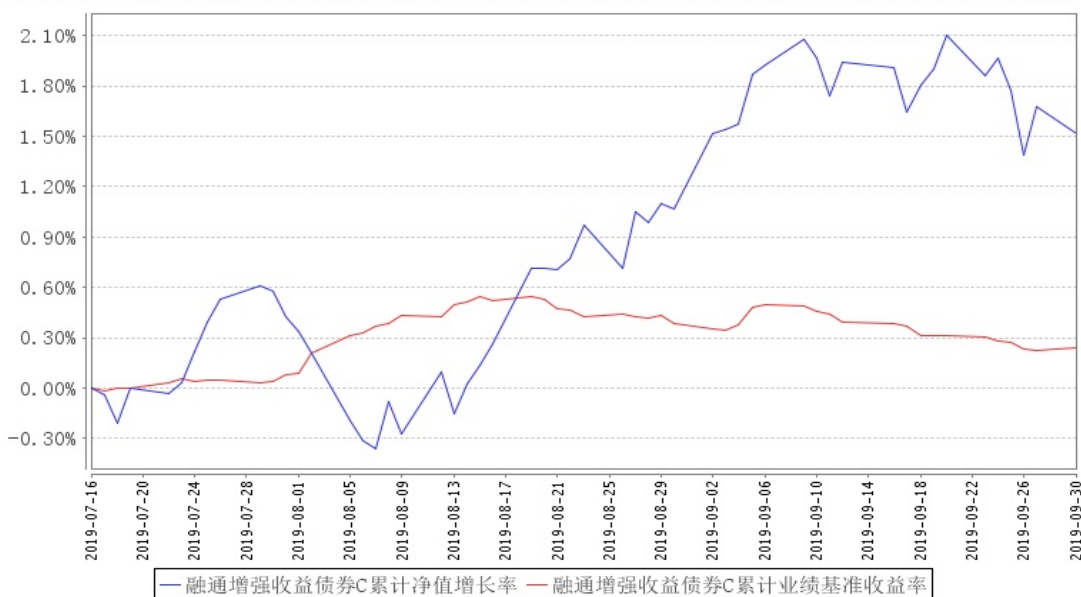
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
自 2019 年 7 月 16 日 -2019 年 9 月 30 日	1.52%	0.20%	0.24%	0.18%	1.28%	0.02%

3.2.2 自基金转型以来基金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

融通增强收益债券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



融通增强收益债券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：本基金转型后的基金合同生效日为 2019 年 7 月 16 日，至报告期末基金转型未满一年。

3.2 基金净值表现（转型前）

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

融通通泰保本混合 A

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
自 2019 年 7	0.38%	0.11%	0.11%	0.00%	0.27%	0.11%

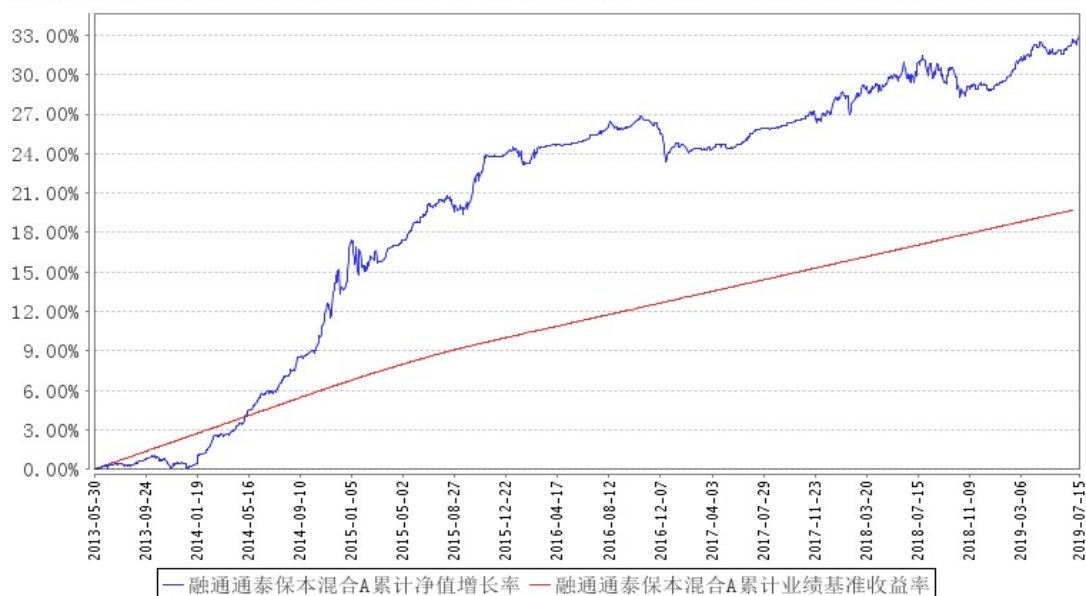
月 1 日						
-2019 年 7						
月 15 日						

融通通泰保本混合 C

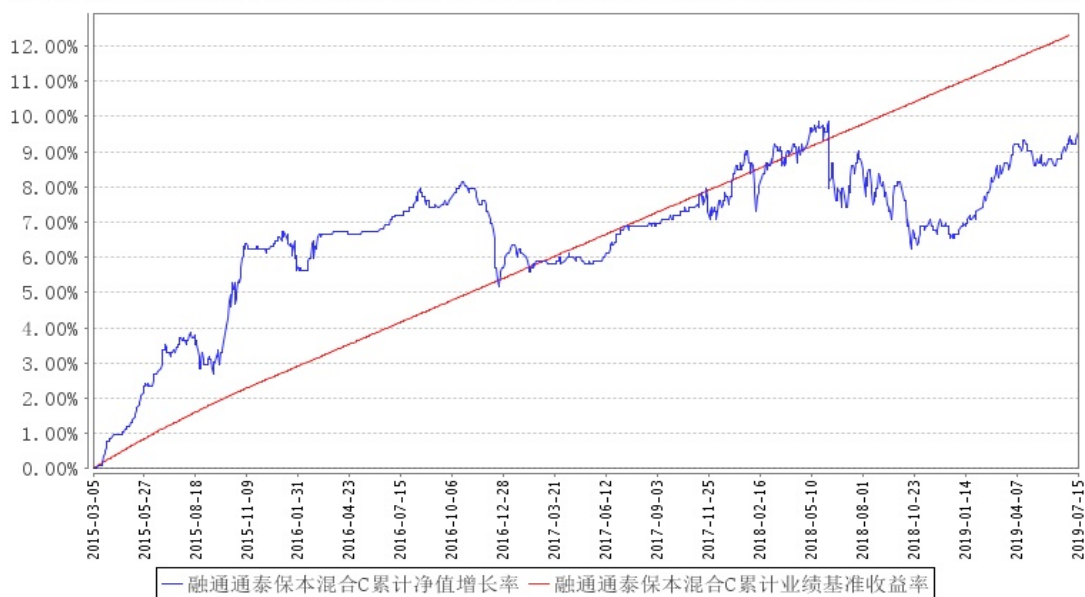
阶段	净值增长率①	净值增长率标准 差②	业绩比较基准 收益率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①—③	②—④
自 2019 年 7 月 1 日 -2019 年 7 月 15 日	0.29%	0.10%	0.11%	0.00%	0.18%	0.10%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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



§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介（转型后）

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
余志勇	本基金的基金经理、组合投资部总监	2019-07-16	-	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、研究部总监、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、融通通泰保本混合型证券投资基金基金经理，现任组合投资部总监、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、融通增强收益债券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	2019-07-16	-	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、融通通泰保本混合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、融通汇财宝货币市场基金经理、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、融通增强收益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的工作时间为计算标准。

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介（转型前）

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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	2015-03-17	2019-07-15	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

				<p>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、研究部总监、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。现任组合投资部总监、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、融通通泰保本混合型证券投资基金基金经理。</p>
王超	本基金的基金经理、固定收益部总监	2016-05-13	2019-07-15	<p>11</p> <p>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、融通汇财宝货币市场基金经理、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</p>

					基金基金经理、融通超短债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。
--	--	--	--	--	--

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的工作时间为计算标准。

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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一直坚持公平对待旗下所有投资组合的原则,并制定了相应的制度和流程,在授权、研究、决策、交易和业绩评估等各个环节保证公平交易制度的严格执行。报告期内,本基金管理人严格执行了公平交易的原则和制度。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金报告期内未发生异常交易。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

三季度债券市场收益率先下后上,7月末受到中美贸易冲突升级及海外风险偏好大幅下降的影响,债券收益率快速下行;随着市场预期内的利多因素在7-8月中旬基本释放完毕,而债券收益率曲线处于历史极低水平,导致后期收益率开始出现了反弹。从季度角度来看,三季度末收益率基本与二季度末持平。权益市场在7月底遭受风险偏好下降的打击后,市场企稳,并于8月中旬后有所反弹,在触及前期高位后,市场在9月后半段有所调整。

从组合操作来看,本基金组合在三季度逐渐提升了股票仓位。

展望后市,债券大概率处于牛市尾声阶段,经济基本面依然有利于债市,收益率存在下行空间,但从收益率及长短债利差水平来看,目前长债利率及利差均处于历史较低水平,从而导致收益率下行空间可能有限。短期内,市场面临通胀及政策发力的冲击,市场波动有可能加大。

权益方面,目前市场整体估值水平相对债市而言处于中性水平,估值修复带来的市场上涨已经结束,后续市场上扬需得到基本面的有效支撑,从上市企业利润指标来看,仍处于探底阶段,

预计市场后期将仍呈现指数震荡、个股分化的走势。

4.5 报告期内基金的业绩表现

转型后（2019 年 7 月 16 日-2019 年 9 月 30 日）：

截至本报告期末融通增强收益债券 A 基金份额净值为 1.0768 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.58%；截至本报告期末融通增强收益债券 C 基金份额净值为 1.0375 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.52%；同期业绩比较基准收益率为 0.24%。

转型前（2019 年 7 月 1 日-2019 年 7 月 15 日）：

截至本报告期末融通通泰保本混合 A 基金份额净值为 1.060 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.38%；截至本报告期末融通通泰保本混合 C 基金份额净值为 1.022 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.29%；同期业绩比较基准收益率为 0.11%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内，本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万的情形。

§ 5 投资组合报告（转型后）

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	11,007,685.96	17.61
	其中：股票	11,007,685.96	17.61
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	45,757,461.60	73.20
	其中：债券	45,757,461.60	73.20
	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	-	-
	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	725,728.28	1.16
8	其他资产	5,018,010.22	8.03
9	合计	62,508,886.06	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	380,354.00	0.70
B	采矿业	-	-

C	制造业	6,882,986.68	12.64
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	333,047.00	0.61
G	交通运输、仓储和邮政业	199,699.00	0.37
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	792,942.50	1.46
J	金融业	894,249.68	1.64
K	房地产业	335,644.00	0.62
L	租赁和商务服务业	1,042,272.00	1.91
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	146,491.10	0.27
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	11,007,685.96	20.22

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601888	中国国旅	11,200	1,042,272.00	1.91
2	600031	三一重工	34,700	495,516.00	0.91
3	600801	华新水泥	24,000	452,400.00	0.83
4	000338	潍柴动力	34,600	388,212.00	0.71
5	002475	立讯精密	13,160	352,161.60	0.65
6	000661	长春高新	800	315,488.00	0.58
7	000568	泸州老窖	3,700	315,314.00	0.58
8	600585	海螺水泥	7,600	314,184.00	0.58
9	600030	中信证券	11,900	267,512.00	0.49
10	600276	恒瑞医药	2,940	237,199.20	0.44

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	29,831,460.00	54.79
	其中：政策性金融债	28,030,740.00	51.48
4	企业债券	13,618,010.00	25.01
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-

7	可转债（可交换债）	2,307,991.60	4.24
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	45,757,461.60	84.04

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	108901	农发 1801	179,000	17,910,740.00	32.90
2	018007	国开 1801	100,000	10,120,000.00	18.59
3	122467	15 万达 02	40,000	4,105,200.00	7.54
4	136140	16 富力 01	20,000	2,019,600.00	3.71
5	136830	16 中信 G1	18,000	1,800,720.00	3.31

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

无。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

无。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体报告期内没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

5.11.2 本基金投资的前十名股票未超出本基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	20,939.94
2	应收证券清算款	4,000,000.00
3	应收股利	-
4	应收利息	996,551.73
5	应收申购款	518.55
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,018,010.22

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	110054	通威转债	366,780.00	0.67

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

§ 5 投资组合报告（转型前）

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	10,829,015.38	11.04
	其中：股票	10,829,015.38	11.04
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	8,318,054.15	8.48
	其中：债券	8,318,054.15	8.48
	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	-	-
	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	78,543,271.77	80.05

8	其他资产	432,242.12	0.44
9	合计	98,122,583.42	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	188,658.00	0.21
B	采矿业	-	-
C	制造业	6,827,396.54	7.67
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	435,742.25	0.49
G	交通运输、仓储和邮政业	171,223.00	0.19
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	811,400.45	0.91
J	金融业	878,056.34	0.99
K	房地产业	419,348.00	0.47
L	租赁和商务服务业	869,418.00	0.98
M	科学研究和技术服务业	75,083.40	0.08
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	114,809.40	0.13
R	文化、体育和娱乐业	37,880.00	0.04
S	综合	-	-
	合计	10,829,015.38	12.16

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	000338	潍柴动力	88,000	1,073,600.00	1.21
2	601888	中国国旅	9,900	869,418.00	0.98
3	600031	三一重工	34,700	466,021.00	0.52
4	600801	华新水泥	20,300	419,804.00	0.47
5	000063	中兴通讯	10,700	351,709.00	0.40
6	002463	沪电股份	20,983	299,637.24	0.34
7	000568	泸州老窖	3,100	271,188.00	0.30
8	002157	正邦科技	13,200	269,940.00	0.30
9	601933	永辉超市	26,200	262,000.00	0.29
10	002798	帝欧家居	12,200	261,934.00	0.29

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
----	------	---------	--------------

1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	4,002,800.00	4.50
	其中：政策性金融债	4,002,800.00	4.50
4	企业债券	4,302,580.00	4.83
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	12,674.15	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	8,318,054.15	9.34

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	112419	16 河钢 01	43,000	4,302,580.00	4.83
2	108901	农发 1801	40,000	4,002,800.00	4.50
3	123027	蓝晓转债	115	12,674.15	0.01

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

无。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

无。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体报告期内没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

5.11.2 本基金投资的前十名股票未超出本基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	19,847.85
2	应收证券清算款	21,038.36
3	应收股利	-
4	应收利息	391,355.91
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	432,242.12

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

§ 6 开放式基金份额变动（转型后）

单位：份

项目	融通增强收益债券 A	融通增强收益债券 C
基金合同生效日（2019 年 7 月 16 日）持有的基金份额	80,015,551.49	4,103,113.85
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	377,706.75	-
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	33,786,306.10	-

报告期期末基金份额总额	46,606,952.14	4,103,113.85
-------------	---------------	--------------

§ 6 开放式基金份额变动（转型前）

单位：份

项目	融通通泰保本混合 A	融通通泰保本混合 C
报告期期初基金份额总额	964,196,793.40	4,103,113.85
报告期期间基金总申购份额	9,755.54	-
减：报告期期间基金总赎回份额	884,190,997.45	-
报告期期末基金份额总额	80,015,551.49	4,103,113.85

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型后）

无。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型前）

无。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息（转型后）

无。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息（转型前）

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20190701-20190710	300,055,820.47	-	300,055,820.47	-	-
	2	20190701-20190708	500,492,817.99	-	500,492,817.99	-	-
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。							

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

（一）《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》

（二）《融通增强收益债券型证券投资基金基金合同》

（三）《融通增强收益债券型证券投资基金托管协议》

（四）《融通增强收益债券型证券投资基金招募说明书》

- (五) 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
- (六) 《融通通泰保本混合型证券投资基金基金合同》
- (七) 《融通通泰保本混合型证券投资基金托管协议》
- (八) 《融通通泰保本混合型证券投资基金招募说明书》及其更新
- (九) 融通基金管理有限公司业务资格批件和营业执照
- (十) 报告期内在指定报刊上披露的各项公告

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

9.3 查阅方式

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

融通基金管理有限公司

2019 年 10 月 25 日