

融通通裕定期开放债券型发起式证券投资基金

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：交通银行股份有限公司

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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据融通通裕定期开放债券型发起式证券投资基金（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	5
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	6
3.3 其他指标	7
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>7</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	8
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	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
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	11
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>11</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
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	11
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	11
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>12</b>
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 净资产变动表	14
6.4 报表附注	16
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>35</b>
7.1 期末基金资产组合情况	35
7.2 期末按债券品种分类的债券投资组合	36
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	36
7.4 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	36
7.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	37

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	37
7.7 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	37
7.8 投资组合报告附注 .....	37
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>38</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	38
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	38
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 .....	38
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况 .....	38
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>39</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>39</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	39
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 .....	39
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	39
10.4 基金投资策略的改变 .....	39
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	39
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 .....	40
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	40
10.8 其他重大事件 .....	42
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>42</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 .....	42
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	43
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>43</b>
12.1 备查文件目录 .....	43
12.2 存放地点 .....	43
12.3 查阅方式 .....	43

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	融通通裕定期开放债券型发起式证券投资基金
基金简称	融通通裕定开债券发起式
基金主代码	002869
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018 年 3 月 14 日
基金管理人	融通基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,056,543,672.66 份
基金合同存续期	不定期

注：本基金由融通通裕债券型证券投资基金转型而来，转型前的基金合同生效日为 2016 年 11 月 2 日。

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险的前提下，力争获得高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金的具体投资策略包括资产配置策略、利率策略、信用策略、类属配置与个券选择策略以及资产支持证券投资策略等部分。
业绩比较基准	中债综合指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，但低于混合型基金、股票型基金，属于较低风险/收益的产品。

### 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	交通银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	涂卫东	方圆
	联系电话	(0755) 26948666	95559
	电子邮箱	service@mail.rtfund.com	fangy_20@bankcomm.com
客户服务电话		400-883-8088、(0755) 26948088	95559
传真		(0755) 26935005	(021) 62701216
注册地址		深圳市南山区华侨城汉唐大厦 13、14 层	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 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	中国（上海）长宁区仙霞路 18 号
邮政编码		518054	200336
法定代表人		张威	任德奇

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.rtfund.com">http://www.rtfund.com</a>
基金中期报告备置地点	基金管理人、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)
本期已实现收益	14,707,597.48
本期利润	32,018,744.57
加权平均基金份额本期利润	0.0303
本期加权平均净值利润率	2.81%
本期基金份额净值增长率	2.86%
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	29,156,100.10
期末可供分配基金份额利润	0.0276
期末基金资产净值	1,153,235,723.45
期末基金份额净值	1.0915
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	43.02%

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

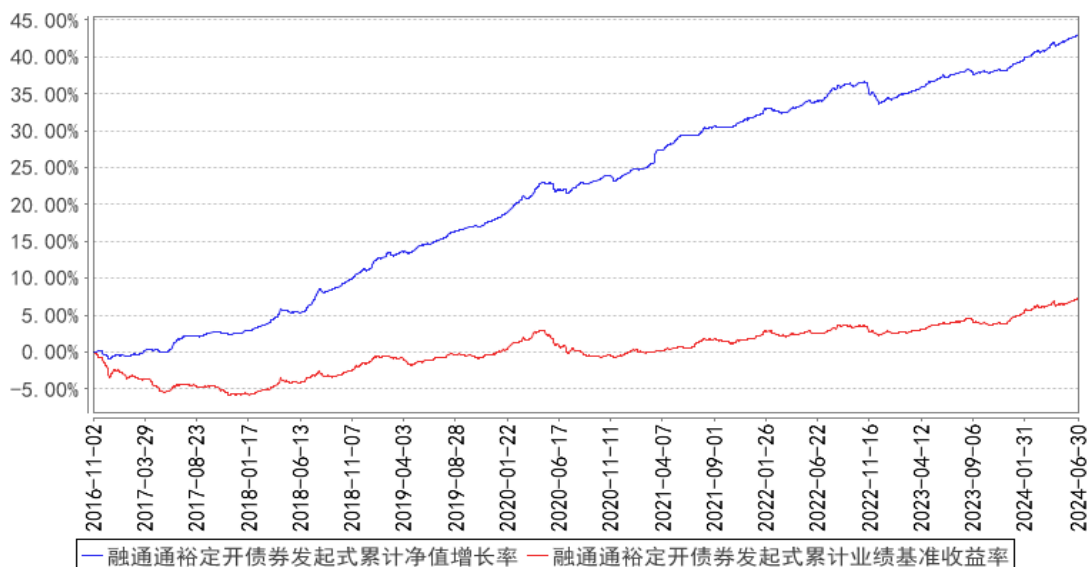
## 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	0.48%	0.02%	0.65%	0.03%	-0.17%	-0.01%
过去三个月	1.44%	0.05%	1.06%	0.07%	0.38%	-0.02%
过去六个月	2.86%	0.04%	2.42%	0.07%	0.44%	-0.03%
过去一年	4.07%	0.04%	3.27%	0.06%	0.80%	-0.02%

过去三年	10.49%	0.05%	6.58%	0.05%	3.91%	0.00%
自基金合同生效起至今	43.02%	0.06%	7.29%	0.07%	35.73%	-0.01%

### 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

融通通裕定开债券发起式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：本基金由融通通裕债券型证券投资基金转型而来，转型前的基金合同生效日为 2016 年 11 月 2 日。

### 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		
刘力宁	本基金的基金经理	2023年8月21日	-	8年	刘力宁先生，中央财经大学经济学硕士，8年证券投资研究经验，具有基金从业资格。2016年7月至2020年7月在中国进出口银行资金营运部工作，2020年8月至2023年3月在渤海银行股份有限公司担任债券交易专员，2023年4月加入融通基金管理有限公司。现任融通通宸债券型证券投资基金基金经理、融通通裕定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理、融通增享纯债债券型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。
李皓	本基金的基金经理、固定收益投资部副总经理	2024年1月4日	-	13年	李皓先生，工程硕士，13年证券投资研究经历，具有基金从业资格。2011年8月至2023年5月在昆仑银行股份有限公司工作，先后从事债券交易、债券投资等方面的工作。2023年5月加入融通基金管理有限公司。现任固定收益投资部副总经理、融通通祺债券型证券投资基金基金经理、融通通裕定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理、融通增悦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、基金业务相关工作的时间为计算标准。

#### 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

2024 年上半年，债市收益率总体走低，利率曲线整体下移，久期策略明显占优，资金面平稳偏松+债市处于“资产荒”的环境，是支撑 2024 年上半年债牛的重要逻辑。整体来看，上半年宏观经济仍处于弱修复区间，结构上呈生产强于需求，出口强于内需的分化特征，需求不足问题依旧突出，地产景气依旧偏弱。货币流动性方面，2024 年上半年，资金面整体平稳，资金分层阶段性弱化。2024 年上半年，央行在跨季期间总体适度加大 OMO 投放以助力跨季平稳，二季度在“手工补息”被禁影响下，非银资金较为充裕，资金面分层在 4-5 月阶段性近乎消失，随着理财逐步回表，叠加 6 月缴税及跨季扰动，资金面分层现象重现。

2024 年上半年货币政策仍在总量宽松空间，财政政策定调积极、超长期特别国债发行计划落地，地产政策全面优化。

年初央行年度工作会议强调，注重新增信贷均衡投放，提高存量资金使用效率，确保社会融资规模全年可持续较快增长。财政政策定调积极，超长期特别国债发行计划于二季度落地，2023 年万亿增发国债项目开工率超 80%。3 月政府工作报告延续“促进综合融资成本稳中有降”的政策诉求，同时专门强调保持流动性合理充裕，后续政府债券发行过程中，货币政策大概率予以积极配合，但也指出要避免资金沉淀空转。但二季度以来，央行召开一季度货政例会表示更好发挥货币政策工具的总量和结构双重功能，同时，表态“关注长期收益率的变化”。5 月 10 日，央行发布 2024 年第一季度货政报告表示，畅通货币政策传导机制，避免资金沉淀空转；长端利率方面，指出长期国债收益率与未来经济向好的态势或更加匹配。6 月 19 日，央行表示，把维护价格稳定、推动价格温和回升作为重要考量，灵活运用利率、存款准备金率等政策工具，同时保持政策定力，不大放大收。政策利率方面，其表示，未来可以继续优化货币政策中间变量，逐步淡化对 M2、社融等数量目标的关注。

地产政策持续优化。央行年度工作会议强调，因城施策精准实施好差别化住房信贷政策，满足各类房地产企业合理融资需求。3 月政府工作报告提及要适应新型城镇化发展趋势和房地产市场供求关系变化，加快构建房地产发展新模式。5 月央行出台优化住房金融政策组合拳：宣布下

调住房贷款最低首付比例 5 个百分点，首套房贷最低首付降至 15%，二套房最低首付降至 25%；取消全国层面首套房和二套房贷款利率政策下限，并下调公积金贷款利率 0.25 个百分点；同时，央行拟设立保障性住房再贷款，规模 3000 亿元，可带动银行贷款 5000 亿元。6 月 12 日，央行召开保障性住房再贷款工作推进会，会议强调，金融机构和有关单位要着力推动保障性住房再贷款政策落地见效，加快推动存量商品房去库存；货币政策司表示，下一步，推进保障性住房再贷款有关工作要做到“精准支持、自愿参与、以需定购、合理定价”。6 月 26 日，北京发布楼市新政，购买首套住房最低首付款比例调整为不低于 20%；至此，一线城市的楼市政策调整全部落地。

债券市场方面，在监管约束和资金面平稳宽松叠加基本面依旧偏弱的大背景下，收益率呈现震荡行情，但整体收益率曲线中枢依然呈现出震荡向下态势。

本组合在上半年跟随市场变化，灵活调整组合持仓，适度增加利率债配置，加大波段交易，适度提升组合久期，维持中性偏积极杠杆水平。综合来看，目前市场优质短端资产收益率依然在下降，当前市场依然处在压缩溢价空间阶段，过度追求杠杆骑乘收益效果并不显著，提高窄区间波动时期交易对提升组合收益或有更大益处。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.0915 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.86%，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

第一，上半年宏观经济仍处于弱修复区间，结构上呈生产强于需求的分化特征，需求不足问题依旧突出，地产景气依旧偏弱。同时，实体融资需求仍偏弱，M2-M1 剪刀差持续走阔，经济活性依旧偏低。

第二，货币政策保持支持性，资金面预计维持平稳均衡。新旧动能转换背景下经济内生动力不强，供给强而需求弱，再通胀困难，融资需求不畅，当前宏观图景下货币政策发生转向的可能性不高。综合来看，资金面偏平稳概率更高。

整体而言，债券市场中期主线尚未改变，内需偏弱和信用派生梗阻形成的高息资产供给减少，叠加安全资产配置需求，使得资产荒格局可能长期存在。债务压力下存在融资成本与名义利率降低诉求，也意味着中长期的下行趋势仍在途中。对三季度而言，外需和制造业部门对冲地产相关内需下行的结构特征仍然存在，实际经济增长变化可能有限，意味着政策风险概率年内可能有限；而名义经济在通胀弹性较弱的背景下大概率持续偏弱。在当前市场与央行预期引导的对抗中，基本面仍然不支持货币流动性收紧。短期在通胀和融资需求仍有下行压力的背景下，流动性宽松可能延续；关注后续政府债券供给扰动因素或汇率波动加大后的潜在资金面波动；

机构行为方面，资产荒格局大概率仍然存在，但三季度随着政府债券供给加速，银行、保险欠配程度和对债券配置需求的支撑力度弱于上半年，广义基金和信用债的资产荒可能延续。操作中建议关注左侧交易机会，按照震荡区间观察，参考交易自身拥挤度及赔率空间进行波段操作。

#### 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及其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

本报告期内本基金管理人无应说明的预警信息。

### § 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，基金托管人在融通通裕定期开放债券型发起式证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

#### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，融通基金管理有限公司在融通通裕定期开放债券型发起式证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

#### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由融通基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关融通通裕定期开放债券型发起式证券投资基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关

内容、投资组合报告等内容真实、准确、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：融通通裕定期开放债券型发起式证券投资基金

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	568,508.55	1,479,891.60
结算备付金		56,248.50	-
存出保证金		620.01	5,958.81
交易性金融资产	6.4.7.2	1,558,362,567.91	1,540,512,938.81
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		1,455,118,526.43	1,496,861,686.21
资产支持证券投资		103,244,041.48	43,651,252.60
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	-	-
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		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		1,558,987,944.97	1,541,998,789.22
<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		405,134,428.71	420,085,657.92
应付清算款		-	-

应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		282,895.12	284,498.37
应付托管费		94,298.37	94,832.80
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		69,202.41	78,922.07
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	171,396.91	237,848.07
负债合计		405,752,221.52	420,781,759.23
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	1,056,543,672.66	1,056,543,720.16
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	96,692,050.79	64,673,309.83
净资产合计		1,153,235,723.45	1,121,217,029.99
负债和净资产总计		1,558,987,944.97	1,541,998,789.22

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0915 元，基金份额总额 1,056,543,672.66 份。

## 6.2 利润表

会计主体：融通通裕定期开放债券型发起式证券投资基金

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	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
<b>一、营业总收入</b>		38,844,717.88	9,672,621.37
1. 利息收入		14,185.82	181,063.11
其中：存款利息收入	6.4.7.13	12,169.05	11,616.41
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		2,016.77	169,446.70
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		21,519,384.97	6,392,074.95
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	19,926,852.71	6,219,592.15
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	1,592,532.26	172,482.80
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	-	-
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	17,311,147.09	3,099,483.31
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	-	-
<b>减：二、营业总支出</b>		6,825,973.31	1,750,899.17
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,697,063.64	495,923.60
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	565,687.88	165,307.85
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		4,358,561.91	969,076.88
其中：卖出回购金融资产支出		4,358,561.91	969,076.88
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		57,139.95	8,509.07
8. 其他费用	6.4.7.23	147,519.93	112,081.77
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		32,018,744.57	7,921,722.20
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		32,018,744.57	7,921,722.20
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		32,018,744.57	7,921,722.20

### 6.3 净资产变动表

会计主体：融通通裕定期开放债券型发起式证券投资基金

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	1,056,543,720.16	-	64,673,309.83	1,121,217,029.99
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-

二、本期期初净资产	1,056,543,720.16	-	64,673,309.83	1,121,217,029.99
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-47.50	-	32,018,740.96	32,018,693.46
(一)、综合收益总额	-	-	32,018,744.57	32,018,744.57
(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)	-47.50	-	-3.61	-51.11
其中：1. 基金申购款	-	-	-	-
2. 基金赎回款	-47.50	-	-3.61	-51.11
(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	1,056,543,672.66	-	96,692,050.79	1,153,235,723.45
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	478,727,802.61	-	39,639,820.89	518,367,623.50
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	478,727,802.61	-	39,639,820.89	518,367,623.50
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-184,399,797.72	-	-7,678,500.91	-192,078,298.63

(一)、综合收益总额	-	-	7,921,722.20	7,921,722.20
(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)	-184,399,797.72	-	-15,600,223.11	-200,000,020.83
其中：1. 基金申购款	-	-	-	-
2. 基金赎回款	-184,399,797.72	-	-15,600,223.11	-200,000,020.83
(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	294,328,004.89	-	31,961,319.98	326,289,324.87

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

融通通裕定期开放债券型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)是由融通通裕债券型证券投资基金(以下简称“原基金”)转型而来。原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]1113号《关于准予融通通裕债券型证券投资基金注册的批复》核准,由融通基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《融通通裕债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。原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 200,023,069.04 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 1378 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《融通通裕债券型证券投资基金基金合同》于 2016 年 11 月 2 日正式生效,原基金基金合同生效日的基金份额总额为 200,033,625.71 份基金份额,其中认购资金利息折合 10,556.67 份基金份额。原基金的基金管



理人为融通基金管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据中国证监会证监许可[2017]2399号《关于准予融通通裕债券型证券投资基金变更注册的批复》，准予融通基金管理有限公司将原基金变更注册为本基金。2018年1月16日至2018年2月4日融通基金管理有限公司以通讯方式组织召开原基金基金份额持有人大会，会议审议通过了《关于融通通裕债券型证券投资基金转型并修改基金合同有关事项的议案》。根据融通基金管理有限公司于2018年2月6日发布的《关于融通通裕债券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》以及于2018年3月14日发布的《融通通裕定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同生效公告》，自2018年3月14日起，《融通通裕定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》正式生效，《融通通裕债券型证券投资基金基金合同》同日起失效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为融通基金管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。

本基金以定期开放方式运作，即本基金以封闭运作和开放运作结合的方式运作。本基金的封闭期为自基金合同生效之日起(包括基金合同生效之日)或自每一开放期结束之日次日起(包括该日)三个月的期间。本基金的开放期为自封闭期结束之日后第一个工作日起(含该日)五至二十个工作日。本基金封闭期内不办理申购与赎回业务，也不上市交易。

本基金为发起式基金，发起资金申购部分为9,633,911.37份基金份额，发起资金申购方承诺使用发起资金申购的基金份额持有期限不少于3年。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《融通通裕定期开放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固定收益类品种，包括国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、资产支持证券、次级债、可分离交易可转债的纯债部分、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具等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的相关规定)。本基金不投资于股票、权证等权益类资产，也不投资于可转换债券(可分离交易可转债的纯债部分除外)、可交换债券。本基金投资组合中，对债券的投资比例不低于基金资产的80%，但应开放期流动性需要，为保护基金份额持有人利益，在每次开放期开始前10个工作日、开放期及开放期结束后10个工作日的期间内，基金投资不受上述比例限制。开放期内，本基金持有现金(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投资比例不低于基金资产净值的5%。在封闭期内，本基金不受上述5%的限制。本基金业绩比较基准为：中债综合指数收益率。

#### 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、《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》、《融通通裕定期开放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[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，包括买卖债券的差价收入，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。

(4)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	568,508.55
等于：本金	568,252.77
加：应计利息	255.78
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	568,508.55

##### 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	-	-	-	-	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	11,157,749.31	119,559.45	11,295,559.45	18,250.69
	银行间市场	1,406,730,327.94	21,399,966.98	1,443,822,966.98	15,692,672.06
	合计	1,417,888,077.25	21,519,526.43	1,455,118,526.43	15,710,922.75
资产支持证券	102,739,419.01	416,441.48	103,244,041.48	88,180.99	
基金	-	-	-	-	

其他	-	-	-	-
合计	1,520,627,496.26	21,935,967.91	1,558,362,567.91	15,799,103.74

#### 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

无。

##### 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	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	52,698.53
其中：交易所市场	-
银行间市场	52,698.53
应付利息	-
预提费用	118,698.38
合计	171,396.91

## 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,056,543,720.16	1,056,543,720.16
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-47.50	-47.50
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	1,056,543,672.66	1,056,543,672.66

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

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	14,448,503.55	50,224,806.28	64,673,309.83
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-

其他	-	-	-
本期期初	14,448,503.55	50,224,806.28	64,673,309.83
本期利润	14,707,597.48	17,311,147.09	32,018,744.57
本期基金份额交易产生的变动数	-0.93	-2.68	-3.61
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-0.93	-2.68	-3.61
本期已分配利润	-	-	-
本期末	29,156,100.10	67,535,950.69	96,692,050.79

#### 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		11,134.39
定期存款利息收入		-
其他存款利息收入		973.34
结算备付金利息收入		48.07
其他		13.25
合计		12,169.05

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

无。

##### 6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

无。

##### 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		21,234,766.08
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入		-1,307,913.37
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	19,926,852.71
----	---------------

## 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	841,800,910.79
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	831,182,089.15
减：应计利息总额	11,913,335.01
减：交易费用	13,400.00
买卖债券差价收入	-1,307,913.37

## 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

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
资产支持证券投资收益——利息收入	1,603,778.44
资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入	-11,246.18
资产支持证券投资收益——赎回差价收入	-
资产支持证券投资收益——申购差价收入	-
合计	1,592,532.26

## 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

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出资产支持证券成交总额	838,104.27
减：卖出资产支持证券成本总额	710,996.18
减：应计利息总额	138,104.27
减：交易费用	250.00
资产支持证券投资收益	-11,246.18

## 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

无。

## 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	17,311,147.09
股票投资	-
债券投资	17,094,914.31
资产支持证券投资	216,232.78
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	17,311,147.09



**6.4.7.21 其他收入**

无。

**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	49,726.04
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行费用	18,971.55
账户维护费	18,600.00
其他	550.00
合计	147,519.93

**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、基金注册登记机构、基金销售机构
交通银行股份有限公司（“交通银行”）	基金托管人、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 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
当期发生的基金应支付的管理费	1,697,063.64	495,923.60
其中：应支付销售机构的客户维护费	-	-
应支付基金管理人的净管理费	1,697,063.64	495,923.60

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.30%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.30%/当年天数。

## 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	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
当期发生的基金应支付的托管费	565,687.88	165,307.85

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值×0.10%/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

无。

## 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固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

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
基金合同生效日（2016年11月2日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	11,589,978.52	11,589,978.52
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	11,589,978.52	11,589,978.52
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.10%	3.94%

注：基金管理人投资本基金的适用费率符合本基金招募说明书和相关公告的规定。

## 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
交通银行	568,508.55	11,134.39	784,126.34	10,290.52

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 405,134,428.71 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
102280446	22 厦门市政 MTN001	2024 年 7 月 1 日	101.81	200,000	20,361,315.07
102280713	22 湖州城投 MTN002(乡村振兴)	2024 年 7 月 1 日	101.77	100,000	10,177,145.21
102382670	23 张家国资 MTN005	2024 年 7 月 1 日	104.32	200,000	20,863,232.79
102382704	23 张家国资 MTN006	2024 年 7 月 1 日	104.26	300,000	31,276,888.52
102480014	24 常城建 MTN001	2024 年 7 月 1 日	103.08	200,000	20,616,928.96
1980075	19 桐乡双创债 01	2024 年 7 月 1 日	42.12	100,000	4,212,412.16
1980176	19 桐乡双创债 02	2024 年 7 月 1 日	41.80	300,000	12,540,571.73
2080218	20 乐清债 01	2024 年 7 月 1 日	106.11	300,000	31,833,196.72
210210	21 国开 10	2024 年 7 月 1 日	107.93	300,000	32,380,265.75
212380010	23 华夏银行债 03	2024 年 7 月 1 日	103.55	53,000	5,488,352.73
212380013	23 浙商银行债 01	2024 年 7 月 1 日	103.58	1,000,000	103,582,830.60
220210	22 国开 10	2024 年 7 月 1 日	105.67	100,000	10,567,150.68
220215	22 国开 15	2024 年 7 月 1 日	107.77	400,000	43,109,005.46
230208	23 国开 08	2024 年 7 月 1 日	102.20	400,000	40,878,180.82
230420	23 农发 20	2024 年 7 月 1 日	106.27	250,000	26,566,413.93
240410	24 农发 10	2024 年 7 月 1 日	101.79	300,000	30,536,712.33
合计				4,503,000	444,990,603.46

**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交通银行，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	-	30,298,819.67
合计	-	30,298,819.67

注：1. 未评级债券为超短期融资券。

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

无。

##### 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	508,132,897.42	709,837,020.99
AAA 以下	757,634,617.25	695,339,845.55
未评级	189,351,011.76	61,386,000.00

合计	1,455,118,526.43	1,466,562,866.54
----	------------------	------------------

注：1. 未评级债券为政策性金融债。

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

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	-	43,651,252.60
AAA 以下	103,244,041.48	-
未评级	-	-
合计	103,244,041.48	43,651,252.60

#### 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于约定开放日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于开放期内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 405,134,428.71 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，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》且于基金开放期内按照《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时间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公司发行的证券不得超过该证券的 10%(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%。

于开放期内，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。

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	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计



30 日					
资产					
货币资金	568,508.55	-	-	-	568,508.55
结算备付金	56,248.50	-	-	-	56,248.50
存出保证金	620.01	-	-	-	620.01
交易性金融资产	248,564,928.16	1,161,324,808.81	148,472,830.94	-	1,558,362,567.91
资产总计	249,190,305.22	1,161,324,808.81	148,472,830.94	-	1,558,987,944.97
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	282,895.12	282,895.12
应付托管费	-	-	-	94,298.37	94,298.37
卖出回购金融资产款	405,134,428.71	-	-	-	405,134,428.71
应交税费	-	-	-	69,202.41	69,202.41
其他负债	-	-	-	171,396.91	171,396.91
负债总计	405,134,428.71	-	-	617,792.81	405,752,221.52
利率敏感度缺口	-155,944,123.49	1,161,324,808.81	148,472,830.94	-617,792.81	1,153,235,723.45
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	1,479,891.60	-	-	-	1,479,891.60
存出保证金	5,958.81	-	-	-	5,958.81
交易性金融资产	379,560,261.77	1,160,952,677.04	-	-	1,540,512,938.81
资产总计	381,046,112.18	1,160,952,677.04	-	-	1,541,998,789.22
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	284,498.37	284,498.37
应付托管费	-	-	-	94,832.80	94,832.80
卖出回购金融资产款	420,085,657.92	-	-	-	420,085,657.92
应交税费	-	-	-	78,922.07	78,922.07
其他负债	-	-	-	237,848.07	237,848.07
负债总计	420,085,657.92	-	-	696,101.31	420,781,759.23
利率敏感度缺口	-39,039,545.74	1,160,952,677.04	-	-696,101.31	1,121,217,029.99

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	8,766,955.19	6,271,693.97
2. 市场利率上升 25 个基点	-8,662,131.06	-6,225,143.85	

## 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

无。

## 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

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	-	-
第二层次	1,558,362,567.91	1,540,512,938.81
第三层次	-	-
合计	1,558,362,567.91	1,540,512,938.81

##### 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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,558,362,567.91	99.96
	其中：债券	1,455,118,526.43	93.34
	资产支持证券	103,244,041.48	6.62
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	624,757.05	0.04
8	其他各项资产	620.01	0.00
9	合计	1,558,987,944.97	100.00

## 7.2 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	634,539,533.17	55.02
	其中：政策性金融债	189,351,011.76	16.42
4	企业债券	119,572,828.59	10.37
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	701,006,164.67	60.79
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,455,118,526.43	126.18

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	2320031	23 华润银行小微债 01	1,000,000	103,794,262.30	9.00
2	212380013	23 浙商银行债 01	1,000,000	103,582,830.60	8.98
3	2328020	23 渤海银行 02	600,000	62,298,852.46	5.40
4	2320035	23 齐鲁银行小微债 01	600,000	62,181,114.75	5.39
5	102382194	23 丽水文旅 MTN001	500,000	52,436,748.63	4.55

## 7.4 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

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	2389013	23 融腾 2B_bc	400,000	40,749,049.18	3.53
2	159947	相城优 05	230,000	23,544,009.86	2.04
3	137977	萧城投 05	200,000	20,185,073.97	1.75
4	143859	新昌水务 ABS 二期优先级	200,000	18,765,908.47	1.63

**7.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细**

无。

**7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细**

无。

**7.7 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明****7.7.1 本期国债期货投资政策**

无。

**7.7.2 本期国债期货投资评价**

无。

**7.8 投资组合报告附注****7.8.1 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 浙商银行债 01，其发行主体为浙商银行股份有限公司。根据发布的相关公告，该证券发行主体因未依法履行职责，受到国家金融监督管理总局浙江监管局的处罚。

2、本基金投资的前十名证券中的 23 齐鲁银行小微债 01，其发行主体为齐鲁银行股份有限公司。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。

3、本基金投资的前十名证券中的 23 华润银行小微债 01，其发行主体为珠海华润银行股份有限公司。根据发布的相关公告，该证券发行主体因未依法履行职责，受到国家金融监督管理总局珠海监管分局的处罚。

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。

**7.8.2 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。

**7.8.3 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	620.01
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	620.01
---	----	--------

## 7.8.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

## 7.8.5 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

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 (%)
285	3,707,170.78	1,056,521,051.06	100.00	22,621.60	0.00

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	160.22	0.00002

## 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	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部 门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## 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	11,589,978.52	1.10	9,633,911.37	0.91	不少于三年
基金管理人高级管理 人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	11,589,978.52	1.10	9,633,911.37	0.91	-

注：本基金合同生效日为 2018 年 3 月 14 日，本基金发起份额持有期限自合同生效日起不少

于三年。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2016 年 11 月 2 日） 基金份额总额	1,462,679,451.12
本报告期期初基金份额总额	1,056,543,720.16
本报告期基金总申购份额	-
减：本报告期基金总赎回份额	47.50
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,056,543,672.66

## § 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，本基金的托管人的托管业务部门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 (%)	
长江证券	1	-	-	-	-	-
诚通证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-

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

本报告期内交易单元无变更。

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 (%)
长江证券	-	-	-	-	-	-
诚通证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	10,143,563.01	33.14	-	-	-	-
国信证券	19,452,855.45	63.55	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
兴业证券	1,014,186.30	3.31	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-

中信建投	-	-	-	-	-	-
------	---	---	---	---	---	---

### 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	融通通裕定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理变更公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 1 月 4 日
2	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
3	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
4	融通通裕定期开放债券型发起式证券投资基金第二十次集中开放申购、赎回业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 2 月 23 日
5	融通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中国邮政储蓄银行股份有限公司“邮你同赢”平台为销售平台并开通基金转换业务及参加申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 4 月 17 日
6	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
7	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
8	融通通裕定期开放债券型发起式证券投资基金第二十一集中开放申购、赎回业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 5 月 31 日
9	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
10	融通关于旗下部分开放式基金新增和讯信息科技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 6 月 25 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

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	20240101-20240630	1,044,930,179.54	-	-	1,044,930,179.54	98.90
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份额净值剧烈波动的风险及流动性风险。

### 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《关于准予融通通裕债券型证券投资基金变更注册的批复》
- (二) 《关于融通通裕债券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》
- (三) 《融通通裕定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》
- (四) 《融通通裕定期开放债券型发起式证券投资基金托管协议》
- (五) 《融通通裕定期开放债券型发起式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，或登陆本基金管理人网站 <http://www.rtfund.com> 查阅。

融通基金管理有限公司

2024 年 8 月 29 日