

融通增强收益债券型证券投资基金

2024 年中期报告

2024 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：2024 年 8 月 29 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 2024 年 8 月 27 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 2024 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	6
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
3.3 其他指标	8
<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	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
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	13
<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 净资产变动表	16
6.4 报表附注	18
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>39</b>
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
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	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	43

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 .....	43
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 .....	43
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 .....	43
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 .....	43
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	43
7.11 投资组合报告附注 .....	44
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>44</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	44
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	45
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 .....	45
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>45</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>46</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	46
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 .....	46
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	46
10.4 基金投资策略的改变 .....	46
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	46
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 .....	46
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	46
10.8 其他重大事件 .....	49
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>50</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 .....	50
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	50
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>50</b>
12.1 备查文件目录 .....	50
12.2 存放地点 .....	51
12.3 查阅方式 .....	51

## § 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	4,430,641,953.28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
报告期末下属分级基金的份额总额	4,107,841,090.85份	322,800,862.43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
	联系电话	(0755) 26948666
	电子邮箱	service@mail.rtfund.com
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	深圳市南山区海德三道1066号深 创投广场41、42层	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码	518054	100140
法定代表人	张威	廖林

## 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	深圳市南山区海德三道 1066 号深创投广场 41、42 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(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 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	15,532,342.15	35,600.51
本期利润	96,865,656.02	3,500,662.47
加权平均基金份额本期利润	0.0248	0.0129
本期加权平均净值利润率	2.25%	1.24%
本期基金份额净值增长率	2.41%	2.26%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	1,306,409,394.76	82,789,992.94
期末可供分配基金份额利润	0.3180	0.2565
期末基金资产净值	4,584,124,322.63	338,833,595.40
期末基金份额净值	1.1159	1.0497
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	26.40%	24.24%

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

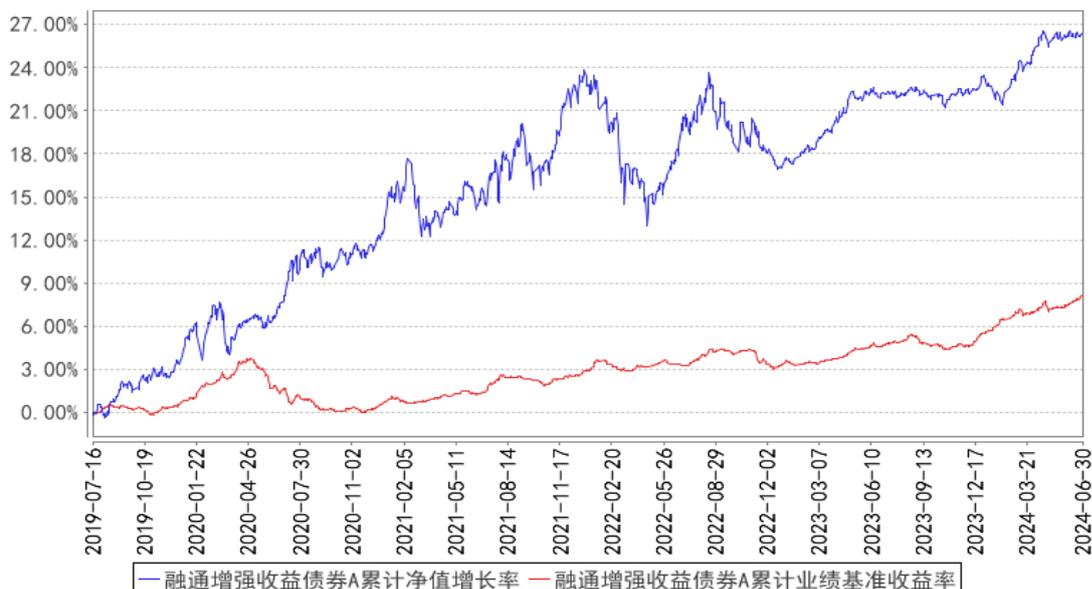
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.20%	0.13%	0.65%	0.03%	-0.45%	0.10%
过去三个月	1.22%	0.15%	1.06%	0.07%	0.16%	0.08%
过去六个月	2.41%	0.17%	2.42%	0.07%	-0.01%	0.10%
过去一年	3.40%	0.14%	3.27%	0.06%	0.13%	0.08%
过去三年	9.49%	0.33%	6.58%	0.05%	2.91%	0.28%
自基金合同生效起至今	26.40%	0.32%	8.12%	0.06%	18.28%	0.26%

融通增强收益债券 C

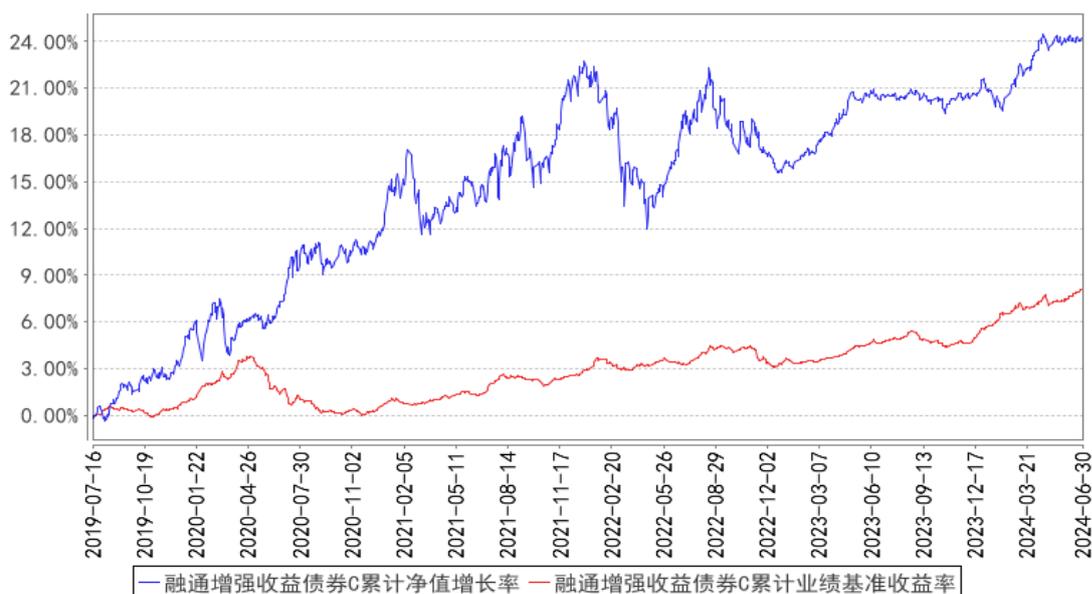
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.17%	0.12%	0.65%	0.03%	-0.48%	0.09%
过去三个月	1.14%	0.15%	1.06%	0.07%	0.08%	0.08%
过去六个月	2.26%	0.17%	2.42%	0.07%	-0.16%	0.10%
过去一年	3.06%	0.14%	3.27%	0.06%	-0.21%	0.08%
过去三年	8.35%	0.33%	6.58%	0.05%	1.77%	0.28%
自基金合同生效起至今	24.24%	0.32%	8.12%	0.06%	16.12%	0.26%

### 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



### 3.3 其他指标

无。

## § 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（Nikko Asset Management Co., Ltd.）40%。本基金管理人拥有公募基金管理资格、特定客户（专户）资产管理资格、合格境内机构投资者资格（QDII）、保险资产受托管理资格、人民币合格境内机构投资者（RQDII）资格、合格境内投资企业（QDIE）资格，产品线完备，涵盖主动权益类基金、被动投资类基金、债券基金、货币基金、混合基金、QDII 基金等。

#### 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		
范琨	本基金的基金经理、研究部总经理	2022年11月29日	-	12年	范琨女士，复旦大学金融学硕士，12年证券、基金行业从业经历，具有基金从业资格。2012年7月加入融通基金管理有限公司，历任化工行业研究员、周期行业研究组组长、研究部副总监、融通中国风1号灵活配置混合型证券投资基金基金经理、融通新区域新经济灵活配置混合型证券投资基金基金经理、融通明锐混合型证券投资基金基金经理，现任研究部总经理、融通内需驱动混合型证券投资基金基金经理、融通成长30灵活配置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、融通慧心混合型证券投资基金基金经理。
李冠頔	本基金的基金经理	2022年11月29日	-	7年	李冠頔女士，南开大学金融学硕士，7年证券、基金行业从业经历，具有基金从业资格。2017年7月加入融通基金管理有限公司，曾任固定收益研究员、融通通裕定期开放债券型发起式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，现任融通通润债券型证券投资基金基金经理、融通通和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、融通通福债券型证券投资基金（LOF）基金经理、融通增辉定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理、融通增悦债券型证券投资基金基金经理、融通通灿债券型证券投资基金基金经理、融通通玺债券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、基金业务相关的工作时间为计算标准。

#### 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、10 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

权益方面：本基金 2024 年上半年以来主仓位延续了 2023 年以来的高股息配置，具体行业涉及交运、公用、家电、电信等。对于表观股息率高的银行和煤炭，未有持仓。这里面的选股标准，是寻找分子端稳定的高股息。同时一季度我们增加了一部分出口链标的，二季度有部分兑现。二季度逐步增仓了部分黄金股。

固收方面：第一，市场复盘。

在经历了 2023 年 11 月底至 2024 年年初流畅而超预期的牛市趋势之后，债市在二季度的演绎，我们认为可以大致分为三个阶段：

(1) 2024 年 3 月 7 日-2024 年 4 月 23 日，无增量基本面逻辑主线，但资金驱动，供需关系良好下的利差压平牛市行情；

(2) 2024 年 4 月 23 日至 2024 年 5 月底，产生了 2024 年以来最大的回调行情。在此之后，进入多空逻辑并存，市场无阻力最小方向，时间与空间综合维度下难以产生大机会的震荡市当中，并且从 4 月底的宽幅震荡逐步向窄幅震荡演绎。在此过程中中短期限品种和信用债补涨占优。

(3) 2024 年 6 月至今，市场再度进入多头行情的展开当中，宏观基本面的趋势方向无显著边际变化，但市场拥挤度在前期震荡中缓解，叠加增量资金引导下的供需关系的良好助推行情演绎，各曲线结构轮涨，并再度创出价格的历史新高。

第二，运作分析。

回顾 2024 年上半年的基金操作，我们严格遵照基金合同的相关约定，按照既定的投资流程进行了规范运作。运作期间，本基金在保证资产流动性和安全性的前提下，在 2024 年一季度整体维持了偏长久期的债券策略；在二季度市场的赢率和赔率逻辑、趋势强度和拥挤度逻辑的矛盾性有所增强过程中，进行了顺势交易和逆向交易的多种策略尝试。其中，4 月中下旬，我们基于“风险大于机会”的短期判断进行了左侧的防守，整体回撤控制尚可；5 月以来，我们在不同阶段的账户操作与策略选择当中，持续立足底层逻辑稳定和工具不断迭代的“适应性”策略交易体系，遵循“顺大势逆小势”的策略纪律适时参与了债券交易的波段进攻和波段防守，对于不同券种进行了择优配置选择，不断在“攻守平衡”和“超额收益”的路上探索与进步。

#### 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 1.1159 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.41%，同期业绩比较基准收益率为 2.42%；

截至本报告期末融通增强收益债券 C 基金份额净值为 1.0497 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.26%，同期业绩比较基准收益率为 2.42%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

权益方面，目前市场结构鲜明：稳定高股息和与经济脱敏的成长板块受到市场追捧。就均值回归的角度看，高股息或者大股票的超额收益处于历史比较极端的分位数位置。这背后提示出来的高股息累计的风险也需要关注。但是均值回归方法适用的前提是要看清楚价值的锚是否稳定。就如同考虑完全竞争的周期品行业价格波动趋势，如果行业整体成本中枢下移，参考之前的价格波动区间去考虑均值回归是刻舟求剑的做法。我们预期市场的显性变化要么来自于价格充分反应预期以后的自然反转，要么来自经济层面基础牢固方向清晰的先导指引。成长板块里面预期有不少波段性机会。

固收方面：第一，宏观展望。

赢率视角来看，具备领先性的金融条件指标仍然偏弱，叠加 2024 年广义财政发力节奏的相对疲弱，经济向上动能略显分化和不足，这对于债市而言仍然是奠定牛市方向的重要基础。

赔率视角下，从静态历史分位数的比价来看，无论是相对利差还是绝对利率水平均处于低位区间；但我们认为在适应性赔率衡量下，当前利率水平在与经济增长情况的匹配度以及与其他大

类资产的比价当中，大概率处于“不极端”的位置，而且长短端利率曲线的形态仍然是相对健康的，因此我们整体认为赔率处于风险尚且可控的区间维度。

从市场面角度来看，2024 年以来债市整体呈现出与前几年特征有所变化的“强势市场”特征，主要表现为行情的时间流畅度和波动空间的偏强，以及对利多逻辑定价的敏感而非钝化。而从市场拥挤度的逆向视角来看，今年以来在 3 月、4 月底等拥挤度偏高的位置多数产生了较为猛烈的快速回调，但时间上均较为短暂，空间上是较为猛烈的，这也呈现出一致预期和一致策略下的波动特征。总体来看，当前强势市场的趋势特征未有明显改变，市场节奏大概率继续伴随拥挤度和预期定价的变化而波动向前。

## 第二，反思。

本次我们深度探讨一个问题——深刻认知“趋势投资”。

(1) 反思的起点来自于今年上半年对于市场策略的观察：

今年以来，“等回调买入”的思路基本是失效的，踏空后右侧如何上车成为许多投资者的“痛苦”所在；

今年以来，我们“顺大势逆小势”体系中的工具箱信号提示阶段性失效，突破历史维度的“均值回归”特征，展现出趋势性强劲的特征；

今年以来，事后来看想做出超额收益的路径有两种：第一，对宏观趋势的中长周期认知非常深刻，且给出一致性的利率下行想象空间；第二，久期的勇敢者博弈，但波动性难以有效控制。

(2) 站在大类资产“趋势投资”的视角，去看待 2024 年以来债市强势趋势的演绎，其实就没有那么难理解了。

在前些年权益投资当中市场对于“茅指数”、“宁组合”等热点品种的追逐过程，以及海外成熟大类资产的波动中，均能够看到类似今年债市“趋势投资”过程中市场对估值、趋势以及定价、情绪等因子的相似表现；

我们的反思点是，在趋势投资当中，要摒弃历史视角里绝对分位数的锚定效应，要明确拥挤的极致和疯狂的极限在哪里，要顺趋势而为而非追求完美买点，要从流动性角度给卖点留余地，要保持想象力和思想的开放性。

## 第三，未来策略展望。

从组合操作和债券策略来看，未来我们或仍将持续面临债券收益率位于历史偏低分位水平的客观环境，这会影响到市场在一些阶段对于利多和利空因素反应程度的“不对称”，抓取波动下超额收益的难度有所增大。下阶段本基金将在保证资产流动性和安全性的前提下，力争赚取稳定票息和骑乘收益，同时结合市场环境的动态变化调整组合杠杆和久期，做好适时的攻守转换。

#### 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基金估值业务原则和程序管理细则》进行，公司设立由研究相关部门、风险管理部、登记清算部、稽核审计部和法律合规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、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。

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

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

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，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，本基金的管理人——融通基金管理有限公司在本基金的投资运作、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，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

#### 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

本托管人依法对融通基金管理有限公司编制和披露的本基金 2024 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：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	27,318,131.64	18,924,566.28
结算备付金		3,712,653.25	1,871,294.90
存出保证金		182,788.79	173,547.40
交易性金融资产	6.4.7.2	5,946,277,517.79	5,896,980,508.94
其中：股票投资		707,536,944.46	575,281,084.67
基金投资		-	-
债券投资		5,238,740,573.33	5,321,699,424.27
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	27,000,000.00	-
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		-	135,685,166.27
应收股利		-	-
应收申购款		325,793.38	11,045,392.37
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		6,004,816,884.85	6,064,680,476.16
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2023 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		1,050,476,196.53	1,365,429,165.48
应付清算款		27,000,000.00	18,242,255.63
应付赎回款		165,493.63	111,452,079.77
应付管理人报酬		2,764,720.71	2,812,101.72

应付托管费		789,920.20	803,457.62
应付销售服务费		97,937.67	158,423.87
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	3.82
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	564,698.08	829,896.98
负债合计		1,081,858,966.82	1,499,727,384.89
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	3,533,758,530.33	3,359,370,151.45
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	1,389,199,387.70	1,205,582,939.82
净资产合计		4,922,957,918.03	4,564,953,091.27
负债和净资产总计		6,004,816,884.85	6,064,680,476.16

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，基金份额总额 4,430,641,953.28 份，其中融通增强收益债券 A 类基金份额 4,107,841,090.85 份，基金份额净值 1.1159 元；融通增强收益债券 C 类基金份额 322,800,862.43 份，基金份额净值 1.0497 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：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		134,463,475.74	12,049,890.94
1. 利息收入		596,444.31	137,006.39
其中：存款利息收入	6.4.7.13	109,648.03	41,218.60
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		486,796.28	95,787.79
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		48,568,547.72	10,382,218.40
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-73,745,065.59	2,113,323.17
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	111,653,309.94	7,609,733.27
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
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	10,660,303.37	659,161.96
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	84,798,375.83	1,509,877.38
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	500,107.88	20,788.77
<b>减：二、营业总支出</b>		34,097,157.25	2,726,110.82
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	15,934,062.10	1,577,037.25
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	4,552,589.19	450,582.08
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	491,696.04	218,577.27
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		12,964,905.60	399,473.11
其中：卖出回购金融资产支出		12,964,905.60	399,473.11
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		0.23	31.48
8. 其他费用	6.4.7.23	153,904.09	80,409.63
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		100,366,318.49	9,323,780.12
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		100,366,318.49	9,323,780.12
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		100,366,318.49	9,323,780.12

### 6.3 净资产变动表

会计主体：融通增强收益债券型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	3,359,370,151.45	-	1,205,582,939.82	4,564,953,091.27

加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	3,359,370,151.45	-	1,205,582,939.82	4,564,953,091.27
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	174,388,378.88	-	183,616,447.88	358,004,826.76
（一）、综合收益总额	-	-	100,366,318.49	100,366,318.49
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	174,388,378.88	-	83,250,129.39	257,638,508.27
其中：1. 基金申购款	1,396,565,975.35	-	518,090,084.60	1,914,656,059.95
2. 基金赎回款	-1,222,177,596.47	-	-434,839,955.21	-1,657,017,551.68
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	3,533,758,530.33	-	1,389,199,387.70	4,922,957,918.03
项目	上年度可比期间			
	2023 年 1 月 1 日至 2023 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	43,719,952.37	-	22,770,604.63	66,490,557.00
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	43,719,952.37	-	22,770,604.63	66,490,557.00
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	1,496,502,916.40	-	803,477,911.09	2,299,980,827.49
（一）、综合收益总额	-	-	9,323,780.12	9,323,780.12
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	1,496,502,916.40	-	807,188,403.01	2,303,691,319.41

其中：1. 基金申购款	1,553,533,285.63	-	836,661,354.79	2,390,194,640.42
2. 基金赎回款	-57,030,369.23	-	-29,472,951.78	-86,503,321.01
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-13,034,272.04	-13,034,272.04
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	1,540,222,868.77	-	826,248,515.72	2,366,471,384.49

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：

商小虎

高翔

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、《资产管理产品相关会计处理规定》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本报告期末的财务状况以及本报告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。

#### 6.4.5 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[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。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(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 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	27,318,131.64

等于：本金	27,316,751.93
加：应计利息	1,379.71
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	27,318,131.64

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	674,620,781.04	-	707,536,944.46	32,916,163.42	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	189,298,291.96	2,330,308.47	208,666,608.87	17,038,008.44
	银行间市场	4,907,608,539.37	75,886,664.46	5,030,073,964.46	46,578,760.63
	合计	5,096,906,831.33	78,216,972.93	5,238,740,573.33	63,616,769.07
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	5,771,527,612.37	78,216,972.93	5,946,277,517.79	96,532,932.49	

#### 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

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	27,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	27,000,000.00	-

## 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
----	-----

	2024 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	39.20
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	436,014.20
其中：交易所市场	380,193.32
银行间市场	55,820.88
应付利息	-
预提费用	128,644.68
合计	564,698.08

## 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	3,818,486,973.67	3,046,828,381.08
本期申购	1,450,387,485.82	1,157,287,153.17
本期赎回（以“-”号填列）	-1,161,033,368.64	-926,400,606.38
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	4,107,841,090.85	3,277,714,927.87

## 融通增强收益债券 C

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	394,034,349.04	312,541,770.37
本期申购	301,664,063.28	239,278,822.18
本期赎回（以“-”号填列）	-372,897,549.89	-295,776,990.09
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	322,800,862.43	256,043,602.46

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
上年度末	1,212,059,260.83	-98,425,206.13	1,113,634,054.70
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	1,212,059,260.83	-98,425,206.13	1,113,634,054.70
本期利润	15,532,342.15	81,333,313.87	96,865,656.02
本期基金份额交易产生的变动数	94,335,799.19	1,573,884.85	95,909,684.04
其中：基金申购款	457,663,161.21	-14,982,707.80	442,680,453.41
基金赎回款	-363,327,362.02	16,556,592.65	-346,770,769.37
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,321,927,402.17	-15,518,007.41	1,306,409,394.76

## 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
上年度末	101,243,638.00	-9,294,752.88	91,948,885.12
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	101,243,638.00	-9,294,752.88	91,948,885.12
本期利润	35,600.51	3,465,061.96	3,500,662.47
本期基金份额交易产生的变动数	-17,579,634.93	4,920,080.28	-12,659,554.65
其中：基金申购款	76,417,304.18	-1,007,672.99	75,409,631.19
基金赎回款	-93,996,939.11	5,927,753.27	-88,069,185.84
本期已分配利润	-	-	-
本期末	83,699,603.58	-909,610.64	82,789,992.94

## 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
活期存款利息收入	70,980.45
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	37,214.67
其他	1,452.91
合计	109,648.03

注：此处其他列示的是基金交易保证金利息收入。

## 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 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-73,745,065.59
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	-73,745,065.59

## 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 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出股票成交总额	554,616,253.28
减：卖出股票成本总额	626,810,583.58
减：交易费用	1,550,735.29
买卖股票差价收入	-73,745,065.59

## 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 2024年1月1日至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	82,905,264.46
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	28,748,045.48
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	111,653,309.94

## 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 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	4,458,735,224.47
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	4,371,695,880.81

减：应计利息总额	58,247,541.57
减：交易费用	43,756.61
买卖债券差价收入	28,748,045.48

#### 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 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	10,660,303.37
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	10,660,303.37

## 6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
1. 交易性金融资产	84,798,375.83
股票投资	40,303,997.07
债券投资	44,494,378.76
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	84,798,375.83

## 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
基金赎回费收入	489,142.65
基金转换费收入	10,965.23
合计	500,107.88

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. 基金的转换费用包括转换费和补差费，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
----	----

	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
审计费用	59,672.34
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行费用	15,959.41
账户维护费	18,600.00
合计	153,904.09

#### 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

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。

##### 6.4.9.2 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
诚通证券股份有限公司（“诚通证券”）	基金管理人的股东、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。

#### 6.4.10 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

###### 6.4.10.1.1 股票交易

无。

###### 6.4.10.1.2 债券交易

无。

###### 6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

###### 6.4.10.1.4 权证交易

无。

###### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

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	上年度可比期间
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	15,934,062.10	1,577,037.25
其中：应支付销售机构的客户维护费	2,169,900.91	218,287.57
应支付基金管理人的净管理费	13,764,161.19	1,358,749.68

注：1. 支付基金管理人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	上年度可比期间
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	4,552,589.19	450,582.08

注：支付基金托管人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		
	2024 年 1 月 1 日至 2024 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	-	197,451.40	197,451.40
中国工商银行	-	295.73	295.73
诚通证券	-	268.08	268.08
合计	-	198,015.21	198,015.21
获得销售服务费的各关联方	上年度可比期间		
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		

方名称	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	-	131,524.81	131,524.81
中国工商银行	-	35.47	35.47
诚通证券	-	761.74	761.74
合计	-	132,322.02	132,322.02

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.35% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给基金管理人，再由基金管理人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 类基金份额的基金资产净值 × 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

单位：人民币元

本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国工商银行	-	-	-	-	800,070,000.00	290,184.91
上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国工商银行	-	-	-	-	-	-

#### 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自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		上年度可比期间	
	2024年1月1日至2024年6月30日		2023年1月1日至2023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	27,318,131.64	70,980.45	1,986,839.24	21,369.61

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，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（2024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

截至本报告期末 2024 年 6 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 1,050,476,196.53 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
160210	16 国开 10	2024 年 7 月 2 日	103.06	1,000,000	103,057,972.60
160410	16 农发 10	2024 年 7 月 2 日	117.46	1,000,000	117,459,836.07
180205	18 国开 05	2024 年 7 月 2 日	111.97	2,000,000	223,933,333.33
190215	19 国开 15	2024 年 7 月 2 日	109.34	158,000	17,275,163.11
1928023	19 农业银行 永续债 02	2024 年 7 月 2 日	103.84	185,000	19,211,158.20
200215	20 国开 15	2024 年 7 月 2 日	111.45	106,000	11,813,474.10
200219	20 国开 19	2024 年 7 月 2 日	104.65	495,000	51,802,345.08
2028006	20 邮储银行 永续债	2024 年 7 月 2 日	102.24	500,000	51,119,602.74
2028037	20 光大银行	2024 年 7 月 2 日	106.64	1,500,000	159,953,196.72

	永续债				
2028040	20 交通银行 永续债	2024 年 7 月 2 日	106.61	700,000	74,626,426.23
2128011	21 邮储银行 永续债 01	2024 年 7 月 2 日	105.15	1,500,000	157,723,150.68
2228001	22 邮储银行 永续债 01	2024 年 7 月 2 日	104.82	1,000,000	104,817,868.85
230202	23 国开 02	2024 年 7 月 2 日	102.43	1,000,000	102,427,158.47
合计				11,144,000	1,195,220,686.18

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 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，其长期平均风险和预期收益率低于股票基金、混合基金，高于货币市场基金。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的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。本基金将在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，通过积极主动的投资管理，追求较高的当期收益和长期回报，力争实现基金资产的长期稳健增值。

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。

监察稽核相关部门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。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国工商银行，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

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	146,858,644.99	254,477,826.09
合计	146,858,644.99	254,477,826.09

注：1、未评级债券为国债、政策性金融债。

2、债券信用评级取自第三方评级机构的评级。

## 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

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	29,778,727.50	448,255,046.11
合计	29,778,727.50	448,255,046.11

## 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 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
AAA	2,210,053,398.99	1,299,144,826.82
AAA 以下	-	972,316.84
未评级	2,852,049,801.85	3,318,849,408.41
合计	5,062,103,200.84	4,618,966,552.07

注：1、未评级债券为国债、政策性金融债。

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 2024 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额中有 1,050,476,196.53 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 2024 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。于 2024 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未来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。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，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 2024年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	27,318,131.64	-	-	-	27,318,131.64
结算备付金	3,712,653.25	-	-	-	3,712,653.25
存出保证金	182,788.79	-	-	-	182,788.79
交易性金融资产	687,802,491.15	3,498,133,040.96	1,052,805,041.22	707,536,944.46	5,946,277,517.79
买入返售金融资产	27,000,000.00	-	-	-	27,000,000.00
应收申购款	-	-	-	325,793.38	325,793.38
资产总计	746,016,064.83	3,498,133,040.96	1,052,805,041.22	707,862,737.84	6,004,816,884.85
负债					
应付赎回款	-	-	-	165,493.63	165,493.63
应付管理人报酬	-	-	-	2,764,720.71	2,764,720.71
应付托管费	-	-	-	789,920.20	789,920.20
应付清算款	-	-	-	27,000,000.00	27,000,000.00
卖出回购金融资产	1,050,476,196.53	-	-	-	1,050,476,196.53

款					
应付销售服务费	-	-	-	97,937.67	97,937.67
其他负债	-	-	-	564,698.08	564,698.08
负债总计	1,050,476,196.53	-	-	31,382,770.29	1,081,858,966.82
利率敏感度缺口	-304,460,131.70	3,498,133,040.96	1,052,805,041.22	676,479,967.55	4,922,957,918.03
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	18,924,566.28	-	-	-	18,924,566.28
结算备付金	1,871,294.90	-	-	-	1,871,294.90
存出保证金	173,547.40	-	-	-	173,547.40
交易性金融资产	1,263,878,811.06	2,589,144,153.04	1,468,676,460.17	575,281,084.67	5,896,980,508.94
应收申购款	-	-	-	11,045,392.37	11,045,392.37
应收清算款	-	-	-	135,685,166.27	135,685,166.27
资产总计	1,284,848,219.64	2,589,144,153.04	1,468,676,460.17	722,011,643.31	6,064,680,476.16
负债					
应付赎回款	-	-	-	111,452,079.77	111,452,079.77
应付管理人报酬	-	-	-	2,812,101.72	2,812,101.72
应付托管费	-	-	-	803,457.62	803,457.62
应付清算款	-	-	-	18,242,255.63	18,242,255.63
卖出回购金融资产款	1,365,429,165.48	-	-	-	1,365,429,165.48
应付销售服务费	-	-	-	158,423.87	158,423.87
应交税费	-	-	-	3.82	3.82
其他负债	-	-	-	829,896.98	829,896.98
负债总计	1,365,429,165.48	-	-	134,298,219.41	1,499,727,384.89
利率敏感度缺口	-80,580,945.84	2,589,144,153.04	1,468,676,460.17	587,713,423.90	4,564,953,091.27

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		
分析	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 (2024 年 6 月 30 日)	上年度末 (2023 年 12 月 31 日)
	1. 市场利率下降 25 个基点	52,015,990.98	54,839,024.57
2. 市场利率上升 25 个基点	-50,614,067.82	-53,572,223.83	

#### 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。

#### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

无。

#### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

无。

#### 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。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的固定收益品种。截至资产负债表日，本基金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 2024年6月30日		上年度末 2023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	707,536,944.46	14.37	575,281,084.67	12.60
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	707,536,944.46	14.37	575,281,084.67	12.60

##### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2024 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 14.37%(2023 年 12 月 31 日：12.60%)，因此除市场利率和外汇汇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(2023 年 12 月 31 日：同)。

#### 6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

#### 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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	707,536,944.46	576,253,401.51
第二层次	5,238,740,573.33	5,320,727,107.43
第三层次	-	-
合计	5,946,277,517.79	5,896,980,508.94

##### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

##### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2024 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(2023 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

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	707,536,944.46	11.78
	其中：股票	707,536,944.46	11.78
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	5,238,740,573.33	87.24
	其中：债券	5,238,740,573.33	87.24
	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	27,000,000.00	0.45
	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	31,030,784.89	0.52
8	其他各项资产	508,582.17	0.01
9	合计	6,004,816,884.85	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	-	-
B	采矿业	156,904,141.80	3.19
C	制造业	243,224,758.74	4.94
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	139,019,374.12	2.82
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	141,241,617.80	2.87
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	18,543,750.00	0.38
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	8,603,302.00	0.17
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	707,536,944.46	14.37

### 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	600547	山东黄金	2,544,400	69,665,672.00	1.42
2	601006	大秦铁路	9,615,700	68,848,412.00	1.40
3	000975	银泰黄金	3,538,220	57,637,603.80	1.17

4	600461	洪城环境	4,516,850	52,305,123.00	1.06
5	000333	美的集团	751,000	48,439,500.00	0.98
6	600900	长江电力	1,461,700	42,272,364.00	0.86
7	688332	中科蓝讯	547,766	32,312,716.34	0.66
8	300502	新易盛	286,400	30,229,520.00	0.61
9	600988	赤峰黄金	1,808,900	29,557,426.00	0.60
10	600026	中远海能	1,659,300	25,901,673.00	0.53
11	600894	广日股份	2,118,600	24,363,900.00	0.49
12	600993	马应龙	776,100	20,698,587.00	0.42
13	601598	中国外运	3,501,500	19,713,445.00	0.40
14	600941	中国移动	172,500	18,543,750.00	0.38
15	002039	黔源电力	1,013,140	17,831,264.00	0.36
16	002332	仙琚制药	1,541,700	17,590,797.00	0.36
17	600803	新奥股份	817,000	16,993,600.00	0.35
18	601000	唐山港	3,193,886	15,011,264.20	0.30
19	002223	鱼跃医疗	372,300	13,998,480.00	0.28
20	300833	浩洋股份	266,850	12,381,840.00	0.25
21	688169	石头科技	30,704	12,054,390.40	0.24
22	601919	中远海控	759,640	11,766,823.60	0.24
23	600066	宇通客车	440,000	11,352,000.00	0.23
24	300192	科德教育	876,100	8,603,302.00	0.17
25	300952	恒辉安防	444,900	7,714,566.00	0.16
26	000100	TCL 科技	1,658,200	7,163,424.00	0.15
27	600681	百川能源	1,457,176	4,910,683.12	0.10
28	600114	东睦股份	325,300	4,681,067.00	0.10
29	603393	新天然气	116,200	4,036,788.00	0.08
30	600863	内蒙华电	144,300	669,552.00	0.01
31	300677	英科医疗	9,100	243,971.00	0.00
32	002155	湖南黄金	2,400	43,440.00	0.00

#### 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	000333	美的集团	69,231,413.00	1.52
2	000895	双汇发展	67,891,423.80	1.49
3	688332	中科蓝讯	36,443,610.88	0.80
4	600988	赤峰黄金	32,832,134.36	0.72
5	601006	大秦铁路	31,657,583.00	0.69
6	600894	广日股份	28,269,395.00	0.62
7	300502	新易盛	27,780,085.40	0.61
8	688036	传音控股	27,446,906.32	0.60
9	600026	中远海能	23,539,062.30	0.52

10	601598	中国外运	21,666,129.53	0.47
11	002332	仙琚制药	19,135,771.00	0.42
12	688087	英科再生	18,570,595.50	0.41
13	002039	黔源电力	18,332,639.20	0.40
14	301376	致欧科技	18,302,593.69	0.40
15	603009	北特科技	18,300,286.00	0.40
16	300709	精研科技	18,290,722.56	0.40
17	300833	浩洋股份	18,280,817.02	0.40
18	600461	洪城环境	18,267,634.97	0.40
19	600941	中国移动	17,040,931.05	0.37
20	000975	银泰黄金	14,989,386.00	0.33

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	000895	双汇发展	59,616,358.54	1.31
2	301345	涛涛车业	36,943,972.57	0.81
3	688036	传音控股	32,094,707.86	0.70
4	300773	拉卡拉	30,847,953.00	0.68
5	000333	美的集团	27,441,408.00	0.60
6	000403	派林生物	25,862,649.00	0.57
7	002976	瑞玛精密	20,129,942.00	0.44
8	688087	英科再生	19,051,401.82	0.42
9	688678	福立旺	18,856,256.83	0.41
10	300709	精研科技	18,232,598.00	0.40
11	301376	致欧科技	17,738,762.72	0.39
12	300174	元力股份	16,027,422.71	0.35
13	688111	金山办公	15,815,013.67	0.35
14	300893	松原股份	15,233,541.92	0.33
15	603009	北特科技	14,151,235.00	0.31
16	300006	莱美药业	11,944,400.00	0.26
17	688137	近岸蛋白	11,702,915.84	0.26
18	300577	开润股份	10,885,065.00	0.24
19	000683	远兴能源	10,781,459.00	0.24
20	000628	高新发展	10,708,766.00	0.23

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	718,762,446.30
卖出股票收入（成交）总额	554,616,253.28

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	454,064,973.36	9.22
2	央行票据	-	-
3	金融债券	4,754,896,872.47	96.59
	其中：政策性金融债	2,544,843,473.48	51.69
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	同业存单	29,778,727.50	0.60
9	其他	-	-
10	合计	5,238,740,573.33	106.41

### 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	190311	19 进出 11	2,600,000	267,596,901.64	5.44
2	210316	21 进出 16	2,400,000	255,180,590.16	5.18
3	2028051	20 浦发银行永续债	2,200,000	234,397,978.14	4.76
4	210203	21 国开 03	2,200,000	227,732,849.32	4.63
5	180205	18 国开 05	2,000,000	223,933,333.33	4.55

### 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 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现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 23 宁波银行 02、23 宁波银行永续债 01，其发行主体为宁波银行股份有限公司。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 21 邮储银行永续债 01，其发行主体为中国邮政储蓄银行股份有限公司。根据发布的相关公告，该证券发行主体因未依法履行职责，受到央行的处罚。

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 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

无。

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	182,788.79
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	325,793.38
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	508,582.17

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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	户均持有的基金份额	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者

	(户)		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	1,818	2,259,538.55	4,080,749,211.25	99.34	27,091,879.60	0.66
融通增强 收益债券 C	6,705	48,143.31	309,337,513.70	95.83	13,463,348.73	4.17
合计	8,523	519,845.35	4,390,086,724.95	99.08	40,555,228.33	0.92

### 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	融通增强收益债券 A	300,354.17	0.00731
	融通增强收益债券 C	-	-
	合计	300,354.17	0.00678

### 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	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	0~10
	融通增强收益债券 C	0
	合计	0~10

## §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	3,818,486,973.67	394,034,349.04
本报告期基金总申购份额	1,450,387,485.82	301,664,063.28
减：本报告期基金总赎回份额	1,161,033,368.64	372,897,549.89
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	4,107,841,090.85	322,800,862.43

## § 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 基金管理人的重大人事变动

1、2024 年 1 月 27 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》，新任张民为公司副总经理，上述变更事项经本公司董事会审议通过。

2、2024 年 4 月 23 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》，公司副总经理商小虎代任公司总经理，张帆不再担任公司总经理，上述变更事项经本公司董事会审议通过。

#### 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

#### 10.6.1 管理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及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

#### 10.6.2 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	

					(%)	
国盛证券	1	333,361,114.50	26.18	311,995.52	26.18	-
长江证券	1	255,278,262.49	20.05	238,915.25	20.05	-
中泰证券	2	172,971,189.54	13.58	161,882.44	13.58	-
开源证券	2	152,332,603.02	11.96	142,570.50	11.96	-
中金公司	1	108,573,023.22	8.53	101,611.70	8.53	-
浙商证券	2	105,547,005.64	8.29	98,780.32	8.29	-
东北证券	1	75,613,139.64	5.94	70,764.99	5.94	-
天风证券	2	62,446,499.37	4.90	58,448.46	4.90	-
国投证券	2	7,255,862.16	0.57	6,790.95	0.57	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
诚通证券	2	-	-	-	-	-
东方财富	1	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	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	-	-	-	-	-
华西证券	3	-	-	-	-	-
华鑫证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
万联证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	3	-	-	-	-	-
野村东方 证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
中信证券	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五个方面：

- (1) 实力雄厚，信誉良好；内部管理规范，严格；注册资本符合证监会相关要求；
- (2) 研究实力较强，有稳定的研究机构和专业的研究人员，能及时为本公司提供高质量的研究支持与服务，包括宏观与策略报告、行业与公司分析报告、债券市场分析报告和金融衍生品分析报告等，并能根据基金投资的特定需求，提供专门研究报告；
- (3) 券商利用其他专业研究咨询机构为本公司提供研究与支持服务的，对该券商研究方面的

要求按照上述第 2 点规定执行；

- (4) 严格禁止将席位开设与券商的基金销售挂钩；
- (5) 严格禁止向券商承诺基金在交易单元上的交易量。

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) 评价券商。投资研究相关部门对拟合作券商的研究质量与研究服务进行评价；
- (2) 拟定合作券商。投资研究相关部门根据券商选择标准，拟定备选合作券商；
- (3) 上报批准。投资研究相关部门将备选合作券商上报至研究部，由研究部将备选合作券商的情况上报公司批准；

- (4) 签署协议。在获得批准后，研究部依据公司合同审批流程，与确定的券商签约。

### 3、交易单元变更情况

本基金本报告期终止租用中泰证券交易单元 2 个。

4、根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》的要求，本公司已于法规规定的时间内，完成调整相关交易费用。

## 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 (%)
国盛证券	77,372,173.19	36.39	1,641,000,000.00	53.43	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
浙商证券	45,675,191.00	21.48	450,300,000.00	14.66	-	-
东北证券	89,569,746.49	42.13	799,000,000.00	26.02	-	-
天风证券	-	-	181,000,000.00	5.89	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
诚通证券	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-

东兴证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
野村东方 证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

### 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	融通基金管理有限公司关于提醒投资者注意防范不法分子诈骗活动的提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 1 月 26 日
2	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	2024 年 1 月 27 日
3	关于融通增强收益债券型证券投资基金 A 类在网上直销平台开通基金定投业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 1 月 29 日
4	关于旗下部分开放式基金在中国农业银行股份有限公司开通定期定额投资、转换业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 1 月 31 日
5	关于旗下部分开放式基金新增西南证券股份有限公司为销售机构并开通定期定额投资及转换业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 3 月 1 日
6	关于旗下部分开放式基金新增华西证券股份有限公司为销售机构并开通定期定额投资、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	2024 年 3 月 7 日
7	关于旗下部分开放式基金新增麦高证券有限责任公司为销售机构并开通定期定额投资、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	2024 年 3 月 11 日
8	融通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增中信银行股份有限公司为销售机构并开通定期定额投资业务、转换业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 3 月 19 日
9	融通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金	中国证监会指	2024 年 3 月 26 日

	新增上海长量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	定报刊及网站	
10	关于旗下部分开放式基金新增方正证券股份有限公司为销售机构并开通定期定额投资、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	2024 年 4 月 17 日
11	融通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增上海大智慧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	2024 年 4 月 18 日
12	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	2024 年 4 月 23 日
13	关于旗下部分开放式基金新增国联证券股份有限公司为销售机构并开通定期定额投资、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	2024 年 4 月 29 日
14	关于旗下部分开放式基金新增江海证券有限公司为销售机构并开通定期定额投资、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	2024 年 6 月 4 日
15	关于广发证券股份有限公司新增开通融通基金管理有限公司旗下部分开放式基金的定期定额投资业务并开展申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 6 月 5 日
16	融通基金管理有限公司关于公司办公地址变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 6 月 15 日

## § 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

无。

## § 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》及其更新
- (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，或登录本基金管理人网站 <http://www.rtfund.com> 查阅。

融通基金管理有限公司

2024 年 8 月 29 日