

融通增利债券型证券投资基金

2017 年半年度报告摘要

2017 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：中信银行股份有限公司

送出日期：2017 年 8 月 28 日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中信银行股份有限公司根据融通增利债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)基金合同规定，于 2017 年 8 月 18 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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	融通增利债券
基金主代码	002579
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 4 月 1 日
基金管理人	融通基金管理有限公司
基金托管人	中信银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	989,514,162.77 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的前提下，力争获得高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金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以及资产支持证券的投资策略等部分。
业绩比较基准	中债综合全价（总值）指数
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	中信银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	涂卫东	方韡
	联系电话	(0755) 26948666	4006800000
	电子邮箱	service@mail.rtfund.com	fangwei@citicbank.com
客户服务电话		400-883-8088、(0755) 26948088	95558
传真		(0755) 26935005	010-85230024

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.rtfund.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人处、基金托管人处

§ 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(2017 年 1 月 1 日 - 2017 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	15,092,378.96
本期利润	10,292,825.08
加权平均基金份额本期利润	0.0104
本期基金份额净值增长率	1.00%

3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.0031
期末基金资产净值	992,602,454.48
期末基金份额净值	1.003

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）。

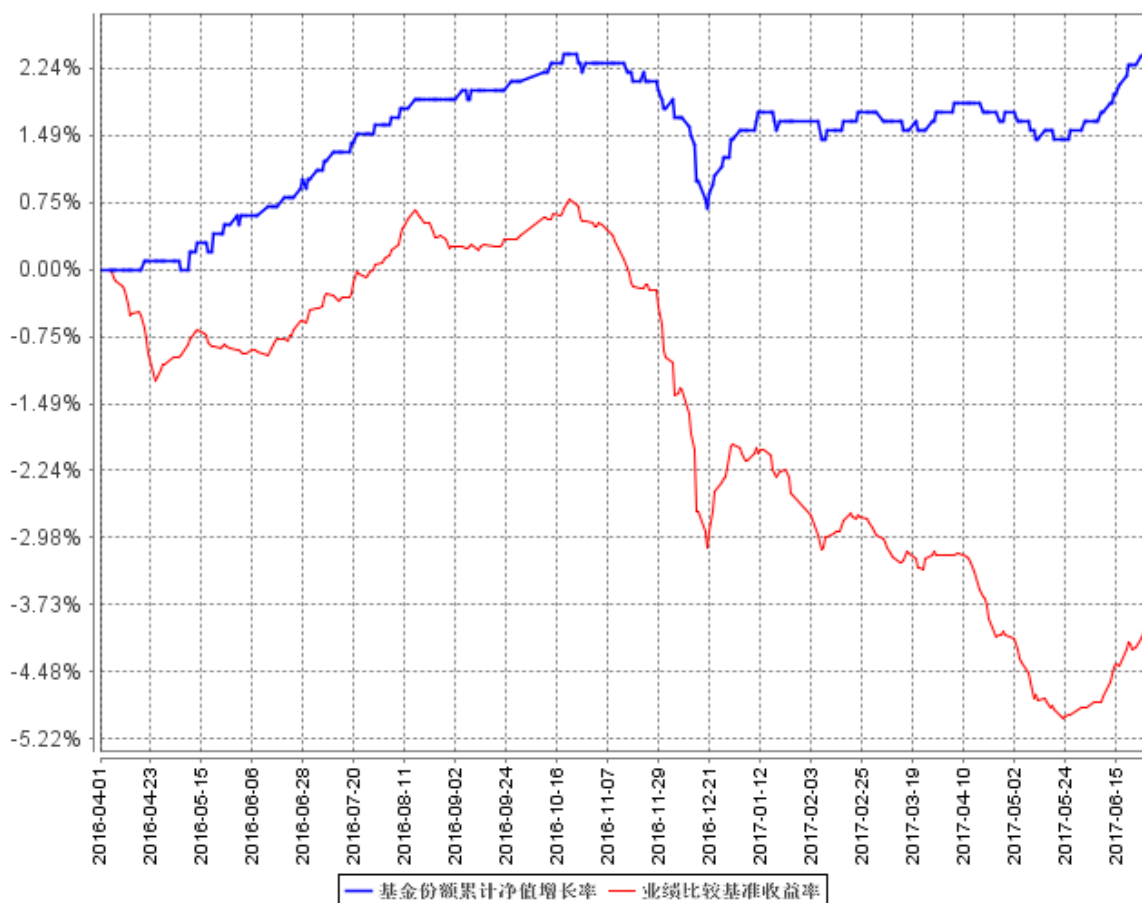
3.2 基金净值表现

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	0.90%	0.05%	0.90%	0.06%	0.00%	-0.01%
过去三个月	0.70%	0.06%	-0.88%	0.08%	1.58%	-0.02%
过去六个月	1.00%	0.06%	-2.11%	0.08%	3.11%	-0.02%
过去一年	1.46%	0.06%	-3.50%	0.10%	4.96%	-0.04%
自基金合同生效起至今	2.47%	0.06%	-4.02%	0.09%	6.49%	-0.03%

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

基金份额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 2016 年 4 月 1 日。

2、本基金的建仓期为自合同生效日起 6 个月，截止报告期末，各项资产配置比例符合合同规定。

§ 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（Nikko Asset Management Co., Ltd.）40%。

截至 2017 年 6 月 30 日，公司共管理六十六只开放式基金：即融通新蓝筹混合基金、融通债券基金、融通深证 100 指数基金、融通蓝筹成长混合基金、融通行业景气混合基金、融通巨潮 100 指数基金（LOF）、融通易支付货币基金、融通动力先锋股票基金、融通领先成长混合基金（LOF）、

融通内需驱动混合基金、融通深证成份指数基金、融通四季添利债券基金、融通创业板指数基金、融通医疗保健混合基金、融通岁岁添利定期开放债券基金、融通丰利四分法（QDII-FOF）基金、融通汇财宝货币市场基金、融通可转债债券基金、融通通泰保本混合基金、融通通泽混合基金、融通通福债券基金（LOF）、融通通源短融债券基金、融通通瑞债券基金、融通月月添利基金、融通健康产业混合基金、融通转型三动力混合基金、融通互联网传媒混合基金、融通新区域新经济混合基金、融通通鑫混合基金、融通新能源混合基金、融通军工分级指数基金、融通证券分级指数基金、融通中证大农业指数基金（LOF）、融通跨界成长混合基金、融通新机遇混合基金、融通成长 30 混合基金、融通中国风 1 号混合基金、融通通盈保本混合基金、融通增利债券基金、融通增裕债券基金、融通增鑫债券基金、融通增益债券基金、融通增祥债券基金、融通新消费混合基金、融通增丰债券基金、融通通安债券基金、融通通优债券基金、融通通乾研究精选混合基金、融通新趋势混合基金、融通通景混合基金、融通国企改革新机遇混合基金、融通通尚混合基金、融通新优选混合基金、融通通裕债券基金、融通通和债券基金、融通沪港深智慧生活混合基金、融通现金宝货币市场基金、融通通祺债券基金、融通稳利债券基金、融通通宸债券基金、融通通玺债券基金和融通通穗债券基金、融通通弘债券基金、融通通润债券基金、融通通颐定期开放债券基金、融通人工智能指数基金（LOF）。其中，融通债券基金、融通深证 100 指数基金和融通蓝筹成长混合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		
王涛	本基金的基金经理	2016 年 4 月 1 日	-	14	王涛先生，南开大学经济学硕士，14 年证券投资从业经历，具有基金从业资格。历任中国工商银行深圳市分行外汇及衍生品交易员、招商银行总行金融市场部交易员、东莞证券固定收益类产品投资经理。2014 年 9 月加入融通基金管理有限公司，现任融通易支付货币、融通汇财宝货币（由原融通七天理财债券转型而来）、融通通源短融债券、融通增利债券、融通通安债券、融通月月添利定期开放债

					券、融通通福债券（LOF）（由原融通通福分级债券转型而来）、融通通和债券、融通通祺债券、融通通宸债券、融通通玺债券、融通通穗债券、融通通弘债券、融通通颐定期开放债券基金的基金经理。
--	--	--	--	--	--

注：1、任免日期根据基金管理人对外披露的任免日期填写；证券从业年限以从事证券业务相关工作的时间为计算标准。

2、2017 年 7 月 29 日起，王涛先生不再担任本基金的基金经理，由黄浩荣先生担任本基金的基金经理。具体内容请参阅 2017 年 7 月 29 日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上刊登的相关公告。

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

2017 年上半年，宏观基本面相对稳定，受到货币政策收紧和监管政策双重影响，利率债市场主要表现为收益率的显著上升以及期限利差的持续收窄两大特征，并且短端调整幅度明显大于长端；信用债收益率年初以来出现了明显上行，从 5 月开始见顶回落。信用利差方面，短融中票的

信用利差出现了主动走扩，4 月份进一步走扩，6 月份利差收窄较明显。

6 月随着央行提出“削峰填谷”熨平资金周期的货币政策基调，监管部门加强政策解读和预期引导，加之配置资金的入场，近期债市出现了一定的回调，市场情绪快速好转，收益率经历了一波下行。

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 1.003 元；本报告期基金份额净值增长率为 1.00%，业绩比较基准收益率为-2.11%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，一方面未来随着房地产调控、金融去杠杆、地方政府融资限制对实体经济构成压力，基本面对债市有潜在的边际催化因素；全国金融工作会议中既无明显“加重”金融去杠杆笔墨，也未透露政策放松的迹象，因此下半年货币政策整体大概率维持上半年的中性偏紧的态势，监管协调继续加强；

另一方面，困扰市场的几个因素仍然存在。首先，去杠杆政策依然没有结束，从银行同业占比、NCD 发行力度等都可以看出本轮金融去杠杆尚未完全实现目标；第二，下半年债市供求形势并不乐观，上半年紧张氛围中大量债券发行推迟，使得下阶段发行压力有所囤积；第三，在央行流动性“削峰填谷”的操作基调下，不排除央行逆市场预期而动，保持资金整体紧平衡状态的可能性，而这可能会引发市场预期的重新修正。

上半年诸多利空之下，短期债券收益率高点可能已经显现，市场上各机构欠配资金仍存在需求反弹的空间，可能助力债市上涨；但本轮去杠杆过程中，银行和非银机构均面临一定的负债端压力，在债券市场上表现为负债端高成本和需求端的缺位，会制约收益率下行的幅度。因此，整体债市在下半年可能呈现区间震荡格局，组合应把握存在预期差的合适交易性机会。

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指定人员共同组成的估值委员会，通过参考行业协会估值意见、参考独立第三方机构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，估值委员会成员不包含基金经理。

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，风险管理部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计算每日基金净值，每日对基金所投资品种的公开信息、基金会计估值方法的法规等进行搜集并整理汇总，供估值委员会参考，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。基金经理不参与估值决定，参与估值流程各方之间亦不存在任何重大利益冲突，截至报告期末公司未与外部估值定价服务机构签约。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

(1) 本基金于 2017 年 1 月 11 日实施 2016 年第 3 次利润分配，以 2016 年 12 月 31 日的可分配收益为基准，每 10 份基金份额派发红利 0.03 元。

(2) 本基金于 2017 年 3 月 29 日实施 2017 年第 1 次利润分配，以 2017 年 3 月 22 日的可分配收益为基准，每 10 份基金份额派发红利 0.03 元。

(3) 本基金于 2017 年 4 月 14 日实施 2017 年第 2 次利润分配，以 2017 年 3 月 31 日的可分配收益为基准，每 10 份基金份额派发红利 0.02 元。

(4) 本基金于 2017 年 6 月 26 日实施 2017 年第 3 次利润分配，以 2017 年 6 月 20 日的可分配收益为基准，每 10 份基金份额派发红利 0.05 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

自 2016 年 4 月 1 日融通增利债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）成立以来，作为本基金的托管人，中信银行严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何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

本报告期内，本托管人按照国家有关法律法规、基金合同和托管协议要求，对基金管理人——融通基金管理有限公司在本基金投资运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，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，本基金对基金份额持有人进行了 4 次利润分配，分配金额为 12,863,943.71 元。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

由本基金管理人——融通基金管理有限公司编制，并经本托管人复核审查的本半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、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：融通增利债券型证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	384,406.71	4,255,971.15
结算备付金	19,549,294.87	19,399,459.24
存出保证金	3,000.39	34,696.42
交易性金融资产	1,271,041,744.70	1,322,282,511.10
其中：股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	1,271,041,744.70	1,322,282,511.10
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	14,104.08	-
应收利息	25,709,204.73	18,391,319.05
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,316,701,755.48	1,364,363,956.96
负债和所有者权益	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
负债：		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	323,700,000.00	365,500,000.00
应付证券清算款	-	3,185,276.35
应付赎回款	0.15	9.98
应付管理人报酬	244,582.00	253,032.93
应付托管费	81,527.34	84,344.32

应付销售服务费	-	-
应付交易费用	3,725.43	809.60
应交税费	-	-
应付利息	-123,930.61	12,069.13
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	193,396.69	60,000.01
负债合计	324,099,301.00	369,095,542.32
所有者权益：		
实收基金	989,514,162.77	989,608,519.02
未分配利润	3,088,291.71	5,659,895.62
所有者权益合计	992,602,454.48	995,268,414.64
负债和所有者权益总计	1,316,701,755.48	1,364,363,956.96

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值为 1.003，基金份额总额为 989,514,162.77 份。

6.2 利润表

会计主体：融通增利债券型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 4 月 1 日(基金合 同生效日)至 2016 年 6 月 30 日
一、收入	18,947,242.42	4,506,921.72
1. 利息收入	24,033,251.84	3,014,595.23
其中：存款利息收入	150,122.33	428,808.93
债券利息收入	23,883,129.51	2,540,851.30
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	44,935.00
其他利息收入	-	-
2. 投资收益	-286,480.76	-211,152.30
其中：股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-286,480.76	-211,152.30
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	-	-
3. 公允价值变动收益	-4,799,553.88	1,703,478.75
4. 汇兑收益	-	-

5. 其他收入	25.22	0.04
减：二、费用	8,654,417.34	723,520.30
1. 管理人报酬	1,476,788.64	239,118.41
2. 托管费	492,262.92	79,706.15
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	2,756.89	3,954.38
5. 利息支出	6,466,238.12	354,614.01
其中：卖出回购金融资产支出	6,466,238.12	354,614.01
6. 其他费用	216,370.77	46,127.35
三、利润总额	10,292,825.08	3,783,401.42
减：所得税费用	-	-
四、净利润	10,292,825.08	3,783,401.42

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：融通增利债券型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 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）	989,608,519.02	5,659,895.62	995,268,414.64
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	10,292,825.08	10,292,825.08
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-94,356.25	-485.28	-94,841.53
其中：1. 基金申购款	6,064.24	13.99	6,078.23
2. 基金赎回款	-100,420.49	-499.27	-100,919.76
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-12,863,943.71	-12,863,943.71
五、期末所有者权益（基金净值）	989,514,162.77	3,088,291.71	992,602,454.48
项目	上年度可比期间 2016 年 4 月 1 日（基金合同生效日）至 2016 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)	205, 110, 525. 50		205, 110, 525. 50
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	3, 783, 401. 42	3, 783, 401. 42
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	293, 823, 416. 05	1, 175, 292. 97	294, 998, 709. 02
其中: 1. 基金申购款	293, 823, 705. 18	1, 175, 294. 82	294, 999, 000. 00
2. 基金赎回款	-289. 13	-1. 85	-290. 98
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)	498, 933, 941. 55	4, 958, 694. 39	503, 892, 635. 94

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 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。

6.4.2 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的会计差错更正。

6.4.3 关联方关系

6.4.3.1 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。

6.4.3.2 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	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中信银行股份有限公司(“中信银行”)	基金托管人

注: 上述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.4.2 关联方报酬

6.4.4.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月 30日	上年度可比期间 2016年4月1日(基金合同生效日)至 2016年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,476,788.64	239,118.41
其中：支付销售机构的客户维护费	0.32	-

注：1、支付基金管理人融通基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 0.3% 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：

日基金管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.3% / 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。

6.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	上年度可比期间 2016年4月1日(基金合同生效日) 至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	492,262.92	79,706.15

注：支付基金托管人中信银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.1% 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 × 0.1% / 当年天数。

6.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间均无与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间基金管理人均未运用固有资金投资本基金。

6.4.4.4.2 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

本报告期末及上年度末，基金管理人的主要股东及其控制的机构均未持有本基金份额。

6.4.4.5 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 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年4月1日(基金合同生效日)至2016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
中信银行	384,406.71	27,522.59	12,339,540.68	118,484.17

注：本基金的银行存款由基金托管人中信银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

1、本基金本报告期末未买入管理人、托管人的控股股东在承销期内担任副主承销商或分销商所承销的证券；

2、本基金本报告期末未买入管理人、托管人的主要股东（非控股）在承销期承销的股票。

6.4.4.7 其他关联交易事项的说明

本基金无其他关联交易事项的说明。

6.4.5 期末（2017年6月30日）本基金持有的流通受限证券**6.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发而流通受限的证券。

6.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有因暂时停牌而流通受限的股票。

6.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**6.4.5.3.1 银行间市场债券正回购**

本基金本报告期末未持有因从事银行间市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2017 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 323,700,000.00 元，分别于 2017 年 7 月 3 日、2017 年 7 月 4 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，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。

§ 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	固定收益投资	1,271,041,744.70	96.53
	其中：债券	1,271,041,744.70	96.53
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	19,933,701.58	1.51
7	其他各项资产	25,726,309.20	1.95
8	合计	1,316,701,755.48	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	8,980,300.00	0.90
2	央行票据	-	-
3	金融债券	119,620,000.00	12.05
	其中：政策性金融债	119,620,000.00	12.05
4	企业债券	157,902,854.70	15.91
5	企业短期融资券	20,052,000.00	2.02
6	中期票据	187,777,590.00	18.92
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	472,729,000.00	47.63
9	其他	303,980,000.00	30.62
10	合计	1,271,041,744.70	128.05

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	170204	17 国开 04	1,000,000	99,570,000.00	10.03
2	140161	16 辽宁 09	1,000,000	98,320,000.00	9.91
3	140082	16 宁夏 09	600,000	58,704,000.00	5.91
4	1282513	12 滨海建 MTN1	500,000	50,400,000.00	5.08

5	111695294	16 鄞州银行 CD013	500,000	48,445,000.00	4.88
5	111695400	16 内蒙古银行 CD035	500,000	48,445,000.00	4.88
5	111695421	16 稠州银行 CD025	500,000	48,445,000.00	4.88

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

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

本基金本报告期末投资国债期货。

7.7.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.7.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

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没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

7.8.2 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	3,000.39
2	应收证券清算款	14,104.08
3	应收股利	-
4	应收利息	25,709,204.73
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	25,726,309.20

7.8.3 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

§ 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
201	4,922,956.03	989,498,858.27	100.00%	15,304.50	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	1,035.18	0.0001%

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的情况

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 究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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2016年4月1日）基金份额总额	205,110,525.50
本报告期期初基金份额总额	989,608,519.02
本报告期基金总申购份额	6,064.24
减：本报告期基金总赎回份额	100,420.49
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	989,514,162.77

§ 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 基金管理人的重大人事变动

(1) 2017年3月4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公告》，经本基金管理人第五届董事会第十七次临时会议审议并通过，同意孟朝霞女士辞去公司总经理职务，并决定由公司董事长高峰先生代为履行公司总经理职务。

(2) 2017年6月3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》，经本基金管理人第五届董事会第十八次临时会议决议审议并通过，决定由张帆先生担任公司总经理职务，公司董事长高峰先生不再代为履行公司总经理职务。

(3) 2017 年 7 月 29 日起，王涛先生不再担任本基金的基金经理，由黄浩荣先生担任本基金的基金经理。具体内容请参阅 2017 年 7 月 29 日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上刊登的相关公告。

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，基金托管人无重大人事变更。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

在本报告期内没有涉及基金管理人、基金财产、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、托管人及其高级管理人员无受监管部门稽查或处罚的情形。

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	
中金公司	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，本基金无交易单元变更。

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
中金公司	31,293,523.79	100.00%	17,694,200,000.00	100.00%	-	-

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20170101-20170630	989,498,858.27	-	-	989,498,858.27	100.00%
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。

融通基金管理有限公司

二〇一七年八月二十八日