

# 财通资管积极收益债券型发起式证券投资基金

## 2019 年半年度报告摘要

2019 年 06 月 30 日

基金管理人:财通证券资产管理有限公司

基金托管人:中国工商银行股份有限公司

送出日期:2019 年 08 月 27 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年08月22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。

本报告期自2019年01月01日起至2019年06月30日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	财通资管积极收益债券		
基金主代码	002901		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2016年07月19日		
基金管理人	财通证券资产管理有限公司		
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	1, 109, 955, 699. 76份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称	财通资管积极收益债券A	财通资管积极收益债券C	财通资管积极收益债券E
下属分级基金的交易代码	002901	002902	006162
报告期末下属分级基金的份额总额	196, 362, 65 6. 20份	78, 395, 052. 81份	835, 197, 99 0. 75份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在有效控制风险的基础上，通过积极主动的投资管理，力争为投资者实现超越业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金将充分发挥基金管理人的投研能力，采取自上而下的方法对基金的大类资产进行动态配置，综合久期管理、收益率曲线配置等策略对个券进行精选，力争在严格控制基金风险的基础上，获取长期稳定超额收益。另外，本基金可投资于股票、权证等权益类资产，基金管理人将选择估值合理、具有持续竞争优势和较大成长空间的个股进行投资，强化基金的获利能力，提高预期收益水平，以期达到收益增强的效果。
业绩比较基准	中债总指数（全价）收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期风险与预期收益高于货币市场基金，低于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		财通证券资产管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	钱慧	郭明
	联系电话	021-20568207	010-66105799
	电子邮箱	qianh@ctzg.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		95336	95588
传真		021-68753502	010-66105798

## 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	www.ctzg.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

## § 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(2019年01月01日-2019年06月30日)		
	财通资管积极收益债券A	财通资管积极收益债券C	财通资管积极收益债券E
本期已实现收益	3,898,171.01	2,278,224.29	29,536,064.99
本期利润	3,943,743.44	2,557,425.15	30,597,945.06
加权平均基金份额本期利润	0.0190	0.0194	0.0196
本期基金份额净值增长率	1.98%	1.78%	1.94%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年06月30日)		
期末可供分配基金份额利润	0.0570	0.0486	0.0300
期末基金资产净值	207,552,396.96	82,206,086.06	864,304,148.15

期末基金份额净值	1.0570	1.0486	1.0348
----------	--------	--------	--------

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. 期末可供分配利润，为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

### 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

财通资管积极收益债券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	0.17%	0.04%	0.47%	0.07%	-0.30%	-0.03%
过去三个月	0.68%	0.03%	-0.53%	0.11%	1.21%	-0.08%
过去六个月	1.98%	0.03%	-0.37%	0.10%	2.35%	-0.07%
过去一年	5.32%	0.03%	2.70%	0.10%	2.62%	-0.07%
自基金合同生效起至今	15.23%	0.09%	-0.39%	0.11%	15.62%	-0.02%

财通资管积极收益债券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	0.14%	0.04%	0.47%	0.07%	-0.33%	-0.03%

个月						
过去三 个月	0.58%	0.03%	-0.53%	0.11%	1.11%	-0.08%
过去六 个月	1.78%	0.03%	-0.37%	0.10%	2.15%	-0.07%
过去一 年	4.91%	0.03%	2.70%	0.10%	2.21%	-0.07%
自基金 合同生 效起至 今	13.79%	0.09%	-0.39%	0.11%	14.18%	-0.02%

财通资管积极收益债券E

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	0.16%	0.04%	0.47%	0.07%	-0.31%	-0.03%
过去三 个月	0.65%	0.03%	-0.53%	0.11%	1.18%	-0.08%
过去六 个月	1.94%	0.03%	-0.37%	0.10%	2.31%	-0.07%
自基金 合同生 效起至 今	4.50%	0.03%	2.06%	0.10%	2.44%	-0.07%

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

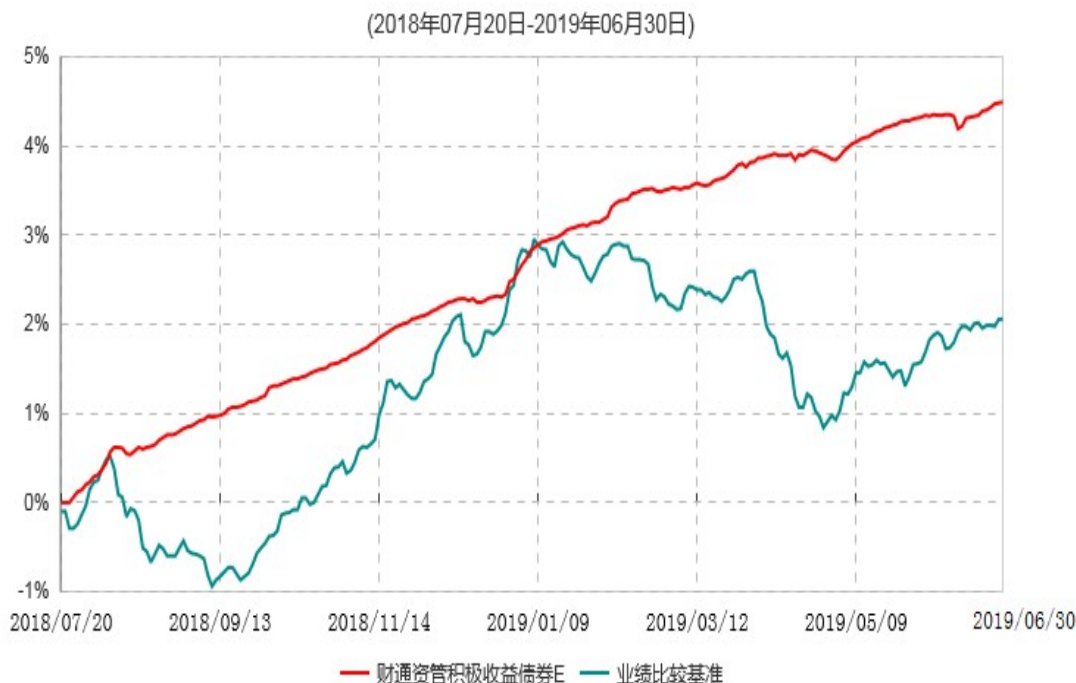
财通资管积极收益债券A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2016年07月19日-2019年06月30日)



财通资管积极收益债券C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2016年07月19日-2019年06月30日)



财通资管积极收益债券E累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



注：自基金合同生效至报告期末，财通资管积极收益债券 A 基金份额净值增长率为 15.23%，同期业绩比较基准收益率为-0.39%；财通资管积极收益债券 C 基金份额净值增长率为 13.79%，同期业绩比较基准收益率为-0.39%；财通资管积极收益债券 E 基金份额净值增长率为 4.50%，同期业绩比较基准收益率为 2.06%。

## § 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

财通证券资产管理有限公司系财通证券股份有限公司的全资子公司，注册资本2亿元人民币。2015年12月，公司获准开展公开募集证券投资基金管理业务。截至2019年06月30日，公司共管理15只基金，分别为财通资管积极收益债券型发起式证券投资基金、财通资管鑫管家货币市场基金、财通资管鑫逸回报混合型证券投资基金、财通资管鑫锐回报混合型证券投资基金、财通资管鸿达纯债债券型证券投资基金、财通资管睿智6个月定期开放债券型发起式证券投资基金、财通资管消费精选灵活配置混合型证券投资基金、财通资管鑫盛6个月定期开放混合型证券投资基金、财通资管瑞享12个月定期开放混合型证券投资基金、财通资管鸿睿12个月定期开放债券型证券投资基金、财通资管鸿益中短债债券型证券投资基金、财通资管鸿利中短债债券型证券投资基金、财通资管鸿运中短债债券型证券投资基金、财通资管价值成长混合型证券投资基金和财通资管中证500指数增强型证券投资基金（LOF）。



#### 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		
宫志芳	本基金基金经理、财通资管鑫管家货币市场基金、财通资管鑫逸回报混合型证券投资基金、财通资管鑫锐回报混合型证券投资基金和财通资管鸿达纯债债券型证券投资基金基金经理。	2017-08-18	-	8	武汉大学数理金融硕士，中级经济师，2010年7月进入浙江泰隆银行资金运营部先后从事外汇交易和债券交易；2012年3月进入宁波通商银行金融市场部筹备债券业务，主要负责资金、债券投资交易，同时15年初筹备并开展贵金属自营业务；2016年3月加入财通证券资产管理有限公司。
顾宇笛	本基金基金经理、财通资管瑞享12个月定期开放混合型证券投资基金、财通资管鸿益中短债债券型证券投资基金、财通资管鸿利中短债债券型证券投资基金、财通资管鸿睿12个月定期开放债券型证券投资基金和财通资管鑫盛6个月定期开放混合型证券投资基金基金经理。	2017-08-29	2019-03-21	4	华东师范大学经济学硕士。2014年6月至2014年12月担任财通证券股份有限公司资产管理部债券研究员；2015年1月至2017年8月担任财通证券资产管理有限公司固定收益部债券研究员，2017年8月起担任基金经理岗位。

注：1、上述任职日期为根据公司确定的聘任日期，离任日期为根据公司确定的解聘日期；首任基金经理任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的涵义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》相关规定。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

在本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金法》和其他相关法律法规的规定以及《财通资管积极收益债券型发起式证券投资基金基金合同》、《财通资管积极收益债券型发起式证券投资基金招募说明书》的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产。本报告期内，基金运作合法合规，没有发生损害基金份额持有人利益的行为。

## 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

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《财通证券资产管理有限公司公平交易管理办法》等规定。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。报告期内，未出现涉及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况，本基金与本公司管理的其他基金在不同时间窗下（如日内、3日内、5日内）同向交易的交易价差未出现异常。

## 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

宏观数据回顾：上半年PMI偏弱，除3、4月份外，制造业PMI均位于荣枯线下方。投资方面，有所企稳但仍然偏弱，前五个月全国固定资产投资（不含农户）同比增长5.6%，基建投资（不含电力）同比增长4.0%，制造业投资增速约2.7%。消费方面，增速减慢，今年前五个月，社会消费品零售总额增长约8.1%，较去年同期下降约1.4个百分点，乘用车销售下降约15%。就业方面5月城镇调查失业率报5.0%保持稳定，但城镇新增就业与PMI从业人员数据走弱。通胀方面，上半年CPI从1.7一路上行至2.7，主要受猪肉和水果价格的拉动；PPI整体持续偏弱，受到下游产业需求不振影响。上半年社融增速略有企稳；进出口增速均有所回落。

产品投资和运作分析：上半年主要以中高评级城投和优质产业债为主，维持适当杠杆，控制整体久期。密切关注各项宏观经济数据、政策面和市场资金面情况，对组合的信用风险和流动性风险实时监控，控制转债持仓占比，适度参与利率品种的波段交易，争取提高组合的超额收益，力争为投资人创造长期投资回报。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末财通资管积极收益债券A基金份额净值为1.0570元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为1.98%，同期业绩比较基准收益率为-0.37%；截至报告期末财通资管积极收益债券C基金份额净值为1.0486元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为1.78%，同期业绩比较基准收益率为-0.37%；截至报告期末财通资管积极收益债券E基金份额净值为1.0348元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为1.94%，同期业绩比较基准收益率为-0.37%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

预计下半年经济偏弱但仍具有韧性，具体表现为：投资中地产表现不弱、基建或小幅改善、制造业底部徘徊，但扣除价格后实际固定资产投资增速仍强；出口增速有所回落但顺差仍可支撑；居民消费或有望在减税政策持续促进下有所改善；通胀方面，下半年生猪补栏、夏令水果上市等或将对CPI起到平抑作用，预计CPI温和上涨幅度可控；短期内下游产业需求不振或延续，PPI预计整体继续偏弱。

下半年“六稳”形势依然不容乐观，未来财政政策或进一步加大灵活性，有望使用更多政策工具精准发力进一步加快减税降费落地速度，更加注意与货币政策协同配合。货币政策方面：中国人民银行货币政策委员会2019年第二季度例会指出，坚持创新和完善宏观调控，适时适度实施逆周期调节，加强宏观政策协调。稳健的货币政策松紧适度，把好货币供给总闸门，不搞“大水漫灌”，保持广义货币M2和社会融资规模增速与国内生产总值名义增速相匹配。

下半年资金利率或短期内保持稳定、窄幅波动，但如果全球经济和贸易形势继续恶化，美联储转向降息，我国有跟进的可能性。

下半年信用债市场或分化更严重，信用利差特别是低评级债的信用利差可能会进一步走阔，市场机构风险偏好或一时难以好转，中高评级信用债收益率或呈现震荡小幅下行，但需要警惕金融供给侧改革可能对负债端稳定性造成的冲击，降低杠杆，进一步提高风险偏好。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，对基金所持有的投资品种进行估值，本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。

为了向基金投资人提供更好的证券投资管理服务，本基金管理人对估值和定价过程进行了严格的控制。本基金管理人在充分衡量市场风险、信用风险、流动性风险、货币风险、衍生工具和结构性产品等影响估值和定价因素的基础上，确定本基金管理人采用

的估值政策。本基金管理人的估值人员均具有专业会计学习经历，具有基金从业人员资格。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司签署提供中债收益率曲线和中债估值的服务协议，由其按约定提供银行间同业市场债券品种的估值数据。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内无利润分配。

#### 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

报告期内，本基金未出现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元的情形。

### § 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，本基金托管人在对财通资管积极收益债券型发起式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，财通资管积极收益债券型发起式证券投资基金的管理人——财通证券资产管理有限公司在财通资管积极收益债券型发起式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。本报告期内，财通资管积极收益债券型发起式证券投资基金未进行利润分配。

#### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对财通证券资产管理有限公司编制和披露的财通资管积极收益债券型发起式证券投资基金2019年半年度报告中财务指标、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：财通资管积极收益债券型发起式证券投资基金

报告截止日：2019年06月30日

单位：人民币元

资 产	本期末 2019年06月30日	上年度末 2018年12月31日
<b>资 产：</b>		
银行存款	99,452,097.07	175,127,832.05
结算备付金	14,845,312.09	7,818,852.40
存出保证金	91,165.39	49,714.15
交易性金融资产	1,295,959,202.30	2,145,939,450.82
其中：股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	1,215,633,131.06	2,035,346,737.10
资产支持证券投资	80,326,071.24	110,592,713.72
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	15,255,861.78	365,090.15
应收利息	24,244,092.01	31,940,876.35
应收股利	-	-
应收申购款	6,333,171.01	8,391,059.40
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,456,180,901.65	2,369,632,875.32
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 2019年06月30日</b>	<b>上年度末 2018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	-	-

卖出回购金融资产款	294,925,812.90	635,777,021.83
应付证券清算款	-	28,213,366.42
应付赎回款	5,292,443.66	9,306,313.07
应付管理人报酬	831,992.06	1,216,111.70
应付托管费	207,998.01	304,027.93
应付销售服务费	107,812.05	182,392.03
应付交易费用	223,915.16	105,902.49
应交税费	155,485.31	183,205.31
应付利息	243,727.33	761,122.72
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	129,084.00	289,002.15
负债合计	302,118,270.48	676,338,465.65
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	1,109,955,699.76	1,662,659,580.58
未分配利润	44,106,931.41	30,634,829.09
所有者权益合计	1,154,062,631.17	1,693,294,409.67
负债和所有者权益总计	1,456,180,901.65	2,369,632,875.32

注：报告截止日2019年6月30日，A类基金份额净值1.0570元，C类基金份额净值1.0486元，E类基金份额净值1.0348元；基金份额总额1,109,955,699.76份，下属分级基金的份额总额分别为：A类基金份额总额196,362,656.20份，C类基金份额总额78,395,052.81份，E类基金份额总额835,197,990.75份。

## 6.2 利润表

会计主体：财通资管积极收益债券型发起式证券投资基金

本报告期：2019年01月01日至2019年06月30日

单位：人民币元

项目	本期2019年01月01日至2019年06月30日	上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06月30日
一、收入	60,950,055.24	8,489,046.56
1. 利息收入	51,757,719.86	7,233,391.34

其中：存款利息收入	3,148,947.76	36,997.35
债券利息收入	44,905,999.11	7,091,257.88
资产支持证券利息收入	2,834,991.65	26,386.44
买入返售金融资产收入	867,781.34	78,749.67
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	7,133,336.52	4,088,778.62
其中：股票投资收益	-	-1,061,160.00
基金投资收益	-	-
债券投资收益	7,199,021.89	5,143,347.55
资产支持证券投资收益	-57,039.74	5,669.87
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-8,645.63	-
股利收益	-	921.20
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	1,386,653.36	-2,926,566.56
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	672,345.50	93,443.16
<b>减：二、费用</b>	<b>23,850,941.59</b>	<b>2,920,749.98</b>
1. 管理人报酬	7,791,248.12	889,210.03
2. 托管费	1,947,812.03	222,302.58
3. 销售服务费	1,071,584.29	353,445.71
4. 交易费用	207,532.09	50,329.42
5. 利息支出	7,201,105.29	1,274,616.80
其中：卖出回购金融资产支出	7,201,105.29	1,274,616.80
6. 税金及附加	132,550.71	24,295.36
7. 其他费用	5,499,109.06	106,550.08
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>37,099,113.65</b>	<b>5,568,296.58</b>

减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>37,099,113.65</b>	<b>5,568,296.58</b>

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：财通资管积极收益债券型发起式证券投资基金

本报告期：2019年01月01日至2019年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2019年01月01日至2019年06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)	1,662,659,580.58	30,634,829.09	1,693,294,409.67
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	37,099,113.65	37,099,113.65
三、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)	-552,703,880.82	-23,627,011.33	-576,330,892.15
其中：1. 基金申购款	3,148,993,070.00	78,867,729.39	3,227,860,799.39
2. 基金赎回款	-3,701,696,950.82	-102,494,740.72	-3,804,191,691.54
四、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)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	1,109,955,699.76	44,106,931.41	1,154,062,631.17
项 目	上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06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)	132,664,461.14	2,424,498.16	135,088,959.30



二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	5,568,296.58	5,568,296.58
三、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)	142,528,356.17	5,349,392.29	147,877,748.46
其中：1. 基金申购款	509,138,678.84	20,280,780.53	529,419,459.37
2. 基金赎回款	-366,610,322.67	-14,931,388.24	-381,541,710.91
四、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)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	275,192,817.31	13,342,187.03	288,535,004.34

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：

马晓立

刘博

刘博

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

财通资管积极收益债券型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2016]1155号文《关于准予财通资管积极收益债券型发起式证券投资基金注册的批复》核准,由财通证券资产管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《财通资管积极收益债券型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币1,342,480,754.11元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2016)第975号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《财通资管积极收益债券型发起式证券投资基金基金合同》于2016年7月19日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,342,719,980.43份基金份额,其中认购资金利息折合239,226.32份基金份额。本基金的基金管理人为财通证券资产管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《财通资管积极收益债券型发起式证券投资基金基金合同》和《财通资管积极

收益债券型发起式证券投资基金招募说明书》的规定，本基金自募集期起根据认购/申购费用与销售服务费用收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购、申购基金时收取认购费、申购费，在赎回时根据持有期限收取赎回费，而不计提销售服务费的，称为A类基金份额；在投资人认购、申购基金时不收取认购费、申购费，在赎回时根据持有期限收取赎回费，从本类别基金资产中计提销售服务费且销售服务费率为0.40%/年的基金份额，称为C类基金份额；在投资人申购基金时不收取申购费，在赎回时根据持有期限收取赎回费，从本类别基金资产中计提销售服务费且销售服务费率为0.10%/年的基金份额，称为E类基金份额。本基金各类基金份额分别设置基金代码。由于基金费用的不同，本基金各类基金份额将分别计算基金份额净值。投资人可自由选择申购某一类别的基金份额，但各类别基金份额之间不能相互转换。

本基金为发起式基金，基金管理人股东资金、基金管理人固有资金、基金管理人高级管理人员、基金经理等投资管理人员认购金额不低于1,000万元，认购的基金份额持有期限不低于三年。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《财通资管积极收益债券型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(含国家债券、地方债券、政府支持机构债、金融债券、次级债券、中央银行票据、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、可转换债券、可分离交易可转债、证券公司发行的短期公司债券)、债券回购、协议存款、通知存款、定期存款、同业存单、货币市场工具、权证、资产支持证券、国债期货以及经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)。本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%；投资于股票、权证等权益类资产的比例不超过基金资产的20%，其中基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的3%；每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或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。本基金的业绩比较基准为中债总指数(全价)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<年度报告和半年度报告>》、中国证券业协会(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》、《财通资管积极收益债券型发起式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2019年6月30日的财务状况以及2019年1月1日至6月30日期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

此外，本财务报表同时符合如会计报表附注6.4.2所列示的其他有关规定的要求。

### 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相一致。

### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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[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]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应

税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、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2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(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费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 关联方关系

##### 6.4.7.1 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

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.7.2 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
财通证券资产管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
财通证券股份有限公司	基金管理人的控股股东、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。

##### 6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年01月01日至2019年06 月30日		上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06 月30日	
	成交 金额	占当期股票成交总 额的比例	成交金 额	占当期股票成交总 额的比例
财通证券股份有限公司	-	-	311,80 0.00	41.28%

#### 6.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间均未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

#### 6.4.8.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年01月01日至2019年06 月30日		上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06 月30日	
	成交金额	占当期债券成 交总额的比例	成交金额	占当期债券成 交总额的比例
财通证券股份有限公 司	1,552,89 9,510.73	90.47%	356,667, 903.36	95.93%

#### 6.4.8.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年01月01日至2019年06 月30日		上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06 月30日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例
财通证券股份有限公司	16,027,1 00,000.0	77.67%	1,241,36 0,000.00	94.52%

	0			
--	---	--	--	--

#### 6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年01月01日至2019年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
财通证券股份有限公司	380,572.96	98.21%	193,184.57	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
财通证券股份有限公司	42,709.26	96.50%	32,209.46	97.05%

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

#### 6.4.8.2 关联方报酬

##### 6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019年01月01日至2019年06月30日	上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06月30日
	当期发生的基金应支付的管理费	7,791,248.12
其中：支付销售机构的客户维护费	3,485,450.08	179,437.84

注：基金管理费按基金前一日的资产净值乘以0.80%的管理费率来计算，具体计算方法如下：每日应计提基金管理费=前一日该基金资产净值×年管理费率÷当年天数。

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

#### 6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019年01月01日至2019 年06月30日	上年度可比期间 2018年01月01日至2018 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,947,812.03	222,302.58

注：基金托管费按基金前一日的资产净值乘以0.20%的托管费率来计算，具体计算方法如下：每日应计提基金托管费=前一日该基金资产净值×年托管费率÷当年天数。基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

#### 6.4.8.2.3 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 2019年01月01日至2019年06月30日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	财通资管积 极收益债券A	财通资管积 极收益债券C	财通资管积 极收益债券E	合计
财通证券股份有限公司	-	142,116.94	791,723.45	933,840.39
财通证券资产管理有限公司	-	301.31	2,169.53	2,470.84
中国工商银行股份有限公司	-	105,996.82	-	105,996.82
合计	-	248,415.07	793,892.98	1,042,308.05
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06月30日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	财通资管积 极收益债券A	财通资管积 极收益债券C	财通资管积 极收益债券E	合计
财通证券股份有限公司	-	293,768.35	-	293,768.35

财通证券资产管理有限公司	-	22,414.43	-	22,414.43
中国工商银行股份有限公司	-	35,397.99	-	35,397.99
合计	-	351,580.77	-	351,580.77

注：1、本基金A类基金份额不收取销售服务费；C类基金份额的年销售服务费率为0.40%，E类基金份额的年销售服务费率为0.10%；具体计算方法如下：每日该类基金份额应计提的基金销售服务费=前一日该类基金份额的基金资产净值×该类基金份额年销售服务费率÷当年天数，基金销售服务费每日计提，按月支付。

2、财通资管积极收益债券E类份额自2018年7月20日生效，无上年度可比期间数据。

#### 6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

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

财通资管积极收益债券A

份额单位：份

项目	本期 2019年01月01 日至2019年06 月30日	上年度可比期 间 2018年01月01 日至2018年06 月30日
基金合同生效日（2016年07月19日）持有的基金份额	9,999,900.00	9,999,900.00
报告期初持有的基金份额	9,999,900.00	9,999,900.00
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	9,999,900.00	9,999,900.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.90%	3.63%



财通资管积极收益债券C

份额单位：份

项目	本期 2019年01月01 日至2019年06 月30日	上年度可比期 间 2018年01月01 日至2018年06 月30日
基金合同生效日（2016年07月19日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

财通资管积极收益债券E

份额单位：份

项目	本期 2019年01月01 日至2019年06 月30日	上年度可比期 间 2018年01月01 日至2018年06 月30日
基金合同生效日（2016年07月19日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

注：本报告期内及上年度可比期间基金管理人无运用固有资金申购赎回本基金的情况。

#### 6.4.8.4.2 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

本基金本报告期末及上年度末，除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

#### 6.4.8.5 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 2019年01月01日至2019年 06月30日		上年度可比期间 2018年01月01日至2018年0 6月30日	
	期末余额	当期利息收 入	期末余额	当期利息收 入
中国工商银行股份有限公司	2,400,736. 92	91,140.62	2,593,006. 69	30,875.75

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。

#### 6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间均无其他关联交易事项。

#### 6.4.9 期末（2019年06月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2019 年 06 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 136,729,234.90 元，是以如下债券作为抵押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单 价	数量（张）	期末估值总 额
------	------	-------	------------	-------	------------

100204	10国开04	2019-07-05	99.53	700,000	69,671,000.00
041900099	19陕煤化CP001	2019-07-02	100.24	40,000	4,009,600.00
101553003	15五矿股MTN001	2019-07-02	101.21	500,000	50,605,000.00
101754037	17晋能MTN001	2019-07-05	102.04	200,000	20,408,000.00
合计				1,440,000	144,693,600.00

#### 6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2019年6月30日止，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158,196,578.00元，截至2019年7月1日（先后）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。

#### 6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 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	1,295,959,202.30	89.00
	其中：债券	1,215,633,131.06	83.48
	资产支持证券	80,326,071.24	5.52
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	114,297,409.16	7.85
8	其他各项资产	45,924,290.19	3.15
9	合计	1,456,180,901.65	100.00

注：由于四舍五入的原因，期末市值金额占期末总资产基金总资产比例的分项之和与合计可能有尾差。

## 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

本基金本报告期末未持有股票。

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

## 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

本基金本报告期内未投资股票。

### 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

本基金本报告期内未投资股票。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内未投资股票。

## 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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	69,671,000.00	6.04
	其中：政策性金融债	69,671,000.00	6.04
4	企业债券	582,973,537.20	50.51
5	企业短期融资券	236,264,000.00	20.47
6	中期票据	313,785,600.00	27.19
7	可转债（可交换债）	12,866,347.76	1.11
8	同业存单	-	-
9	其他	72,646.10	0.01
10	合计	1,215,633,131.06	105.34

注：1、其他为地方政府债。

2、由于四舍五入的原因，公允价值占基金资产净值比例的分项之和与合计可能有尾差。

#### 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	100204	10国开04	700,000	69,671,000.00	6.04
2	122384	15中信01	556,280	56,340,038.40	4.88
3	101553003	15五矿股MTN001	500,000	50,605,000.00	4.38
4	041800385	18铜陵建投CP003	500,000	50,500,000.00	4.38
5	101754037	17晋能MTN001	450,000	45,918,000.00	3.98

#### 7.7 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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净
----	------	------	-------	------	--------

					值比例 (%)
1	131128	余燃气4	300,000	30,326,071.24	2.63
2	156712	吴中优02	200,000	20,000,000.00	1.73
3	149939	18借呗2A	200,000	20,000,000.00	1.73
4	149675	青山湖01	200,000	10,000,000.00	0.87

注：本基金本报告期末只持有上述四只资产支持证券。

#### 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

本基金报告期末未持有贵金属。

#### 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

本基金本报告期末未持有权证。

#### 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资股指期货。

#### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金对国债期货的投资以套期保值，回避市场风险为主要目的。结合国债交易市场和期货市场的收益性、流动性等情况，通过套期保值策略进行操作，对冲利率波动风险。

##### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险指标说明
-	-	-	-	-	-
公允价值变动总额合计(元)					-
国债期货投资本期收益(元)					-8,500.00
国债期货投资本期公允价值变动(元)					-

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

在合规的前提下，以套期保值为目标，对持仓利率债的利率波动风险进行适度对冲，降低利率波动风险，对组合收益有增厚作用。

### 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责和处罚。

7.12.2 本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

### 7.12.3 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	91,165.39
2	应收证券清算款	15,255,861.78
3	应收股利	-
4	应收利息	24,244,092.01
5	应收申购款	6,333,171.01
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	45,924,290.19

### 7.12.4 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。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期内未进行股票投资。

## § 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
财通 资管 积极 收益 债券A	1,325	148,198.23	10,000,883.46	5.09%	186,361,772.74	94.91%
财通 资管 积极 收益 债券C	1,353	57,941.65	0.00	0.00%	78,395,052.81	100.00%
财通 资管 积极 收益 债券E	5,068	164,798.34	25,436,283.50	3.05%	809,761,707.25	96.95%
合计	7,746	143,294.05	35,437,166.96	3.19%	1,074,518,532.80	96.81%

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

## 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	财通资管积极收 益债券A	25,239.77	0.01%
	财通资管积极收 益债券C	24,327.99	0.03%



	财通资管积极收益债券E	330,627.31	0.04%
	合计	380,195.07	0.03%

### 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	财通资管积极收益债券A	0
	财通资管积极收益债券C	0~10
	财通资管积极收益债券E	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	财通资管积极收益债券A	0
	财通资管积极收益债券C	0
	财通资管积极收益债券E	0
	合计	0

### 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	9,999,900.00	0.90%	9,999,900.00	0.90%	自基金合同生效之日起不少

					于3年
基金管理人高级管理人员	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
基金经理等人员	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
基金管理人股东	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
其他	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
合计	9,999,900.00	0.90%	9,999,900.00	0.90%	-

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

	财通资管积极 收益债券A	财通资管积极 收益债券C	财通资管积极 收益债券E
基金合同生效日(2016年07月19日)基金份额总额	359,722,982.2 6	982,996,998.1 7	-
本报告期期初基金份额总额	146,186,001.8 4	153,596,825.3 1	1,362,876,75 3.43
本报告期基金总申购份额	140,787,291.4 2	89,348,448.15	2,918,857,33 0.43
减：本报告期基金总赎回份额	90,610,637.06	164,550,220.6 5	3,446,536,09 3.11
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	196,362,656.2 0	78,395,052.81	835,197,990.7 5

## § 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

本报告期内，无基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

### 10.3 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，未涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

#### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略无改变。

#### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

#### 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，本基金管理人、托管人及其高级管理人员未受监管部门的稽查或处罚。

#### 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	
西部证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	6,936.73	1.79%	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	2	-	-	380,572.96	98.21%	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源证券	1	-	-	-	-	-
华金证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-

安信证券	1	-	-	-	-	-
------	---	---	---	---	---	---

注：此处的佣金指通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计，不单指股票交易佣金。

### 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		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
西部证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	84,207,152.14	4.91%	3,103,540.00	15.04%	-	-	-	-
华泰证券	79,279,732.97	4.62%	1,503,100.00	7.28%	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
财通证券	1,552,899,510.73	90.47%	16,027,100.00	77.67%	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-

申万宏源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-

注：a. 本基金管理人负责选择证券经营机构，租用其交易单元作为本基金的交易单元。基金交易单元的选择标准如下：

- 1、经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- 2、具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需  
要；
- 3、具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业  
分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析  
的报告及丰富全面的信息服务；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，  
具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以  
及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

b. 基金交易单元的选择程序如下：

- 1、本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构。
- 2、基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

c. 本基金本报告期新增中信证券公司的交易单元1个。

d. 由于四舍五入的原因，成交金额占当期债券回购成交总额的比例的分项之和与合计可  
能有尾差。

## § 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

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

财通证券资产管理有限公司  
二〇一九年八月二十七日