

财通安瑞短债债券型证券投资基金 2019 年半年度报告

2019 年 06 月 30 日

基金管理人:财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:2019 年 08 月 27 日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年8月23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2019年03月20日（基金合同生效日）起至6月30日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录 .....	2
1.1 重要提示 .....	2
1.2 目录 .....	3
§2 基金简介 .....	5
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 .....	6
2.4 信息披露方式 .....	7
2.5 其他相关资料 .....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现 .....	7
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	7
3.2 基金净值表现 .....	8
§4 管理人报告 .....	11
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 .....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	12
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 .....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	14
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 .....	15
§5 托管人报告 .....	15
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 .....	15
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 .....	15
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 .....	15
§6 半年度财务会计报告(未经审计) .....	15
6.1 资产负债表 .....	15
6.2 利润表 .....	17
6.3 所有者权益(基金净值)变动表 .....	18
6.4 报表附注 .....	19
§7 投资组合报告 .....	45
7.1 期末基金资产组合情况 .....	45
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	45
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 .....	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	46
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 .....	46
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 .....	47
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 .....	47
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 .....	47
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	47
7.12 投资组合报告附注 .....	47
§8 基金份额持有人信息 .....	48
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	48
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	49

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 .....	49
§9 开放式基金份额变动 .....	49
§10 重大事件揭示 .....	50
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	50
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 .....	50
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	50
10.4 基金投资策略的改变 .....	50
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	50
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 .....	50
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	50
10.8 其他重大事件 .....	54
§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....	55
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 .....	55
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	55
§11 备查文件目录 .....	55
11.1 备查文件目录 .....	55
11.2 存放地点 .....	55
11.3 查阅方式 .....	55

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	财通安瑞短债债券型证券投资基金	
基金简称	财通安瑞短债债券	
场内简称	-	
基金主代码	006965	
交易代码	-	
基金运作方式	契约型、开放式	
基金合同生效日	2019年03月20日	
基金管理人	财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	660,378,530.17份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	财通安瑞短债债券A	财通安瑞短债债券C
下属分级基金的场内简称	-	-
下属分级基金的交易代码	006965	006966
报告期末下属分级基金的份额总额	335,430,221.55份	324,948,308.62份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金力争在保持投资组合较高流动性的前提下，获取超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金力争在保持投资组合较高流动性的前提下，获取超越业绩比较基准的投资回报。本基金的投资策略包括目标久期策略及凸性策略、收益率曲线配置策略、信用债券投资策略、杠杆投资策略和资产支持证券投资策略。在组合的久期选择方面，本基金将综合分析宏观面的各个要素，通过对各宏观变量的分析，判断其对市场利率水平的影响方向和程度，从而确定本基金投资组合久期的合理范围。并且动态调整本基金的目标久期，从而提高债券投资收益；本基金除了考虑系统性的利率风险对收益率曲线平移的影响之外，还将考虑债券市场微观因素对收益率曲线的影响，形成

	<p>一定阶段内的收益率曲线形状变动趋势的预测，据此调整债券投资组合；在投资市场选择层面，本基金将在控制市场风险与流动性风险的前提下，根据交易所市场和银行间市场信用债券到期收益率相对变化、流动性情况和市场规模等，相机调整不同市场的信用债券所占的投资比例。在品种选择层面，本基金将基于各品种信用债券类金融工具信用利差水平的变化特征、宏观经济预测分析和信用债券供求关系分析等，综合考虑流动性、绝对收益率等因素，采取定量分析和定性分析结合的方法，在各种不同信用级别的信用债券之间进行优化配置。；在综合考虑债券品种的票息收入和融资成本后，在控制组合整体风险的基础上，当回购利率低于债券收益率时，买入收益率高于回购成本的债券，通过正回购融资操作来博取超额收益，从而获得杠杆放大收益；本基金在资产支持证券投资方面将深入分析资产支持证券的市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等基本面因素，估计资产违约风险和提前偿付风险，并根据资产证券化的收益结构安排，模拟资产支持证券的本金偿还和利息收益的现金流过程，辅助采用数量化定价模型，评估其内在价值。</p>	
业绩比较基准	中债综合财富（1年以下）指数收益率*80%+银行活期存款利率（税后）*20%	
风险收益特征	本基金是债券型基金，其预期风险与收益水平高于货币市场基金，低于股票型基金和混合型基金。	
下属分级基金的风险收益特征	本基金是债券型基金，其预期风险与收益水平高于货币市场基金，低于股票型基金和混合型基金。	本基金是债券型基金，其预期风险与收益水平高于货币市场基金，低于股票型基金和混合型基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	财通基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露	姓名 武祎	郭明

露负责人	联系电话	021-20537888	010-66105798
	电子邮箱	service@ctfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-820-9888	95588
传真		021-20537999	010-66105799
注册地址		上海市虹口区吴淞路619号505室	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址		上海市银城中路68号时代金融中心41/43楼	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码		200120	100140
法定代表人		夏理芬	陈四清

## 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》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.ctfund.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人办公地址

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	财通基金管理有限公司	上海市银城中路68号时代金融中心41/43楼

## §3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019年03月20日(基金合同生效日)-2019年06月30日)	
	财通安瑞短债债券A	财通安瑞短债债券C
本期已实现收益	9,930,428.88	6,447,422.09

本期利润	10,117,452.63	6,617,986.44
加权平均基金份额本期利润	0.0109	0.0098
本期加权平均净值利润率	1.11%	1.00%
本期基金份额净值增长率	1.08%	0.97%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	报告期末(2019年06月30日)	
期末可供分配利润	1,101,025.14	929,566.74
期末可供分配基金份额利润	0.0033	0.0029
期末基金资产净值	336,695,806.16	326,038,540.38
期末基金份额净值	1.0038	1.0034
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	报告期末(2019年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	1.08%	0.97%

注：(1)所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；

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

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

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

财通安瑞短债债券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	0.29%	0.01%	0.25%	0.01%	0.04%	0.00%
过去三个月	0.96%	0.01%	0.62%	0.01%	0.34%	0.00%
自基金合同	1.08%	0.01%	0.72%	0.01%	0.36%	0.00%



生效起至今 (2019年3月 20日-2019年6 月30日)						
--	--	--	--	--	--	--

注：(1)上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)本基金业绩比较基准为：中债综合财富（1年以下）指数收益率\*80%+银行活期存款利率（税后）\*20%。

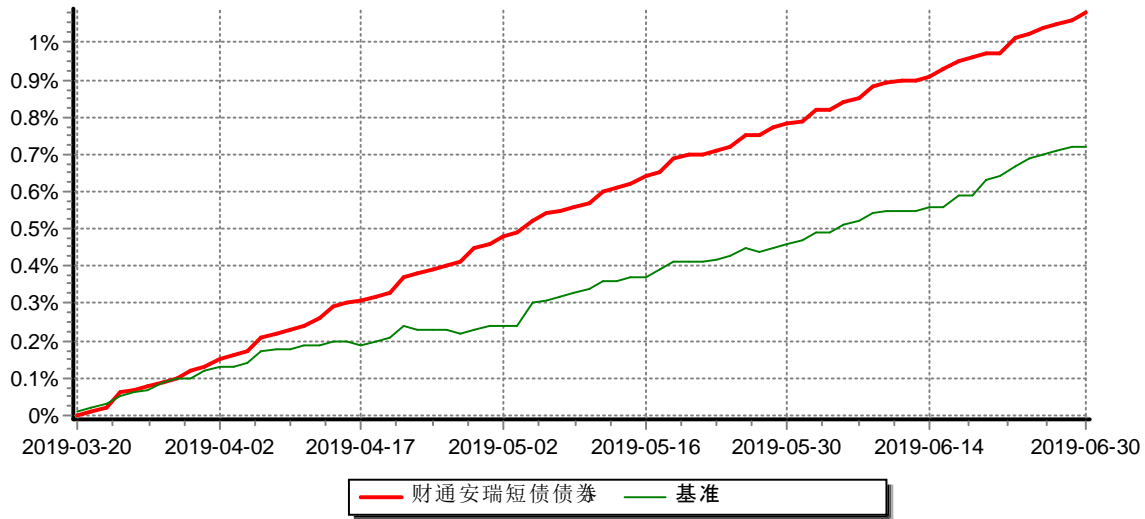
### 财通安瑞短债债券C

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	0.26%	0.01%	0.25%	0.01%	0.01%	0.00%
过去三个月	0.86%	0.01%	0.62%	0.01%	0.24%	0.00%
自基金合同 生效起至今 (2019年3月 20日-2019年6 月30日)	0.97%	0.01%	0.72%	0.01%	0.25%	0.00%

注：(1)上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)本基金业绩比较基准为：中债综合财富（1年以下）指数收益率\*80%+银行活期存款利率（税后）\*20%

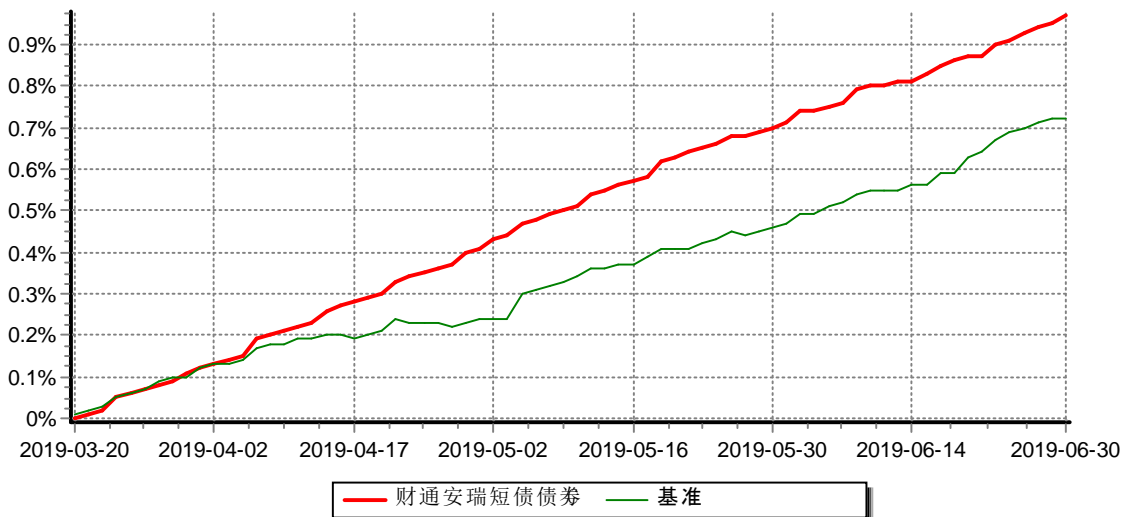
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

财通安瑞短债债券型证券投资基金A  
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2019年03月20日-2019年6月30日)



注：(1)本基金合同生效日为2019年3月20日，基金合同生效起至披露时点不满一年；  
 (2)根据《基金合同》规定：本基金对债券的投资比例不低于基金资产的 80%，其中投资于短期债券的比例不低于非现金基金资产的 80%；本基金保持现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

财通安瑞短债债券型证券投资基金C  
 累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
 (2019年3月20日-2019年6月30日)



注：(1)本基金合同生效日为2019年3月20日，基金合同生效起至披露时点不满一年；  
 (2)根据《基金合同》规定：本基金对债券的投资比例不低于基金资产的 80%，其中投资于短期债券的比例不低于非现金基金资产的 80%；本基金保持现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

财通基金管理有限公司成立于2011年6月，由财通证券股份有限公司、杭州市实业投资集团有限公司和浙江瀚叶股份有限公司共同发起设立，财通证券股份有限公司为第一大股东，出资比例40%。公司注册资本2亿元人民币，注册地上海，经营范围为基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其它业务。

财通基金始终秉承“持有人利益至上”的核心价值观，致力于为客户提供专业优质的资产管理服务。在公募业务方面，公司坚持以客户利益为出发点设计产品，逐步建立起覆盖各种投资标的、各种风险收益特征的产品线，获得一定市场口碑；公司将特定客户资产管理业务作为重要发展战略之一，形成玉泉系列、富春系列等多个子品牌，产品具有追求绝对收益、标的丰富、方案灵活等特点，为机构客户、高端个人客户提供个性化的理财选择。

公司现有员工165人，管理人员和主要业务骨干的证券、基金从业平均年限在10年以上。通过提供多维度、人性化的客户服务，财通基金始终与持有人保持信息透明；通过建立完备的风险控制体系，财通基金最大限度地保证客户的利益。公司将以专业的投资能力、规范的公司治理、诚信至上的服务、力求创新的精神为广大投资者创造价值。

#### 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期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
林洪钧	本基金的基金经理、公司固定收益投资总监兼固定收益部总监	2019年03月20日	-	14年	复旦大学工商管理硕士、力学与工程科学本科。历任国泰君安证券股份有限公司上海分公司机构客户部客户经理，华安基金管理有限公司债券交易员，加拿大 Financial Engineering Source Inc.金融研究员，交银施罗德基金管理有限公司固定收益部债券研究员、专户投资部投资经理、固定收益部助理总经理/基金经理，光大保德信基金管理有限

					公司固定收益部固定收益投资总监，兴证证券资产管理有限公司固定收益投资三部固收总监。2018年8月加入财通基金管理有限公司，现任公司固定收益投资总监兼固定收益部总监。
--	--	--	--	--	--

注：(1)基金的首任基金经理，其"任职日期"为基金合同生效日，其"离职日期"为根据公司决议确定的解聘日期；

(2)非首任基金经理，其"任职日期"和"离任日期"分别指根据公司决议确定的聘任日期和解聘日期；

(3)证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定；

(4)本基金自2019年7月3日起增聘罗晓倩为基金经理。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》、基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在认真控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有发生损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人以价值投资为理念，致力于建设合理的组织架构和科学的投资决策体系，营造公平交易的执行环境。公司通过严格的内控制度和授权体系，确保投资、研究、交易等各个环节的独立性。公司将投资管理职能和交易执行职能相隔离，实行集中交易，并建立了公平的交易分配制度，确保在场内、场外各类交易中，各投资组合都享有公平的交易执行机会。

同时，公司逐步建立健全公司各投资组合均可参考的投资对象备选库和交易对手备选库，在此平台上共享研究成果，并对各组合提供无倾向性支持；在公用备选库的基础上，各投资组合经理根据不同投资组合的投资目标、投资风格、投资范围和关联交易限制等，建立不同投资组合的投资对象备选库和交易对手备选库，进而根据投资授权构建具体的投资组合。在确保投资组合间信息隔离、权限明晰的基础上，形成信息公开、资源共享的公平投资管理环境。

公司建立了专门的公平交易制度，并在交易系统中适当启用公平交易模块，保证公平交易的严格执行。对异常交易的监控包括事前、事中和事后等环节，特殊情况会经过

严格的报告和审批程序，会定期针对旗下所有组合的交易记录进行了交易时机和价差的专项统计分析，以排查异常交易。

报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《财通基金管理有限公司公平交易制度》的规定，未发现组合间存在违背公平交易原则的行为或异常交易行为。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本公司原则上禁止不同投资组合之间（完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的投资组合及短期国债回购交易除外）或同一投资组合在同一交易日内进行反向交易。如果因应对大额赎回等特殊情况需要进行反向交易的，则需经公司领导严格审批并留痕备查。

本投资组合为主动型开放式基金。本报告期内，本投资组合与本公司管理的其他主动型投资组合未发生过同日反向交易（短期国债回购交易除外）的情况，也未发生影响市场价格的临近日同向或反向交易。

经过事前制度约束、事中严密监控，以及事后的统计排查，本报告期内各笔交易的市场成交比例、成交均价等交易结果数据表明，本期基金运作未对市场产生有违公允性的影响，亦未发现本基金存在异常交易行为。

### 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

本报告期内经济动能仍偏弱，经济继续处于下行通道，生产需求双弱格局未改。房地产下行走势明确且当前限产对生产不利，基建将反弹但预计反弹斜率较缓。

货币政策层面，包商事件引发的实体融资压力尚未得到缓解，当前不具备货币政策收紧的前提。在经济数据持续偏弱的大背景下，货币政策在趋势上难以收紧。海外方面，美债收益率屡创新低，对国内债市而言，随着贬值预期与资本外流压力的有效释放，整体利好国内债券市场。

本报告期内，本基金在报告期尚处建仓期，主要以存款和回购资产为主；封闭期后陆续建仓，主要以高评级短久期债券为主。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末财通安瑞短债债券A基金份额净值为1.0038元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为1.08%，同期业绩比较基准收益率为0.72%；截至报告期末财通安瑞短债债券C基金份额净值为1.0034元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.97%，同期业绩比较基准收益率为0.72%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2019年将面临经济增长环境内外同时放缓的局面，从经济增长和社融的领先滞后关系来看，去杠杆对经济的负面影响还未结束，2019年国内经济增长将持续下行；同时发达国家的经济增长很可能出现见顶回落的风险，尤其是近几年相对表现强劲的美国经济。自2017年起美联储资产负债表开始出现缩表，欧央行和日本相继出现缩表迹象，我国社融增速从2017年的14%的增速大幅下降到9%。

经济面临较大压力，货币政策预计依旧宽松，当下监管已然已经趋缓，叠加中美贸易摩擦依旧还有不确定的因素，或将进一步降低投资者投资偏好，基于对经济，金融以及外部冲击的综合考虑，2019年债券市场大概率仍然会是比较安全的品种。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证券监督管理委员会《关于证券投资基金估值业务的指导意见》和中国证券业协会基金估值工作小组《关于停牌股票估值的参考方法》等法律法规的有关规定，本基金管理人设立估值委员会并制定估值委员会制度。

估值委员会成员由总经理、督察长、基金投资部、专户投资部、固定收益部、研究部、风险管理部、监察稽核部、基金清算部等部门负责人、基金清算部相关业务人员、涉及的相关基金经理或投资经理或实际履行前述部门相当职责的部门负责人或人员组成。估值委员会成员均具有会计核算经验、行业分析经验、金融工具应用等丰富的证券投资基金行业从业经验和专业能力，且之间不存在任何重大利益冲突。基金经理如果认为某证券有更能准确反应其公允价值的估值方法，可以向估值委员会申请对其进行专项评估。新的证券价格需经估值委员会和托管行同意后才能采纳，否则不改变用来进行证券估值的初始价格。

估值委员会职责：根据相关估值原则研究相关估值政策和估值模型，拟定公司的估值政策、估值方法和估值程序，确保公司各基金产品净值计算的公允性，以维护广大投资者的利益。

基金管理人与中国工商银行股份有限公司于2013年9月签订了《基金估值核算业务外包协议》。

本基金自2017年9月8日起根据中国证券投资基金业协会《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）>的通知》（中基协发〔2017〕6号）确定的估值方法对持有的流通受限股票进行调整。基金管理人与中证指数有限公司签订了《流通受限股票流动性折扣委托计算协议》，委托中证指数有限公司计算并提供流通受限股票流动性折扣。

基金管理人与中国工商银行股份有限公司上海市分行于2018年6月签订了《基金行政外包协议》，与中信中证投资服务有限责任公司于2019年7月签订了《行政管理服务协议》。截至报告期末，基金管理人旗下部分特定客户资产管理计划估值业务实行外包。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》约定：在符合有关基金分红条件的前提下，本基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若基金合同生效不满3个月可不进行收益分配。

根据相关法律法规及《基金合同》的要求，结合本基金运作情况，本报告期内本基金共分红1次，其中财通安瑞短债债券A每份合计分红0.0070元，财通安瑞短债债券C每份合计分红0.0063元。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，本基金未有连续20个工作日基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元的情况出现。

### §5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对财通安瑞短债债券型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，财通安瑞短债债券型证券投资基金的管理人--财通基金管理有限公司在财通安瑞短债债券型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，财通安瑞短债债券型证券投资基金对基金份额持有人进行了1次利润分配，其中财通安瑞短债债券A分配金额为5,761,052.42元，财通安瑞短债债券C分配金额为2,876,490.76元。

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

本托管人依法对财通基金管理有限公司编制和披露的财通安瑞短债债券型证券投资基金2019年半年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

### §6 半年度财务会计报告(未经审计)

#### 6.1 资产负债表

会计主体：财通安瑞短债债券型证券投资基金

报告截止日：2019年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019年06月30日
<b>资产：</b>		
银行存款	6.4.7.1	5,088,911.50
结算备付金		-
存出保证金		-
交易性金融资产	6.4.7.2	682,932,700.00
其中：股票投资		-
基金投资		-
债券投资		682,932,700.00
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产		-
买入返售金融资产	6.4.7.4	79,920,239.88
应收证券清算款		-
应收利息	6.4.7.5	10,484,784.39
应收股利		-
应收申购款		1,445,333.46
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	33,326,520.55
资产总计		813,198,489.78
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2019年06月30日</b>
<b>负债：</b>		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债		-
卖出回购金融资产款		146,699,726.65
应付证券清算款		-
应付赎回款		3,172,509.85



应付管理人报酬		202,053.44
应付托管费		53,880.92
应付销售服务费		122,578.69
应付交易费用	6.4.7.7	12,968.69
应交税费		98,890.56
应付利息		22,579.79
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	78,954.65
负债合计		150,464,143.24
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	6.4.7.9	660,378,530.17
未分配利润	6.4.7.10	2,355,816.37
所有者权益合计		662,734,346.54
负债和所有者权益总计		813,198,489.78

注：(1)后附会计报表附注为本会计报表的组成部分；

(2)报告截止日2019年6月30日，基金份额净值1.0036元，基金份额总额660,378,530.17份。其中A类基金份额净值1.0038元，A类基金份额总额335,430,221.55份，C类基金份额净值1.0034元，C类基金份额总额324,948,308.62份。

## 6.2 利润表

会计主体：财通安瑞短债债券型证券投资基金

本报告期：2019年03月20日（基金合同生效日）至2019年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2019年03月20日（基金合同生效日）至2019年06月30日
一、收入		19,376,814.43
1.利息收入		21,225,773.20
其中：存款利息收入	6.4.7.11	10,672,003.05
债券利息收入		3,687,214.75
资产支持证券利息收入		-

买入返售金融资产收入		6,866,555.40
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-2,207,468.52
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	-2,207,468.52
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.14	-
股利收益	6.4.7.15	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	357,588.10
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	921.65
<b>减：二、费用</b>		2,641,375.36
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,354,391.48
2. 托管费	6.4.10.2.2	361,171.07
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	760,472.44
4. 交易费用	6.4.7.18	9,497.50
5. 利息支出		56,237.61
其中：卖出回购金融资产支出		56,237.61
6. 税金及附加		11,151.68
7. 其他费用	6.4.7.19	88,453.58
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		16,735,439.07
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		16,735,439.07

注：后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：财通安瑞短债债券型证券投资基金

本报告期：2019年03月20日（基金合同生效日）至2019年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2019年03月20日（基金合同生效日）至2019年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	2,055,718,719.72	-	2,055,718,719.72
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	16,735,439.07	16,735,439.07
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-1,395,340,189.55	-5,742,079.52	-1,401,082,269.07
其中：1.基金申购款	223,353,214.15	594,840.50	223,948,054.65
2.基金赎回款	-1,618,693,403.70	-6,336,920.02	-1,625,030,323.72
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-8,637,543.18	-8,637,543.18
五、期末所有者权益 (基金净值)	660,378,530.17	2,355,816.37	662,734,346.54

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：

王家俊

王家俊

刘为臻

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

财通安瑞短债债券型证券投资基金(以下简称"本基金"),系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[2019]45号文《关于准予财通安瑞短债债券型证券投资基金注册的批复》的核准,由基金管理人财通基金管理有限公司自2019年2月22日到2019年3月15日止期间向社会公开发行募集,募集期结束经安永华明会计师事务

所（特殊普通合伙）验证并出具安永华明（2019）验字第60951782\_B03号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2019年3月20日正式生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币2,054,552,044.61元，折合2,054,552,044.61份基金份额，其中A类基金份额1,190,628,955.80份，C类基金份额863,923,088.81份。在募集期间产生的存款利息为人民币1,166,675.11元，折合1,166,675.11份基金份额，其中A类基金份额625,900.76份，C类基金份额540,774.35份。以上实收基金（本息）合计为人民币2,055,718,719.72元，折合2,055,718,719.72份基金份额，其中A类基金份额1,191,254,856.56份，C类基金份额864,463,863.16份。本基金的基金管理人和注册登记机构为财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。

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括债券（包括国债、地方政府债、央行票据、金融债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债、可分离交易可转债的纯债部分及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、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。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%，投资于短期债券的比例不低于非现金基金资产的80%。持有现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金的业绩比较基准为：中债综合财富（1年以下）指数收益率\*80%+银行活期存款利率（税后）\*20%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则-基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第3号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基

金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 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于2019年6月30日的财务状况以及2019年3月20日（基金合同生效日）至2019年6月30日止期间的经营成果和净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

##### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年自1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间系自2019年3月20日（基金合同生效日）起至2019年6月30日止。

##### 6.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

##### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

###### (1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括债券投资等；

###### (2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

##### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的债券等，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

#### (1) 债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

#### (2) 回购协议

本基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最小层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 6.4.4.6 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

#### 6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 债券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(6) 资产支持证券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 公允价值变动收益/（损失）系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(8) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

(1) 基金管理费按前一日基金资产净值的0.3%的年费率逐日计提；

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的0.08%的年费率逐日计提；



(3)销售服务费可用于本基金市场推广、销售以及基金份额持有人服务等各项费用。本基金份额分为不同的类别，适用不同的销售服务费率。其中，A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额销售服务费年费率为0.4%。

本基金的管理人报酬和托管费等在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金的收益分配原则如下：

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若基金合同生效不满3个月可不进行收益分配；

(2) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(3) 基金收益分配后任一类基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的任一类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(4) 每份基金份额享有同等分配权；

(5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

### 6.4.6 税项

#### 1. 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年4月24日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的3‰调整为1‰。

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年9月19日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变。

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

## 2. 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自2016年5月1日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140号文《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》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自2018年1月1日起，本基金的基金管理人运营本基金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。

## 3. 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

## 4. 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税。

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税。

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资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，股权的股息、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。

#### 5. 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自2008年10月9日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《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》的规定，自2013年1月1日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按25%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；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101号文《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》的规定，自2015年9月8日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019年06月30日
活期存款	5,088,911.50
定期存款	-
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	-
合计	5,088,911.50

注：本基金本报告期末未投资于定期存款。

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末2019年06月30日		
		成本	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	-	-	-
	银行间市场	682,575,111.90	682,932,700.00	357,588.10
	合计	682,575,111.90	682,932,700.00	357,588.10
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		682,575,111.90	682,932,700.00	357,588.10

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产或负债。

### 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2019年06月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	79,920,239.88	-
合计	79,920,239.88	-

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

**6.4.7.5 应收利息**

单位：人民币元

项目	本期末 2019年06月30日
应收活期存款利息	5,411.25
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	10,369,979.34
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	109,393.80
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-
合计	10,484,784.39

**6.4.7.6 其他资产**

单位：人民币元

项目	本期末 2019年06月30日
其他应收款	33,326,520.55
待摊费用	-
合计	33,326,520.55

**6.4.7.7 应付交易费用**

单位：人民币元

项目	本期末 2019年06月30日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	12,968.69
合计	12,968.69

**6.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2019年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	78,954.65
合计	78,954.65

**6.4.7.9 实收基金**

**6.4.7.9.1 财通安瑞短债债券A**

金额单位：人民币元

项目 (财通安瑞短债债券A)	本期2019年03月20日（基金合同生效日）至2019年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	-	-
本期申购	1,328,127,215.71	1,328,127,215.71
本期赎回（以“-”号填列）	-992,696,994.16	-992,696,994.16
本期末	335,430,221.55	335,430,221.55

**6.4.7.9.2 财通安瑞短债债券C**

金额单位：人民币元

项目 (财通安瑞短债债券C)	本期2019年03月20日（基金合同生效日）至2019年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	-	-
本期申购	950,944,718.16	950,944,718.16
本期赎回（以“-”号填列）	-625,996,409.54	-625,996,409.54
本期末	324,948,308.62	324,948,308.62

**6.4.7.10 未分配利润**

**6.4.7.10.1 财通安瑞短债债券A**

单位：人民币元

项目 (财通安瑞短债债券A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	9,930,428.88	187,023.75	10,117,452.63
本期基金份额交易产生的变动数	-3,068,351.32	-22,464.28	-3,090,815.60
其中：基金申购款	342,992.20	690.86	343,683.06
基金赎回款	-3,411,343.52	-23,155.14	-3,434,498.66
本期已分配利润	-5,761,052.42	-	-5,761,052.42
本期末	1,101,025.14	164,559.47	1,265,584.61

#### 6.4.7.10.2 财通安瑞短债债券C

单位：人民币元

项目 (财通安瑞短债债券C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	6,447,422.09	170,564.35	6,617,986.44
本期基金份额交易产生的变动数	-2,641,364.59	-9,899.33	-2,651,263.92
其中：基金申购款	248,234.82	2,922.62	251,157.44
基金赎回款	-2,889,599.41	-12,821.95	-2,902,421.36
本期已分配利润	-2,876,490.76	-	-2,876,490.76
本期末	929,566.74	160,665.02	1,090,231.76

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2019年03月20日（基金合同生效日）至2019年06月30日
活期存款利息收入	147,154.38
定期存款利息收入	10,521,819.45
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	228.00

其他	2,801.22
合计	10,672,003.05

注：其他为应收申购款利息收入。

#### 6.4.7.12 股票投资收益

本基金本报告期末未有股票投资收益。

#### 6.4.7.13 债券投资收益

##### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2019年03月20日（基金合同生效日）至2019年 06月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-2,207,468.52
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	-2,207,468.52

##### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年03月20日（基金合同生效日）至2019年06月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	668,482,907.71
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	656,191,268.52
减：应收利息总额	14,499,107.71
买卖债券差价收入	-2,207,468.52

##### 6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入



本基金本报告期未有债券赎回差价收入。

**6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入**

本基金本报告期未有债券申购差价收入。

**6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益**

本基金本报告期未有资产支持证券投资收益。

**6.4.7.14 衍生工具收益**

本基金本报告期未投资衍生工具，衍生工具收益为零。

**6.4.7.15 股利收益**

本基金本报告期内无股利收益。

**6.4.7.16 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2019年03月20日（基金合同生效日）至2019年06月30日
1.交易性金融资产	357,588.10
——股票投资	-
——债券投资	357,588.10
——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	357,588.10

**6.4.7.17 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2019年03月20日（基金合同生效日）至2019年06月30日
基金赎回费收入	921.65
合计	921.65

#### 6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年03月20日（基金合同生效日）至2019年06月30日
交易所市场交易费用	-
银行间市场交易费用	9,497.50
合计	9,497.50

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年03月20日（基金合同生效日）至2019年06月30日
审计费用	32,299.77
信息披露费	46,654.88
汇划手续费	9,498.93
合计	88,453.58

### 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2019年06月30日止，本基金未发生需要披露的或有事项。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金于资产负债表日之后、半年度报告批准报出日之前无需要说明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

本基金本报告期不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。

### 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
财通基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
财通证券股份有限公司("财通证券")	基金管理人的股东、基金代销机构
中国工商银行股份有限公司("中国工商银行")	基金托管人、基金代销机构

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

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。

#### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

#### 6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年03月20日（基金合同生效日）至2019年06月30日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例
财通证券	3,898,276,000.00	100.00%

注：本基金于2019年3月20日成立，无比较式的上年度数据。

#### 6.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

### 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 2019年03月20日（基金合同生效日）至2019年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,354,391.48
其中：支付销售机构的客户维护费	630,448.24

注：(1) 本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.3% 年费率计提。基金管理费每日计算，按月支付；

(2) 基金管理人报酬计算公式为：日基金管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.3% / 当年天数；

(3) 客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的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 2019年03月20日（基金合同生效日）至2019年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	361,171.07

注：(1) 支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值 0.08% 的年费率计提，逐日计提，按月支付；

(2) 基金托管费计算公式为：日基金托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.08% / 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 2019年03月20日（基金合同生效日）至2019年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	财通安瑞债券 A	财通安瑞债券 C	合计
财通证券	0.00	229,752.05	229,752.05
财通基金	0.00	715.73	715.73
中国工商	0.00	484,074.25	484,074.25

银行			
合计	-	714,542.03	714,542.03

注：(1)本基金A类基金份额不收取销售服务费；

(2)本基金C类基金份额基金销售服务费按前一日C类基金份额资产净值的0.4%年费率计提；

(3)本基金C类基金份额销售服务费计提的计算公式为：每日应计提的基金销售服务费=前一日C类基金份额的基金资产净值×0.4%÷当年天数；

(4)本基金于2019年3月20日成立，无比较式的上年度数据。

#### 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

本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

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

本基金本报告期内基金管理人均未运用固有资金投资本基金。

##### 6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

#### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年03月20日（基金合同生效日）至2019年06月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行活期	5,088,911.50	147,154.38

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末在承销期内直接购入关联方承销的证券。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

##### 6.4.10.7.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无其他关联交易事项的说明。

##### 6.4.10.7.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用

本基金本报告期无当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费

用。

### 6.4.11 利润分配情况--非货币市场基金

财通安瑞短债债券A

单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日	每10份基金 份额分红数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润 分配合计	备注
1	2019-0 5-27	2019-05-2 7	0.070	5,560,24 6.82	200,805.60	5,761,05 2.42	-
合计			0.070	5,560,24 6.82	200,805.60	5,761,05 2.42	-

财通安瑞短债债券C

单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日	每10份基金 份额分红数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润 分配合计	备注
1	2019-0 5-27	2019-05-2 7	0.063	2,673,87 9.84	202,610.92	2,876,49 0.76	-
合计			0.063	2,673,87 9.84	202,610.92	2,876,49 0.76	-

### 6.4.12 期末（2019年06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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有临时停牌等流通受限股票。

#### 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

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
011901225	19中纺集SCP0 03	2019-07-01	100.09	500,000	50,045,000.00

011802292	18郑州公投SC P002	2019-07-01	100.50	300,000	30,150,000.00
011901274	19柯桥轻纺SC P001	2019-07-01	100.05	300,000	30,015,000.00
011900395	19融和融资SC P002	2019-07-01	100.17	230,000	23,039,100.00
011900579	19天成租赁SC P002	2019-07-01	100.14	300,000	30,042,000.00
合计				1,630,000	163,291,100.00

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有因交易所市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

### 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

本基金在日常活动中面临各种金融工具的风险，主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的管理人进行风险管理的主要目标是加强对投资风险的防范和控制，保证基金资产的安全，维护基金份额持有人的利益；同时，提升基金投资组合的风险调整后收益水平，将以上各种风险控制在限定的范围之内，在基金的风险和收益之间取得最佳的平衡，实现“风险和收益相匹配”的投资目标，谋求基金资产的长期稳定增长。

本基金的基金管理人建立了董事会领导下的架构清晰、控制有效、系统全面、切实可行的风险控制体系。董事会下设合规控制委员会，负责对公司风险管理战略和政策、内部控制及风险控制基本制度进行审定，对基本制度的执行情况、关联交易的合法合规性等进行监督和检查。董事会聘任督察长，负责公司及其基金运作的监察稽核工作。总经理负责公司日常经营管理中的风险控制工作，公司下设投资决策委员会和风险控制委员会，负责对公司经营及基金运作中的风险进行研究、评估和防控。公司各业务部门根据具体情况制定本部门的作业流程及风险控制制度，加强对风险的控制，作为一线责任人，将风险控制在最小范围内。同时，公司设独立的监察稽核部和风险管理部，两者依各自职能对公司运作各环节的各类风险进行监控。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

### 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建立了信用风险管理流程，通过对各类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，建立相应的分级别的交易对手库，并分别限定交易额度，同时采取一定的风险缓释措施。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国工商银行股份有限公司，按银行同业利率计息，与该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、对手授信额度、价格偏离等方面进行限制以控制相应的信用风险。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。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。

#### 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》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。

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，并对基金组合资产中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超过7个工作日可变现资产的可变现价值，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带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持大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，因此



除在附注6.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。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资产的公允价值。

本基金本报告期末及上年度末均无重大流动性风险。

#### 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现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。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。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款，结算备付金及债券投资等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末2019年06月30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	5,088,911.50	-	-	-	-	-	5,088,911.50
交易性金融资产	30,168,000.00	271,240,000.00	350,744,700.00	30,780,000.00	-	-	682,932,700.00
买入返售金融资产	79,920,239.88	-	-	-	-	-	79,920,239.88
应收利息	-	-	-	-	-	10,484,784.39	10,484,784.39
应收申购款	-	-	-	-	-	1,445,333.46	1,445,333.46
其他资产	-	-	-	-	-	33,326,520.55	33,326,520.55
资产总计	115,177,151.38	271,240,000.00	350,744,700.00	30,780,000.00	-	45,256,638.40	813,198,489.78
负债							

卖出回购金 融资产款	146,699,7 26.65	-	-	-	-	-	146,699,7 26.65
应付赎回款	-	-	-	-	-	3,172,509. 85	3,172,50 9.85
应付管理人 报酬	-	-	-	-	-	202,053.4 4	202,053.4 4
应付托管费	-	-	-	-	-	53,880.92	53,880.92
应付销售服 务费	-	-	-	-	-	122,578.6 9	122,578.6 9
应付交易费 用	-	-	-	-	-	12,968.69	12,968.69
应交税费	-	-	-	-	-	98,890.56	98,890.56
应付利息	-	-	-	-	-	22,579.79	22,579.79
其他负债	-	-	-	-	-	78,954.65	78,954.65
负债总计	146,699,7 26.65	-	-	-	-	3,764,416. 59	150,464,1 43.24
利率敏感度 缺口	-31,522,57 5.27	271,240,00 0.00	350,744, 700.00	30,780,0 00.00	-	41,492,22 1.81	662,734,3 46.54

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1.市场利率变化主要对基金组合债券类资产的估值产生影响，对其他会计科目的影响可忽略。	
假设	2.基金组合对利率的风险暴露，根据报告期末各只债券的修正久期加权计算得到，债券凸性对组合净值的影响可忽略。	
假设	3.市场即期利率曲线平行变动。	
假设	4.基金组合构成和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 2019年06月30日
	市场利率下降25个基点	592,004.00

市场利率上升25个基点	-592,004.00
-------------	-------------

注：本基金于2019年3月20日成立，无比较式的上年度数据。

#### 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。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要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股票和债券，所面临的其他价格风险来源于证券市场的整体波动，以及单个证券发行主体的自身经营情况或特殊事件影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，以价值投资为核心，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%，投资于短期债券的比例不低于非现金基金资产的80%。持有现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金所投资的短期债券是指剩余期限不超过397天的债券资产，主要包括国债、地方政府债、央行票据、金融债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债、可分离交易可转债的纯债部分等金融工具。本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 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 2019年06月30日	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产—股票投资	-	-
交易性金融资产—基金投	-	-

资		
交易性金融资产—债券投资	682,932,700.00	103.05
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	682,932,700.00	103.05

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

截止本报告期末，本基金未投资于相对其他价格风险敏感的资产，因此其他的市场因素对本基金资产净值无重要影响。

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 1、公允价值

##### 1)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括贷款和应收款项以及其他金融负债，其因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

##### 2)以公允价值计量的金融工具

##### (1)各层次金融工具公允价值

于2019年6月30日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第二层次的余额为人民币682,932,700.00元，无属于第一层次、第三层次的余额。

##### (2)公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关股票和可转换债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。

##### (3)第三层次公允价值余额和本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具第三层次公允价值本期未发生变动。

##### 2、承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

##### 3、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	682,932,700.00	83.98
	其中：债券	682,932,700.00	83.98
	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	79,920,239.88	9.83
	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	5,088,911.50	0.63
8	其他各项资产	45,256,638.40	5.57
9	合计	813,198,489.78	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

本基金本报告期末未持有股票。

#### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过沪港通机制投资的港股。

### 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

本基金本报告期末未持有股票。

### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金本报告期未买入股票。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金本报告期未卖出股票。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期未投资股票。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	59,994,000.00	9.05
	其中：政策性金融债	59,994,000.00	9.05
4	企业债券	30,591,000.00	4.62
5	企业短期融资券	501,701,000.00	75.70
6	中期票据	90,646,700.00	13.68
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	682,932,700.00	103.05

#### 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	011901225	19中纺集SCP003	500,000	50,045,000.00	7.55
2	101768007	17中铝业MTN002	300,000	30,780,000.00	4.64
3	1280366	12鄂西圈投债	300,000	30,591,000.00	4.62

4	041800428	18常高新CP001	300,000	30,180,000.00	4.55
5	011802360	18中交建融SCP001	300,000	30,168,000.00	4.55
6	011802059	18杭金投SCP011	300,000	30,168,000.00	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**  
本基金本报告期末未投资资产支持证券。

**7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细**  
本基金本报告期末未投资贵金属。

**7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细**  
本基金本报告期末未持有权证。

**7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**

**7.10.1 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合约。

**7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策**  
本基金不投资股指期货。

**7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

**7.11.1 本期国债期货投资政策**  
本基金暂不投资国债期货。

**7.11.2 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合约。

**7.11.3 本期国债期货投资评价**  
本基金本报告期末未持有国债期货合约。

**7.12 投资组合报告附注**

**7.12.1**报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体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、处罚的情形。

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

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	10,484,784.39
5	应收申购款	1,445,333.46
6	其他应收款	33,326,520.55
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	45,256,638.40

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，本报告中涉及比例计算的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例



财通安瑞短债债券A	1,143	293,464.76	150,832,702.34	44.97%	184,597,519.21	55.03%
财通安瑞短债债券C	1,534	211,830.71	9,663,013.42	2.97%	315,285,295.20	97.03%
合计	2,677	246,686.04	160,495,715.76	24.30%	499,882,814.41	75.70%

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用期末基金份额总额，特此说明。

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	财通安瑞短债债券A	4,996.19	0.00%
	财通安瑞短债债券C	2,009.78	0.00%
	合计	7,005.97	0.00%

### 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、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	财通安瑞短债债券A	0
	财通安瑞短债债券C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	财通安瑞短债债券A	0
	财通安瑞短债债券C	0
	合计	0

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

	财通安瑞短债债券A	财通安瑞短债债券C
--	-----------	-----------

基金合同生效日(2019年03月20日)基金份额总额	-	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	1,328,127,215.71	950,944,718.16
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	992,696,994.16	625,996,409.54
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	335,430,221.55	324,948,308.62

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

## §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

1、本报告期内，基金管理人于2019年1月18日聘任夏理芬先生担任公司董事长职务，原董事长刘未先生于2019年1月18日离任；

2、本报告期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

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内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

本报告期内，为本基金进行审计的机构未发生变化，为安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内未发生基金管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情形。

### 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	
新时代证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
华融证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
东海证券	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
湘财证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	2	-	-	-	-	-
高华证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
中信建投证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
民族证券	2	-	-	-	-	-
国联证券	2	-	-	-	-	-

天风证券	2	-	-	-	-	-
申银万国	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
财通证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
山西证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	3	-	-	-	-	-
联讯证券	4	-	-	-	-	-
安信证券	4	-	-	-	-	-
兴业证券	4	-	-	-	-	-

注：1、基金专用交易单元的选择标准如下：

- (1)经营行为稳健规范，内控制度健全的证券经营机构；
- (2)具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- (3)具有较强的全方位金融服务能力和水平，能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

2、基金专用交易单元的选择程序如下：

- (1)投资、研究部门与券商联系商讨合作意向，根据公司对券商交易单元的选择标准，确定选用交易单元的所属券商以及（主）交易单元，报投资总监与总经理审核批准；
- (2)集中交易部与券商商议交易单元租用协议，经相关业务部门确认后，报公司领导审批；
- (3)基金清算部负责对接托管行、各证券交易所、中登公司上海和深圳分公司办理交易单元手续及账户开户手续。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额	成交金额	占当期权证成交总额	成交金额	占当期基金成交总额

				额的比例		比例		比例
新时代证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-	-	-
民族证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	3,898,276,000.00	100.00%	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
联讯证券	-	-	-	-	-	-	-	-

安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-

### 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	《财通基金管理有限公司关于调整旗下部分证券投资基金持有“视觉中国”股票估值方法的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2019-04-13
2	《财通安瑞短债债券型证券投资基金开放日常申购、赎回（转换、定期定额投资）业务的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2019-05-15
3	《财通基金管理有限公司关于旗下部分基金增加江苏汇林保大基金销售有限公司为代销机构并参加基金费率优惠活动的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2019-05-22
4	《关于财通基金管理有限公司旗下部分基金增加洪泰财富(青岛)基金销售有限责任公司为代销机构的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2019-05-23
5	《财通安瑞短债债券型证券投资基金分红公告》	中国证监会指定报刊及网站	2019-05-24
6	《财通安瑞短债债券型证券投资基金暂停大额申购（转换转入）业务的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2019-05-24
7	《财通安瑞短债债券型证券投资基金恢复大额申购（转换转入）业务的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2019-05-30
8	《关于上海农村商业银行股份有限公司暂停代理销售财通基金管理有限公司旗下基金的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2019-06-07

9	《关于财通安瑞短债债券型证券投资基金增加华金证券股份有限公司为代销机构的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2019-06-21
---	---	--------------	------------

## §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

报告期内本基金未有单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况发生。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期内无影响投资者决策的其他重要信息。

## §12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、关于财通安瑞短债债券型证券投资基金基金合同；
- 3、关于财通安瑞短债债券型证券投资基金基金托管协议；
- 4、关于财通安瑞短债债券型证券投资基金招募说明书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、报告期内披露的各项公告。

### 12.2 存放地点

上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心41楼。

### 11.3 查阅方式

投资者可到基金管理人、基金托管人的办公场所或基金管理人网站免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

投资者对本报告如有疑问，可咨询本管理人。

咨询电话：400-820-9888

公司网址：<http://www.ctfund.com>

财通基金管理有限公司  
二〇一九年八月二十七日

