

融通增润三个月定期开放债券型发起式证券投资基金

2020 年中期报告

2020 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：上海银行股份有限公司

送出日期：2020 年 8 月 27 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。本中期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。

基金托管人上海银行股份有限公司根据融通增润三个月定期开放债券型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）基金合同规定，于 2020 年 8 月 26 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 2020 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

| | |
|---|-----------|
| § 1 重要提示及目录 | 2 |
| 1.1 重要提示 | 2 |
| 1.2 目录 | 3 |
| § 2 基金简介 | 5 |
| 2.1 基金基本情况 | 5 |
| 2.2 基金产品说明 | 5 |
| 2.3 基金管理人和基金托管人 | 5 |
| 2.4 信息披露方式 | 5 |
| 2.5 其他相关资料 | 6 |
| § 3 主要财务指标和基金净值表现 | 6 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标 | 6 |
| 3.2 基金净值表现 | 6 |
| § 4 管理人报告 | 7 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况 | 7 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 | 9 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 | 9 |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 | 9 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 | 10 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 | 10 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 | 11 |
| 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 | 11 |
| § 5 托管人报告 | 11 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 | 11 |
| 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 | 11 |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见 | 11 |
| § 6 中期财务会计报告（未经审计） | 11 |
| 6.1 资产负债表 | 11 |
| 6.2 利润表 | 13 |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表 | 14 |
| 6.4 报表附注 | 14 |
| § 7 投资组合报告 | 33 |
| 7.1 期末基金资产组合情况 | 33 |
| 7.2 期末按债券品种分类的债券投资组合 | 33 |
| 7.3 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 | 34 |
| 7.4 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 | 34 |
| 7.5 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贵金属投资明细 | 34 |
| 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权证投资明细 | 34 |
| 7.7 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 | 34 |
| 7.8 投资组合报告附注 | 34 |

| | |
|--|-----------|
| § 8 基金份额持有人信息 | 35 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 35 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 35 |
| 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 | 35 |
| 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况 | 36 |
| § 9 开放式基金份额变动 | 36 |
| § 10 重大事件揭示 | 36 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 | 36 |
| 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 | 36 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 37 |
| 10.4 基金投资策略的改变 | 37 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 | 37 |
| 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 | 37 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 | 37 |
| 10.8 其他重大事件 | 38 |
| § 11 影响投资者决策的其他重要信息 | 38 |
| 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 | 38 |
| § 12 备查文件目录 | 39 |
| 12.1 备查文件目录 | 39 |
| 12.2 存放地点 | 39 |
| 12.3 查阅方式 | 39 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|-------------------------|
| 基金名称 | 融通增润三个月定期开放债券型发起式证券投资基金 |
| 基金简称 | 融通增润三个月定开债券发起式 |
| 基金主代码 | 007516 |
| 基金运作方式 | 契约型、定期开放式、发起式 |
| 基金合同生效日 | 2019 年 11 月 8 日 |
| 基金管理人 | 融通基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 上海银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 3,009,999,000.00 份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|--|
| 投资目标 | 本基金在严格控制风险并保持基金资产良好流动性的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值。 |
| 投资策略 | 本基金在封闭期与开放期采取不同的投资策略。本基金封闭期内的具体投资策略包括资产配置策略、利率策略、信用策略、类属配置与个券选择策略、资产支持证券投资策略等部分。开放期内，本基金为保持较高的组合流动性，方便投资人安排投资，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，将主要投资于高流动性的投资品种，防范流动性风险，满足开放期流动性的需求。 |
| 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 | 本基金为债券型基金，其长期平均预期风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。 |

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 | 上海银行股份有限公司 |
| 信息披露 负责人 | 姓名 | 涂卫东 | 周直毅 |
| | 联系电话 | (0755) 26948666 | 021-68475608 |
| | 电子邮箱 | service@mail.rtfund.com | custody@bosc.cn |
| 客户服务电话 | | 400-883-8088、(0755) 26948088 | 95594 |
| 传真 | | (0755) 26935005 | 021-68476936 |
| 注册地址 | | 深圳市南山区华侨城汉唐大厦 13、14 层 | 中国（上海）自由贸易试验区银 城中路 168 号 |
| 办公地址 | | 深圳市南山区华侨城汉唐大厦 13、14、15 层 | 中国（上海）自由贸易试验区银 城中路 168 号 37 层、42 层 |
| 邮政编码 | | 518053 | 200120 |
| 法定代表人 | | 高峰 | 金煜 |

2.4 信息披露方式

| | |
|---------------------|---|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 证券日报 |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | http://www.rtfund.com |
| 基金中期报告备置地点 | 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、15 层 |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2020年1月1日-2020年6月30日) |
|---------------|---------------------------|
| 本期已实现收益 | 49,067,688.14 |
| 本期利润 | 59,054,774.31 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0196 |
| 本期加权平均净值利润率 | 1.91% |
| 本期基金份额净值增长率 | 1.94% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2020年6月30日) |
| 期末可供分配利润 | 10,836,648.24 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0036 |
| 期末基金资产净值 | 3,042,495,467.31 |
| 期末基金份额净值 | 1.0108 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2020年6月30日) |
| 基金份额累计净值增长率 | 2.72% |

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

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

（3）期末可供分配基金份额利润=期末可供分配利润÷期末基金份额总额。其中期末可供分配利润：如果期末未分配利润的未实现部分为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分，如果期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润（已实现部分扣除未实现部分）。

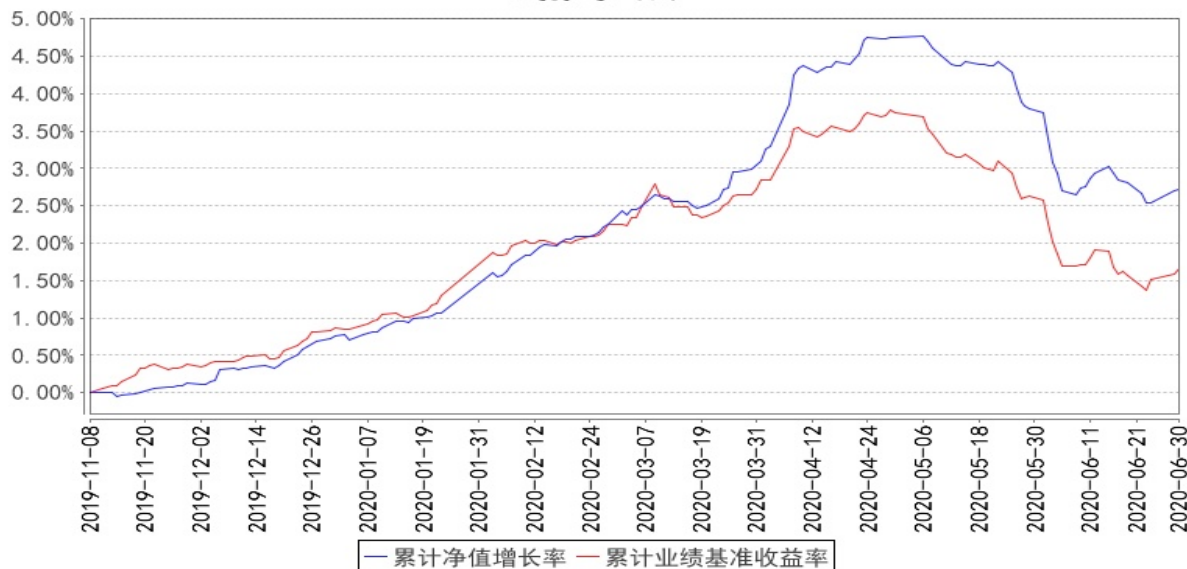
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去一个月 | -1.04% | 0.13% | -0.94% | 0.12% | -0.10% | 0.01% |
| 过去三个月 | -0.32% | 0.14% | -1.04% | 0.12% | 0.72% | 0.02% |
| 过去六个月 | 1.94% | 0.12% | 0.79% | 0.11% | 1.15% | 0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | 2.72% | 0.10% | 1.66% | 0.10% | 1.06% | 0.00% |

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

融通增润三个月定开债券发起式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：1、本基金合同生效日为 2019 年 11 月 8 日，至报告期末基金成立未满 1 年。

2、本基金的建仓期为自合同生效日起 6 个月，截止建仓期结束，各项资产配置比例符合规定。

§ 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 2020 年 6 月 30 日，公司共管理七十三只开放式基金：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)、融通通盈灵活配置混合型证券投资基金、融通通慧混合型证券投资基金、融通增祥三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、融通增强收益债券型证券投资基金、融通消费升级混合型证券投资基金、融通量化多策略灵活配置混合型证券投资基金、融通通昊三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、融通增润三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、融通增享纯债债券型证券投资基金、融通产业趋势股票型证券投资基金、融通中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、融通产业趋势先锋股票型证券投资基金、融通通启一年定期开放债券型证券投资基金、融通通益混合型证券投资基金、融通通远三个月定期开放债券型证券投资基金。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期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|-----|----------|-------------|------|--------|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 许富强 | 本基金的基金经理 | 2019/11/8 | - | 9 | 许富强先生, 北京大学经济学硕士, 9 年证券、基金行业从业经历, 具有基金从业资格。2011 年 7 月加入融通基金管理有限公司, 历任固定收益部研究员、专户投资经理、融通通穗 |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|---|
| | | | | | 债券型证券投资基金基金经理、融通增祥债券型证券投资基金基金经理、融通通优债券型证券投资基金基金经理，现任融通通鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理、融通通安债券型证券投资基金基金经理、融通通宸债券型证券投资基金基金经理、融通可转债债券型证券投资基金基金经理、融通增祥三个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理、融通增享纯债债券型证券投资基金基金经理、融通增润三个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理、融通增鑫债券型证券投资基金基金经理、融通中债 1-3 年国开行债券指数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、基金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遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一直坚持公平对待旗下所有投资组合的原则,在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等各个环节保证公平交易制度的严格执行。

本基金管理人对报告期内不同时间窗下(日内、3日内、5日内)公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行了分析,各投资组合的同向交易价差均处于合理范围之内。

报告期内,本基金管理人严格执行了公平交易的原则和制度。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金报告期内未发生异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年债券市场上演过山车行情,在新冠疫情的影响下,国内经济下行明显,货币政策大幅宽松,收益率在 4 月到达本轮行情低点,后续在宏观经济复苏预期和央行流动性收紧的利空下,

收益率逐步走高，目前已经回到去年年底的水平。4 月份，在央行大幅降准降息政策刺激下，债市收益率逐步下行，特别是央行调降超额存款准备金利率 37BP，市场将其解读为资金利率中枢下移，导致短端收益率快速下行。但从 5、6 月份的情况来看，市场这一理解明显存在偏差。5、6 月份货币政策未出现进一步放松，同时政策对前期宽松政策环境下产生的资金空转套利进行了一系列纠偏，同时恰逢半年末流动性收紧，资金利率回升。债市出现一轮快速大幅度的回调。除了货币政策边际变化以外，二季度疫情逐步平缓，复工复产持续推进，部分领域的复苏超预期也是本轮债市回调的原因之一。

组合以高资质信用债和中短久期利率债为主。短期来看，货币市场利率已经回到中枢水平，流动性仍然充裕，债券组合仍将以票息收入为主，维持中高杠杆水平，同时我们也将继续关注债市的交易性机会，在适当机会通过中长久期利率品种博取超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.0108 元；本报告期基金份额净值增长率为 1.94%，业绩比较基准收益率为 0.79%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望三季度，我们认为经济秩序逐步恢复正常，国内经济环比仍处在改善通道当中，政策引导下逆周期基建的发力以及赶工需求支撑经济走强。在经济重回正轨之前，我们对于货币政策并未出现转向，而短端利率的重新锚定带来的调整已基本结束，未来针对疫情后经济稳态的预期尚不明确，债券市场仍存在一定机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金的估值业务严格按照《融通基金管理有限公司证券投资基金估值业务原则和程序》进行，公司设立由研究部、风险管理部、登记清算部、固定收益部、国际业务部和监察稽核部共同组成的估值委员会，通过参考行业协会估值意见、参考独立第三方估值服务机构的估值数据等一种或多种方式的有效结合，减少或避免估值偏差的发生。估值委员会的相关成员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经历。

估值委员会定期对经济环境是否发生重大变化、证券发行机构是否发生影响证券价格的重大事件以及估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性及其适用性的情况后及时修订估值方法，以保证其持续适用。估值政策和程序的修订须经公司总经理办公会议审批后方可实施。基金在采用新投资策略或投资新品种时，应评价现有估值政策和程序的适用性。其中研究部负责定期对经济环境是否发生重大变化、证券发行机构是否发生影响证券价格的重大事件以及估值政策和程序进行评价，金融工程小组负责估值方法的研究、价格的计算及复核，登记清算

部进行具体的估值核算并与基金托管人核对，同时负责对外进行信息披露。监察稽核部负责基金估值业务的事前、事中及事后的审核工作。

截至本报告期末，本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司、中证指数有限公司签订服务协议，由其提供相关债券品种和流通受限股票的估值参考数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金于 2020 年 6 月 18 日实施 2020 年第一次利润分配，以 2020 年 6 月 10 日的可分配收益为基准，每 10 份基金份额派发红利 0.164 元。

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

本报告期内本基金管理人无应说明的预警信息。

§ 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，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同以及托管协议的有关约定，诚实、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告期，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，融通增润三个月定期开放债券型发起式证券投资基金对基金份额持有人进行了 1 次利润分配，分配金额为 49,363,983.60 元。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核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，认为复核内容真实、准确、完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 中期财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：融通增润三个月定期开放债券型发起式证券投资基金

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2020 年 6 月 30 日 | 上年度末 2019 年 12 月 31 日 |
|-----|-----|------------------------|--------------------------|
| 资产： | | | |

| | | | |
|-----------------|------------|---------------------------|-----------------------------|
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 1,669,836.52 | 1,869,865.24 |
| 结算备付金 | | - | 71,296,889.64 |
| 存出保证金 | | 10,810.37 | 88,266.77 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 3,960,840,000.00 | 3,321,482,000.00 |
| 其中：股票投资 | | - | - |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 3,732,749,000.00 | 3,321,482,000.00 |
| 资产支持证券投资 | | 228,091,000.00 | - |
| 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 | 20,000,150.00 | - |
| 应收证券清算款 | | 50,000,000.00 | - |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 52,877,641.85 | 57,039,651.86 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | - | - |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 4,085,398,438.74 | 3,451,776,673.51 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2020年6月30日 | 上年度末 2019年12月31日 |
| 负 债： | | | |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | 6.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | 991,126,859.80 | 417,661,013.50 |
| 应付证券清算款 | | 50,063,593.61 | - |
| 应付赎回款 | | - | - |
| 应付管理人报酬 | | 756,470.90 | 769,854.17 |
| 应付托管费 | | 252,156.97 | 256,618.06 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付交易费用 | 6.4.7.7 | 30,841.72 | 15,033.86 |
| 应交税费 | | 71,351.25 | 39,941.89 |
| 应付利息 | | 463,408.02 | 229,535.43 |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.8 | 138,289.16 | - |
| 负债合计 | | 1,042,902,971.43 | 418,971,996.91 |
| 所有者权益： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.9 | 3,009,999,000.00 | 3,009,999,000.00 |
| 未分配利润 | 6.4.7.10 | 32,496,467.31 | 22,805,676.60 |
| 所有者权益合计 | | 3,042,495,467.31 | 3,032,804,676.60 |
| 负债和所有者权益总计 | | 4,085,398,438.74 | 3,451,776,673.51 |

注：1、报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0108 元，基金份额总额

3,009,999,000.00 份。

2、本基金合同生效日为 2019 年 11 月 8 日，截至报告期末本基金合同生效未满一年，本报告财务报表附注均无同期对比数据。

6.2 利润表

会计主体：融通增润三个月定期开放债券型发起式证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |
|---------------|------------|--|
| 一、收入 | | 71,760,883.62 |
| 1. 利息收入 | | 60,725,723.70 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.11 | 52,156.42 |
| 债券利息收入 | | 56,645,883.24 |
| 资产支持证券利息收入 | | 4,006,605.13 |
| 买入返售金融资产收入 | | 21,078.91 |
| 证券出借利息收入 | | - |
| 其他利息收入 | | - |
| 2. 投资收益 | | 1,048,073.75 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.12 | - |
| 基金投资收益 | | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.13 | 1,048,073.75 |
| 资产支持证券投资收益 | | - |
| 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 | - |
| 3. 公允价值变动收益 | 6.4.7.17 | 9,987,086.17 |
| 4. 汇兑收益 | | - |
| 5. 其他收入 | 6.4.7.18 | - |
| 减：二、费用 | | 12,706,109.31 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 4,610,534.45 |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 1,536,844.86 |
| 3. 销售服务费 | | - |
| 4. 交易费用 | 6.4.7.19 | 2,237.41 |
| 5. 利息支出 | | 6,357,080.47 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 6,357,080.47 |
| 6. 税金及附加 | | 44,360.42 |
| 7. 其他费用 | 6.4.7.20 | 155,051.70 |
| 三、利润总额 | | 59,054,774.31 |
| 减：所得税费用 | | - |
| 四、净利润 | | 59,054,774.31 |

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：融通增润三个月定期开放债券型发起式证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 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） | 3,009,999,000.00 | 22,805,676.60 | 3,032,804,676.60 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 59,054,774.31 | 59,054,774.31 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 | - | - | - |
| 其中：1. 基金申购款 | - | - | - |
| 2. 基金赎回款 | - | - | - |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动 | - | -49,363,983.60 | -49,363,983.60 |
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 3,009,999,000.00 | 32,496,467.31 | 3,042,495,467.31 |

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
基金管理人负责人

颜锡廉
主管会计工作负责人

刘美丽
会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

融通增润三个月定期开放债券型发起式证券投资基金(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[2019]937号《关于准予融通增润三个月定期开放债券型发起式证券投资基金注册的批复》核准,由融通基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《融通增润三个月定期开放债券型发起式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,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币3,009,999,000.00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(2019)第0656号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《融通增润三个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》于2019年11月8日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为3,009,999,000.00份基金份额,无认购资金利息折合基金份额。本基金的基金管理人为融通基金管理有限公司,基金托管人为上海银行股份有限公司。

本基金以定期开放方式运作，即本基金以封闭运作和开放运作结合的方式运作。本基金的封闭期为自《基金合同》生效之日起(包括《基金合同》生效之日)或自每一开放期结束之日次日起(包括该日)三个月的期间。本基金的开放期为自每个封闭期结束之日后第一个工作日起(含该日)一至二十个工作日。本基金封闭期内不办理申购与赎回业务，也不上市交易。

本基金为发起式基金，发起资金认购部分为 10,000,000.00 份基金份额，发起资金认购方承诺使用发起资金认购的基金份额持有期限不少于 3 年。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《融通增润三个月定期开放债券型发起式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固定收益类品种，包括国债、央行票据、金融债、地方政府债、企业债、公司债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、次级债券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款等)、货币市场工具、同业存单、资产支持证券、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金不投资于权益类资产，也不投资于可转换债券、可交换债券。本基金投资组合中，债券资产的比例不低于基金资产的 80%，但应开放期流动性需要，为保护基金份额持有人利益，在每次开放期开始前 10 个工作日、开放期及开放期结束后 10 个工作日的期间内，基金投资不受上述比例限制。在开放期内，本基金每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，持有的现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)及到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%；在封闭期内，本基金不受上述 5%的限制，但每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)。本基金的业绩比较基准为：中债综合全价(总值)指数收益率。

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<年度报告和中期报告>》、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》、《融通增润三个月定期开放债券型发起式证券投资基金》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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

基金的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 2020 年 6 月 30 日的

财务状况以及 2020 年 1 月 1 日至 6 月 30 日期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日止期间。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的债券投资和资产支持证券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；

或者(3) 该金融资产已转移, 虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬, 但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时, 其账面价值与收到的对价的差额, 计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时, 终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额, 计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的债券投资和资产支持证券投资按如下原则确定公允价值并进行估值:

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值; 估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的, 按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的, 应对市场交易价格进行调整, 确定公允价值。与上述投资品种相同, 但具有不同特征的, 应以相同资产或负债的公允价值为基础, 并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等, 如果该限制是针对资产持有者的, 那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外, 基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场, 采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时, 优先使用可观察输入值, 只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下, 才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件, 应对估值进行调整并确定公允价值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的; 且 2) 交易双方准备按净额结算时, 金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时, 申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时, 申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的

金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若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，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、

经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1)对于证券交易所上市的债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术进行估值。

(2)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(资产支持证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号

《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关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。

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

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

(4) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育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 2020 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款 | 1,669,836.52 |
| 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 | 1,669,836.52 |

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2020 年 6 月 30 日 | | |
|----|------------------------|------|--------|
| | 成本 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | - | - | - |

| | | | |
|---------------|------------------|------------------|------------------|
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | 1,314,872,149.59 | 1,319,939,000.00 |
| | 银行间市场 | 2,394,308,031.34 | 2,412,810,000.00 |
| | 合计 | 3,709,180,180.93 | 3,732,749,000.00 |
| 资产支持证券 | 230,000,000.00 | 228,091,000.00 | -1,909,000.00 |
| 基金 | - | - | - |
| 其他 | - | - | - |
| 合计 | 3,939,180,180.93 | 3,960,840,000.00 | 21,659,819.07 |

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 2020年6月30日 | |
|-------|-------------------|-----------|
| | 账面余额 | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | - | - |
| 银行间市场 | 20,000,150.00 | - |
| 合计 | 20,000,150.00 | - |

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 2020年6月30日 |
|------------|-------------------|
| 应收活期存款利息 | 1,379.14 |
| 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 | - |
| 应收债券利息 | 52,772,092.57 |
| 应收资产支持证券利息 | 100,043.72 |
| 应收买入返售证券利息 | 4,121.52 |
| 应收申购款利息 | - |
| 应收黄金合约拆借孳息 | - |
| 应收出借证券利息 | - |
| 其他 | 4.90 |
| 合计 | 52,877,641.85 |

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 2020年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | - |
| 银行间市场应付交易费用 | 30,841.72 |
| 合计 | 30,841.72 |

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2020年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | - |
| 应付证券出借违约金 | - |
| 预提费用 | 138,289.16 |
| 合计 | 138,289.16 |

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2020年1月1日至2020年6月30日 | |
|---------------|----------------------------|------------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 3,009,999,000.00 | 3,009,999,000.00 |
| 本期申购 | - | - |
| 本期赎回（以“-”号填列） | - | - |
| 本期末 | 3,009,999,000.00 | 3,009,999,000.00 |

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|----------------|---------------|----------------|
| 上年度末 | 11,132,943.70 | 11,672,732.90 | 22,805,676.60 |
| 本期利润 | 49,067,688.14 | 9,987,086.17 | 59,054,774.31 |
| 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 | -49,363,983.60 | - | -49,363,983.60 |
| 本期末 | 10,836,648.24 | 21,659,819.07 | 32,496,467.31 |

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|----|----|
| | |

| | 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------|
| 活期存款利息收入 | 34,106.47 |
| 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 | 17,406.98 |
| 其他 | 642.97 |
| 合计 | 52,156.42 |

6.4.7.12 股票投资收益

无。

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2020年1月1日至2020年6月30日 |
|-------------------------|----------------------------|
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额 | 317,739,898.50 |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 311,946,691.65 |
| 减：应收利息总额 | 4,745,133.10 |
| 买卖债券差价收入 | 1,048,073.75 |

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

无。

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |
|--------------|---------------------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | 9,987,086.17 |
| 股票投资 | - |
| 债券投资 | 11,896,086.17 |
| 资产支持证券投资 | -1,909,000.00 |
| 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 | 9,987,086.17 |

6.4.7.18 其他收入

无。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2020年1月1日至2020年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 62.41 |
| 银行间市场交易费用 | 2,175.00 |
| 合计 | 2,237.41 |

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2020年1月1日至2020年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 审计费用 | 69,616.82 |
| 信息披露费 | 59,672.34 |
| 证券出借违约金 | - |
| 银行费用 | 3,962.54 |
| 账户维护费 | 21,000.00 |
| 其他 | 800.00 |
| 合计 | 155,051.70 |

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

| 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 |
| 上海银行股份有限公司（“上海银行”） | 基金托管人 |
| 新时代证券股份有限公司（“新时代证券”） | 基金管理人的股东 |
| 日兴资产管理有限公司 | 基金管理人的股东 |
| 深圳市融通资本管理股份有限公司 | 基金管理人的子公司 |
| 融通国际资产管理有限公司 | 基金管理人的子公司 |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期的关联方交易

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2020年1月1日至2020年6月30日 |
|-----------------|----------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 4,610,534.45 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | - |

注：支付基金管理人融通基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.30% 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 X 0.30% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2020年1月1日至2020年6月30日 |
|----------------|----------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 1,536,844.86 |

注：支付基金托管人上海银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.10% 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：

日基金托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.10% / 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

| 项目 | 本期 2020年1月1日至 2020年6月30日 |
|----------------------------|--------------------------------|
| 基金合同生效日（2019年11月8日）持有的基金份额 | 10,000,000.00 |

| | |
|---------------------|---------------|
| 报告期初持有的基金份额 | 10,000,000.00 |
| 报告期内申购/买入总份额 | - |
| 报告期内因拆分变动份额 | - |
| 减：报告期内赎回/卖出总份额 | - |
| 报告期末持有的基金份额 | 10,000,000.00 |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 0.33% |

注：本基金合同生效日为 2019 年 11 月 8 日，基金管理人持有份额为发起认购份额。

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

份额单位：份

| 关联方名称 | 本期末 2020 年 6 月 30 日 | | 上年度末 2019 年 12 月 31 日 | |
|-------|------------------------|------------------------------|--------------------------|------------------------------|
| | 持有的 基金份额 | 持有的基金份额 占基金总份额的比 例 (%) | 持有的 基金份额 | 持有的基金份额 占基金总份额的比 例 (%) |
| 上海银行 | 2,999,999,000.00 | 99.67 | 2,999,999,000.00 | 99.67 |

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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 | |
|---------|---------------------------------------|-----------|
| | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 上海银行-活期 | 1,669,836.52 | 34,106.47 |

注：本基金的银行存款由基金托管人上海银行保管，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

单位：人民币元

| 序号 | 权益 登记日 | 除息日 | | 每 10 份基金 份额分 红数 | 现金形式 发放总额 | 再投 资形 式 发 放 总 额 | 本期利润分配 合计 | 备注 |
|----|-----------|-----|-----------|--------------------------|---------------|-----------------------------------|---------------|----|
| | | 场内 | 场外 | | | | | |
| 1 | 2020/6/18 | - | 2020/6/18 | 0.1640 | 49,363,983.60 | - | 49,363,983.60 | - |
| 合计 | - | - | - | 0.1640 | 49,363,983.60 | - | 49,363,983.60 | - |

6.4.12 期末(2020 年 6 月 30 日)本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

截至本报告期末 2020 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 600,126,859.80 元，是以如下债券作为抵押：

金额单位：人民币元

| 债券代码 | 债券名称 | 回购到期日 | 期末估值单价 | 数量（张） | 期末估值总额 |
|--------|----------|----------|--------|-----------|----------------|
| 160417 | 16 农发 17 | 2020-7-1 | 101.91 | 5,790,000 | 590,058,900.00 |
| 160417 | 16 农发 17 | 2020-7-1 | 101.91 | 511,000 | 52,076,010.00 |
| 合计 | | | | 6,301,000 | 642,134,910.00 |

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2020 年 6 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 391,000,000.00 元，分别于 2020 年 7 月 1 日、2020 年 7 月 6 日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.13 金融工具风险及管理**6.4.13.1 风险管理政策和组织架构**

本基金是债券型基金，其长期平均预期风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。本基金主要投资于固定收益类金融工具。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过管理及信息系统持续监控上述各类风险。本基金在严格控制风险的基础上，追求基金资产的长期稳定增值。

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行上海银行，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 2020年6月30日 | 上年度末 2019年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| AAA | 2,009,883,000.00 | 1,469,319,000.00 |
| AAA 以下 | 61,074,000.00 | - |
| 未评级 | 1,516,307,000.00 | 1,706,798,000.00 |
| 合计 | 3,587,264,000.00 | 3,176,117,000.00 |

注：1. 未评级部分为政策性金融债。

2. 债券信用评级取自第三方评级机构的评级。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末 2020年6月30日 | 上年度末 2019年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| AAA | 228,091,000.00 | |
| AAA 以下 | - | |
| 未评级 | - | |
| 合计 | 228,091,000.00 | |

注：债券信用评级取自第三方评级机构的评级。

6.4.13.2.3 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末 2020年6月30日 | 上年度末 2019年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| AAA | - | - |
| AAA 以下 | - | - |
| 未评级 | 145,485,000.00 | 145,365,000.00 |
| 合计 | 145,485,000.00 | 145,365,000.00 |

注：债券信用评级取自第三方评级机构的评级。

6.4.13.3 流动性风险

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

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人于开放期内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 2020 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额中有 991,126,859.80 元将在一个月以内到期且计息外，本基金所承担的其他金融负债的合同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》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时间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公司的证券不得超过该证券的 10%(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 2020 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 2020 年 6 月 30 日，本基金最后交易日的组合资产中 7 个工作日可变现资产账面金额与净赎回金额符合

上述法规要求。

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2020年6月30日 | 1年以内 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |
|-------------------|----------------|------------------|----------------|----------------|------------------|
| 资产 | | | | | |
| 银行存款 | 1,669,836.52 | - | - | - | 1,669,836.52 |
| 存出保证金 | 10,810.37 | - | - | - | 10,810.37 |
| 交易性金融资产 | 507,309,000.00 | 3,225,440,000.00 | 228,091,000.00 | - | 3,960,840,000.00 |
| 买入返售金融资产 | 20,000,150.00 | - | - | - | 20,000,150.00 |
| 应收利息 | - | - | - | 52,877,641.85 | 52,877,641.85 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | 50,000,000.00 | 50,000,000.00 |
| 资产总计 | 528,989,796.89 | 3,225,440,000.00 | 228,091,000.00 | 102,877,641.85 | 4,085,398,438.74 |
| 负债 | | | | | |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 756,470.90 | 756,470.90 |
| 应付托管费 | - | - | - | 252,156.97 | 252,156.97 |
| 应付证券清算款 | - | - | - | 50,063,593.61 | 50,063,593.61 |

| | | | | | |
|---------------------|-----------------|------------------|----------------|---------------|------------------|
| 卖出回购金融资产款 | 991,126,859.80 | - | - | - | 991,126,859.80 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 30,841.72 | 30,841.72 |
| 应付利息 | - | - | - | 463,408.02 | 463,408.02 |
| 应交税费 | - | - | - | 71,351.25 | 71,351.25 |
| 其他负债 | - | - | - | 138,289.16 | 138,289.16 |
| 负债总计 | 991,126,859.80 | - | - | 51,776,111.63 | 1,042,902,971.43 |
| 利率敏感度缺口 | -462,137,062.91 | 3,225,440,000.00 | 228,091,000.00 | 51,101,530.22 | 3,042,495,467.31 |
| 上年度末 2019年12月31日 | 1年以内 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |
| 资产 | | | | | |
| 银行存款 | 1,869,865.24 | - | - | - | 1,869,865.24 |
| 结算备付金 | 71,296,889.64 | - | - | - | 71,296,889.64 |
| 存出保证金 | 88,266.77 | - | - | - | 88,266.77 |
| 交易性金融资产 | 528,951,000.00 | 2,792,531,000.00 | - | - | 3,321,482,000.00 |
| 应收利息 | - | - | - | 57,039,651.86 | 57,039,651.86 |
| 资产总计 | 602,206,021.65 | 2,792,531,000.00 | - | 57,039,651.86 | 3,451,776,673.51 |
| 负债 | | | | | |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 769,854.17 | 769,854.17 |
| 应付托管费 | - | - | - | 256,618.06 | 256,618.06 |
| 卖出回购金融资产款 | 417,661,013.50 | - | - | - | 417,661,013.50 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 15,033.86 | 15,033.86 |
| 应付利息 | - | - | - | 229,535.43 | 229,535.43 |
| 应交税费 | - | - | - | 39,941.89 | 39,941.89 |
| 负债总计 | 417,661,013.50 | - | - | 1,310,983.41 | 418,971,996.91 |
| 利率敏感度缺口 | 184,545,008.15 | 2,792,531,000.00 | - | 55,728,668.45 | 3,032,804,676.60 |

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| 假设 | 除市场利率以外的其他市场变量保持不变 | | |
|------------------|--------------------|-----------------------------|---------------------|
| 分析 | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位：人民币元) | |
| | | 本期末 2020年6月30日 | 上年度末 2019年12月31日 |
| | 1. 市场利率下降 25 个基点 | 22,053,046.37 | - |
| 2. 市场利率上升 25 个基点 | -21,874,486.64 | - | |

注：本基金合同生效日为 2019 年 11 月 8 日，截至 2019 年 12 月 31 日止成立尚未满一年，无足够历史经验数据计算上年度末利率风险对基金资产净值的影响。

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。本基金主要投资于证券交易所上市或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。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|------------------|---------------|
| 1 | 权益投资 | - | - |
| | 其中：股票 | - | - |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 3,960,840,000.00 | 96.95 |
| | 其中：债券 | 3,732,749,000.00 | 91.37 |
| | 资产支持证券 | 228,091,000.00 | 5.58 |
| 4 | 贵金属投资 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | 20,000,150.00 | 0.49 |
| | 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 | 1,669,836.52 | 0.04 |
| 8 | 其他各项资产 | 102,888,452.22 | 2.52 |
| 9 | 合计 | 4,085,398,438.74 | 100.00 |

7.2 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 | 3,027,912,000.00 | 99.52 |
| | 其中：政策性金融债 | 1,516,307,000.00 | 49.84 |
| 4 | 企业债券 | 192,260,000.00 | 6.32 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | 367,092,000.00 | 12.07 |
| 7 | 可转债（可交换债） | - | - |
| 8 | 同业存单 | 145,485,000.00 | 4.78 |
| 9 | 其他 | - | - |

| | | | |
|----|----|------------------|--------|
| 10 | 合计 | 3,732,749,000.00 | 122.69 |
|----|----|------------------|--------|

7.3 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 | 160417 | 16 农发 17 | 12,300,000 | 1,253,493,000.00 | 41.20 |
| 2 | 163670 | 20 华泰 G6 | 2,500,000 | 249,175,000.00 | 8.19 |
| 3 | 1928034 | 19 交通银行 01 | 2,000,000 | 202,900,000.00 | 6.67 |
| 4 | 163126 | 20 中财 G1 | 2,000,000 | 201,400,000.00 | 6.62 |
| 5 | 150316 | 15 进出 16 | 2,000,000 | 201,080,000.00 | 6.61 |

7.4 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 证券代码 | 证券名称 | 数量（份） | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|---------|-------------|-----------|----------------|--------------|
| 1 | 2089013 | 20 工元宜居 1A2 | 2,300,000 | 228,091,000.00 | 7.50 |

7.5 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贵金属投资明细

无。

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权证投资明细

无。

7.7 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.7.1 本期国债期货投资政策

本基金的国债期货投资将以风险管理为原则，以套期保值为目的，适度运用国债期货，提高投资组合的运作效率。基金管理人将按照相关法律法规的规定，结合国债现货市场和期货市场的波动性、流动性等情况，通过多头或空头套期保值等策略进行操作，获取超额收益。

7.7.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

7.7.3 本期国债期货投资评价

无。

7.8 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券中的 19 交通银行 01，其发行主体为交通银行股份有限公司。

2020 年 4 月 20 日，中国银行保险监督管理委员会向交通银行股份有限公司做出行政处罚决定（银保监罚决字（2020）6 号），依据《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十七条和相关

内控管理、审慎经营规定，就其监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在的违法违规行，决定罚款合计 260 万元。

投资决策说明：

交通银行股份有限公司（下称“公司”）因其在监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送方面的违法违规行，被中国银行保险监督管理委员会处以行政处罚人民币 260 万元罚款。罚款金额在公司 2019 年全年净利润中占比小于 0.1%，对公司整体业务开展以及持续经营无重大不利影响，对公司资金周转和债务偿还影响小。

7.8.2 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|----|---------|----------------|
| 1 | 存出保证金 | 10,810.37 |
| 2 | 应收证券清算款 | 50,000,000.00 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 52,877,641.85 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 102,888,452.22 |

7.8.3 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数(户) | 户均持有的基金份额 | 持有人结构 | | | |
|----------|------------------|------------------|-----------|-------|-----------|
| | | 机构投资者 | | 个人投资者 | |
| | | 持有份额 | 占总份额比例(%) | 持有份额 | 占总份额比例(%) |
| 2 | 1,504,999,500.00 | 3,009,999,000.00 | 100.00 | 0.00 | 0.00 |

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 持有份额总数(份) | 占基金总份额比例(%) |
|------------------|-----------|-------------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 0 | 0 |

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

| 项目 | 持有基金份额总量的数量区间(万份) |
|----|-------------------|
| | |

| | |
|--------------------------------|---|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金 | 0 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 0 |

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

| 项目 | 持有份额总数 | 持有份额占基金总份额比例 (%) | 发起份额总数 | 发起份额占基金总份额比例 (%) | 发起份额承诺持有期限 |
|-------------|---------------|------------------|---------------|------------------|------------|
| 基金管理人固有资金 | 10,000,000.00 | 0.33 | 10,000,000.00 | 0.33 | 不低于三年 |
| 基金管理人高级管理人员 | - | - | - | - | - |
| 基金经理等人员 | - | - | - | - | - |
| 基金管理人股东 | - | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - | - |
| 合计 | 10,000,000.00 | 0.33 | 10,000,000.00 | 0.33 | - |

注：本基金合同生效日为 2019 年 11 月 8 日，基金管理人持有份额为发起认购份额。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|--------------------------------|------------------|
| 基金合同生效日（2019 年 11 月 8 日）基金份额总额 | 3,009,999,000.00 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 3,009,999,000.00 |
| 本报告期基金总申购份额 | - |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | - |
| 本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 3,009,999,000.00 |

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期末未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

(1) 基金管理人的重大变动

2020 年 6 月 22 日，本基金管理人发布了《融通基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，经本基金管理人第六届董事会第四次定期会议审议通过，决定由邹曦先生担任公司副总经理职务。

(2) 本报告期基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

2020 年 3 月，许卿斌同志不再担任上海银行股份有限公司资产托管部总经理职务。上述人事变动已进行备案、公告。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产及基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|------|--------|------|--------------|-----------|------------|----|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 | |
| 中银国际 | 2 | - | - | - | - | - |

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

- 1) 资质雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币；
- 2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- 3) 经营行为规范，最近两年未因重大违规行为而受到中国证监会和中国人民银行处罚；
- 4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- 5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需，并能为本基金提供全面的信息服；
- 6) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告及其他专门报告，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告。

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

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

(3) 交易单元变更情况

本报告期交易单元均为合同生效时新增, 无其他变更。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位: 人民币元

| 券商名称 | 债券交易 | | 债券回购交易 | | 权证交易 | |
|------|---------------|--------------|------------------|----------------|------|--------------|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 中银国际 | 61,343,424.66 | 100.00% | 2,091,000,000.00 | 100.00% | - | - |

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调整旗下基金 2020 年春节假期申购赎回等交易业务及清算交收安排的提示性公告 | 证券日报、中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站 | 2020-01-30 |
| 2 | 融通增润三个月定期开放债券型发起式证券投资基金第一次集中开放申购、赎回业务的公告 | 证券日报、管理人网站 | 2020-02-07 |
| 3 | 融通增润三个月定期开放债券型发起式证券投资基金第二次集中开放申购、赎回业务的公告 | 证券日报、管理人网站 | 2020-06-05 |
| 4 | 融通增润三个月定期开放债券型发起式证券投资基金第一次分红公告 | 证券日报、管理人网站 | 2020-06-16 |
| 5 | 融通基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告 | 证券日报、中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站 | 2020-06-22 |
| 6 | 关于融通基金管理有限公司旗下基金参与中信建投证券股份有限公司费率优惠活动的公告 | 证券日报、管理人网站 | 2020-06-29 |

§ 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 | 持有基金份额比例 | 期初 | 申购 | 赎回 | 持有份额 |

| | 号 | 达到或者超过 20% 的时间区间 | 份额 | 份额 | 份额 | | |
|--|---|-------------------|------------------|------|------|------------------|-------|
| 机构 | 1 | 20200101-20200630 | 2,999,999,000.00 | 0.00 | 0.00 | 2,999,999,000.00 | 99.67 |
| 个人 | - | - | - | - | - | - | - |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| 当基金份额持有人占比过于集中时，可能存在因某单一基金份额持有人大额赎回而引起基金单位份额净值剧烈波动的风险及流动性风险。 | | | | | | | |

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会批准融通增润三个月定期开放债券型发起式证券投资基金设立的文件
- (二) 《融通增润三个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》
- (三) 《融通增润三个月定期开放债券型发起式证券投资基金托管协议》
- (四) 《融通增润三个月定期开放债券型发起式证券投资基金招募说明书》
- (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> 查询。

融通基金管理有限公司

2020 年 8 月 27 日