融通逆向策略灵活配置混合型证券投资基金

2019 第二季度 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:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2019年7月16日

§1 重要提示

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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年7月16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2019年6月30日止。

§2基金产品概况

基金简称	融通逆向策略灵活配置混合
基金主代码	005067
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年2月11日
报告期末基金份额总额	178,046,104.26份
投资目标	本基金将采用逆向投资策略,重点投资于价值低估及阶段性错误定价的个股品种,在严格控制风险的前提下,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自上而下的研究,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,并结合自下而上对投资标的基本面分析,通过资产配置获得超额收益。
业绩比较基准	沪深300指数收益率x50%+中债综合全价 总值)指数收益率x50%
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与货币市场基金,低于股票型基金,属于中高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	中国工商银行股份有限公司

§3主要财务指标和基金净值表现

3.1主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2019年4月1日 - 2019年6月30日)
1.本期已实现收益	11,058,021.30
2.本期利润	-8,805,236.78
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0475
4.期末基金资产净值	165,098,032.58
5.期末基金份额净值	0.9273

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、本投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

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
过去三个月	-5.75%	1.79%	-0.54%	0.75%	-5.21%	1.04%

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

注:本基金的建仓期为自合同生效日起6个月,至建仓期结束,各项资产配置比例符合合同约定。

§4管理人报告

4.1基金经理(或基金经理小组)简介

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		
张延闽	本基金的基金经理、权益投资部总经理	2018年2月11日	-	9	张延闽先生,哈尔滨工业大学工学硕士,9年证券投资从业经历,具有基金从业资格,2010年2月加入融通基金管理有限公司,历任行业研究员、融通转型三动力灵活配置混合型证券投资基金基金经理,现任权益投资部总经理、融通峰彩研究精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理、融通新蓝筹证券投资基金基金经理、融通逆向策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理、融通研究优选混合型证券投资基金基金经理。
刘安坤	本基金的基金经理	2019年5月17日	-	6	刘安坤先生,武汉大学金融学硕士,6年证券投资从业经历,具有基金从业资格,2013年7月至2015年6月就职于长江证券股份有限公司任分析师,2015年6月加入融通基金管理有限公司,历任金融行业研究员、策略研究员、专户投资经理,现任融通逆向策略灵活配置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管理人对报告期内本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

2019年2季度万得全A指数-4.26%,沪深300指数-1.21%,本基金在报告期内-5.74%,表现略逊于指数。主要原因是持仓的农业、计算机、汽车零部件等板块呈现明显的负收益。

本季度持仓做了一定的调整。主要增加了农业养殖板块,这也是组合超配的行业方向。作为周期品,价格永远是行情的主要矛盾和矛盾的主要方面,而数量可能是周期演绎过程中的干扰因素。本轮猪周期底部向上始于2018年底,供求失衡状况会在2019年下半年开始逐渐严重,猪价的高点预计将在2020年呈现。我们判断行业龙头的盈利能力和ROE在2019年3季度开始恢复。在这个过程中我们也会紧盯个股风险,时刻评估投资假设的潜在风险。

本基金对下半年的市场保持乐观的态度。面对经济增长乏力的困扰,低利率似乎是各国央行的一致选择,全球范围内的核心资产正享受到估值溢价。未来本基金将保持高仓位运作,在能力圈内选择风险回报给当的资产。

4.5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0.9273元;本报告期基金份额净值增长率为-5.75%,业绩比较基准收益率为-0.54%。

4.6报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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投资组合报告

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	152,559,180.69	90.95
	其中:股票	152,559,180.69	90.95
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	372,856.80	0.22
	其中:债券	372,856.80	0.22
	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	14,656,054.59	8.74
8	其他资产	153,835.26	0.09
9	合计	167,741,927.34	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	26,775,692.60	16.22
B	采矿业	109,308.05	0.07
C	制造业	59,052,710.85	35.77
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	25,286,431.00	15.32
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	19,145,245.76	11.60
J	金融业	12,391,131.59	7.51
K	房地产业	9,775,554.24	5.92
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	23,106.60	0.01
S	综合	-	-
	合计	152,559,180.69	92.41

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	600887	伊利股份	489,100	16,340,831.00	9.90
2	601933	永辉超市	1,457,100	14,876,991.00	9.01
3	300059	东方财富	1,035,920	14,036,716.00	8.50
4	300498	温氏股份	383,060	13,736,531.60	8.32
5	601336	新华保险	224,555	12,357,261.65	7.48
6	603960	克来机电	441,625	12,051,946.25	7.30
7	603883	老百姓	178,000	10,409,440.00	6.31
8	000031	大悦城	1,522,672	9,775,554.24	5.92
9	600742	一汽富维	819,680	8,745,985.60	5.30
10	002714	牧原股份	141,900	8,342,301.00	5.05

5.4报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
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)	372,856.80	0.23
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	372,856.80	0.23

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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113531	百姓转债	3,370	372,856.80	0.23

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	146,383.01
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,761.22
5	应收申购款	2,691.03
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	153,835.26

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。

§6开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	220,128,175.36
报告期期间基金总申购份额	1,728,799.41
减:报告期期间基金总赎回份额	43,810,870.51
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	178,046,104.26

§7基金管理人运用固有资金投资本基金情况

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8备查文件目录

8.1备查文件目录

(一)中国证监会批准融通逆向策略灵活配置混合型证券投资基金设立的文件

(二)《融通逆向策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》

(三)《融通逆向策略灵活配置混合型证券投资基金托管协议》

(四)《融通逆向策略灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》

(五)融通基金管理有限公司业务资格批件和营业执照

(六)报告期内在指定报刊上披露的各项公告

8.2存放地点

基金管理人、基金托管人处。

8.3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

融通深证成份指数证券投资基金

2019 第二季度 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:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2019年7月16日

§1 重要提示

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。

基金托管人中国工商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2019年6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	融通深证成份指数
基金主代码	161612
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年11月15日
报告期末基金份额总额	170,329,362.51份
投资目标	本基金采取完全复制方法进行指数化投资,通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段,力争将本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪误差控制在0.35%以内,年化跟踪误差控制在4%以内,以实现对深证成份指数的有效跟踪。
投资策略	本基金为被动式指数基金,原则上采用完全复制指数的投资策略,按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整,力争实现基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪误差控制在0.35%以内,年化跟踪误差控制在4%的投资目标。
业绩比较基准	深证成份指数收益率x95% + 银行活期存款利率x5%
风险收益特征	本基金为股票型指数基金,属于高风险高收益的基金品种,其收益和风险均高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。
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
下属分级基金的基金简称	融通深证成份指数A/B 融通深证成份指数C
下属分级基金的交易代码	161612 004875
下属分级基金的前端交易代码	161612 004875
下属分级基金的后端交易代码	161662 -
报告期末下属分级基金的份额总额	164,672,964.75份 5,656,397.76份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2019年4月1日 - 2019年6月30日)	
	融通深证成份指数A/B	融通深证成份指数C
1.本期已实现收益	-1,124,355.22	-59,419.37
2.本期利润	-7,366,463.13	-255,805.93
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0450	-0.0434
4.期末基金资产净值	131,641,901.84	4,462,634.23
5.期末基金份额净值	0.799	0.789

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

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

融通深证成份指数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
过去三个月	-5.56%	1.75%	-6.95%	1.74%	1.39%	0.01%

融通深证成份指数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
过去三个月	-5.62%	1.76%	-6.95%	1.74%	1.33%	0.02%

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

注:本基金于2017年7月5日增设C类份额,本基金C类份额的统计区间为2017年7月6日至本报告期末。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

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		
蔡志伟	本基金的基金经理	2016-11-19	-	8	蔡志伟先生,计算机应用技术硕士,金融风险管理师(FRM),8年证券投资从业经历,具有基金从业资格,2006年7月至2008年8月就职于汇丰软件开发(广东)有限公司任高级软件工程师,2011年6月加入融通基金管理有限公司,历任风险管理专员、金融工程研究员,现任融通巨潮100指数证券投资基金(LOF)基金经理、融通深证成份指数证券投资基金基金经理、融通创业板指数增强型证券投资基金基金经理。

注:任免日期均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。

4.2 管理人对报告期内本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

在严格遵守基金合同的前提下实现持有人利益的最大化是本基金管理的核心思想,并将此原则贯彻于基金的运作之中。本基金采取指数化投资策略,紧密跟踪标的指数。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末融通深证成份指数A/B基金份额净值为0.799元,本报告期基金份额净值增长率为-5.56%;截至本报告期末融通深证成份指数C基金份额净值为0.789元,本报告期基金份额净值增长率为-5.62%;同期业绩比较基准收益率为-6.95%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

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	128,578,281.38	93.21
	其中:股票	128,578,281.38	93.21
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	4,510,699.92	3.27
	其中:债券	4,510,699.92	3.27
	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	2,663,615.09	1.93
8	其他资产	2,188,763.26	1.59
9	合计	137,941,359.65	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资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	4,405,357.88	3.24
B	采矿业	1,494,462.23	1.10
C	制造业	80,219,904.45	58.94
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,263,591.00	0.93
E	建筑业	905,483.45	0.67
F	批发和零售业	2,539,558.77	1.87
G	交通运输、仓储和邮政业	1,158,956.07	0.85
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,797,001.82	9.40
J	金融业	9,112,619.17	6.70
K	房地产业	7,044,796.66	5.18
L	租赁和商务服务业	1,928,646.94	1.42
M	科学研究和技术服务业	452,130.00	0.33
N	水利、环境和公共设施管理业	706,419.50	0.52
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	81,007.00	0.06
Q	卫生和社会工作	2,175,193.29	1.60
R	文化、体育和娱乐业	1,705,898.94	1.25
S	综合	212,983.00	0.16
	合计	128,204,010.17	94.20

5.2.2 报告期末积极投资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	31,445.00	0.02
B	采矿业	-	-
C	制造业	209,778.11	0.15
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	109,941.50	0.08
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	23,106.60	0.02
S	综合	-	-
	合计	374,271.21	0.27

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

5.3.1 报告期末指数投资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	000651	格力电器	89,702	4,933,610.00	3.62
2	000333	美的集团	94,703	4,911,297.58	3.61
3	000858	五粮液	33,205	3,916,529.75	2.88
4	300498	温氏股份	86,148	3,089,267.28	2.27
5	000002	万科A	94,700	2,633,607.00	1.93
6	000001	平安银行	163,609	2,254,532.02	1.66
7	002415	海康威视	67,335	1,857,099.30	1.36
8	000725	京东方A	515,598	1,773,657.12	1.30
9	000063	中兴通讯	46,577	1,515,149.81	1.11
10	002304	洋河股份	10,735	1,304,946.60	0.96

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	300770	新媒股份	1,271	109,941.50	0.08
2	300782	卓胜微	743	80,927.56	0.06
3	002668	奥马电器	10,218	52,929.24	0.04
4	000587	金洲慈航	17,100	44,118.00	0.03
5	300594	朗进科技	721	31,803.31	0.02

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	4,501,800.00	3.31
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
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)	8,899.92	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	4,510,699.92	3.31

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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	019608	18国债26	30,000	3,000,600.00	2.20
2	019600	18国债18	15,000	1,501,200.00	1.10
3	128068	和而转债	89	8,899.92	0.01

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

本基金本报告期末持有股指期货。

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 基金投资的前十名股票未超出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	5,277.12
2	应收证券清算款	2,017,999.30
3	应收股利	-
4	应收利息	80,879.87
5	应收申购款	84,606.97
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,188,763.26

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。

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	融通深证成份指数A/B	融通深证成份指数C
报告期期初基金份额总额	162,883,637.82	5,429,464.54
报告期期间基金总申购份额	17,073,593.92	8,830,699.18
减:报告期期间基金总赎回份额	15,284,266.99	8,603,765.96
报告期期间基金拆分变动份额	-	-
报告期期末基金份额总额	164,672,964.75	5,656,397.76

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

(一)中国证监会核准融通深证成份指数证券投资基金设立的文件

(二)《融通深证成份指数证券投资基金基金合同》

(三)《融通深证成份指数证券投资基金托管协议》

(四)《融通深证成份指数证券投资基金招募说明书》及其更新

(五)融通基金管理有限公司业务资格批件和营业执照

(六)报告期内在指定报刊上披露的各项公告

8.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

8.3 咨询方式

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

融通通福债券型证券投资基金(LOF)

2019 第二季度 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:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2019年7月16日

§1 重要提示

本基金由原融通通福分级债券型证券投资基金转型而来,转型后的基金合同生效日为2016年12月13日。

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。

基金托管人中国工商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2019年6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	融通通福债券(LOF)	
交易代码	161626	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016年12月13日	
报告期末基金份额总额	50,541,690.57份	
投资目标	本基金以债券为主要投资对象,在严格控制风险的基础上,追求基金资产的长期稳定增值。	
投资策略	本基金将采用自上而下的方法对基金资产进行动态的整体资产配置和类属资产配置。在认真研判宏观经济运行状况和金融市场运行趋势的基础上,根据整体资产配置策略动态调整大类金融资产的比例;在充分分析债券市场环境及市场流动性的基础上,根据类属资产配置策略对投资组合类属资产进行最优化配置和调整。	
业绩比较基准	中债综合 总价)指数收益率	
风险收益特征	本基金为债券型基金,属于证券投资基金中预期收益和预期风险较低的基金品种,其风险收益预期高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。	
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	
下属分级基金的基金简称	融通通福债券A	融通通福债券C
下属分级基金的场内简称	融通通福	-
下属分级基金的交易代码	161626	161627
报告期末下属分级基金的份额总额	46,678,144.65份	3,863,545.92份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2019年4月1日 - 2019年6月30日)	
	融通通福债券A	融通通福债券C
1.本期已实现收益	222,862.88	15,328.74
2.本期利润	132,776.18	7,593.18
3.加权平均基金份额本期利润	0.0028	0.0020
4.期末基金资产净值	50,985,903.04	4,189,295.58
5.期末基金份额净值	1.092	1.084

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

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

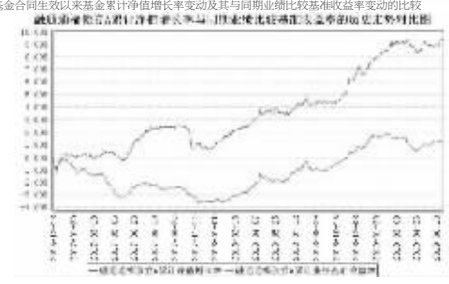
融通通福债券A

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
过去三个月	0.28%	0.09%	-0.24%	0.06%	0.52%	0.03%

融通通福债券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
过去三个月	0.18%	0.10%	-0.24%	0.06%	0.42%	0.04%

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



§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

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		
朱浩然	本基金的基金经理	2017-9-8	-	7	朱浩然先生,中央财经大学经济学硕士,7年证券投资从业经历,具有基金从业