

融通通慧混合型证券投资基金
(原融通国企改革新机遇灵活配置混合型证券投资基金)
2019 年第 2 季度报告

2019 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：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：2019 年 7 月 16 日

§ 1 重要提示

融通通慧混合型证券投资基金是由“融通国企改革新机遇灵活配置混合型证券投资基金”转型而来。2019 年 5 月 11 日至 2019 年 5 月 14 日，“融通国企改革新机遇灵活配置混合型证券投资基金”的管理人融通基金管理有限公司以通讯方式召开了基金份额持有人大会，会议审议并于 2019 年 5 月 15 日表决通过了《关于融通国企改革新机遇灵活配置混合型证券投资基金转型并修改基金合同有关事项的议案》，本次基金份额持有人大会决议报中国证监会报备，并自表决之日起生效。“融通国企改革新机遇灵活配置混合型证券投资基金”基金名称相应变更为“融通通慧混合型证券投资基金”，转型后基金的投资管理程序、投资策略、投资理念、投资范围等部分基金合同内容发生变化。自 2019 年 5 月 16 日起，《融通通慧混合型证券投资基金基金合同》生效，同日起《融通国企改革新机遇灵活配置混合型证券投资基金基金合同》失效。《融通通慧混合型证券投资基金基金合同》生效当日，原融通国企改革新机遇灵活配置混合型证券投资基金收取前端认/申购费用的基金份额（基金代码：002612）结转为融通通慧混合型证券投资基金的 A 类基金份额，原融通国企改革新机遇灵活配置混合型证券投资基金收取后端认/申购费用的基金份额（基金代码：002613）结转为融通通慧混合型证券投资基金的 B 类基金份额。

详情请参阅 2019 年 5 月 16 日刊登在指定报告信息披露媒体上的《关于融通国企改革新机遇灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 7 月 12 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。其中：

转型前（即原融通国企改革新机遇灵活配置混合型证券投资基金）报告期为 2019 年 4 月 1 日起至 2019 年 5 月 15 日止，

转型后（融通通慧混合型证券投资基金）报告期为 2019 年 5 月 16 日起至 2019 年 6 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

2.1 基金基本情况（转型后）

基金简称	融通通慧混合	
基金主代码	002612	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019 年 5 月 16 日	
报告期末基金份额总额	121,324,183.78 份	
投资目标	本基金在严格控制风险并保持基金资产良好流动性的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值。	
投资策略	本基金的资产配置策略主要是通过对宏观经济周期运行规律的研究，基于定量与定性相结合的宏观及市场分析，确定组合中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例，规避系统性风险。	
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×25%+中债综合全价（总值）指数收益率×75%	
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。本基金如果投资港股通标的股票，可能会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。	
基金管理人	融通基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	融通通慧混合 A/B	融通通慧混合 C
下属分级基金的交易代码	002612	007387
下属分级基金的前端交易代码	002612	007387
下属分级基金的后端交易代码	002613	-
报告期末下属分级基金的份额总额	99,850,210.24 份	21,473,973.54 份

注：本基金 A/B 份额由原融通国企改革新机遇灵活配置混合型证券投资基金转型而来，并于转型后合同生效日 2019 年 5 月 16 日增设 C 类份额类别，C 类份额首次确认日为 2019 年 6 月 21 日。

2.1 基金基本情况（转型前）

基金简称	融通国企改革新机遇灵活配置混合
基金主代码	002612
基金运作方式	契约型开放式

基金合同生效日	2016 年 9 月 20 日
报告期末基金份额总额	36,826,147.49 份
投资目标	本基金精选国企改革相关的优质上市公司进行投资, 分享中国国企改革及相关行业、上市公司发展过程中的投资机会, 在严格控制风险的前提下, 力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金的资产配置策略主要是通过对宏观经济周期运行规律的研究, 基于定量与定性相结合的宏观及市场分析, 确定组合中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例, 规避系统性风险。
业绩比较基准	中证国有企业改革指数收益率×50%+中债综合全价(总值)指数收益率×50%
风险收益特征	本基金为混合型基金, 其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金, 但低于股票型基金, 属于中等预期收益和预期风险水平的投资品种。
基金管理人	融通基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标 (转型后)

单位: 人民币元

主要财务指标	报告期(2019年5月16日 - 2019年6月30日)	
	融通通慧混合 A/B	融通通慧混合 C
1. 本期已实现收益	316,506.01	39,463.57
2. 本期利润	180,103.29	-17,457.43
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0045	-0.0008
4. 期末基金资产净值	116,173,774.18	24,982,542.57
5. 期末基金份额净值	1.1635	1.1634

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

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

(3) 本基金于 2019 年 5 月 16 日增设 C 类份额类别, C 类份额首次确认日为 2019 年 6 月 21 日。

3.1 主要财务指标 (转型前)

单位: 人民币元

主要财务指标	报告期(2019年4月1日 - 2019年5月15日)
1. 本期已实现收益	6,774,437.88
2. 本期利润	558,873.72
3. 加权平均基金份额本期	0.0216

利润	
4. 期末基金资产净值	42,627,323.97
5. 期末基金份额净值	1.158

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

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

3.2 基金净值表现（转型后）

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

融通通慧混合 A/B

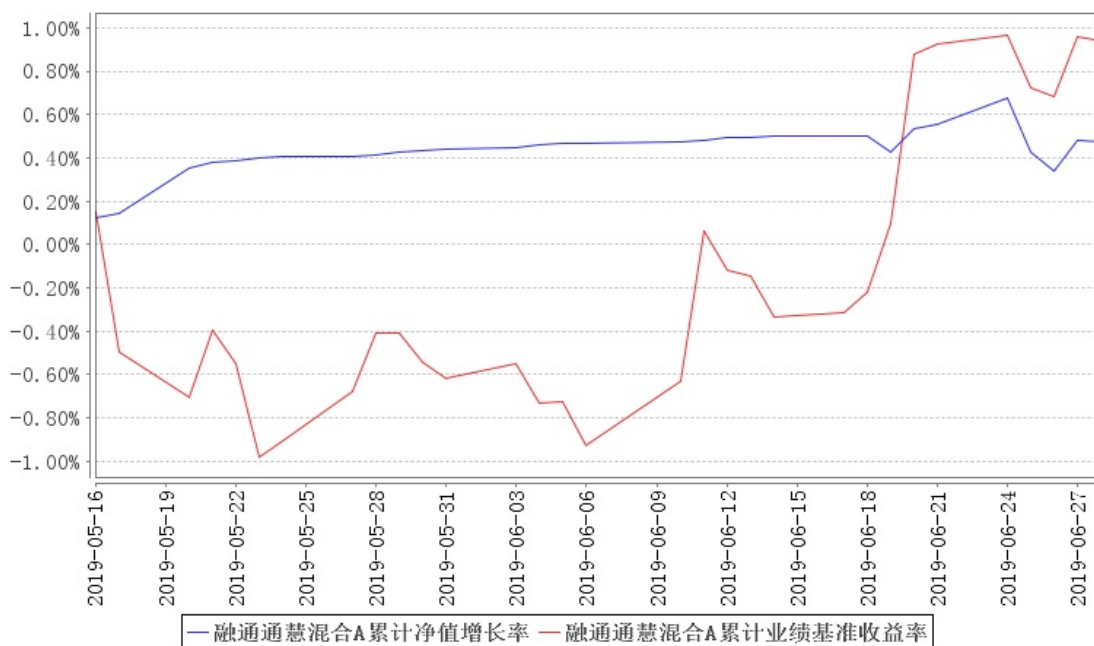
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
自 2019-5-16 至 2019-06-30	0.47%	0.08%	0.94%	0.28%	-0.47%	-0.20%

融通通慧混合 C

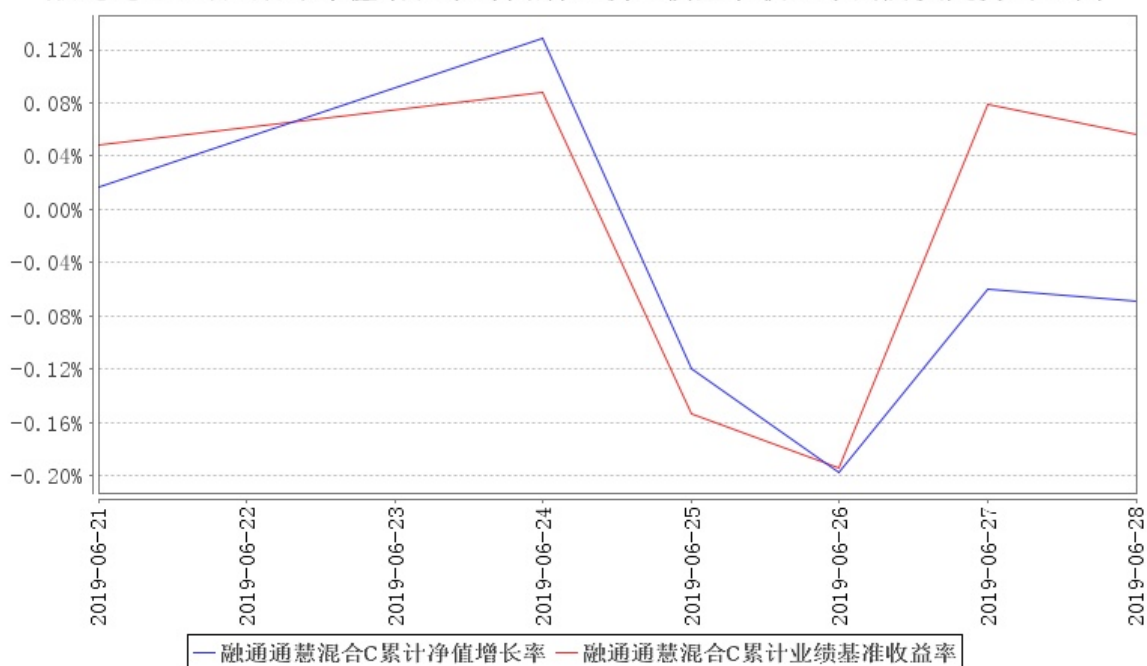
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
自 2019-6-21 至 2019-06-30	-0.07%	0.13%	0.06%	0.15%	-0.13%	-0.02%

3.2.2 自基金转型以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

融通通慧混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



融通通慧混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：（1）本基金转型后的基金合同生效日为 2019 年 5 月 16 日，至报告期末基金转型未满一年。

（2）本基金于 2019 年 5 月 16 日增设 C 类份额类别，C 类份额首次确认日为 2019 年 6 月 21 日。

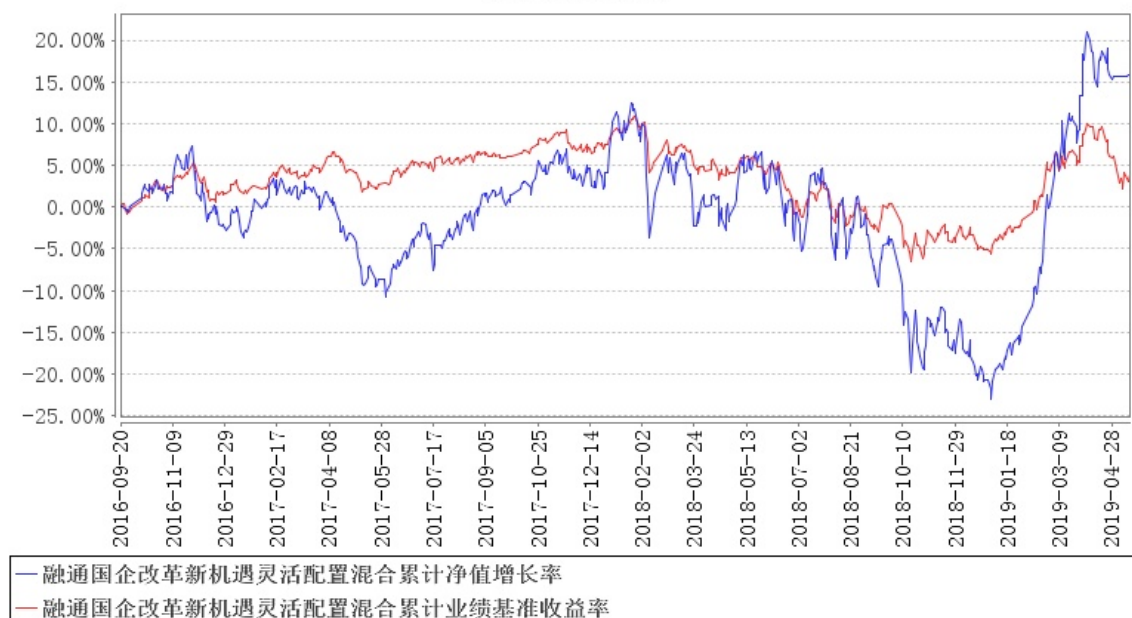
3.2 基金净值表现（转型前）

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
自 2019-04-01 至 2019-05-15	2.12%	1.30%	-3.21%	0.93%	5.33%	0.37%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

融通国企改革新机遇灵活配置混合累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介（转型后）

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
余志勇	本基金的基金经理、研究部总监	2019年5月16	-	19	余志勇先生，武汉大学金融学硕士，19年证券投资从业经历，具有基金从业资格。1992年7月至1997年9月就职于湖北省农业厅任研究员，2000年7月至2004年7月就职于闽发证券公司任研究员，2004年7月至2007年4月就职于招商证券股份有限公司任研究员。2007年4月加入融通基金管理有限公司，历任研究部行业研究员、行业研究组组长、融

					通领先成长混合型证券投资基金 (LOF) 基金经理、融通通泽灵活配置混合基金基金经理、融通增裕债券型证券投资基金基金经理、融通增丰债券型证券投资基金基金经理、融通通景灵活配置混合型证券投资基金基金经理、融通通尚灵活配置混合型证券投资基金基金经理、融通新优选灵活配置混合型证券投资基金基金经理、融通通润债券型证券投资基金基金经理、融通通颐定期开放债券型证券投资基金基金经理、融通新动力灵活配置混合型证券投资基金基金经理，现任公司研究部总监、融通通泰保本混合型证券投资基金基金经理、融通通鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理、融通新机遇灵活配置混合型证券投资基金基金经理、融通四季添利债券型证券投资基金 (LOF) 基金经理、融通通慧混合型证券投资基金基金经理、融通沪港深智慧生活灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
彭炜	本基金的基金经理	2019 年 5 月 16	-	7	彭炜先生，上海交通大学管理科学与工程硕士，7 年证券投资从业经历，具有基金从业资格。2012 年 4 月加入融通基金管理有限公司，历任建筑建材行业研究员、房地产行业研究员、钢铁煤炭行业研究员、周期行业研究组组长、融通国企改革新机遇灵活配置混合型证券投资基金基金经理、融通新区新经济灵活配置混合型证券投资基金基金经理，现任融通中国风 1 号灵活配置混合型证券投资基金基金经理、融通通慧混合型证券投资基金基金经理。

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

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介（转型前）

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
彭炜	本基金的基金经理	2017 年 12 月 5 日	2019 年 5 月 15 日	7	彭炜先生，上海交通大学管理科学与工程硕士，7 年证券投资从业经历，具有基金从业资格。2012 年 4 月加入融通基金管理有限公司，历任建筑建材行业研究员、房地产行业研究员、钢铁煤炭行

					业研究员、周期行业研究组组长、融通国企改革新机遇灵活配置混合型证券投资基金基金经理、融通新区新经济灵活配置混合型证券投资基金基金经理，现任融通中国风 1 号灵活配置混合型证券投资基金基金经理、融通通慧混合型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	--

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

4.2 管理人对报告期内基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金报告期内未发生异常交易。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

A 股市场 1 季度出现了连续的大幅上涨，主要是市场预期从极端悲观状态到边际改善状态的修复，主要推动力来自于政策呵护暖风、流动性改善和中美贸易关系缓和带来的风险偏好提升。但整体经济增长并没有出现明显改善的迹象，依然处于寻底中，因此在 4 月初市场情绪修复基本完成且政策有收紧趋势时，本基金采取了大幅降低仓位的操作。

基金通慧在 2 季度投资方向有一个重大的调整：投资目标以绝对收益为主，并兼顾基金净值增长率的平稳性。因此本基金随后的操作方式是保持较低的仓位，采取组合投资和新股申购的投资策略。

未来通慧在权益投资策略上倾向于采取相对均衡配置的阿尔法策略，力求在行业配置和个股选择上，获取持续稳定的超额收益 α 。主要配置思路有三：第一，在周期股中寻找供需竞争格

局明显好转和行业周期波动性降低的龙头，例如重卡、工程机械等。第二，重点关注在新经济中具有中长期发展前景的细分板块龙头，例如 5G、云计算、新能源等。第三，消费板块中能长期保持竞争优势的企业，例如旅游、医药、食品饮料等。

4.5 报告期内基金的业绩表现

转型后（2019 年 5 月 16 日起至 2019 年 6 月 30 日）

截至本报告期末融通通慧混合 A/B 基金份额净值为 1.1635 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.47%，同期业绩比较基准收益率为 0.94%；

截至本报告期末融通通慧混合 C 基金份额净值为 1.1634 元，本报告期基金份额净值增长率为-0.07%；同期业绩比较基准收益率为 0.06%。

转型前（2019 年 4 月 1 日起至 2019 年 5 月 15 日）

截至 2019 年 5 月 15 日融通国企改革新机遇灵活配置混合型证券投资基金份额净值为 1.158 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.12%，业绩比较基准收益率为-3.21%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

截止 2019 年 5 月 8 日，融通国企改革新机遇灵活配置混合型证券投资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。

2019 年 5 月 16 日，融通国企改革新机遇灵活配置混合型证券投资基金转型为融通通慧混合型证券投资基金。

从 2019 年 5 月 16 日至 6 月 20 日，本基金存在连续二十个工作日以上基金资产净值低于五千万的情形。

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 投资组合报告（转型后）

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	70,288,428.00	46.38
	其中：股票	70,288,428.00	46.38
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	40,000,000.00	26.39
	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	41,210,722.67	27.19
8	其他资产	45,823.84	0.03
9	合计	151,544,974.51	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	6,622,757.00	4.69
C	制造业	10,152,935.00	7.19
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	21,785,887.00	15.43
E	建筑业	1,671,696.00	1.18
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	8,202,386.00	5.81
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	16,826,078.00	11.92
K	房地产业	3,333,474.00	2.36
L	租赁和商务服务业	1,693,215.00	1.20
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	70,288,428.00	49.79

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600660	福耀玻璃	76,700	1,743,391.00	1.24
2	600863	内蒙华电	549,300	1,724,802.00	1.22
3	600585	海螺水泥	41,400	1,718,100.00	1.22
4	601318	中国平安	19,300	1,710,173.00	1.21
5	601888	中国国旅	19,100	1,693,215.00	1.20
6	600900	长江电力	94,400	1,689,760.00	1.20
7	601398	工商银行	286,800	1,689,252.00	1.20
8	601328	交通银行	276,000	1,689,120.00	1.20
9	601139	深圳燃气	296,400	1,686,516.00	1.19
10	601766	中国中车	208,200	1,684,338.00	1.19

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

在法律法规允许的范围内，本基金可基于谨慎原则运用股指期货等相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险，提高投资效率。本基金主要采用流动性好、交易活跃的衍生品合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.2 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。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

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

5.11.2 本基金投资的前十名股票未超出本基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	12,746.95
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	11,666.61
5	应收申购款	21,410.28
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	45,823.84

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 5 投资组合报告（转型前）

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例
----	----	-------	-----------

			(%)
1	权益投资	3,678.42	0.01
	其中：股票	3,678.42	0.01
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	20,800,000.00	39.03
	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	32,341,212.61	60.69
8	其他资产	147,427.10	0.28
9	合计	53,292,318.13	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	3,678.42	0.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	3,678.42	0.01

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300777	中简科技	607	3,678.42	0.01

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

在法律法规允许的范围内，本基金可基于谨慎原则运用股指期货等相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险，提高投资效率。本基金主要采用流动性好、交易活跃的衍生品合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.2 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。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

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

5.11.2 本基金投资的前十名股票未超出本基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	13,627.80
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	13,887.89
5	应收申购款	119,911.41
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	147,427.10

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	300777	中简科技	3,678.42	0.01	新股流通受限

§ 6 开放式基金份额变动（转型后）

单位：份

项目	融通通慧混合 A	融通通慧混合 C
基金合同生效日（2019 年 5 月 16 日）	36,826,147.49	-

管理人持有的本基金份额		
报告期期间基金总申购份额	82,597,881.23	21,473,973.54
减:报告期期间基金总赎回份额	19,573,818.48	-
报告期期间基金拆分变动份额	-	-
报告期期末基金份额总额	99,850,210.24	21,473,973.54

§ 6 开放式基金份额变动 (转型前)

单位: 份

本报告期期初基金份额总额	22,581,482.01
本报告期基金总申购份额	33,535,782.93
减:本报告期基金总赎回份额	19,291,117.45
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	36,826,147.49

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况 (转型后)

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位: 份

报告期期初管理人持有的本基金份额	1,930,501.93
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	1,930,501.93
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%)	1.59

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况 (转型前)

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位: 份

报告期期初管理人持有的本基金份额	1,930,501.93
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	1,930,501.93
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%)	5.24

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息 (转型后)

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20190620-20190630	0.00	42,995,098.46	0.00	42,995,098.46	35.44%
	2	20190620-20190630	0.00	42,971,092.81	0.00	42,971,092.81	35.42%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
当基金份额持有人占比过于集中时，可能存在因某单一基金份额持有人大额赎回而引起基金单位份额净值剧烈波动的风险及流动性风险。							

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- (一) 《关于融通国企改革新机遇灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》
- (二) 《融通通慧混合型证券投资基金基金合同》
- (三) 《融通通慧混合型证券投资基金托管协议》
- (四) 《融通通慧混合型证券投资基金招募说明书》
- (五) 中国证监会批准融通国企改革新机遇灵活配置混合型证券投资基金设立的文件
- (六) 《融通国企改革新机遇灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- (七) 《融通国企改革新机遇灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- (八) 《融通国企改革新机遇灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》及其更新
- (九) 融通基金管理有限公司业务资格批件和营业执照
- (十) 报告期内在指定报刊上披露的各项公告

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

9.3 查阅方式

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

融通基金管理有限公司

2019 年 7 月 16 日