

融通通利系列证券投资基金之

融通债券投资基金

2021 年中期报告

2021 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：2021 年 8 月 27 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

融通通利系列证券投资基金由融通债券投资基金、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共同构成。本报告为融通通利系列证券投资基金之子基金融通债券投资基金（以下简称“本基金”）2021 年中期报告。

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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据《融通通利系列证券投资基金基金合同》的规定，于 2021 年 8 月 25 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 2021 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	6
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	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
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	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 中期财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	16
§ 7 投资组合报告	31
7.1 期末基金资产组合情况	31
7.2 期末按债券品种分类的债券投资组合	31
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	32
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	32
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	32
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	32

7.7 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	32
7.8 投资组合报告附注	32
§ 8 基金份额持有人信息	34
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	34
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
§ 9 开放式基金份额变动	35
§ 10 重大事件揭示	35
10.1 基金份额持有人大会决议	35
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	35
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	36
10.4 基金投资策略的改变	36
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	36
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	36
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	36
10.8 其他重大事件	37
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	38
§ 12 备查文件目录	38
12.1 备查文件目录	38
12.2 存放地点	38
12.3 查阅方式	38

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	融通债券投资基金	
基金简称	融通债券	
基金主代码	161603	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2003 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	
报告期末基金份额总额	107,101,213.24 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	融通债券 A/B	融通债券 C
下属分级基金的交易代码	161603	161693
下属分级基金的前端交易代码	161603	-
下属分级基金的后端交易代码	161653	-
报告期末下属分级基金的份额总额	86,579,317.18 份	20,521,896.06 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在强调本金安全的前提下，追求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	以组合优化为基本策略，利用收益曲线模型和债券品种定价模型，在获取较好的稳定收益的基础上，捕捉市场出现的中短期投资机会。
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	属于相对低风险的基金品种

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 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 13、14 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		深圳市南山区华侨城汉唐大厦 13、14、15 层	北京市西城区复兴门内大街 55 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(2021年1月1日-2021年6月30日)	
	融通债券 A/B	融通债券 C
本期已实现收益	621,454.14	86,093.99
本期利润	1,189,324.74	195,997.92
加权平均基金份额本期利润	0.0129	0.0106
本期加权平均净值利润率	1.29%	1.06%
本期基金份额净值增长率	1.30%	1.10%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)	
期末可供分配利润	1,101,494.07	148,586.27
期末可供分配基金份额利润	0.0127	0.0072
期末基金资产净值	87,680,811.25	20,670,482.33
期末基金份额净值	1.013	1.007
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	136.51%	51.30%

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

融通债券 A/B

第 6 页 共 38 页

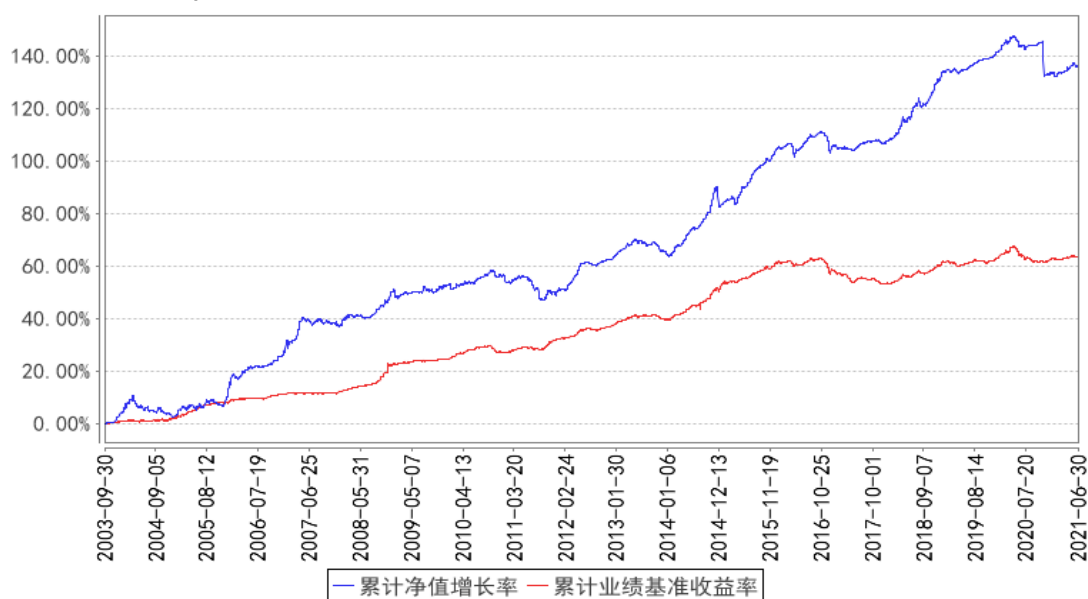
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-0.20%	0.09%	-0.04%	0.03%	-0.16%	0.06%
过去三个月	1.10%	0.09%	0.45%	0.03%	0.65%	0.06%
过去六个月	1.30%	0.09%	0.65%	0.04%	0.65%	0.05%
过去一年	-2.97%	0.24%	-0.20%	0.06%	-2.77%	0.18%
过去三年	7.77%	0.16%	4.53%	0.07%	3.24%	0.09%
自基金合同生效起至今	136.51%	0.17%	63.62%	0.10%	72.89%	0.07%

融通债券 C

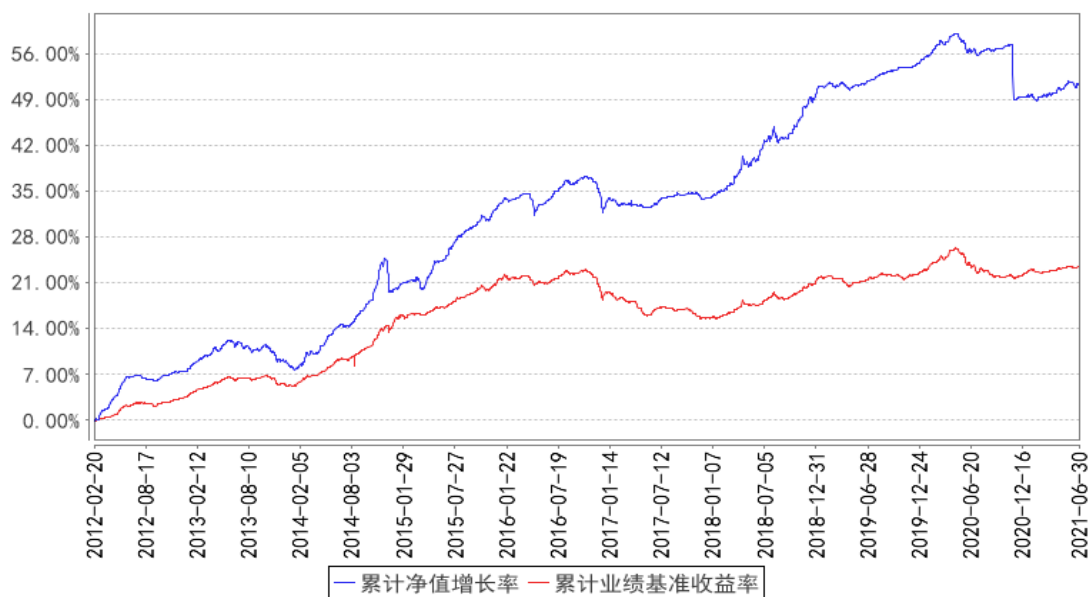
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-0.20%	0.08%	-0.04%	0.03%	-0.16%	0.05%
过去三个月	0.90%	0.09%	0.45%	0.03%	0.45%	0.06%
过去六个月	1.10%	0.09%	0.65%	0.04%	0.45%	0.05%
过去一年	-3.36%	0.24%	-0.20%	0.06%	-3.16%	0.18%
过去三年	6.53%	0.16%	4.53%	0.07%	2.00%	0.09%
自基金合同生效起至今	51.30%	0.14%	23.49%	0.08%	27.81%	0.06%

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

融通债券A/B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：1、本基金业绩比较基准项目分段计算，其中：2009年12月31日(含此日)之前采用“银行间债券综合指数”，2010年1月1日起至2015年9月30日(含此日)采用“中信标普全债指数收益率”，2015年10月1日起采用新基准“中债综合全价(总值)指数收益率”。

2、本基金于2012年2月20日增加C类份额，本基金C类份额的统计区间为2012年2月20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2021年6月30日,公司共管理七十六只开放式基金: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、融通通益混合型证券投资基金、融通创业板交易型开放式指数证券投资基金、融通通恒 63 个月定期开放债券型证券投资基金、融通产业趋势臻选股票型证券投资基金、融通稳健添盈灵活配置混合型证券投资基金、融通中证云计算与大数据主题指数证券投资基金 (LOF)、融通产业趋势精选 2 年封闭运作混合型证券投资基金、融通价值趋势混合型证券投资基金、融通核心趋势混合型证券投资基金。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（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		

王超	本基金的基金经理、固定收益部总监	2013 年 12 月 27 日	-	13	王超先生，厦门大学金融工程硕士，13 年证券、基金行业从业经历，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、融通通泰保本混合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、融通增鑫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、融通汇财宝货币市场基金基金经理，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、融通增益债券型证券投资基金基金经理、融通易支付货币市场证券投资基金基金经理、融通通优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、基金业务相关的工作时间为计算标准。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

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

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

上半年债券市场利率债整体呈现震荡走势，信用债收益率整体下行。3 年期国开债收益率较去年末上行 2bp；10 年政策性金融债收益率较去年末下行 4bp；3 年期限中高等级信用债收益率下行 40bp 左右。市场主要受金融数据与资金面驱动。今年 1-2 月社融数据较好，但 3 月以后的社融远不及去年同期，3-5 月社融合计下降超过了 4 万亿。与此同时，货币市场融资利率回购利率中枢也随着社融的好转而抬升，随着社融下降而下降。债券市场收益率基本跟随资金面变化，收益率在 2 月中旬前上行，此后下行。

转债方面，年初受到 PPI 快速上升及强劲基本面数据的影响，市场担忧货币收紧从而导致市场大幅回调，随后随着资金面的稳定及财报出炉，股票转而上扬，转债指数在一季度宽幅震荡，在二季度有所上涨。

本基金上半年整体上降低了信用债投资仓位，并提升了现有组合中信用品种的资质水平，同时提高了转债仓位水平。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末融通债券 A/B 基金份额净值为 1.013 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.30%；截至本报告期末融通债券 C 基金份额净值为 1.007 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.10%；同期业绩比较基准收益率为 0.65%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

当下中国内部金融条件（货币+信用）未有显著回落，信用环境的边际收缩对于经济的负面影响在三季度左右将成为验证和观察时点；外部金融条件和经济环境仍在向好过程中，目前对经济的未来发展难以做出周期性走弱的悲观判断。在当下国内和海外利率环境如此低位宽松的环境下，本轮经济的韧性或超预期。利率债大概率维持震荡走势，难以出现趋势性机会。

信用债投资方面，目前海内外的宏观经济环境仍处于后疫情的修复过程中，对应实体企业的自身信用景气度有望继续改善。但从政策层面看，随着疫情的影响逐步褪去，未来政策取向或向中性货币+紧信用转化，此过程中由于外部融资环境并不十分有利，偿债对企业自身经营的依赖性将上升，信用风险的防范将更加重要。

目前股市整体估值处于历史偏高水平，但受益于利率低位徘徊及企业利润仍处于好转阶段，股市大幅下跌风险或不大。大盘指数大概率维持震荡的格局，结构性投资机会依然存在，转债投资需自下而上精选个券。

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

本基金本报告期末未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

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债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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，融通债券投资基金的管理人——融通基金管理有限公司在融通债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。

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

本托管人依法对融通基金管理有限公司编制和披露的融通债券投资基金 2021 年中期报告中财务指标、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 中期财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：融通通利系列证券投资基金之融通债券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	1,189,715.78	1,250,938.65
结算备付金		2,176,199.65	637,555.23
存出保证金		5,984.57	8,388.16
交易性金融资产	6.4.7.2	118,679,237.82	146,346,234.91
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		118,679,237.82	130,240,034.91
资产支持证券投资		-	16,106,200.00
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	-	-
应收证券清算款		-	498,631.51
应收利息	6.4.7.5	1,211,591.85	2,994,398.78
应收股利		-	-
应收申购款		1,294,229.85	817,880.54
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		124,556,959.52	152,554,027.78
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 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		12,100,000.00	30,399,650.90
应付证券清算款		588,897.58	-
应付赎回款		481,574.76	411,204.24
应付管理人报酬		52,017.70	60,504.65
应付托管费		17,339.19	20,168.21
应付销售服务费		5,247.68	6,184.49
应付交易费用	6.4.7.7	56,029.34	60,348.39
应交税费		2,565,703.37	2,574,829.02
应付利息		-	6,708.63
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	338,856.32	440,071.18
负债合计		16,205,665.94	33,979,669.71
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	107,101,213.24	118,683,961.69
未分配利润	6.4.7.10	1,250,080.34	-109,603.62
所有者权益合计		108,351,293.58	118,574,358.07
负债和所有者权益总计		124,556,959.52	152,554,027.78

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额总额 107,101,213.24 份，其中融通债券 A/B 基金份额总额 86,579,317.18 份，基金份额净值 1.013 元。融通债券 C 基金份额总额 20,521,896.06 份，基金份额净值 1.007 元。

6.2 利润表

会计主体：融通通利系列证券投资基金之融通债券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		2,266,057.96	23,491,958.65
1. 利息收入		1,859,289.17	22,009,556.24
其中：存款利息收入	6.4.7.11	13,435.63	82,668.51
债券利息收入		1,565,824.99	20,927,889.05
资产支持证券利息收入		256,734.94	967,762.74
买入返售金融资产收入		23,293.61	31,235.94
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益		-406,972.21	5,327,946.07
其中：股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-

债券投资收益	6. 4. 7. 12	-421, 856. 32	5, 327, 946. 07
资产支持证券投资收益	6. 4. 7. 12. 3	14, 884. 11	-
贵金属投资收益	6. 4. 7. 13	-	-
衍生工具收益	6. 4. 7. 14	-	-
股利收益		-	-
3. 公允价值变动收益	6. 4. 7. 15	677, 774. 53	-4, 647, 336. 65
4. 汇兑收益		-	-
5. 其他收入	6. 4. 7. 16	135, 966. 47	801, 792. 99
减：二、费用		880, 735. 30	5, 266, 300. 48
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	330, 374. 52	2, 464, 061. 47
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	110, 124. 76	821, 353. 86
3. 销售服务费	6. 4. 10. 2. 3	32, 206. 14	116, 963. 89
4. 交易费用	6. 4. 7. 17	4, 849. 76	14, 845. 00
5. 利息支出		190, 807. 70	1, 531, 768. 20
其中：卖出回购金融资产支出		190, 807. 70	1, 531, 768. 20
6. 税金及附加		2, 771. 39	62, 516. 76
7. 其他费用	6. 4. 7. 18	209, 601. 03	254, 791. 30
三、利润总额		1, 385, 322. 66	18, 225, 658. 17
减：所得税费用		-	-
四、净利润		1, 385, 322. 66	18, 225, 658. 17

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：融通通利系列证券投资基金之融通债券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 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)	118, 683, 961. 69	-109, 603. 62	118, 574, 358. 07
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1, 385, 322. 66	1, 385, 322. 66
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-11, 582, 748. 45	-25, 638. 70	-11, 608, 387. 15
其中：1. 基金申购款	66, 758, 384. 34	151, 599. 75	66, 909, 984. 09
2. 基金赎回款	-78, 341, 132. 79	-177, 238. 45	-78, 518, 371. 24
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)	107, 101, 213. 24	1, 250, 080. 34	108, 351, 293. 58
项目	上年度可比期间 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)	1, 347, 107, 508. 14	42, 782, 766. 93	1, 389, 890, 275. 07
二、本期经营活动产生的基金净	-	18, 225, 658. 17	18, 225, 658. 17

值变动数（本期利润）			
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-966,871,319.60	-44,459,053.00	-1,011,330,372.60
其中：1. 基金申购款	121,389,500.52	5,684,854.72	127,074,355.24
2. 基金赎回款	-1,088,260,820.12	-50,143,907.72	-1,138,404,727.84
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）	380,236,188.54	16,549,372.10	396,785,560.64

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

融通债券投资基金（以下简称“本基金”）是融通通利系列证券投资基金的一个子基金。融通通利系列证券投资基金经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监基金字[2003]第 94 号《关于同意融通通利系列证券投资基金设立的批复》核准，由融通基金管理有限公司依照《证券投资基金管理暂行办法》及其实施细则、《开放式证券投资基金试点办法》等有关规定（后由《中华人民共和国证券投资基金法》及相关法规替代）和《融通通利系列证券投资基金基金契约》（后更名为《融通通利系列证券投资基金基金合同》）发起，并于 2003 年 9 月 30 日募集成立。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 873,320,777.53 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道验字(2003)第 138 号验资报告予以验证，有效认购金额产生的利息折份额为 141,916.58 份基金份额，共计实收基金 873,462,694.11 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《关于融通债券投资基金份额分类及修订基金合同相关内容的公告》，本基金自 2012 年 2 月 20 日起实施分级，在投资者申购时收取前端申购费用的份额（即原前端收费份额），称为 A 类份额；在投资者赎回时收取后端申购费用的份额（即原后端收费份额），称为 B 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的份额，称为 C 类份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《融通通利系列证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围限于固定收益类金融工具，包括国内依法公开发行上市的国债、金融债和企业债（包括可转换债券）等。其中投资于债券的比例不低于基金资产总值的 80%，投资于国家

债券的比例不低于基金资产净值的 20%，并保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的原业绩比较基准为：中信标普全债指数收益率。根据本基金的基金管理人于 2015 年 11 月 11 日发布的《融通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金变更业绩比较基准及修改相关基金合同的公告》，自 2015 年 10 月 1 日起，本基金业绩比较基准变更为：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》、《融通通利系列证券投资基金合同》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 2021 年中期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 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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 2021 年 6 月 30 日
活期存款	1,189,715.78
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	1,189,715.78

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 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	61,883,509.82	-246,350.08
	银行间市场	56,795,728.00	-8,741,260.97
	合计	118,679,237.82	-8,987,611.05
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-

合计	127,666,848.87	118,679,237.82	-8,987,611.05
----	----------------	----------------	---------------

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

无。

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 2021年6月30日
应收活期存款利息	149.76
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	881.37
应收债券利息	1,210,558.29
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	2.43
合计	1,211,591.85

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 2021年6月30日
交易所市场应付交易费用	54,849.34
银行间市场应付交易费用	1,180.00
合计	56,029.34

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应付券商交易单元保证金	250,000.00
应付赎回费	213.16

应付证券出借违约金	-
预提费用	88,643.16
合计	338,856.32

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

融通债券 A/B

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	98,504,465.90	98,504,465.90
本期申购	57,173,549.48	57,173,549.48
本期赎回	-69,098,698.20	-69,098,698.20
本期末	86,579,317.18	86,579,317.18

融通债券 C

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	20,179,495.79	20,179,495.79
本期申购	9,584,834.86	9,584,834.86
本期赎回	-9,242,434.59	-9,242,434.59
本期末	20,521,896.06	20,521,896.06

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

融通债券 A/B

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,983,394.84	-3,011,150.30	-27,755.46
本期利润	621,454.14	567,870.60	1,189,324.74
本期基金份额交易产生的变动数	-377,969.62	317,894.41	-60,075.21
其中：基金申购款	1,651,746.78	-1,534,836.44	116,910.34
基金赎回款	-2,029,716.40	1,852,730.85	-176,985.55
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,226,879.36	-2,125,385.29	1,101,494.07

融通债券 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	534,493.53	-616,341.69	-81,848.16
本期利润	86,093.99	109,903.93	195,997.92
本期基金份额交易产生的变动数	31,724.41	2,712.10	34,436.51
其中：基金申购款	273,289.58	-238,600.17	34,689.41
基金赎回款	-241,565.17	241,312.27	-252.90
本期已分配利润	-	-	-
本期末	652,311.93	-503,725.66	148,586.27

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
活期存款利息收入	5,176.75
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	8,208.53
其他	50.35
合计	13,435.63

6.4.7.12 债券投资收益

6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-421,856.32
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	-421,856.32

6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	202,971,748.94
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	200,181,920.32
减：应收利息总额	3,211,684.94
买卖债券差价收入	-421,856.32

6.4.7.12.3 资产支持证券投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
卖出资产支持证券成交总额	16,501,343.57
减：卖出资产支持证券成本总额	15,985,115.89
减：应收利息总额	501,343.57
资产支持证券投资收益	14,884.11

6.4.7.13 贵金属投资收益

无。

6.4.7.14 衍生工具收益

无。

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
1. 交易性金融资产	677,774.53
股票投资	-
债券投资	798,858.64
资产支持证券投资	-121,084.11
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	677,774.53

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
基金赎回费收入	10,430.13
基金转换费收入	125,536.34
合计	135,966.47

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不低于转出基金赎回费用的 25% 归入转出基金的基金资产。

6.4.7.17 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
交易所市场交易费用	1,012.26
银行间市场交易费用	3,837.50
合计	4,849.76

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
审计费用	19,835.79
信息披露费	59,507.37
银行费用	2,261.93
账户维护费	18,600.00

其他	300.00
交易佣金	109,095.94
合计	209,601.03

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
融通基金管理有限公司（“融通基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

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 2021年1月1日至 2021年6月30日	上年度可比期间 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	330,374.52	2,464,061.47
其中：支付销售机构的客户维护费	152,650.75	241,442.07

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 0.60% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.60\% / \text{当年天数}。$$

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	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	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	110,124.76	821,353.86

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		
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	融通债券 A/B	融通债券 C	合计
融通基金	-	893.57	893.57
中国工商银行	-	13,226.02	13,226.02
合计	-	14,119.59	14,119.59
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	融通债券 A/B	融通债券 C	合计
融通基金	-	25,339.97	25,339.97
中国工商银行	-	29,211.25	29,211.25
合计	-	54,551.22	54,551.22

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类份额基金资产净值的 0.35% 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：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日 C 类基金资产净值} \times 0.35\% \div \text{当年天数}。$$

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

无。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020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	1,189,715.78	5,176.75	1,759,396.77	41,326.45

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(2021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：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(单位:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113050	南银转债	2021/6/17	2021/7/1	新债未上市	100.00	100.00	350	34,999.54	34,999.54	-

6.4.12.2 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.2.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.2.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2021 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 12,100,000.00 元，截至 2021 年 7 月 1 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。本基金投资的金融工具主要包括债券投资及资产支持证券等。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，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金的基金管理人奉行建设全面风险管理体系、风控优先的政策，在董事会下设立合规与审计委员会，负责检查公司合规运作的状况及合规控制的有效性，并对公司的合规控制提出相关要求；在管理层层面设立风险控制委员会，负责建立健全公司的风险管理制度并组织实施，审定公司的业务风险管理政策，审定公司内控管理组织实施方案，审定公司的业务授权方案，审定基金资产组合的风险状况评价分析报告，审定公司各项风险与内控状况评价报告，审定业务风险损失责任人的责任，审定重大业务可行性风险论证，协调突发性重大风险事件的处理；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，具有根据业务特点控制业务风险的职责。业务人员是风险控制环节的第一责任人，部门负责人是控制业务风险管理的第一责任人，对部门风险控制措施的实施情况进行管理；风险管理小组由投资经理、金融工程人员和研究员组成，负责制定相关业务风险的识别和度量方法，指导业务部门实施风险的管理和控制，并定期出具投资组合风险报告，进行投资风险分析与绩效评估；督察长和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，确保既定的风险控制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。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

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同责任，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 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	5,011,000.00	10,001,000.00
合计	5,011,000.00	10,001,000.00

注：1. 未评级部分为超短期融资券和政策性金融债。

2. 债券信用评级取自第三方评级机构的评级。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
A-1	-	10,099,000.00
A-1 以下	-	-
未评级	-	-
合计	-	10,099,000.00

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

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 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
AAA	78,633,721.54	48,924,975.11
AAA 以下	9,855,016.28	31,766,059.80
未评级	25,179,500.00	39,548,000.00
合计	113,668,237.82	120,239,034.91

注：1. 未评级债券为国债和政策性金融债。

2. 债券信用评级取自第三方评级机构的评级。

6.4.13.2.5 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 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
AAA	-	6,007,200.00

AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	-	6,007,200.00

注：债券信用评级取自第三方评级机构的评级。

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 2021 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额中有 12,100,000.00 元将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)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 2021 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 2021 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 2021 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	1,189,715.78	-	-	-	1,189,715.78
结算备付金	2,176,199.65	-	-	-	2,176,199.65
存出保证金	5,984.57	-	-	-	5,984.57
交易性金融资产	51,556,444.00	60,420,718.00	6,702,075.82	-	118,679,237.82
应收利息	-	-	-	1,211,591.85	1,211,591.85
应收申购款	-	-	-	1,294,229.85	1,294,229.85

资产总计	54,928,344.00	60,420,718.00	6,702,075.82	2,505,821.70	124,556,959.52
负债					
应付赎回款	-	-	-	481,574.76	481,574.76
应付管理人报酬	-	-	-	52,017.70	52,017.70
应付托管费	-	-	-	17,339.19	17,339.19
应付证券清算款	-	-	-	588,897.58	588,897.58
卖出回购金融资产款	12,100,000.00	-	-	-	12,100,000.00
应付销售服务费	-	-	-	5,247.68	5,247.68
应付交易费用	-	-	-	56,029.34	56,029.34
应交税费	-	-	-	2,565,703.37	2,565,703.37
其他负债	-	-	-	338,856.32	338,856.32
负债总计	12,100,000.00	-	-	4,105,665.94	16,205,665.94
利率敏感度缺口	42,828,344.00	60,420,718.00	6,702,075.82	-1,599,844.24	108,351,293.58
上年度末 2020 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	1,250,938.65	-	-	-	1,250,938.65
结算备付金	637,555.23	-	-	-	637,555.23
存出保证金	8,388.16	-	-	-	8,388.16
交易性金融资产	55,455,044.00	88,806,208.00	2,084,982.91	-	146,346,234.91
应收利息	-	-	-	2,994,398.78	2,994,398.78
应收申购款	-	-	-	817,880.54	817,880.54
应收证券清算款	-	-	-	498,631.51	498,631.51
资产总计	57,351,926.04	88,806,208.00	2,084,982.91	4,310,910.83	152,554,027.78
负债					
应付赎回款	-	-	-	411,204.24	411,204.24
应付管理人报酬	-	-	-	60,504.65	60,504.65
应付托管费	-	-	-	20,168.21	20,168.21
卖出回购金融资产款	30,399,650.90	-	-	-	30,399,650.90
应付销售服务费	-	-	-	6,184.49	6,184.49
应付交易费用	-	-	-	60,348.39	60,348.39
应付利息	-	-	-	6,708.63	6,708.63
应交税费	-	-	-	2,574,829.02	2,574,829.02
其他负债	-	-	-	440,071.18	440,071.18
负债总计	30,399,650.90	-	-	3,580,018.81	33,979,669.71
利率敏感度缺口	26,952,275.14	88,806,208.00	2,084,982.91	730,892.02	118,574,358.07

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 (2021 年 6 月 30 日)	上年度末 (2020 年 12 月 31 日)
	市场利率上升 25 个基点	-503,250.36	-594,332.11
	市场利率下降 25 个基点	508,333.51	600,105.57

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	118,679,237.82	95.28
	其中：债券	118,679,237.82	95.28
	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	3,365,915.43	2.70
8	其他各项资产	2,511,806.27	2.02
9	合计	124,556,959.52	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	71,469,400.00	65.96
	其中：政策性金融债	25,179,500.00	23.24
4	企业债券	61,728.00	0.06

5	企业短期融资券	5,011,000.00	4.62
6	中期票据	1,360,000.00	1.26
7	可转债（可交换债）	40,777,109.82	37.63
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	118,679,237.82	109.53

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	1920045	19 杭州银行债	100,000	10,140,000.00	9.36
2	018006	国开 1702	100,000	10,118,000.00	9.34
3	1928037	19 交通银行 02	100,000	10,092,000.00	9.31
4	2128007	21 华夏银行 01	100,000	10,081,000.00	9.30
5	190207	19 国开 07	100,000	10,060,000.00	9.28

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

无。

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

无。

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、处罚的情况。

1、本基金投资的前十名证券中的浦发转债，其发行主体为上海浦东发展银行股份有限公司。

2020 年 8 月 10 日，中国银行保险监督管理委员会上海监管局向上海浦东发展银行股份有限公司做出了行政处罚决定（沪银保监银罚决字〔2020〕12 号），依据《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条第（五）项等规定，就其未按专营部门制规定开展同业业务、同业投资资

金违规投向“四证”不全的房地产项目等违法违规行为，决定责令改正，并处罚款共计 2100 万元。

投资决策说明：浦发银行股份有限公司（下称“公司”）的上述罚款合计金额在公司 2020 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。

2、本基金投资的前十名证券中的国开 1702、19 国开 07，其发行主体为国家开发银行。

2020 年 12 月 25 日，中国银行保险监督管理委员会向国家开发银行做出了行政处罚决定（银保监罚决字〔2020〕67 号），依据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条和相关审慎经营规则，就其为违规的政府购买服务项目提供融资、违规变相发放土地储备贷款、项目资本金管理不到位等二十四项违法违规行为，决定罚款 4880 万元。

投资决策说明：国家开发银行（下称“公司”）的上述罚款合计金额在公司 2020 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。

3、本基金投资的前十名证券中的 21 华夏银行 01，其发行主体为华夏银行股份有限公司。

2020 年 7 月 13 日，中国银行保险监督管理委员会向华夏银行股份有限公司做出了行政处罚决定（银保监罚决字〔2020〕24 号），依据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条第（五）项规定和相关审慎经营的规则，就其内控制度执行不到位、审查系统存在重大风险隐患、账务管理工作存在重大错漏、长期未处置风险监控预警信息等违法违规行为，决定罚款 110 万元。

投资决策说明：华夏银行股份有限公司（下称“公司”）的上述罚款合计金额在公司 2020 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。

4、本基金投资的前十名证券中的 21 招商银行小微债 02，其发行主体为招商银行股份有限公司。

2021 年 5 月 17 日，中国银行保险监督管理委员会向招商银行股份有限公司做出了行政处罚决定（银保监罚决字〔2021〕16 号），依据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一、四十五条、四十六条和相关审慎经营规则，就其理财资金池化运作、并表管理不到位等二十七项违法违规行为，决定罚款 7170 万元。

投资决策说明：招商银行股份有限公司（下称“公司”）的上述罚款合计金额在公司 2020 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	5,984.57
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,211,591.85
5	应收申购款	1,294,229.85
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,511,806.27

7.8.3 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	132004	15 国盛 EB	7,701,144.00	7.11
2	132007	16 凤凰 EB	7,303,800.00	6.74
3	110059	浦发转债	7,170,100.00	6.62
4	110043	无锡转债	3,155,040.00	2.91
5	113011	光大转债	3,120,660.00	2.88
6	113021	中信转债	2,111,400.00	1.95
7	127017	万青转债	1,231,560.00	1.14
8	113024	核建转债	1,024,700.00	0.95
9	128109	楚江转债	941,920.00	0.87
10	113612	永冠转债	880,460.00	0.81
11	110077	洪城转债	689,940.00	0.64
12	128129	青农转债	641,160.00	0.59
13	123060	苏试转债	519,200.00	0.48
14	127022	恒逸转债	267,704.00	0.25
15	128121	宏川转债	215,880.00	0.20
16	113026	核能转债	105,730.00	0.10
17	128114	正邦转债	105,680.00	0.10
18	128066	亚泰转债	103,300.00	0.10
19	123091	长海转债	60,432.28	0.06
20	128135	洽洽转债	57,100.00	0.05

§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	户均持有的 基金份	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者

	数 (户)	额	持有份额	占总份额 比例 (%)	持有份额	占总份额 比例 (%)
融通债券 A/B 类	6,061	14,284.66	1,385,061.65	1.60	85,194,255.53	98.40
融通债券 C 类	2,102	9,763.03	0.00	0.00	20,521,896.06	100.00
合计	8,163	13,120.33	1,385,061.65	1.29	105,716,151.59	98.71

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	融通债券 A/B 类	3,792.85	0.00438
	融通债券 C 类	136.62	0.00067
	合计	3,929.47	0.00367

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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	融通债券 A/B 类	0
	融通债券 C 类	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	融通债券 A/B 类	0
	融通债券 C 类	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	融通债券 A/B	融通债券 C
基金合同生效日 (2003 年 9 月 30 日) 基金份额总额	873,462,694.11	-
本报告期期初基金份额总额	98,504,465.90	20,179,495.79
本报告期基金总申购份额	57,173,549.48	9,584,834.86
减：本报告期基金总赎回份额	69,098,698.20	9,242,434.59
本报告期期末基金份额总额	86,579,317.18	20,521,896.06

§ 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 基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

中国工商银行股份有限公司（以下简称“本公司”）根据工作需要，任命刘彤女士担任本

公司资产托管部总经理，全面主持资产托管部相关工作。刘彤女士的托管人高级管理人员任职信息已经在中国证券投资基金业协会备案。李勇先生不再担任本公司资产托管部总经理职务。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本基金管理人、基金财产、基金托管业务在本报告期内无诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金的投资策略未发生变更。

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

本报告期内基金管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受任何稽查或处罚等情况。

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证券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	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
上海证券	1	145,675,880.31	85.74%	1,409,600,000.00	95.43%	-	-
中信建投	1	24,237,106.53	14.26%	67,500,000.00	4.57%	-	-

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、交易单元变更情况

本报告期内交易单元无变更。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

本基金本报告期无租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况。

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	融通关于旗下部分开放式基金新增深圳市前海排排网基金销售有限责任公司为销售机构并开通转换业务及参加其费率优惠的公告	证券日报、 管理人网站	2021-03-10
2	融通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参与蚂蚁（杭州）基金销售有限公司费率优惠的公告	证券日报、 管理人网站	2021-03-16
3	融通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中国中金财富证券有限公司为销售机构并开通定期定额投资及转换业务的公告	证券日报、 管理人网站	2021-03-29
4	融通关于旗下部分开放式基金新增上海联泰基金销售有限公司为销售机构和新增开通基金定期定额投资业务的公告	证券日报、 管理人网站	2021-03-30
5	融通关于旗下部分开放式基金在上海华夏财富开通定投及参加其申购费率优惠活动的公告	证券日报、 管理人网站	2021-04-12
6	融通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参与蚂蚁（杭州）基金销售有限公司费率优惠的公告	证券日报、 管理人网站	2021-04-14
7	融通关于旗下部分开放式基金参加招商银行股份有限公司申购费率优惠活动的公告	证券日报、 管理人网站	2021-04-16
8	融通关于旗下部分开放式基金参与腾安基金销售（深圳）有限公司费率优惠活动的公告	证券日报、 管理人网站	2021-04-20
9	关于旗下部分开放式基金参与中国国际金融股份有限公司及中国中金财富证券有限公司费率优惠的公告	证券日报、 管理人网站	2021-04-27
10	融通关于旗下部分开放式基金参加蚂蚁（杭州）基金销售有限公司转换费率优惠活动的公告	证券日报、 管理人网站	2021-05-31
11	关于东方财富证券销售的融通基金旗下部分开放式基金开通定期定额投资业务及参加其费率优惠活动的公	证券日报、 管理人网站	2021-06-08

	告		
12	关于旗下部分基金增加侧袋机制并相应修改基金合同、托管协议的公告	证券日报、 管理人网站	2021-06-11
13	融通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参与上海基煜基金销售有限公司费率优惠的公告	证券日报、 管理人网站	2021-06-24
14	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	证券日报、 管理人网站	2021-06-30

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

2021 年 6 月 11 日，本基金管理人发布了《关于旗下部分基金增加侧袋机制并相应修改基金合同、托管协议的公告》，经与基金托管人协商一致，在对本基金的基金合同进行修订后，对本基金的托管协议、招募说明书（更新）、基金产品资料概要（更新）中涉及的上述相关内容进行相应修订，本基金修订后的基金合同、托管协议自 2021 年 6 月 11 日起生效，基金管理人已履行了规定的程序，符合相关法律法规的规定及基金合同的约定。

§ 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利系列证券投资基金设立的文件
- （二）《融通通利系列证券投资基金基金合同》
- （三）《融通通利系列证券投资基金托管协议》
- （四）《融通通利系列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

2021 年 8 月 27 日