

# 融通增强收益债券型证券投资基金 2022 年中期报告

2022 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：2022 年 8 月 26 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据融通增强收益债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）基金合同规定，于 2022 年 8 月 19 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 2022 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示 .....	2
1.2 目录 .....	3
<b>§ 2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况 .....	5
2.2 基金产品说明 .....	5
2.3 基金管理人和基金托管人 .....	5
2.4 信息披露方式 .....	5
2.5 其他相关资料 .....	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	6
3.2 基金净值表现 .....	7
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>8</b>
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 .....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 .....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 .....	13
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 .....	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见 .....	14
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>14</b>
6.1 资产负债表 .....	14
6.2 利润表 .....	15
6.3 净资产（基金净值）变动表 .....	15
6.4 报表附注 .....	18
<b>§ 7 投资组合报告</b> .....	<b>43</b>
7.1 期末基金资产组合情况 .....	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	43
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 .....	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	48
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....	48
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	48
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	49

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	49
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	49
7.11 投资组合报告附注 .....	49
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>50</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	50
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	50
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 .....	51
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>51</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>51</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	51
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 .....	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	51
10.4 基金投资策略的改变 .....	52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	52
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 .....	52
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	52
10.8 其他重大事件 .....	54
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>55</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	55
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	55
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>56</b>
12.1 备查文件目录 .....	56
12.2 存放地点 .....	56
12.3 查阅方式 .....	56

## § 2 基金简介

## 2.1 基金基本情况

基金名称	融通增强收益债券型证券投资基金	
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	
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	30,449,962.40 份	
基金合同存续期	不定期	
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
下属分级基金的前端交易代码	000142	-
报告期末下属分级基金的份额总额	26,338,408.27 份	4,111,554.13 份

## 2.2 基金产品说明

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。

## 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		张威	陈四清

## 2.4 信息披露方式

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

登载基金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(2022年01月01日-2022年06月30日)	
	融通增强收益债券 A	融通增强收益债券 C
本期已实现收益	-615,855.92	-99,870.52
本期利润	-1,000,940.63	-146,372.36
加权平均基金份额本期利润	-0.0369	-0.0355
本期加权平均净值利润率	-2.94%	-2.97%
本期基金份额净值增长率	-2.64%	-2.81%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022年6月30日)	
期末可供分配利润	12,645,678.52	1,753,831.47
期末可供分配基金份额利润	0.4801	0.4266
期末基金资产净值	33,661,219.88	5,014,564.78
期末基金份额净值	1.2780	1.2196
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	20.57%	19.33%

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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

融通增强收益债券 A

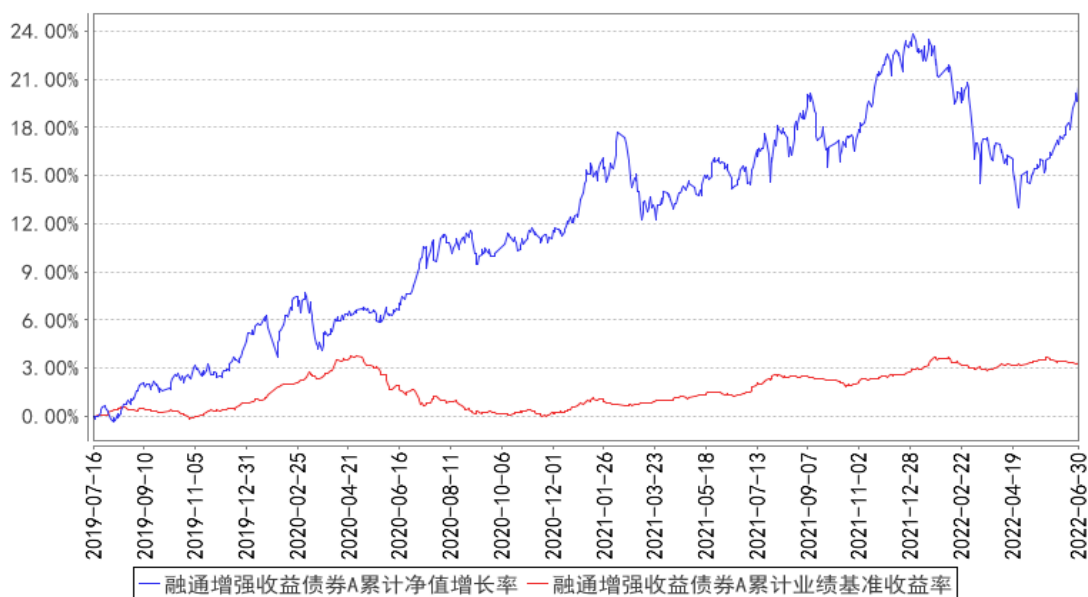
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	3.57%	0.32%	-0.24%	0.03%	3.81%	0.29%
过去三个月	3.36%	0.40%	0.29%	0.04%	3.07%	0.36%
过去六个月	-2.64%	0.49%	0.38%	0.05%	-3.02%	0.44%
过去一年	4.45%	0.48%	1.83%	0.05%	2.62%	0.43%
自基金合同生效起至今	20.57%	0.38%	3.30%	0.07%	17.27%	0.31%

融通增强收益债券 C

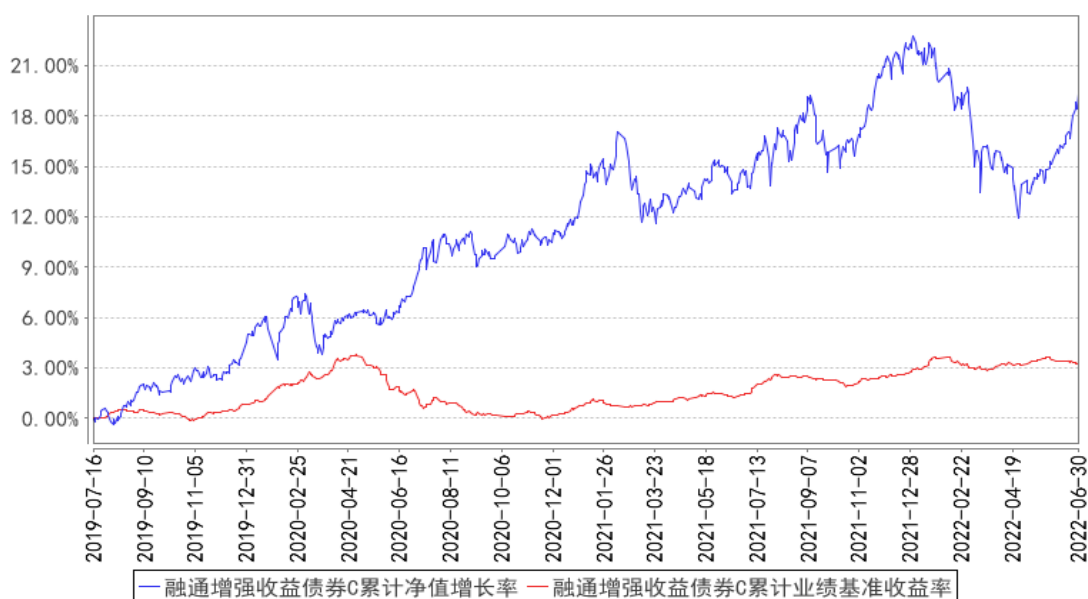
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	3.53%	0.32%	-0.24%	0.03%	3.77%	0.29%
过去三个月	3.27%	0.40%	0.29%	0.04%	2.98%	0.36%
过去六个月	-2.81%	0.49%	0.38%	0.05%	-3.19%	0.44%
过去一年	4.07%	0.48%	1.83%	0.05%	2.24%	0.43%
自基金合同生效起至今	19.33%	0.38%	3.30%	0.07%	16.03%	0.31%

### 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



## § 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：诚通证券股份有限公司 60%、日兴资产管理有限公司（NikkoAssetManagementCo.,Ltd.）40%。

截至 2022 年 6 月 30 日，公司共管理 80 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

多元收益一年持有期混合型证券投资基金、融通创新动力混合型证券投资基金、融通稳健增长一年持有期混合型证券投资基金、融通通跃一年定期开放债券型发起式证券投资基金、融通鑫新成长混合型证券投资基金、融通稳健增利 6 个月持有期混合型证券投资基金、融通稳信增益 6 个月持有期混合型证券投资基金、融通先进制造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		
余志勇	本基金的基金经理、组合投资部总监	2019-7-16	-	22 年	余志勇先生，武汉大学金融学硕士，22 年证券、基金行业从业经历，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、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，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、融通增强收益债券型证券投资基金基金经理、融通蓝筹成长证券投资基金基金经理、融通新消费灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、融通稳健增长一年持有期混合型证券投资基金基金经理。
王超	本基金的基金经理、	2019-7-16	-	14 年	王超先生，厦门大学金融工程硕士，14 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

	固定收益部总监			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、融通易支付货币市场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、融通增益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、融通增强收益债券型证券投资基金基金经理、融通稳健增长一年持有期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、基金业务相关工作的时间为计算标准。

#### 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

上半年债券市场整体呈现震荡走势，利率反复上下，至 6 月底，3-10 年利率债基本与 2021 年年末持平；其中 3 年国开小幅上行 4bp，5 年国开上行 1bp，10 年国开下行 3bp；信用债方面 3 年高等级信用债表现与利率相似，变动幅度不超过 5bp，中低等级信用债表现较好，3 年期 AA 中票收益率上半年下行幅度约 35bp。

1 月份 MLF 利率下调后市场对经济下行担忧情绪加剧，从而促使债券收益率快速下行，随着稳增长政策落实，市场预期信用扩张将很快见效，收益率转而上行；到了 3 月份市场发现 2 月份社融远低于预期，收益率开始见顶；随着疫情的扩散，市场对经济担忧情绪加剧并于 5 月底到达极致，收益率在此过程中一路下行；上海疫情缓解后，稳增长政策预期再次升温，市场担忧货币市场利率回归正常水平，债券市场再次调整。

权益市场上半年先下后上，一季度受到海外风险偏好下降、股市估值偏高及对经济担忧的影响，股市大幅调整，随后受上海疫情爆发的冲击而达到最低点，市场风险偏好降至最低；4 月底，市场开始反向修正，从最低点反弹了将近 25%。

本基金依照基金契约、根据市场情况，灵活调整了组合资产配置。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，融通增强收益债券 A 基金份额净值为 1.2780 元，报告期基金份额净值增长率为-2.64%；融通增强收益债券 C 基金份额净值为 1.2196 元，报告期基金份额净值增长率为-2.81%；同期业绩比较基准收益率为 0.38%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年宏观经济数据大概率会出现回升，但受制于房地产行业的表现，复苏力度大概率不及 2019 年。因此对市场的整体的走势我们认为大概率类似于 2019 年的震荡市场行情，由于经济复苏力度更弱，波动幅度也将显著低于 2019 年。货币政策大概率会维持友好的局面，投资上需要保持一定杠杆，灵活操作。

权益市场 4 月底的低点大概率为市场底部，目前股市整体估值合理，在弱复苏的经济背景下，可能缺乏整体上涨行情，更多关注结构性机会，转债投资需自下而上挖掘个券。

#### 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其适用性的情况后及时修订估值方法，以保证其持续适用。估值政策和程序的修订须经公司总经理办公会议审批后方可实施。基金在采用新投资策略或投资新品种时，应评价现有估值政策和程序的适用性。其中研究部负责定期对经济环境是否发生重大变化、证券发行机构是否发生影响证券价格的重大事件以及估值政策和程序进行评价，金融工程小组负责估值方法的研究、价格的计算及复核，登记清算部进行具体的估值核算并与基金托管人核对，同时负责对外进行信息披露。监察稽核部负责基金估值业务的事前、事中及事后的审核工作。

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配，符合法律法规和基金合同的规定。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

截至本报告期末，本基金存在连续六十个工作日以上基金资产净值低于五千万的情形。本基金管理人已经按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》向中国证监会报告并提出解决方案。

本基金本报告期内未发生连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人的情形。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

本报告期内，融通增强收益债券型证券投资基金的管理人——融通基金管理有限公司在融通增强收益债券型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 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增强收益债券型证券投资基金 2022 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 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：融通增强收益债券型证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	38,090.45	1,235,864.49
结算备付金		247,553.30	447,373.76
存出保证金		3,861.44	3,635.31
交易性金融资产	6.4.7.2	42,392,155.79	44,020,343.89
其中：股票投资		7,723,322.83	6,906,519.61
基金投资		-	-
债券投资		34,668,832.96	37,113,824.28
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		554,565.46	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	1,296,529.94
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	417,663.52
资产总计		43,236,226.44	47,421,410.91
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2021 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-

交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		4,500,000.00	500,000.00
应付清算款		-	350,493.70
应付赎回款		30.25	3,053,501.43
应付管理人报酬		21,933.25	24,243.37
应付托管费		6,266.67	6,926.67
应付销售服务费		1,410.27	1,519.55
应付投资顾问费		-	-
应交税费		139.03	81.03
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	30,662.31	47,092.88
负债合计		4,560,441.78	3,983,858.63
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	24,276,274.67	26,526,814.54
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	14,399,509.99	16,910,737.74
净资产合计		38,675,784.66	43,437,552.28
负债和净资产总计		43,236,226.44	47,421,410.91

注：报告截止日 2022 年 6 月 30 日，基金份额总额 30,449,962.40 份，其中融通增强收益债券 A 基金份额总额为 26,338,408.27 份，基金份额净值 1.2780 元；融通增强收益债券 C 基金份额总额为 4,111,554.13 份，基金份额净值 1.2196 元。

## 6.2 利润表

会计主体：融通增强收益债券型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-891,448.56	1,076,587.37
1. 利息收入		4,496.35	407,962.95
其中：存款利息收入	6.4.7.13	4,496.35	3,905.67
债券利息收入		-	403,228.76
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	828.52
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-464,671.17	1,804,517.40
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-633,821.02	1,238,363.16
基金投资收益		-	-

债券投资收益	6.4.7.15	108,750.03	525,326.95
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	60,399.82	40,827.29
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	-431,586.55	-1,140,199.13
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	312.81	4,306.15
<b>减：二、营业总支出</b>		255,864.43	330,134.52
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	135,338.67	147,172.42
2. 托管费	6.4.10.2.2	38,668.15	42,049.33
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	8,568.49	19,121.65
4. 投资顾问费	6.4.10.2.1.1	-	-
5. 利息支出		39,437.06	70,732.48
其中：卖出回购金融资产支出		39,437.06	70,732.48
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		216.67	295.34
8. 其他费用	6.4.7.23	33,635.39	50,763.30
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-1,147,312.99	746,452.85
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-1,147,312.99	746,452.85
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-1,147,312.99	746,452.85

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：融通增强收益债券型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	26,526,814.54	-	16,910,737.74	43,437,552.28
加：会计政策变更	-	-	-	-



前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	26,526,814.54	-	16,910,737.74	43,437,552.28
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-2,250,539.87	-	-2,511,227.75	-4,761,767.62
（一）、综合收益总额	-	-	-1,147,312.99	-1,147,312.99
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-2,250,539.87	-	-1,363,914.76	-3,614,454.63
其中：1. 基金申购款	347,702.59	-	205,199.75	552,902.34
2. 基金赎回款	-2,598,242.46	-	-1,569,114.51	-4,167,356.97
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	24,276,274.67	-	14,399,509.99	38,675,784.66
项目	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	30,237,481.50	-	14,947,297.14	45,184,778.64
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	30,237,481.50	-	14,947,297.14	45,184,778.64
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-2,966,004.21	-	-816,654.74	-3,782,658.95
（一）、综合收益总额	-	-	746,452.85	746,452.85
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-2,966,004.21	-	-1,563,107.59	-4,529,111.80
其中：1. 基金申购款	1,845,491.65	-	970,518.57	2,816,010.22
2. 基金赎回款	-4,811,495.86	-	-2,533,626.16	-7,345,122.02

（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	27,271,477.29	-	14,130,642.40	41,402,119.69

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

融通增强收益债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)是由融通通泰保本混合型证券投资基金第二个保本周期届满后转型而来。原融通通泰保本混合型证券投资基金经中国证券监督管理委员会 2013 年 3 月 7 日证监许可[2013]219 号文核准募集，为契约型开放式证券投资基金，存续期限不定，第二个保本期于 2019 年 7 月 8 日到期。由于不能满足保本基金存续条件，经基金管理人与基金托管人协商一致，原融通通泰保本混合型证券投资基金根据《融通通泰保本混合型证券投资基金基金合同》的约定转型为非保本的债券型基金。即自 2019 年 7 月 16 日起“融通通泰保本混合型证券投资基金”转型为“融通增强收益债券型证券投资基金”。本基金为契约型开放式基金，期限为不定期。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《融通增强收益债券型证券投资基金基金合同》和《融通增强收益债券型证券投资基金招募说明书》本基金根据申购费用、销售服务费等收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者申购时收取申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费而不收取申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用的，称为 C 类基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《融通增强收益债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的债券（包括可转换债券及可分离转债、国债、央行票据、中期票据、公司债、企业债、短期融资券、政府机构债、政策性金融机构金融债、商业银行金融债、资产支持证券等）、股票、权证、货币市场工

具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相关规定）。本基金可参与一级市场新股申购或增发新股，也可在二级市场上投资股票、权证等权益类证券。本基金的投资组合比例为：对固定收益类证券的投资比例不低于基金资产的 80%，股票、权证等权益类资产的投资比例不高于基金资产的 20%，基金保留不低于基金资产净值 5%的现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券。本基金的业绩比较基准为：中债综合全价指数。

#### 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其他相关规定（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》、《融通增强收益债券型证券投资基金基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2022 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 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产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

本报告期所采用的会计政策除以下会计政策与最近一期年度报告不一致外，其余会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

##### 6.4.4.1 金融资产和金融负债的分类

###### 新金融工具准则

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

###### (1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分

类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

#### 债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

##### 以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

##### 以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

#### 权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

### (2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和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。本基金持有的以摊余成本计量的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。

### (3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

#### 原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

#### (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股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具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。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，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。

#### 6.4.4.2 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

##### 新金融工具准则

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，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，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，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。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

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。

#### 6.4.4.3 收入/(损失)的确认和计量

##### 新金融工具准则

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证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投资收益。

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扣除相关交易费用后的净额确认为投资收益，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。

##### 原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证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和资产支持证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或票面利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。

## 6.4.5 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

财政部于 2017 年颁布了修订后的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（以下合称“新金融工具准则”），财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。此外，中国证监会于 2022 年颁布了修订后的《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〉》，本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金 2022 年中期财务报表，对本基金财务报表的影响列示如下：

#### (a) 金融工具

根据新金融工具准则的相关规定，本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整 2022 年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额，2021 年度的比较财务报表未重列。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日，本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

于 2022 年 1 月 1 日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、应收利息和应收申购款，金额分别为 1,235,864.49 元、447,373.76 元、3,635.31 元、417,663.52 元和 1,296,529.94 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、其他资产-应收利息和应收申购款，金额分别为 1,236,007.51 元、447,575.16 元、3,636.91 元、0.00 元和 1,296,529.94 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 44,020,343.89 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 44,437,661.39 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为卖出回购金融资产款、应付证券清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、应付交易费用、应付利息和其他负债-其他应付款，金额分别为 500,000.00 元、350,493.70 元、3,053,501.43 元、24,243.37 元、6,926.67 元、1,519.55 元、5,952.59 元、-452.05 元和 2,292.34 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为卖出回购金融资产款、应付清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、其他负债-应付交易费用、其他负债-应付利息和其他负债-其他应付款，金额分别为 499,547.95 元、350,493.70 元、3,053,501.43 元、24,243.37 元、6,926.67 元、1,519.55



元、5,952.59 元、0.00 元和 2,292.34 元。

于 2021 年 12 月 31 日，本基金“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于 2022 年 1 月 1 日，本基金根据新金融工具准则下的计量类别，将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示，无期初留存收益影响。

(b) 修订后的《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>》

根据中国证监会于 2022 年颁布的修订后的《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>》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

#### 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[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

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

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育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 2022 年 6 月 30 日
活期存款	38,090.45
等于：本金	38,054.61
加：应计利息	35.84
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
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	-
等于：本金	-
加：应计利息	-

减：坏账准备	-
合计	38,090.45

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	7,211,794.63	-	7,723,322.83	511,528.20
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	398,920.49	32,512,531.26	379,001.31
	银行间市场	53,701.70	2,156,301.70	32,403.53
	合计	452,622.19	34,668,832.96	411,404.84
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	41,016,600.56	452,622.19	42,392,155.79	922,933.04

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

##### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

##### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

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。

##### 6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

#### 6.4.7.5 债权投资

##### 6.4.7.5.1 债权投资情况

无。

##### 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

## 6.4.7.6 其他债权投资

## 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

## 6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

## 6.4.7.7 其他权益工具投资

## 6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

## 6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

## 6.4.7.8 其他资产

无。

## 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	0.02
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	6,485.90
其中：交易所市场	6,485.90
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	24,176.39
合计	30,662.31

## 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

## 融通增强收益债券 A

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	29,155,593.26	23,263,350.47
本期申购	403,461.16	321,919.47
本期赎回（以“-”号填列）	-3,220,646.15	-2,569,728.58
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	26,338,408.27	21,015,541.36

## 融通增强收益债券 C

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	4,114,996.81	3,263,464.07
本期申购	32,510.55	25,783.12
本期赎回 (以“-”号填列)	-35,953.23	-28,513.88
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回 (以“-”号填列)	-	-
本期末	4,111,554.13	3,260,733.31

注：申购含红利再投及转换入份额；赎回含转换出份额。

## 6.4.7.11 其他综合收益

无。

## 6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

## 融通增强收益债券 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	15,361,731.71	-351,549.34	15,010,182.37
本期利润	-615,855.92	-385,084.71	-1,000,940.63
本期基金份额交易产生的变动数	-1,478,318.26	114,755.04	-1,363,563.22
其中：基金申购款	213,356.05	-22,385.18	190,970.87
基金赎回款	-1,691,674.31	137,140.22	-1,554,534.09
本期已分配利润	-	-	-
本期末	13,267,557.53	-621,879.01	12,645,678.52

## 融通增强收益债券 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	1,943,033.87	-42,478.50	1,900,555.37
本期利润	-99,870.52	-46,501.84	-146,372.36
本期基金份额交易产生的变动数	-1,203.27	851.73	-351.54
其中：基金申购款	15,217.90	-989.02	14,228.88
基金赎回款	-16,421.17	1,840.75	-14,580.42
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,841,960.08	-88,128.61	1,753,831.47

## 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

活期存款利息收入	974.99
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	3,487.92
其他	33.44
合计	4,496.35

#### 6.4.7.14 股票投资收益

##### 6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-633,821.02
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-633,821.02

##### 6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出股票成交总额	6,787,892.05
减：卖出股票成本总额	7,399,704.49
减：交易费用	22,008.58
买卖股票差价收入	-633,821.02

##### 6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

#### 6.4.7.15 债券投资收益

##### 6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	406,287.67
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-297,537.64
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	108,750.03

## 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	42,738,281.79
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	42,608,138.45
减：应计利息总额	426,516.27
减：交易费用	1,164.71
买卖债券差价收入	-297,537.64

## 6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

## 6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

## 6.4.7.16 资产支持证券投资收益

## 6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

## 6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

## 6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

## 6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

## 6.4.7.17 贵金属投资收益

## 6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

## 6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

## 6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

## 6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

## 6.4.7.18 衍生工具收益

## 6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

## 6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

## 6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	60,399.82
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	60,399.82

## 6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-431,586.55
股票投资	-492,409.15
债券投资	60,822.60
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-431,586.55

## 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	222.08
基金转换费收入	90.73
合计	312.81

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

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

## 6.4.7.22 信用减值损失

无。



**6.4.7.23 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
审计费用	14,876.39
信息披露费	-
证券出借违约金	-
银行费用	159.00
账户维护费	18,600.00
合计	33,635.39

**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**

2022 年 4 月 13 日，本基金管理人发布了《融通基金管理有限公司关于公司实际控制人变更的公告》，中国证券监督管理委员会于 2022 年 3 月 24 日依法核准了中国诚通控股集团有限公司成为新时代证券股份有限公司主要股东、融通基金管理有限公司实际控制人。本次变更完成后，本基金管理人控股股东为新时代证券股份有限公司保持不变，本基金管理人实际控制人变更为中国诚通控股集团有限公司。2022 年 6 月 2 日，本基金管理人控股股东的公司名称由“新时代证券股份有限公司”变更为“诚通证券股份有限公司”。

**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：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

**6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易****6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易**

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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	135,338.67	147,172.42
其中：支付销售机构的客户维护费	56,914.11	53,250.39

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 0.70%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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.70\% / \text{当年天数}。$$

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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	38,668.15	42,049.33

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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	融通增强收益债券 A	融通增强收益债券 C	合计
融通基金	-	8,525.75	8,525.75
合计	-	8,525.75	8,525.75
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 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		
	融通增强收益债券 A	融通增强收益债券 C	合计
融通基金	-	19,116.91	19,116.91
合计	-	19,116.91	19,116.91

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值 0.35%的年费率计提，逐日

累计至每月月底，按月支付给融通基金，再由融通基金计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日销售服务费 = 前一日 C 类基金资产净值 × 0.35% / 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 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

##### 6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

##### 6.4.10.5.2 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。

#### 6.4.10.6 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 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021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	38,090.45	974.99	78,989.87	1,394.54

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。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 6.4.10.8 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(2022年6月30日)本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2022 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 4,500,000.00 元，截至 2022 年 7 月 4 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。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为债券型基金。本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金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。本基金的活期银行存款和部分定期存款（若有）存放在本基金的托管人中国工商银行；其他定期存款（若有）存放在具有存款资格的商业银行，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

无。

**6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资**

无。

**6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

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 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
AAA	12,742,680.01	6,919,489.98
AAA 以下	5,390,236.46	8,136,291.40
未评级	16,535,916.49	22,058,042.90
合计	34,668,832.96	37,113,824.28

注：1、未评级部分为国债、政策性金融债和国开债。

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**

无。

**6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

无。

**6.4.13.3 流动性风险**

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

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

于 2022 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额中有 4,500,000.00 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(净资产)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发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制）。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2022 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 2022 年 6 月 30 日，本基金最后交易日的组合资产中 7 个工作日可变现资产账面金额与净赎回金额符合上述法规要求。

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

#### 6.4.13.4 市场风险

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

#### 6.4.13.4.1 利率风险

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

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

本基金投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种比重较大，此外还持有银行存款、结算备付金、存出保证金和买入返售金融资产等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022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	38,090.45	-	-	-	38,090.45
结算备付金	247,553.30	-	-	-	247,553.30
存出保证金	3,861.44	-	-	-	3,861.44
交易性金融资产	5,799,996.03	19,405,969.18	9,462,867.75	7,723,322.83	42,392,155.79
应收清算款	-	-	-	554,565.46	554,565.46
资产总计	6,089,501.22	19,405,969.18	9,462,867.75	8,277,888.29	43,236,226.44
负债					
应付赎回款	-	-	-	30.25	30.25
应付管理人报酬	-	-	-	21,933.25	21,933.25
应付托管费	-	-	-	6,266.67	6,266.67
卖出回购金融资产款	4,500,000.00	-	-	-	4,500,000.00
应付销售服务费	-	-	-	1,410.27	1,410.27
应交税费	-	-	-	139.03	139.03
其他负债	-	-	-	30,662.31	30,662.31
负债总计	4,500,000.00	-	-	60,441.78	4,560,441.78
利率敏感度缺口	1,589,501.22	19,405,969.18	9,462,867.75	8,217,446.51	38,675,784.66
上年度末 2021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	1,235,864.49	-	-	-	1,235,864.49
结算备付金	447,373.76	-	-	-	447,373.76
存出保证金	3,635.31	-	-	-	3,635.31
交易性金融资产	10,565,596.20	16,894,384.50	9,653,843.58	6,906,519.61	44,020,343.89
应收利息	-	-	-	417,663.52	417,663.52
应收申购款	-	-	-	1,296,529.94	1,296,529.94
资产总计	12,252,469.76	16,894,384.50	9,653,843.58	8,620,713.07	47,421,410.91
负债					



应付赎回款	-	-	-	3,053,501.43	3,053,501.43
应付管理人报酬	-	-	-	24,243.37	24,243.37
应付托管费	-	-	-	6,926.67	6,926.67
应付证券清算款	-	-	-	350,493.70	350,493.70
卖出回购金融资产款	500,000.00	-	-	-	500,000.00
应付销售服务费	-	-	-	1,519.55	1,519.55
应付交易费用	-	-	-	5,952.59	5,952.59
应付利息	-	-	-	-452.05	-452.05
应交税费	-	-	-	81.03	81.03
其他负债	-	-	-	41,592.34	41,592.34
负债总计	500,000.00	-	-	3,483,858.63	3,983,858.63
利率敏感度缺口	11,752,469.76	16,894,384.50	9,653,843.58	5,136,854.44	43,437,552.28

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2022年6月30日）	上年度末（2021年12月31日）
分析	1. 市场利率下降 25 个基点	420,927.74	392,474.26
	2. 市场利率上升 25 个基点	-411,431.08	-383,977.95

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日		上年度末 2021年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	7,723,322.83	19.97	6,906,519.61	15.90

交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	7,723,322.83	19.97	6,906,519.61	15.90

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2022 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性权益类投资公允价值占基金净资产的比例为 19.97%(2021 年 12 月 31 日：15.90%)，因此除市场利率以外的市场价格因素的变动对于本基金净资产无重大影响(2021 年 12 月 31 日：同)。

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	23,699,937.60	19,861,501.01
第二层次	18,692,218.19	24,158,842.88
第三层次	-	-
合计	42,392,155.79	44,020,343.89

###### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

###### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2022 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2021 年 12 月 31

日：同)。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

#### 6.4.15 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	7,723,322.83	17.86
	其中：股票	7,723,322.83	17.86
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	34,668,832.96	80.18
	其中：债券	34,668,832.96	80.18
	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	285,643.75	0.66
8	其他各项资产	558,426.90	1.29
9	合计	43,236,226.44	100.00

#### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

##### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	60,797.00	0.16
B	采矿业	266,416.00	0.69
C	制造业	5,019,708.81	12.98
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	68,502.00	0.18
E	建筑业	41,538.00	0.11
F	批发和零售业	62,060.00	0.16
G	交通运输、仓储和邮政业	282,337.00	0.73
H	住宿和餐饮业	81,770.00	0.21
I	信息传输、软件和信息技术服务业	366,776.72	0.95
J	金融业	469,724.10	1.21
K	房地产业	529,338.00	1.37

L	租赁和商务服务业	222,263.40	0.57
M	科学研究和技术服务业	100,738.80	0.26
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	94,017.00	0.24
R	文化、体育和娱乐业	57,336.00	0.15
S	综合	-	-
	合计	7,723,322.83	19.97

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600048	保利发展	24,200	422,532.00	1.09
2	002179	中航光电	3,780	239,349.60	0.62
3	600031	三一重工	12,200	232,532.00	0.60
4	600519	贵州茅台	100	204,500.00	0.53
5	002142	宁波银行	4,210	150,760.10	0.39
6	002475	立讯精密	3,900	131,781.00	0.34
7	603606	东方电缆	1,700	130,220.00	0.34
8	688063	派能科技	406	126,753.20	0.33
9	688800	瑞可达	961	121,383.91	0.31
10	688052	纳芯微	307	116,340.72	0.30
11	000333	美的集团	1,900	114,741.00	0.30
12	601838	成都银行	6,900	114,402.00	0.30
13	002304	洋河股份	600	109,890.00	0.28
14	600522	中天科技	4,700	108,570.00	0.28
15	601155	新城控股	4,200	106,806.00	0.28
16	600256	广汇能源	9,400	99,076.00	0.26
17	601012	隆基绿能	1,484	98,878.92	0.26
18	300568	星源材质	3,400	98,736.00	0.26
19	000568	泸州老窖	400	98,616.00	0.25
20	600809	山西汾酒	300	97,440.00	0.25
21	300015	爱尔眼科	2,100	94,017.00	0.24
22	300760	迈瑞医疗	300	93,960.00	0.24
23	601888	中国中免	400	93,172.00	0.24
24	603737	三棵树	700	90,601.00	0.23
25	601088	中国神华	2,600	86,580.00	0.22
26	002493	荣盛石化	5,600	86,184.00	0.22

27	300776	帝尔激光	480	82,944.00	0.21
28	600754	锦江酒店	1,300	81,770.00	0.21
29	000338	潍柴动力	6,400	79,808.00	0.21
30	688123	聚辰股份	747	79,570.44	0.21
31	002850	科达利	500	79,500.00	0.21
32	300496	中科创达	600	78,288.00	0.20
33	600026	中远海能	7,500	77,475.00	0.20
34	603290	斯达半导	200	77,180.00	0.20
35	603816	顾家家居	1,300	73,619.00	0.19
36	688599	天合光能	1,105	72,101.25	0.19
37	002271	东方雨虹	1,400	72,058.00	0.19
38	000999	华润三九	1,600	72,000.00	0.19
39	601872	招商轮船	12,400	71,424.00	0.18
40	601058	赛轮轮胎	6,300	71,001.00	0.18
41	600030	中信证券	3,200	69,312.00	0.18
42	600025	华能水电	9,800	68,502.00	0.18
43	601009	南京银行	6,500	67,730.00	0.18
44	600036	招商银行	1,600	67,520.00	0.17
45	002594	比亚迪	200	66,698.00	0.17
46	300122	智飞生物	600	66,606.00	0.17
47	600801	华新水泥	3,400	66,334.00	0.17
48	300763	锦浪科技	300	63,900.00	0.17
49	603259	药明康德	600	62,394.00	0.16
50	601933	永辉超市	14,500	62,060.00	0.16
51	000683	远兴能源	5,800	60,958.00	0.16
52	002714	牧原股份	1,100	60,797.00	0.16
53	002372	伟星新材	2,500	60,100.00	0.16
54	688180	君实生物	787	59,292.58	0.15
55	300627	华测导航	1,680	57,775.20	0.15
56	300662	科锐国际	1,100	57,079.00	0.15
57	000625	长安汽车	3,250	56,290.00	0.15
58	300752	隆利科技	2,300	56,258.00	0.15
59	300587	天铁股份	2,700	55,161.00	0.14
60	603067	振华股份	4,400	55,132.00	0.14
61	688776	国光电气	324	55,076.76	0.14
62	600085	同仁堂	1,000	52,880.00	0.14
63	600989	宝丰能源	3,500	51,275.00	0.13
64	601111	中国国航	4,400	51,084.00	0.13
65	601677	明泰铝业	2,120	50,456.00	0.13
66	002959	小熊电器	800	49,864.00	0.13
67	688518	联赢激光	1,467	49,863.33	0.13
68	688078	龙软科技	1,000	49,470.00	0.13

69	600938	中国海油	2,800	48,860.00	0.13
70	000786	北新建材	1,400	48,468.00	0.13
71	600941	中国移动	800	48,400.00	0.13
72	002832	比音勒芬	1,900	47,880.00	0.12
73	002223	鱼跃医疗	1,800	46,188.00	0.12
74	002831	裕同科技	1,500	44,325.00	0.11
75	603558	健盛集团	3,600	43,992.00	0.11
76	300979	华利集团	600	43,848.00	0.11
77	000822	山东海化	4,300	43,688.00	0.11
78	603300	华铁应急	5,320	42,400.40	0.11
79	600406	国电南瑞	1,560	42,120.00	0.11
80	002311	海大集团	700	42,007.00	0.11
81	688072	拓荆科技	269	41,721.90	0.11
82	600600	青岛啤酒	400	41,568.00	0.11
83	000498	山东路桥	4,300	41,538.00	0.11
84	601975	招商南油	10,300	41,509.00	0.11
85	601021	春秋航空	700	40,845.00	0.11
86	001215	千味央厨	700	39,403.00	0.10
87	002068	黑猫股份	2,800	39,060.00	0.10
88	300416	苏试试验	1,560	38,344.80	0.10
89	000933	神火股份	2,900	37,932.00	0.10
90	000799	酒鬼酒	200	37,162.00	0.10
91	300146	汤臣倍健	1,700	36,805.00	0.10
92	603486	科沃斯	300	36,567.00	0.09
93	002353	杰瑞股份	900	36,270.00	0.09
94	002422	科伦药业	1,900	35,530.00	0.09
95	688112	鼎阳科技	578	35,338.92	0.09
96	300767	震安科技	600	34,908.00	0.09
97	601689	拓普集团	500	34,215.00	0.09
98	601098	中南传媒	3,600	33,984.00	0.09
99	600557	康缘药业	2,200	32,318.00	0.08
100	300687	赛意信息	1,400	32,158.00	0.08
101	600988	赤峰黄金	2,000	31,900.00	0.08
102	002472	双环传动	1,000	31,840.00	0.08
103	002027	分众传媒	4,400	29,612.00	0.08
104	601952	苏垦农发	2,100	29,379.00	0.08
105	603517	绝味食品	500	28,910.00	0.07
106	002371	北方华创	100	27,712.00	0.07
107	605338	巴比食品	900	27,459.00	0.07
108	300413	芒果超媒	700	23,352.00	0.06
109	603236	移远通信	130	17,375.80	0.04

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

## 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300059	东方财富	300,316.20	0.69
2	000656	金科股份	190,434.00	0.44
3	601838	成都银行	175,375.00	0.40
4	002179	中航光电	174,793.00	0.40
5	002475	立讯精密	144,263.00	0.33
6	000333	美的集团	127,944.00	0.29
7	600048	保利发展	116,872.00	0.27
8	002142	宁波银行	111,680.00	0.26
9	601658	邮储银行	109,014.00	0.25
10	002493	荣盛石化	104,769.00	0.24
11	601009	南京银行	104,625.00	0.24
12	601155	新城控股	104,310.00	0.24
13	000999	华润三九	89,006.00	0.20
14	600030	中信证券	88,040.00	0.20
15	300568	星源材质	85,124.00	0.20
16	688063	派能科技	83,592.79	0.19
17	688052	纳芯微	81,324.30	0.19
18	601872	招商轮船	81,300.00	0.19
19	601888	中国中免	80,698.00	0.19
20	000552	靖远煤电	79,825.00	0.18

注：“买入金额”是指买入股票成交金额，即成交单价乘以成交数量，相关交易费用不考虑。

## 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300059	东方财富	358,497.95	0.83
2	300750	宁德时代	182,520.00	0.42
3	688536	思瑞浦	146,612.00	0.34
4	601100	恒立液压	131,606.88	0.30
5	000656	金科股份	124,414.00	0.29
6	002142	宁波银行	116,993.00	0.27
7	300274	阳光电源	115,521.00	0.27
8	601658	邮储银行	96,332.00	0.22
9	600887	伊利股份	89,577.00	0.21
10	300347	泰格医药	88,028.00	0.20
11	000552	靖远煤电	81,313.00	0.19
12	603297	永新光学	76,307.00	0.18
13	300088	长信科技	73,917.00	0.17

14	600111	北方稀土	73,675.00	0.17
15	601668	中国建筑	69,794.00	0.16
16	000875	吉电股份	68,865.00	0.16
17	002245	蔚蓝锂芯	68,477.00	0.16
18	601800	中国交建	68,196.00	0.16
19	601838	成都银行	66,811.00	0.15
20	600958	东方证券	66,186.00	0.15

注：“卖出金额”是指卖出股票成交金额，即成交单价乘以成交数量，相关交易费用不考虑。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	8,708,916.86
卖出股票收入（成交）总额	6,787,892.05

注：表中“买入股票成本（成交）总额”及“卖出股票收入（成交）总额”均指成交金额，即成交单价乘以成交数量，相关交易费用不考虑。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	7,433,046.52	19.22
2	央行票据	-	-
3	金融债券	11,259,171.67	29.11
	其中：政策性金融债	9,102,869.97	23.54
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	15,976,614.77	41.31
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	34,668,832.96	89.64

#### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	108615	国开 2105	50,000	5,118,830.14	13.24
2	132009	17 中油 EB	35,500	3,751,416.30	9.70
3	018008	国开 1802	35,000	3,693,946.03	9.55
4	110059	浦发转债	32,000	3,391,960.55	8.77
5	019569	17 国债 15	21,390	2,425,051.69	6.27

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无。



**7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细**

无。

**7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细**

无。

**7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明****7.10.1 本期国债期货投资政策**

无。

**7.10.2 本期国债期货投资评价**

无。

**7.11 投资组合报告附注****7.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期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：**

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。根据发布的相关公告，该证券发行主体因未依法履行职责，多次受到监管机构的处罚。

2、本基金投资的前十名证券中的国开 2105、国开 1802，其发行主体为国家开发银行。根据发布的相关公告，该证券发行主体因未依法履行职责，受到银保监会的处罚。

3、本基金投资的前十名证券中的 20 兴业银行永续债，其发行主体为兴业银行股份有限公司。根据发布的相关公告，该证券发行主体因未依法履行职责，多次受到监管机构的处罚。

投资决策说明：本基金投资上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

**7.11.2 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。****7.11.3 期末其他各项资产构成**

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	3,861.44
2	应收清算款	554,565.46
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	558,426.90

## 7.11.4 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	132009	17 中油 EB	3,751,416.30	9.70
2	110059	浦发转债	3,391,960.55	8.77
3	123114	三角转债	1,038,831.95	2.69
4	123133	佩蒂转债	1,021,419.62	2.64
5	113042	上银转债	906,799.73	2.34
6	128109	楚江转债	665,995.89	1.72
7	127045	牧原转债	644,999.18	1.67
8	110083	苏租转债	605,258.49	1.56
9	127025	冀东转债	458,391.04	1.19
10	128035	大族转债	451,273.97	1.17
11	127022	恒逸转债	254,172.38	0.66
12	127049	希望转 2	245,631.29	0.64
13	127017	万青转债	243,290.47	0.63
14	113623	凤 21 转债	229,444.11	0.59
15	113044	大秦转债	218,116.16	0.56
16	128145	日丰转债	204,002.82	0.53
17	113634	珀莱转债	139,794.79	0.36
18	123107	温氏转债	131,293.01	0.34
19	128119	龙大转债	126,954.22	0.33
20	113593	沪工转债	116,365.01	0.30

## 7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
融通增强收益债券 A	790	33,339.76	84.45	0.00	26,338,323.82	100
融通增强收益债券 C	5	822,310.83	4,103,113.85	99.79	8,440.28	0.21
合计	795	38,301.84	4,103,198.30	13.48	26,346,764.10	86.52

## 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	融通增强收益债券 A	0.00	0.0000

从业人员持有本基金	融通增强收益债券 C	0.00	0.0000
	合计	0.00	0.0000

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	融通增强收益债券 A	0
	融通增强收益债券 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	融通增强收益债券 A	0
	融通增强收益债券 C	0
	合计	0

### § 9 开放式基金份额变动

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）基金份额总额	80,015,551.49	4,103,113.85
本报告期期初基金份额总额	29,155,593.26	4,114,996.81
本报告期基金总申购份额	403,461.16	32,510.55
减：本报告期基金总赎回份额	3,220,646.15	35,953.23
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	26,338,408.27	4,111,554.13

### § 10 重大事件揭示

#### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

#### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

##### 10.2.1 基金管理人的重大变动

2022 年 5 月 30 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》，本基金管理人董事长由高峰变更为张威，上述变更事项经本基金管理人股东会 2022 年第一次临时会议、第六届董事会第十九次临时会议审议并通过。

##### 10.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

#### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产及基金托管业务的诉讼事项。

**10.4 基金投资策略的改变**

本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

**10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况**

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

**10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况**

本报告期内，本基金的基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

**10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况****10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况**

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
东兴证券	2	5,940,249.22	39.04	5,443.25	39.10	-
野村东方证券	1	3,722,877.95	24.47	3,392.80	24.37	-
华西证券	3	1,560,396.50	10.25	1,421.96	10.21	-
中泰证券	4	1,463,096.78	9.61	1,347.76	9.68	-
西部证券	3	1,460,654.46	9.60	1,330.94	9.56	-
开源证券	2	1,069,629.80	7.03	985.75	7.08	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
东方财富	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	2	-	-	-	-	-
华金证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
华鑫证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
万联证券	2	-	-	-	-	-
诚通证券	2	-	-	-	-	-

浙商证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
中信证券 (华南)	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

本基金本报告期末新增交易单元，新时代证券更名为诚通证券。

#### 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 (%)
东兴证券	26,429,499.88	35.71	334,700,000.00	79.84	-	-
野村东方 证券	5,424,834.68	7.33	15,200,000.00	3.63	-	-

华西证券	14,388,937.66	19.44	2,200,000.00	0.52	-	-
中泰证券	1,796,598.29	2.43	-	-	-	-
西部证券	19,339,117.99	26.13	67,100,000.00	16.01	-	-
开源证券	5,081,768.63	6.87	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	1,547,577.69	2.09	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
诚通证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中信证券 (华南)	-	-	-	-	-	-

### 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参加宁波银行股份有限公司申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-01-25
2	融通基金管理有限公司关于参加平安证券股份有限公司前端申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-02-21
3	关于旗下部分开放式基金新增申万宏源西部证券有限公司为销售机构并开通定期定额申购、转换业务及参加其申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-03-07

4	融通关于旗下部分开放式基金新增和讯信息科技有限公司为销售机构并参加其费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-03-28
5	融通关于旗下部分开放式基金新增嘉实财富管理有限公司为销售机构并参加其费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-03-29
6	融通关于旗下部分开放式基金新增北京中植基金销售有限公司为销售机构并参加其费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-04-06
7	融通基金管理有限公司关于公司实际控制人变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-04-13
8	融通基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-05-30
9	融通基金管理有限公司关于公司股东名称变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-06-10

### § 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

无。

#### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

2022 年 4 月 13 日，本基金管理人发布了《融通基金管理有限公司关于公司实际控制人变更的公告》，中国证券监督管理委员会于 2022 年 3 月 24 日依法核准了中国诚通控股集团有限公司成为新时代证券股份有限公司主要股东、融通基金管理有限公司实际控制人。本次变更完成后，本基金管理人控股股东为新时代证券股份有限公司保持不变，本基金管理人实际控制人变更为中国诚通控股集团有限公司。2022 年 6 月 2 日，本基金管理人控股股东的公司名称由“新时代证券股份有限公司”变更为“诚通证券股份有限公司”。

2022 年 5 月 30 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》，本基金管理人董事长由高峰变更为张威，上述变更事项经本基金管理人股东会 2022 年第一次临时会议、第六届董事会第十九次临时会议审议并通过。

2022 年 7 月，经本基金管理人股东会表决通过，股东诚通证券股份有限公司提名的罗林先生、罗小平先生任公司董事，股东日兴资产管理有限公司（Nikko Asset Management Co., Ltd）提名的吕秋梅女士任公司董事；宗文龙先生、李曙光先生、席德应先生任公司独立董事。王利先生、律磊先生、大柳雄二（Yuji Ooyagi）先生不再担任公司董事；杜婕女士、施天涛先生、田利辉先生不再担任公司独立董事。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会批准融通通泰保本混合型证券投资基金设立的文件
- (二) 《融通通泰保本混合型证券投资基金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》
- (三) 《融通增强收益债券型证券投资基金基金合同》
- (四) 《融通增强收益债券型证券投资基金托管协议》
- (五) 《融通增强收益债券型证券投资基金招募说明书》及更新
- (六) 融通基金管理有限公司业务资格批件和营业执照
- (七) 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

2022 年 8 月 26 日