

融通证券分级基金 2016 年半年度报告

公告日期：2016-08-29

流水号：FB02201608260315

[目录全部展开](#) [目录全部收拢](#)

重要提示

基金产品概况

基金基本情况

基金产品说明

基金管理人和基金托管人

信息披露方式

其他相关资料

主要财务指标、基金净值表现

主要会计数据和财务指标

基金净值表现

本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来基金累计份额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

管理人报告

基金管理人及基金经理情况

基金管理人及其管理基金的经验

基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

公平交易制度的执行情况

公平交易制度和控制方法

本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

异常交易行为的专项说明

管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

报告期内基金的业绩表现

报告期内基金投资策略和运作分析

管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

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

托管人报告

报告期内本基金托管人合规守信情况声明

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

托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

半年度财务会计报告（未经审计）

资产负债表

利润表

所有者权益（基金净值）变动表

报表附注

基金基本情况
会计报表的编制基础
遵循企业会计准则及其他有关规定的声明
重要会计政策和会计估计
会计年度
记账本位币
金融资产和金融负债的分类
金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认
金融资产和金融负债的估值原则
金融资产和金融负债的抵销
实收基金
损益平准金
收入/(损失)的确认和计量
费用的确认和计量
基金的收益分配政策
其他重要的会计政策和会计估计
会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明
会计政策变更的说明
会计估计变更的说明
差错更正的说明
税项
重要财务报表项目的说明
银行存款
交易性金融资产
衍生金融资产/负债
买入返售金融资产
各项买入返售金融资产期末余额
期末买断式逆回购交易中取得的债券
应收利息
其他资产
应付交易费用
其他负债
实收基金
未分配利润
存款利息收入
股票投资收益
股票投资收益项目构成
股票投资收益——买卖股票差价收入
股票投资收益——赎回差价收入
股票投资收益——申购差价收入
基金投资收益
债券投资收益
债券投资收益项目构成
债券投资收益——买卖债券差价收入

债券投资收益——赎回差价收入
债券投资收益——申购差价收入
资产支持证券投资收益
贵金属投资收益
贵金属投资收益项目构成
贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入
贵金属投资收益——赎回差价收入
衍生工具收益
衍生工具收益——买卖权证差价收入
衍生工具收益——其他投资收益
股利收益
公允价值变动收益
其他收入
交易费用
其他费用
分部报告
或有事项、资产负债表日后事项的说明
或有事项
资产负债表日后事项
关联方关系
本报告期及上年度可比期间的关联方交易
通过关联方交易单元进行的交易
股票交易
权证交易
应支付关联方的佣金
关联方报酬
基金管理费
基金托管费
销售服务费
与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易
各关联方投资本基金的情况
报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
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
由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入
本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况
其他关联交易事项的说明
利润分配情况
利润分配情况——非货币市场基金
期末本基金持有的流通受限证券
因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券
期末持有的暂时停牌等流通受限股票
期末债券正回购交易中作为抵押的债券
银行间市场债券正回购
交易所市场债券正回购

金融工具风险及管理
风险管理政策和组织架构
信用风险
按短期信用评级列示的债券投资
按长期信用评级列示的债券投资
流动性风险
金融资产和金融负债的到期期限分析
市场风险
利率风险
利率风险敞口
利率风险的敏感性分析
外汇风险
外汇风险敞口
外汇风险的敏感性分析
其他价格风险
其他价格风险敞口
其他价格风险的敏感性分析
采用风险价值法管理风险
有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项
投资组合报告
期末基金资产组合情况
积极投资按行业分类的股票投资组合
指数投资按行业分类的股票投资组合
期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细
期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细
期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细
报告期内股票投资组合的重大变动
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
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
买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额
期末按债券品种分类的债券投资组合
期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细
期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细
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
期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细
报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
本基金投资股指期货的投资政策
报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
本期国债期货投资政策
报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本期国债期货投资评价
投资组合报告附注
受到调查以及处罚情况

申明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

期末其他各项资产构成

期末持有的处于转股期的可转换债券明细

期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

期末指数投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

投资组合报告附注的其他文字描述部分

基金份额持有人信息

期末基金份额持有人户数及持有人结构

期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

开放式基金份额变动

重大事件揭示

基金份额持有人大会决议

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

涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

基金投资策略的改变

为基金进行审计的会计师事务所情况

管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

基金租用证券公司交易单元的有关情况

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

其他重大事件

发起式基金发起资金持有份额情况

影响投资者决策的其他重要信息

备查文件目录

重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，

并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分

之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据融通中证全指证券公司指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）基金合同规定，于 2016 年 8 月 25 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 2016 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

基金基本情况

项目

数值

基金名称

融通中证全指证券公司指数分级证券投资基金

基金简称

融通证券分级

场内简称

融通证券

基金主代码

161629

基金运作方式

契约型开放式

基金合同生效日

2015-07-17

基金管理人

融通基金管理有限公司

基金托管人

中国建设银行股份有限公司

报告期末基金份额总额

183,536,581.84

基金合同存续期

不定期

基金份额上市的证券交易所

深圳证券交易所

上市日期

2015年8月3日

下属3级基金的基金简称

融通证券分级

证券A基

证券B基

下属3级基金的场内简称

融通证券

证券A基

证券B基

下属3级基金的交易代码

161629

150343

150344

报告期末下属3级基金的份额总额

36096711.84

73719935.00

73719935.00

基金产品说明

投资目标

本基金采用指数化投资策略，紧密跟踪中证全指证券公司指数。在正常市场情况下，力争

将

基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值控制在 0.35%以内，年跟踪

误差控制在 4%以内。

投资策略

本基金采用完全复制法进行投资，按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，

并根据标的指数成份股及其权重的变动对投资组合进行相应调整。

业绩比较基准

$95\% \times \text{中证全指证券公司价格指数收益率} + 5\% \times \text{银行人民币活期存款利率（税后）}$ 。

风险收益特征

本基金为股票型基金，具有较高预期风险、较高预期收益的特征。从本基金所分离的两类基

金份额来看，融通证券 A 份额具有低预期风险、预期收益相对稳定的特征；融通证券 B 份

额具有高预期风险、预期收益相对较高的特征。

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

中国建设银行股份有限公司

信息披露负责人

姓名

涂卫东

田青

联系电话

(0755) 26948666

(010) 67595096

电子邮箱

service@mail.rtfund.com

tianqing1.zh@ccb.com

客户服务电话

400-883-8088、(0755) 26948088

(010) 67595096

传真

(0755) 26935005

(010) 66275853

注册地址

深圳市南山区华侨城汉唐大厦 13、14 层

北京市西城区金融大街 25 号

办公地址

深圳市南山区华侨城汉唐大厦 13、14 层

北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

邮政编码

518053

100033

法定代表人

高峰

王洪章

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

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址

<http://www.rtfund.com>

基金年度报告备置地点

基金管理人处、基金托管人处、深圳证券交易所

其他相关资料

项目

名称

办公地址

注册登记机构

中国证券登记结算有限责任公司

北京市西城区太平桥大街 17 号

主要会计数据和财务指标

金额单位：

期间数据和指标

报告期（2016-01-01 至 2016-06-30）

融通证券分级

融通证券分级

证券 A 基

证券 B 基

本期已实现收益

-129,466,189.43

---本期利润

-140,669,769.37

---加权平均基金份额本期利润

-0.2373

---本期加权平均净值利润率

-27.89%

-%

-%

-%

本期基金份额净值增长率

-16.63%

-%

-%

-%

期末数据和指标

报告期末（2016-06-30）

融通证券分级

融通证券分级

证券 A 基

证券 B 基

期末可供分配利润

-86,837,339.46

---期末可供分配基金份额利润

-0.4731

---期末基金资产净值

205,939,380.40

---期末基金份额净值

1.122

---累计期末指标

报告期末（2016-06-30）

融通证券分级

融通证券分级

证券 A 基

证券 B 基

基金份额累计净值增长率

-25.57%

-%

-%

-%

期末还原后基金份额累计净值

-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）。

基金净值表现

本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较 A

阶段

净值增长率①

净值增长率标准差②

业绩比较基准收益率③

业绩比较基准收益率标准差④

①-③

②-④

本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较 B
阶段

净值增长率①

净值增长率标准差②

业绩比较基准收益率③

业绩比较基准收益率标准差④

①-③

②-④

本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较 C
阶段

净值增长率①

净值增长率标准差②

业绩比较基准收益率③

业绩比较基准收益率标准差④

①-③

②-④

自基金合同生效以来基金累计份额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 A

自基金合同生效以来基金累计份额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 B

自基金合同生效以来基金累计份额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 C

注：1、本基金合同生效日为 2015 年 7 月 17 日。

2、本基金的建仓期为自合同生效日起 6 个月，截止建仓期结束，各项资产配置比例符合规定。

基金管理人及基金经理情况

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：

新时代证券股份有限公司 60%、日兴资产管理有限公司（Nikko AssetManagement Co.,
Ltd.）

40%。

截至 2016 年 6 月 30 日，公司管理的基金共有四十五只：一只封闭式基金，即融通通乾封
闭

基金；四十四只开放式基金，即融通新蓝筹混合基金、融通债券基金、融通深证 100 指数
基

金、融通蓝筹成长混合基金、融通行业景气混合基金、融通巨潮 100 指数基金（LOF）、
融通

易支付货币基金、融通动力先锋股票基金、融通领先成长混合基金（LOF）、融通内需驱动

混合基金、融通深证成份指数基金、融通四季添利债券基金、融通创业板指数基金、融通医疗保健混合基金、融通岁岁添利定期开放债券基金、融通丰利四分法（QDII-FOF）基金、融通汇财宝货币市场基金、融通标普中国可转债指数增强基金、融通通泰保本混合基金、融通通泽混合基金、融通通福分级债券基金、融通通源短融债券基金、融通通瑞债券基金、融通月月添利基金、融通健康产业混合基金、融通转型三动力混合基金、融通互联网传媒混合基金、融通新区新经济混合基金、融通通鑫混合基金、融通新能源混合基金、融通军工分级指数基金、融通证券分级指数基金、融通农业分级指数基金、融通跨界成长混合基金、融通新机遇混合基金、融通成长 30 混合基金、融通中国风 1 号混合基金、融通通盈保本混合基金、融通增利债券基金、融通增裕债券基金、融通增鑫债券基金、融通增益债券基金、融通增祥债券基金和融通新消费混合基金。其中，融通债券基金、融通深证 100 指数基金和融通蓝筹成长混合基金同属融通通利系列证券投资基金。此外，公司还开展了特定客户资产管理业务。

基金经理（或基金经理小组）简介

姓名

职务

任本基金的基金经理期限

证券从业年限

说明

任职日期

离任日期

何天翔

融通深证 100 指数证券投资基金、融通中证军工指数分级证券投资基金、融通中证全指证券公司指数分级证券投资基金、融通中证大农业指数分级证券投资基金的基金经理

2015-07-17

-8

何天翔先生，厦门大学经济学硕士、安徽大学理学学士，8 年证券投资从业经历，具有基金从业资格。曾就职于华泰联合证券有限公司任金融工程分析师。2010 年 3 月加入融通基金管理有限公司，历任金融工程研究员、专户投资投资经理，2014 年 10 月 25 日起至今任“融通深证 100 指数证券投资基金”基金经理，2015 年 7 月 1 日起至今任“融通中证军工指数分级证券投资基金”基金经理，2015 年 7 月 17 日起至今任“融通中证全指证券公司指数分

级证券投资基金”基金经理，2015年8月25日起至今任“融通中证大农业指数分级证券投资基金”基金经理。

注：1、此处的任职日期和离任日期均指公司决定生效之日，首任基金经理，任职日期为基金合同生效日；

2、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。

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《证券投资基金法》等有关法律法规和本基金合同的规定

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。

管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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）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。

公平交易制度和控制方法

-本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

-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。

管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

-报告期内基金投资策略和运作分析

在严格遵守基金合同的前提下实现持有人利益的最大化是本基金管理的核心思想，并将此原

则贯彻于基金的运作始终。本基金运用指数化投资策略，通过控制股票投资权重与中证全指

证券公司指数成份股自然权重的偏离，有效控制跟踪误差，为投资者提供投资中证全指证

公司指数的一个有效工具。

报告期内基金的业绩表现

本报告期基金份额净值增长率为-16.63%，同期业绩比较基准收益率为-15.80%。

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证券投资基金估值业务原则

和程序》进行，公司设立由研究部、风险管理部、登记清算部、固定收益部、国际业务部和

监察稽核部共同组成的估值委员会，通过参考行业协会估值意见、参考独立第三方机构估值

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。估值委员会的相关成员均

具备相应的专业胜任能力和相关工作经历，估值委员会成员不包含基金经理。

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

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。其中研究部负责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，金融工程小组负责估值方法的研究、价格

的计算及复核，登记清算部进行具体的估值核算并计算每日基金净值，每日对基金所投资品

种的公开信息、基金会计估值方法的法规等进行搜集并整理汇总，供估值委员会参考，监察稽

核部负责基金估值业务的事前、事中及事后的审核工作。基金经理不参与估值决定，参与估

值流程各方之间亦不存在任何重大利益冲突，截至报告期末公司未与外部估值定价服务机构

签约。

管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金基金合同约定，本基金（包括融通证券份额、融通证券 A 基金份额、融通证券 B 基金份额）不进行收益分配。

管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

-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

无。

报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金

法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在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。

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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的

基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进

行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

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

本托管人复核审查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。

资产负债表

会计主体：融通中证全指证券公司指数分级证券投资基金

报告截止日：2016-06-30

单位：

资产

本期末

2016-06-30

上年度末

2015-12-31

资产：

银行存款

16,124,537.87

50,827,277.29

结算备付金

-3,472,736.69

存出保证金

463,698.73

156,994.40

交易性金融资产

194,861,795.85

706,425,593.05

其中：股票投资

194,861,795.85

706,425,593.05

基金投资

--债券投资

--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

--应收证券清算款

2,973,111.52

--应收利息

3,094.07

14,503.71

应收股利

--应收申购款

177,234.98

593,672.74

递延所得税资产

--其他资产

--资产总计
214,603,473.02
761,490,777.88
负债和所有者权益
本期末
2016-06-30
上年度末
2015-12-31
负债：
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
--应付证券清算款
--应付赎回款
8,140,977.19
49,912.92
应付管理人报酬
179,694.18
592,108.05
应付托管费
39,532.72
130,263.81
应付销售服务费
--应付交易费用
123,741.40
668,757.54
应交税费
--应付利息
--应付利润
--递延所得税负债
--其他负债
180,147.13
141,492.43
负债合计
8,664,092.62
1,582,534.75
所有者权益：
实收基金
276,626,875.13
850,738,948.92
未分配利润
-70,687,494.73
-90,830,705.79

所有者权益合计

205,939,380.40

759,908,243.13

负债和所有者权益总计

214,603,473.02

761,490,777.88

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，融通证券分级份额净值 1.122 元，融通证券 A 份额净值

1.018 元，融通证券 B 份额净值 1.226 元；基金份额总额 183,536,581.84 份，其中融通证券

分级份额 36,096,711.84 份，融通证券 A 份额 73,719,935.00 份，融通证券 B 份额

73,719,935.00

份。

利润表

会计主体：融通中证全指证券公司指数分级证券投资基金

本报告期：2016-01-01 至 2016-06-30

单位：

项目

本期

2016-01-01 至 2016-06-30

上年度可比期间

至

一、收入

-134,575,785.43

-1.利息收入

201,744.57

-其中：存款利息收入

201,744.57

-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

--其他利息收入

--2.投资收益（损失以“-”填列）

-125,113,506.29

-其中：股票投资收益

-126,964,196.15

-基金投资收益

--债券投资收益

--资产支持证券投资

收益

--贵金属投资收益

--衍生工具收益

--股利收益

1,850,689.86

-3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）

-11,203,579.94

-4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）

--5. 其他收入（损失以“-”号填列）

1,539,556.23

-减：二、费用

6,093,983.94

-

1. 管理人报酬

2,516,926.99

-2. 托管费

553,723.96

-3. 销售服务费

--4. 交易费用

2,814,468.64

-5. 利息支出

--其中：卖出回购金融资产支出

--6. 其他费用

208,864.35

-三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）

-140,669,769.37

-减：所得税费用

-四、净利润（净亏损以“-”号填列）

-140,669,769.37

-注：本基金基金合同生效于 2015 年 7 月 17 日生效，无上年度可比期间数据。

所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：融通中证全指证券公司指数分级证券投资基金

本报告期：2016-01-01 至 2016-06-30

单位：

项目

本期

2016-01-01 至 2016-06-30

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）

850,738,948.92

-90,830,705.79

759,908,243.13

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）

--140,669,769.37

-140,669,769.37

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）

-574,112,073.79

160,812,980.43

-413,299,093.36

其中：1.基金申购款

1,112,092,513.84

-293,754,107.50

818,338,406.34

2.基金赎回款

-1,686,204,587.63

454,567,087.93

-1,231,637,499.70

四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）

---五、期末所有者权益（基金净值）

276,626,875.13

-70,687,494.73

205,939,380.40

项目

上年度可比期间

至

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）

---二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）

---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）

---其中：1.基金申购款

---2.基金赎回款

---四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）

---五、期末所有者权益（基金净值）

---注：本基金基金合同生效于 2015 年 7 月 17 日生效，无上年度可比期间数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告第 6.1 页至第 6.4 页财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：孟朝霞 主管会计工作负责人：颜锡廉 会计机构负责人：

刘美丽

注：此处为 PDF 文件中的章节数或者页数。

报表附注

基金基本情况

融通中证全指证券公司指数分级证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委

员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]1150 号《关于准予融通中证全指证券公司指

数分级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《融通中证全指证券公司指数分级证券投资基金基金合同》负责公开募

集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 240,386,717.80 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(2015)第 963 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《融通中证全指证券公司指数分级证

券

投资基金基金合同》于 2015 年 7 月 17 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 240,398,178.85 份，其中认购资金利息折合 11,461.05 份基金份额。本基金的基金管理人为融通基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司(以下简称“中国建设银行”)。

根据《融通中证全指证券公司指数分级证券投资基金基金合同》的相关规定，根据对基金财

产及收益分配的不同安排，本基金的基金份额具有不同的风险收益特征，本基金的基金份

额包括融通中证全指证券公司指数分级证券投资基金之基础份额(以下简称“融通证券份额”)、

融通中证全指证券公司指数分级证券投资基金之稳健收益份额(以下简称“融通证券 A 份额”)

)及融通中证全指证券公司指数分级证券投资基金之积极收益类份额(以下简称“融通证券 B 份额”)。投资人在场外认/申购的融通证券份额不进行基金份额分拆；投资人在场内认购的

融通证券份额将在基金发售结束后进行基金份额自动分离；投资人在场内申购的融通证券份

额，可选择进行基金份额分拆，也可选择不进行基金份额分拆。融通证券 A 份额指融通证券份额按基金合同约定规则所自动分离或分拆的稳健收益类基金份额。融通证券 B 份额指融

通证券份额按基金合同约定规则所自动分离或分拆的积极收益类基金份额。融通证券 A 份

额、融通证券 B 份额的基金份额配比始终保持 1:1 的比例不变。本基金的基金份额初始公

开发售结束后，场外认购的全部份额确认为融通证券份额；场内认购的份额将按照 1:1 的比

例确认为融通证券 A 份额与融通证券 B 份额。本基金基金合同生效后，融通证券份额与融通证券 A 份额、融通证券 B 份额之间可以按约定的规则进行场内份额配对转换，包括基金份额的分拆和合并两种转换行为。基金份额的分拆，指基金份额持有人将其持有的融通证券份

额按照 2 份融通证券份额对应 1 份融通证券 A 份额与 1 份融通证券 B 份额的比例进行转换

的行为；基金份额的合并，指基金份额持有人将其持有的融通证券 A 份额与融通证券 B 份

额按照 1 份融通证券 A 份额与 1 份融通证券 B 份额对应 2 份融通证券份额的比例进行转换的行为。

基金份额的净值按如下原则计算：融通证券份额的基金份额净值为净值计算日的基金资产净

值除以基金份额总数，其中基金份额总数为融通证券份额、融通证券 A 份额、融通证券 B 份

额的份额数之和。融通证券 A 份额的基金份额净值为融通证券 A 份额的本金及约定应得

收益之和。每 2 份融通证券份额所代表的基金资产净值等于 1 份融通证券 A 份额和 1 份融

通证券 B 份额的基金资产净值之和。

本基金定期进行份额折算。在每年 12 月 15 日(若该日为非工作日，则提前至该日之前的最

后一个工作日)，本基金将进行融通证券 A 份额和融通证券份额的定期份额折算。在基金份

额折算前与折算后，融通证券 A 份额与融通证券 B 份额的份额配比保持 1: 1 的比例。基

金

份额折算基准日折算前融通证券 A 份额的基金份额参考净值超出 1.000 元的部分将折算为融通证券份额的场内份额分配给融通证券 A 份额持有人。融通证券份额持有人持有的每两份融通证券份额将按一份融通证券 A 份额获得新增融通证券份额的分配。持有场外融通证券份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外融通证券份额的分配；持有场内融通证券份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内融通证券份额的分配。经过上述份额折算，融通证券 A 份额的基金份额参考净值调整为 1.000 元，融通证券份额的基金份额净值将相应调整。

除定期份额折算外，本基金还将在融通证券份额的基金份额净值高至 1.500 元或以上、融通证券 B 份额的基金份额参考净值低至 0.250 元或以下时进行不定期份额折算。当融通证券份额的基金份额净值高至 1.500 元或以上，本基金将分别对融通证券 B 份额和融通证券份额进行份额折算，份额折算后本基金将确保融通证券 A 份额和融通证券 B 份额的比例为 1:1，份额折算后融通证券 B 份额的基金份额参考净值和融通证券份额的基金份额净值超过融通证券 A 份额的基金份额参考净值的部分，折算成场内的融通证券份额。份额折算后融通证券份额的基金份额净值、融通证券 B 份额的基金份额参考净值与折算基准日融通证券 A 份额的基金份额参考净值三者相等。当融通证券 B 份额的基金份额参考净值低至 0.250 元或以下，本基金将分别对融通证券 A 份额、融通证券 B 份额和融通证券份额进行份额折算，份额折算后本基金将确保融通证券 A 份额和融通证券 B 份额的比例为 1:1，份额折算后融通证券份额的基金份额净值、融通证券 A 份额和融通证券 B 份额的基金份额参考净值均调整为 1.000 元。融通证券份额、融通证券 A 份额和融通证券 B 份额的份额数将相应缩减。

经深圳证券交易所深证上[2015]367 号文审核同意，本基金融通证券 A 份额 19,106,381.00 份和融通证券 B 份额 19,106,382.00 份于 2015 年 8 月 3 日上市交易。对于托管在场内的融通证券份额，基金份额持有人在符合相关办理条件的前提下，将其分拆为融通证券 A 份额和融通证券 B 份额即可上市流通；对于托管在场外的融通证券份额，基金份额持有人在符合相关办理条件的前提下，将其跨系统转托管至深交所场内后分拆为融通证券 A 份额和融通证券 B 份额即可上市流通。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《融通中证全指证券公司指数分级证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发

行上市的股票(包括中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票)、权证、债券(包括国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产、现金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)。

本基金的股票资产投资比例不低于基金资产的 90%，其中投资于中证全指证券公司指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%，权证投资占基金资产净值的比例为 0% - 3%，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金业绩比较基准为：中证全指证券公司价格指数收益率×95% + 银行活期存款利率(税后)×5%。

会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(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》、《融通中证全指证券公司指数分级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。

遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2016 年半年度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 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

重要会计政策和会计估计

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。

会计年度

-记账本位币

-金融资产和金融负债的分类

-金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

-金融资产和金融负债的估值原则

-金融资产和金融负债的抵销

-实收基金

-损益平准金

-收入/(损失)的确认和计量

-费用的确认和计量

-基金的收益分配政策

-

其他重要的会计政策和会计估计

-会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

会计政策变更的说明

-会计估计变更的说明

-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。

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[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、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

通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税补充政策的通知》及其他相关财

税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于2016年5月1日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业

税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自2016年5月1日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。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，对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(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。

(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，于2015年9月8日前暂减按25%

计入应纳税所得额，自2015年9月8日起，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。

重要财务报表项目的说明

银行存款

单位：
项目
本期末
2016-06-30
活期存款
16,124,537.87
定期存款
-其中：存款期限 1-3 个月
-其他存款
-合计

16,124,537.87
交易性金融资产

单位：
项目
本期末
2016-06-30
成本
公允价值
公允价值变动
股票
208,183,879.77
194,861,795.85
-13,322,083.92
贵金属投资-金交所黄金合约
---债券
交易所市场
---银行间市场
---合计
---资产支持证券
---基金
---其他

-
--合计
208,183,879.77
194,861,795.85
-13,322,083.92
衍生金融资产/负债

单位：
项目
本期末
2016-06-30
合同/名义金额
公允价值
备注

资产

负债

利率衍生工具

---货币衍生工具

---权益衍生工具

---其他衍生工具

---合计

---注：本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

买入返售金融资产

各项买入返售金融资产期末余额

单位：元

项目

本期末

2016-06-30

账面余额

其中：买断式逆回购

注：本基金本报告期末无买入返售金融资产。

期末买断式逆回购交易中取得的债券

单位：元

项目

本期末

2016-06-30

债券代码

债券名称

约定返售日

估值单价

数量（张）

估值总额

其中：已出售或再质押总额

注：本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

应收利息

单位：

项目

本期末

2016-06-30

应收活期存款利息

2,885.47

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

-应收买入返售证券利息

-应收申购款利息

-应收黄金合约拆借孳息

-其他

208.60

合计

3,094.07

其他资产

单位：

项目

本期末

2016-06-30

其他应收款

-待摊费用

-合计

-注：截至本报告期末，本基金未持有其他资产。

应付交易费用

单位：

项目

本期末

2016-06-30

交易所市场应付交易费用

123,741.40

银行间市场应付交易费用

-合计

123,741.40

其他负债

单位：

项目

本期末

2016-06-30

应付券商交易单元保证金

-应付赎回费

30,695.05

预提费用

99,452.08

指数使用费

50,000.00

合计

180,147.13

实收基金

单位：

项目

本期末

2016-06-30

融通证券分级

证券 A 基

证券 B 基
基金份额 (份)
账面金额
基金份额 (份)
账面金额
基金份额 (份)
账面金额

上年度末

-----本期申购

-----本期赎回 (以“-”号填列)

-----2016-03-01 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

-----注: 1. 本基金自 2015 年 7 月 8 日至 2015 年 7 月 14 日止期间公开发售, 共募集有效净认购

资金 240,386,717.80 元。根据《融通中证全指证券公司指数分级证券投资基金基金合同》的

规定, 本基金募集期内认购资金产生的利息收入计 11,461.05 元, 折算为计 11,461.05 份基金份额, 归基金份额持有人所有。

2. 根据《融通中证全指证券公司指数分级证券投资基金基金合同》及《融通中证全指证券公司指数分级证券投资基金招募说明书》的相关规定, 本基金于 2015 年 7 月 17 日(基金合同生效日)至 2015 年 7 月 21 日止期间暂不向投资人开放基金交易。申购和赎回业务自 2015

年 7 月 22 日起开始办理。

3. 根据《融通中证全指证券公司指数分级证券投资基金招募说明书》和本基金的基金管理人融通基金管理有限公司 2016 年 3 月 3 日发布的《融通中证全指证券公司指数分级证券投资基金不定期份额折算结果及恢复交易的公告》, 本基金的基金管理人融通基金管理有限公司

以 2016 年 3 月 1 日为基准日, 对融通证券 A 份额、融通证券 B 份额和融通证券份额进行

份额折算, 份额折算后本基金将确保融通证券 A 份额和融通证券 B 份额的比例为 1:1, 份

额折算后融通证券份额的基金份额净值、融通证券 A 份额和融通证券 B 份额的基金份额参考净值均调整为 1.000 元。融通证券份额、融通证券 A 份额和融通证券 B 份额的份额数将相应

缩减。2016 年 3 月 1 日折算前融通证券场内份额为 5,541,155.00 份, 新增份额折算比例为 0.654599626, 折算后融通证券场内份额为 631,334,510.00 份(包含融通证券 A 份额经份额折

算后产生的新增的场内融通证券份额); 折算前融通证券场外份额为 18,766,403.88 份, 新增

份额折算比例为 0.654599626, 折算后融通证券场外份额为 12,284,483.58 份; 折算前融通

证

券 A 份额为 878,656,542.00 份，新增份额折算比例 0.297402448，折算后融通证券 A 份额为

261,314,606.00 份；折算前融通证券 B 份额为 878,656,543.00 份，新增份额折算比例 0.297402448，折算后融通证券 B 份额为 261,314,606.00 份。本基金的基金管理人已根据上述折算比例，对全体基金份额持有人持有的基金份额进行了折算。

未分配利润

单位：

项目

融通证券分级

证券 A 基

证券 B 基

已实现部分

未实现部分

未分配利润合计

已实现部分

未实现部分

未分配利润合计

已实现部分

未实现部分

未分配利润合计

上年度末

-----本期利润

-----本期基金份额交易产生的变动数

-----其中：基金申购款

-

-----基金赎回款

-----本期已分配利润

-----本期末

-----存款利息收入

项目

本期

2016-01-01 至 2016-06-30

活期存款利息收入

182,085.76

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

15,093.24

其他

4,565.57

合计

201,744.57

股票投资收益

股票投资收益项目构成

单位：

项目

本期

2016-01-01 至 2016-06-30

股票投资收益——买卖股票差价收入

-126,964,196.15

股票投资收益——赎回差价收入

-股票投资收益——申购差价收入

-合计

-126,964,196.15

股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：

项目

本期

2016-01-01 至 2016-06-30

卖出股票成交总额

1,058,159,301.35

减：卖出股票成本总额

1,185,123,497.50

买卖股票差价收入

-126,964,196.15

股票投资收益——赎回差价收入

单位：

项目

本期

2016-01-01 至 2016-06-30

赎回基金份额对价总额

-减：现金支付赎回款总额

-

减：赎回股票成本总额

-赎回差价收入

-股票投资收益——申购差价收入

单位：

项目

本期

2016-01-01 至 2016-06-30

申购基金份额总额

-减：现金支付申购款总额

-减：申购股票成本总额

-申购差价收入

-基金投资收益

单位：

项目

本期

2016-01-01 至 2016-06-30

卖出/赎回基金成交总额

-减：卖出/赎回基金成本总额

-基金投资收益

-债券投资收益

债券投资收益项目构成

单位：

项目

本期

2016-01-01 至 2016-06-30

上年度可比期间

至

债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入

--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

--注：本基金本报告期无债券投资收益/损失。

债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：

项目

本期

2016-01-01 至 2016-06-30

上年度可比期间

至

卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额

--减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额

--减：应收利息总额

--买卖债券差价收入

--债券投资收益——赎回差价收入

单位：

项目

本期

2016-01-01 至 2016-06-30

上年度可比期间

至

赎回基金份额对价总额

--减：现金支付赎回款总额

--减：赎回债券成本总额

--减：赎回债券应收利息总额

--赎回差价收入

--债券投资收益——申购差价收入

单位：

项目

本期

2016-01-01 至 2016-06-30

上年度可比期间

至

申购基金份额对价总额

--减：现金支付申购款总额

--减：申购债券成本总额

--减：申购债券应收利息总额

--申购差价收入

--资产支持证券投资收益

单位：

项目

本期

2016-01-01 至 2016-06-30

卖出资产支持证券成交总额

-减：卖出资产支持证券成本总额

-减：应收利息总额

-资产支持证券投资收益

-贵金属投资收益

贵金属投资收益项目构成

单位：

项目

本期

2016-01-01 至 2016-06-30

贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

-贵金属投资收益——赎回差价收入

-贵金属投资收益——申购差价收入

合计

-贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

单位：

项目

本期

2016-01-01 至 2016-06-30

卖出贵金属成交总额

-减：卖出贵金属成本总额

-买卖贵金属差价收入

-贵金属投资收益——赎回差价收入

单位：

项目

本期

2016-01-01 至 2016-06-30

赎回贵金属份额对价总额

-减：现金支付赎回款总额

-减：赎回贵金属成本总额
-赎回差价收入
-贵金属投资收益——申购差价收入

单位：

项目

本期

2016-01-01 至 2016-06-30

申购贵金属份额总额

-减：现金支付申购款总额

-减：申购贵金属成本总额

-申购差价收入

衍生工具收益

衍生工具收益——买卖权证差价收入

单位：

项目

本期

2016-01-01 至 2016-06-30

卖出权证成交总额

-减：卖出权证成本总额

-买卖权证差价收入

-注：本基金本报告期无衍生工具收益/损失。

衍生工具收益——其他投资收益

项目

本期收益金额

2016-01-01 至 2016-06-30

股利收益

单位：

项目

本期

2016-01-01 至 2016-06-30

股票投资产生的股利收益

1,850,689.86

基金投资产生的股利收益

-合计

1,850,689.86

公允价值变动收益

单位：

项目

本期

2016-01-01 至 2016-06-30

1.交易性金融资产

-11,203,579.94

——股票投资

-11,203,579.94

——债券投资
——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
-合计
-11,203,579.94

其他收入

单位:

项目

本期

2016-01-01 至 2016-06-30

基金赎回费收入

1,536,762.70

转换费收入

2,793.53

合计

1,539,556.23

注: 1、融通证券份额的场内赎回费率为 0.50%，融通证券份额的场外赎回费率随赎回基金份额持有期限的增加而递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金财产。

2、基金转换收取转换费和补差费，其中不低于转换费的 25% 归入转出基金的基金资产。

交易费用

单位:

项目

本期

2016-01-01 至 2016-06-30

交易所市场交易费用

2,814,468.64

银行间市场交易费用

-合计

2,814,468.64

其他费用

单位:

项目

本期

2016-01-01 至 2016-06-30

审计费用

19,890.78

信息披露费

49,726.04

上市费

29,835.26

银行费用

9,412.27

指数使用费

100,000.00

其他

-合计

208,864.35

分部报告

-或有事项、资产负债表日后事项的说明

或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

资产负债表日后事项

截至本财务报表批准日，本基金无需要作披露的资产负债表日后事项。

关联方关系

关联方名称

与本基金的关系

融通基金管理有限公司

基金管理人、基金销售机构

中国建设银行股份有限公司

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。

本报告期及上年度可比期间的关联方交易

-通过关联方交易单元进行的交易

股票交易

单位：元

关联方名称

本期

2016-01-01 至 2016-06-30

上年度可比期间

至

成交金额

占当期股票成交总额的比例

成交金额

占当期股票成交总额的比例

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。

债券交易

单位：元

关联方名称

本期

2016-01-01 至 2016-06-30

上年度可比期间

至

成交金额

占当期债券成交总额的比例

成交金额

占当期债券成交总额的比例

债券回购交易

单位：元

关联方名称

本期

2016-01-01 至 2016-06-30

上年度可比期间

至

成交金额

占当期债券回购成交总额的比例

成交金额

占当期债券回购成交总额的比例

基金交易

单位：元

关联方名称

本期

2016-01-01 至 2016-06-30

上年度可比期间

至

成交金额

占当期基金成交总额的比例

成交金额

占当期基金成交总额的比例

权证交易

单位：元

关联方名称

本期

2016-01-01 至 2016-06-30

上年度可比期间

至

成交金额

占当期股票成交总额的比例

成交金额

占当期股票成交总额的比例

应支付关联方的佣金

单位：元

关联方名称

本期

2016-01-01 至 2016-06-30

当期佣金

占当期佣金总量的比例

期末应付佣金余额

占期末应付佣金总额的比例

关联方名称

上年度可比期间

至

当期佣金

占当期佣金总量的比例

期末应付佣金余额

占期末应付佣金总额的比例

关联方报酬

基金管理费

单位：

项目

本期

2016-01-01 至 2016-06-30

上年度可比期间

至

当期发生的基金应支付的管理费

2,516,926.99

-其中：支付销售机构的客户维护费

198,904.29

-注：1、支付基金管理人融通基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1%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×1% / 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。

基金托管费

单位：

项目

本期

2016-01-01 至 2016-06-30

上年度可比期间

至

当期发生的基金应支付的管理费

553,723.96

-注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.22%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×0.22% / 当年天数。

销售服务费

单位：元

获得销售服务费的各关联方名称

本期

2016-01-01 至 2016-06-30

当期应支付的销售服务费

融通证券分级

证券 A 基

证券 B 基

合计

获得销售服务费的各关联方名称

上年度可比期间

至

当期应支付的销售服务费

融通证券分级

证券 A 基

证券 B 基

融通证券分级

合计

与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：元

本期

2016-01-01 至 2016-06-30

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

上年度可比期间

至

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

注：本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

各关联方投资本基金的情况

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

2016-01-01 至 2016-06-30

上年度可比期间

至

份额级别

融通证券分级

证券 A 基

证券 B 基

融通证券分级

证券 A 基

证券 B 基

基金合同生效日（2015-07-17）持有的基金份额

-----期初持有的基金份额

-----期间申购/买入总份额

-----期间因拆分增加的份额

-减：期间赎回/卖出总份额

-----期末持有的基金份额

-----期末持有的基金份额占基金总份额比例

-----注：本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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

份额单位：份

项目

融通证券分级

本期末

2016-06-30

上年度末

2015-12-31

持有的基金份额

持有的基金份额占基金总份额的比例

持有的基金份额

持有的基金份额占基金总份额的比例

新时代证券股份有限公司

1,327,392.23

0.072300

--项目

证券 A 基

本期末

2016-06-30

上年度末

2015-12-31

持有的基金份额
持有的基金份额占基金总份额的比例
持有的基金份额
持有的基金份额占基金总份额的比例
项目
证券 B 基
本期末
2016-06-30
上年度末
2015-12-31
持有的基金份额
持有的基金份额占基金总份额的比例
持有的基金份额
持有的基金份额占基金总份额的比例
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：

关联方名称
本期
2016-01-01 至 2016-06-30

上年度可比期间
至

期末余额
当期利息收入
期末余额
当期利息收入
中国建设银行
16,124,537.87

182,085.76

--注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

单位：元

本期
2016-01-01 至 2016-06-30

关联方名称
证券代码
证券名称
发行方式
基金在承销期内买入
数量（单位：股/张）
总金额
上年度可比期间
至
关联方名称
证券代码

证券名称

发行方式

基金在承销期内买入

数量（单位：股/张）

总金额

注：1、本基金本报告期未买入管理人、托管人的控股股东在承销期内担任副主承销商或分销商所承销的证券；

2、本基金本报告期未买入管理人、托管人的主要股东（非控股）在承销期内承销的证券。

其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项的说明。

利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

期末（2016-06-30）本基金持有的流通受限证券

因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：元

受限证券类别：股票

证券代码

证券名称

成功认购日

可流通日

流通受限类型

认购价格

期末估值单价

数量（单位：股）

期末成本总额

期末估值总额

备注

受限证券类别：债券

证券代码

证券名称

成功认购日

可流通日

流通受限类型

认购价格

期末估值单价

数量（单位：股）

期末成本总额

期末估值总额

备注

注：本基金本期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：元

股票代码

股票名称

停牌日期
停牌原因
期末估值单价
复牌日期
复牌开盘单价
数量（股）
期末成本总额
期末估值总额
备注

000728

国元证券

2016-06-08

临时停牌

16.72

2016-07-08

17.37

288,753

5,951,719.28

4,827,950.16

-注：本基金截至 2016 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时

停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

期末债券正回购交易中作为抵押的债券

银行间市场债券正回购

-金额单位：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

注：本基金本报告期末无银行间市场债券正回购，因此没有在银行间市场债券正回购交易中

作为抵押的债券。

交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购，因此没有在交易所市场债券正回购交易中作为

抵押的债券。

金融工具风险及管理

-风险管理政策和组织架构

本基金为股票型基金，具有较高预期风险、较高预期收益的特征。本基金采用完全复制法进

行投资，按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股

及其权重的变动对投资组合进行相应调整。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。本基金的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，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。本基金在严格控制风险的基础上，追求基金资产的长期稳定增值。

本基金的基金管理人奉行建设全面风险管理体系、风控优先的政策，在董事会下设立合规与审计委员会，负责检查公司合规运作的状况及合规控制的有效性，并对公司的合规控制提出相关要求；在管理层层面设立风险控制委员会，负责建立健全公司的风险管理制度并组织实施，审定公司的业务风险管理政策，审定公司内控管理组织实施方案，审定公司的业务授权方案，审定基金资产组合的风险状况评价分析报告，审定公司各项风险与内控状况评价报告，审定业务风险损失责任人的责任，审定重大业务可行性风险论证，协调突发性重大风险事件的处理；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，具有根据业务特点控制业务风险的职责。业务人员是风险控制环节的第一责任人，部门负责人是控制业务风险管理的第一责任人，对部门风险控制措施的实施情况进行管理；风险管理小组由投资经理、金融工程人员和研究员组成，负责制定相关业务风险的识别和度量方法，指导业务部门实施风险的管理和控制，并定期出具投资组合风险报告，进行投资风险分析与绩效评估；督察长和监察稽核部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，确保既定的风险控制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。

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。

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同责任，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行中国建设银行，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。

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。

于 2016 年 6 月 30 日，本基金未持有债券投资。

按短期信用评级列示的债券投资

单位：元

短期信用评级

本期末

2016-06-30

上年度末

2015-12-31

A-1

--A-1 以下

--未评级

--合计

--按长期信用评级列示的债券投资

单位：元

长期信用评级

本期末

2016-06-30

上年度末

2015-12-31

AAA

--AAA 以下

--未评级

--合计

--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。

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独立的风险管理部门设定流动性

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。本基金持有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%。本基

金所持全部证券在证券交易所上市，因此除附注 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，其余均能以合理价格适时变现。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投资的公允价

值。

于 2016 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约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(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现

的合约到期现金流量。

金融资产和金融负债的到期期限分析

单位：元

本期末

2016-06-30

合计

资产

资产总计

-负债

负债总计

-流动性净额

-上年度末

2015-12-31

合计

资产

资产总计

-负债

负债总计

-流动性净额

-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。

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。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。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现

金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、

结算备付金和存出保证金等。

利率风险敞口

单位：元

本期末

2016-06-30

1 年以内

不计息

合计

资产

银行存款

16,124,537.87

-16,124,537.87

存出保证金

463,698.73

-463,698.73

交易性金融资产

-194,861,795.85

194,861,795.85

应收证券清算款

-2,973,111.52

2,973,111.52

应收利息

-3,094.07

3,094.07
应收申购款
-177,234.98
177,234.98
其他资产
---资产总计
16,588,236.60
198,015,236.42
214,603,473.02
应付赎回款
-8,140,977.19
8,140,977.19
应付管理人报酬
-179,694.18
179,694.18
应付托管费
-39,532.72
39,532.72
应付交易费用
-123,741.40
123,741.40
其他负债
-180,147.13
180,147.13
负债总计
-8,664,092.62
8,664,092.62
利率敏感度缺口
16,588,236.60
189,351,143.80
205,939,380.40
上年度末
2015-12-31
1 年以内
不计息
合计
资产
银行存款
50,827,277.29
-50,827,277.29
结算备付金
3,472,736.69
-3,472,736.69
存出保证金

156,994.40
-156,994.40
交易性金融资产
-
706,425,593.05
706,425,593.05
应收利息
-14,503.71
14,503.71
应收申购款
-593,672.74
593,672.74
资产总计
54,457,008.38
707,033,769.50
761,490,777.88
应付赎回款
-49,912.92
49,912.92
应付管理人报酬
-592,108.05
592,108.05
应付托管费
-130,263.81
130,263.81
应付交易费用
-668,757.54
668,757.54
其他负债
-141,492.43
141,492.43
负债总计
-1,582,534.75
1,582,534.75
利率敏感度缺口
54,457,008.38
705,451,234.75
759,908,243.13
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。
利率风险的敏感性分析
假设
-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：元）

本期末

2016-06-30

上年度末

2015-12-31

注：于 2016 年 6 月 30 日，本基金未持有债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净

值无重大影响。

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。

外汇风险敞口

单位：元

项目

本期末

2016-06-30

美元折合人民币

港币折合人民币

其他币种折合人民币

合计

以外币计价的资产

资产合计

----以外币计价的负债

负债合计

----资产负债表外汇风险敞口净额

----项目

上年度末

2015-12-31

美元折合人民币

港币折合人民币

其他币种折合人民币

合计

以外币计价的资产

资产合计

----以外币计价的负债

负债合计

----资产负债表外汇风险敞口净额

----外汇风险的敏感性分析

假设

-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：元）

本期末

2016-06-30

上年度末

2015-12-31

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的股票，

所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源

于证券市场整体波动的影响。

本基金采用完全复制法进行投资，按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，

并根据标的指数成份股及其权重的变动对投资组合进行相应调整。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金的股票资产投资比例不低于基金资

产的 90%，其中投资于中证全指证券公司指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金

资产的 80%，权证投资占基金资产净值的比例为 0% - 3%，现金或到期日在一年以内的政府

债券不低于基金资产净值的 5%。此外，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，包括 VaR(Value at Risk)指标等来

测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

其他价格风险敞口

金额单位：元

项目

本期末

2016-06-30

上年度末

2015-12-31

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

194,861,795.85

94.62

706,425,593.05

92.96

交易性金融资产—基金投资

----交易性金融资产—债券投资

----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

194,861,795.85

94.62

706,425,593.05

92.96

其他价格风险的敏感性分析

假设

-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：元）

本期末

2016-06-30

上年度末

2015-12-31

其他价格风险的敏感性分析 A

假设

-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：元）

本期末

2016-06-30

上年度末

2015-12-31

其他价格风险的敏感性分析 B

假设

-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：元）

本期末

2016-06-30

上年度末

2015-12-31

其他价格风险的敏感性分析 C

假设

-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：元）

本期末

2016-06-30

上年度末

2015-12-31

注：于 2016 年 6 月 30 日，本基金成立尚未满一年，无足够历史经验数据计算其他价格风险

对基金资产净值的影响。

采用风险价值法管理风险

-假设

--分析

风险价值（金额单位：元）

本期末

2016-06-30

上年度末

2015-12-31

有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

期末基金资产组合情况

金额单位：元

序号

项目

金额（元）

占基金总资产的比例（%）

1

权益类投资

194,861,795.85

90.80

其中：股票

194,861,795.85

90.80

2

固定收益投资

--其中：债券

--资产支持证券

--3

贵金属投资

--4

金融衍生品投资

--

5

买入返售金融资产

--其中：买断式回购的买入返售金融资产

--6

银行存款和结算备付金合计

16,124,537.87

7.51

7

其他各项资产

3,617,139.30

1.69

8

合计

214,603,473.02

100.00

报告期末按行业分类的股票投资组合

积极投资按行业分类的股票投资组合

金额单位：元

序号

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

--C

制造业

--D

电力、热力、燃气及水生产和供应业

--E

建筑业

--F

批发和零售业

--G

交通运输、仓储和邮政业

--H

住宿和餐饮业

--I

信息传输、软件和信息技术服务业

--J

金融业

--K

房地产业

--L

租赁和商务服务业

--M

科学研究和技术服务业

--N

水利、环境和公共设施管理业

--O

居民服务、修理和其他服务业

--P

教育

--Q

卫生和社会工作

--R

文化、体育和娱乐业

--S

综合类

--合计

--注：本基金本报告期末无积极投资部分的股票。

指数投资按行业分类的股票投资组合

金额单位：元

序号

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

--C

制造业

--D

电力、热力、燃气及水生产和供应业

--E

建筑业

--

F

批发和零售业

--G

交通运输、仓储和邮政业

--H

住宿和餐饮业

--I

信息传输、软件和信息技术服务业

--J

金融业

194,861,795.85

94.62

K

房地产业

--L

租赁和商务服务业

--M

科学研究和技术服务业

--N

水利、环境和公共设施管理业

--O

居民服务、修理和其他服务业

--P

教育

--

Q

卫生和社会工作

--R

文化、体育和娱乐业

--S

综合类

--合计

194,861,795.85

94.62

报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

金额单位：元

行业类别

公允价值（元）

占基金资产净值比例（%）

期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：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

600030

中信证券

1,739,701

28,235,347.23

13.71

2

600837

海通证券

1,791,360

27,622,771.20

13.41

3

601688

华泰证券

728,853

13,789,898.76
6.70
4
600999
招商证券
642,300
10,597,950.00
5.15
5
000776
广发证券
632,264
10,596,744.64
5.15
6
601377
兴业证券
1,179,178
8,714,125.42
4.23
7
000783
长江证券
736,788
8,546,740.80
4.15
8
000166
申万宏源
969,537
8,153,806.17
3.96
9
601901
方正证券
909,152
6,964,104.32
3.38
10
002673
西部证券
264,928
6,851,038.08
3.33

11
601211
国泰君安
359,284
6,391,662.36
3.10
12
601555
东吴证券
472,526
6,331,848.40
3.07
13
601099
太平洋
1,030,453
6,316,676.89
3.07
14
600109
国金证券
400,642
5,400,654.16
2.62
15
000728
国元证券
288,753
4,827,950.16
2.34
16
002736
国信证券
274,830
4,740,817.50
2.30
17
600369
西南证券
635,929
4,616,844.54
2.24
18
601788

光大证券
256,799
4,350,175.06
2.11
19
002500
山西证券
254,355
4,212,118.80
2.05
20
000686
东北证券
298,811
3,857,650.01
1.87
21
600958
东方证券
226,750
3,811,667.50
1.85
22
000750
国海证券
484,363
3,579,442.57
1.74
23
601198
东兴证券
117,681
2,876,123.64
1.40
24
000712
锦龙股份
106,389
2,208,635.64
1.07
25
600061
国投安信
71,100

1,267,002.00

0.62

期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：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（%）

注：本基金本报告期末无积极投资部分的股票。

报告期内股票投资组合的重大变动

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：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

600030

中信证券

91,465,453.47

12.04

2

600837

海通证券

89,003,897.24

11.71

3

600999

招商证券

45,188,188.18

5.95

4

601099

太平洋

44,547,270.92

5.86

5

000166

申万宏源

38,348,736.51

5.05

6
601688
华泰证券
37,405,591.72
4.92
7
000783
长江证券
34,270,470.10
4.51
8
000776
广发证券
33,241,045.15
4.37
9
601377
兴业证券
32,756,571.92
4.31
10
601211
国泰君安
21,190,103.22
2.79
11
002673
西部证券
20,450,560.35
2.69
12
601555
东吴证券
18,174,783.69
2.39
13
601901
方正证券
17,739,475.97
2.33
14
600369
西南证券
17,686,883.00

2.33
15
600109
国金证券
17,613,124.05

2.32
16
000728
国元证券
15,345,718.94

2.02
17
601788
光大证券
15,165,415.91

2.00
18
600958
东方证券
15,135,768.02

1.99
19
002736
国信证券
14,366,040.46

1.89
20
000686
东北证券
11,696,022.34

1.54

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。

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：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

600030
中信证券
159,312,253.57

20.96
2
600837
海通证券
147,439,980.59
19.40
3
600999
招商证券
70,763,824.88
9.31
4
601688
华泰证券
63,499,479.25
8.36
5
000166
申万宏源
56,715,003.39
7.46
6
000776
广发证券
55,366,721.80
7.29
7
601377
兴业证券
53,359,301.52
7.02
8
000783
长江证券
49,550,142.18
6.52
9
601099
太平洋
36,762,381.49
4.84
10
601211
国泰君安

33,870,608.60

4.46

11

601901

方正证券

33,447,175.87

4.40

12

002673

西部证券

31,512,241.26

4.15

13

601555

东吴证券

31,092,336.49

4.09

14

600109

国金证券

29,012,374.83

3.82

15

600369

西南证券

27,948,468.70

3.68

16

600958

东方证券

25,774,900.87

3.39

17

601788

光大证券

25,267,076.74

3.33

18

000728

国元证券

24,587,246.35

3.24

19

002736

国信证券
23,007,224.46

3.03

20

000686

东北证券

18,102,639.83

2.38

21

000750

国海证券

16,590,342.36

2.18

22

002500

山西证券

15,346,753.26

2.02

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。

买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：元

买入股票成本（成交）总额

673,392,083.05

卖出股票收入（成交）总额

1,058,159,301.35

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。

期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：元

序号

债券品种

公允价值（元）

占基金资产净值比例（%）

1

国家债券

--2

央行票据

--3

金融债券

-

-其中：政策性金融债

--4

企业债券

--5

企业短期融资券

--6

中期票据

--7

可转债（可交换债）

--8

同业存单

--9

其他

--10

合计

--注：本基金本报告期末未持有债券。

期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

金额单位：元

序号

债券代码

债券名称

数量（张）

公允价值（元）

占基金资产净值比例（%）

注：本基金本报告期末未持有债券。

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：元

序号

证券代码

证券名称

数量（份）

公允价值（元）

占基金资产净值比例（%）

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

金额单位：元

序号

贵金属代码

贵金属名称

数量（份）

公允价值（元）

占基金资产净值比例（%）

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

金额单位：元

序号

权证代码

权证名称

数量（份）

公允价值（元）

占基金资产净值比例（%）

注：本基金本报告期末未持有权证。

报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码

名称

持仓量（买/卖）

合约市值(元)

公允价值变动(元)

风险说明

公允价值变动总额合计(元)

-股指期货投资本期收益(元)

-股指期货投资本期公允价值变动(元)

-本基金本报告期末未持有股指期货。

本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

代码

名称

持仓量（买/卖）

合约市值(元)

公允价值变动(元)

风险指标说明

公允价值变动总额合计(元)

-国债期货投资本期收益（元）

-国债期货投资本期公允价值变动(元)

-本基金本报告期末未持有国债期货。

本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

投资组合报告附注

受到调查以及处罚情况

1、海通证券

2015年9月10日，海通证券股份有限公司收到中国证监会行政处罚事先告知书（处罚字【2015】73号），拟对公司采取责令改正，给予警告，没收违法所得28,653,000元，并处以

85,959,000元罚款。

2、华泰证券

2015年9月10日，公司收到中国证券监督管理委员会《行政处罚事先告知书》（处罚字

[2015]72号），拟对公司采取责令改正，给予警告，没收违法所得 18,235,275.00 元，并处以 54,705,825.00 元罚款。

3、广发证券

2015年9月10日，公司收到中国证监会《行政处罚事先告知书》（处罚字[2015]71号），拟

对公司采取责令整改，给予警告，没收违法所得 6,805,135.75 元，并处以 20,415,407.25 元罚款。

4、方正证券

9月10日，公司收到中国证监会《行政处罚事先告知书》（处罚字[2015]74号），拟对公司

采取责令改正，给予警告，没收违法所得 8,717,089.13 元，并处以 17,434,178.26 元罚款。

5、兴业证券

2016年6月12日，兴业证券股份有限公司（以下简称“公司”）收到中国证券监督管理委员会

（以下简称“中国证监会”）调查通知书（沈稽查调查通字 16005号），因公司涉嫌未按

规定履行法定职责，根据《中华人民共和国证券法》的有关规定，中国证监会决定对公司立

案调查。

本基金依照法律法规及基金合同的约定，采取指数化投资策略，紧密跟踪标的指数。

申明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

本基金投资的前十名股票未超出本基金合同规定的备选股票库。

期末其他各项资产构成

单位：元

序号

名称

金额（元）

1

存出保证金

463,698.73

2

应收证券清算款

2,973,111.52

3

应收股利

-4

应收利息

3,094.07

5

应收申购款

177,234.98

6

其他应收款

-7

待摊费用

-8

其他

-9

合计

3,617,139.30

期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：元

序号

债券代码

债券名称

公允价值

占基金资产净值比例（%）

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：元

序号

股票代码

股票名称

流通受限部分的公允价值（元）

占基金资产净值比例（%）

流通受限情况说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：元

序号

股票代码

股票名称

流通受限部分的公允价值（元）

占基金资产净值比例（%）

流通受限情况说明

注：本基金本报告期末无积极投资部分的股票。

投资组合报告附注的其他文字描述部分

-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。

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）基金管理人的重大变动

本报告期内基金管理人无重大人事变更。

（2）本报告期基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

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。

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。

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。

改聘会计师事务所情况

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），该事务所自本基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金的基金管理人、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。

基金租用证券公司交易单元的有关情况

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：元

券商名称

交易单元数量

股票交易

基金交易

债券交易

债券回购交易

权证交易

应支付该券商的佣金

备注

成交金额

占当期比例

成交金额

占当期比例

成交金额

占当期比例

成交金额

占当期比例

成交金额

占当期比例

成交金额

占当期比例

兴业证券

1

1,136,503,138.60

65.63%

--%

--%

--%

--%

1,058,422.89

66.04%

-长江证券

1

168,228,743.61

9.72%

--%

--%

--%

--%

153,308.60

9.57%

-国信证券

1

126,256,142.77

7.29%

--%

--%

--%

--%

115,058.59

7.18%

-中信证券

1

120,938,148.49

6.98%

--%

--%

--%

--%

110,212.94

6.88%

-华泰证券

1

46,991,745.97

2.71%

--%

--%

--%

--%

42,823.67

2.67%

-广发证券

1

42,663,646.26

2.46%

--%

--%

--%
--%
39,732.06
2.48%
-国金证券
1
34,682,091.38
2.00%
--%
--%
--%
--%
32,299.46
2.02%
-国泰君安
1
22,729,197.89
1.31%
--%
--%
--%
--%
21,167.94
1.32%
-中金公司
2
15,910,706.12
0.92%
--%
--%
--%
--%
14,499.75
0.90%
-方正证券
1
8,849,682.71
0.51%
--%
--%
--%
--%
8,064.74
0.50%

-安信证券

2

7,798,140.60

0.45%

--%

--%

--%

--%

7,106.64

0.44%

-财达证券

1

--%

--%

--%

--%

--%

--%

--%

-第一创业

1

--%

--%

--%

--%

--%

--%

--%

--%

--%

--%

--%

--%

--%

--%

--%

--%

--%

--%

--%

--%

--%

--%

--%

--%

--%

--%

--%

--%

--%

--%

东方证券

1

--%

--%

--%

--%

--%

--%

--%

--%

--%

--%

--%

--%

--%

-东吴证券

1

--%

--%

--%

--%

--%

--%

-高华证券

1

--%

--%

--%

--%

--%

--%

-国海证券

2

--%

--%

--%

--%

--%

--%

-恒泰证券

2

--%

--%

--%

--%

--%

--%

-华宝证券

1

--%

--%

--%

--%

--%

-

--%

-华创证券

1

--%

--%

--%

--%

--%

--%

-民生证券

1

--%

--%

--%

--%

--%

--%

-平安证券

2

--%

--%

--%

--%

--%

--%

-瑞银证券

1

--%

--%

--%

--%

--%

--%

-上海证券

1

--%

--%

--%

--%

--%

--%

-申万宏源

1

--%

--%

--%

--%

-

--%

--%

-申万宏源西部

1

--%

--%

--%

--%

--%

--%

-西南证券

1

--%

--%

--%

--%

--%

--%

-新时代证券

1

--%

--%

--%

--%

--%

--%

--%

-信达证券

2

--%

--%

--%

--%

--%

--%

-银河证券

1

--%

--%

--%

--%

--%

--%

-招商证券

1

--%

--%

--%

-

-%

--%

--%

-中投证券

1

--%

--%

--%

--%

--%

--%

-中信建投

1

--%

--%

--%

--%

--%

--%

-中银国际

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

以下六个方面：

- 1) 资力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币；
- 2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- 3) 经营行为规范，最近两年未因重大违规行为而受到中国证监会和中国人民银行处罚；
- 4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- 5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的 需要，并能为本基金提供全面的信息服务；
- 6) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询 服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告及其他专门报告，并能

根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告。

（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) 券商服务评价;
- 2) 拟定租用对象。由研究部根据以上评价结果拟定备选的券商;
- 3) 上报批准。研究部将拟定租用对象上报分管副总经理批准;
- 4) 签约。在获得批准后, 按公司签约程序代表公司与确定券商签约。

(3) 交易单元变更情况

本报告期内, 本基金无交易单元变更。

注: 本基金本报告期无租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况。

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

融通中证全指证券公司指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告
上海证券报、管理人网站

2016-01-27

2

融通中证全指证券公司指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告
上海证券报、管理人网站

2016-01-29

3

融通中证全指证券公司指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告
上海证券报、管理人网站

2016-02-16

4

融通中证全指证券公司指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告
上海证券报、管理人网站

2016-02-24

5

融通基金管理有限公司关于旗下部分基金开通转换业务的公告
上海证券报、管理人网站

2016-02-25

6

融通中证全指证券公司指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告
上海证券报、管理人网站

2016-02-26

7

关于融通中证全指证券公司指数分级证券投资基金办理不定期份额折算业务期间暂停申购、

赎回及定期定额投资业务的公告

上海证券报、管理人网站

2016-03-01

8

融通中证全指证券公司指数分级证券投资基金之融通证券 B 份额不定期份额折算的风险提示公告

上海证券报、管理人网站

2016-03-01

9

融通中证全指证券公司指数分级证券投资基金不定期份额折算公告

上海证券报、管理人网站

2016-03-01

10

关于融通中证全指证券公司指数分级证券投资基金办理不定期份额折算业务期间证券 A 基、

证券 B 基停复牌公告

上海证券报、管理人网站

2016-03-02

11

融通中证全指证券公司指数分级证券投资基金不定期份额折算结果及恢复交易的公告

上海证券报、管理人网站

2016-03-03

12

关于融通中证全指证券公司指数分级证券投资基金不定期份额折算前收盘价调整的公告

上海证券报、管理人网站

2016-03-03

13

融通基金管理有限公司关于参加上海陆金所资产管理有限公司费率优惠活动的公告

上海证券报、管理人网站

2016-03-07

14

融通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增浙江同花顺基金销售有限公司为代销机构并参加其申购费率优惠的公告

上海证券报、管理人网站

2016-03-24

15

融通关于旗下部分开放式基金新增代销机构并参加其申购费率优惠的公告

上海证券报、管理人网站

2016-03-24

16

融通基金管理有限公司关于参加上海陆金所资产管理有限公司费率优惠活动的公告

上海证券报、管理人网站

2016-04-20

17

融通基金管理有限公司关于对通过本公司直销中心赎回公司旗下部分基金的养老金客户实施特定赎回费率的公告

上海证券报、管理人网站

2016-05-09

18

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利得基金销售有限公司为代销机构并参加其申购费率优惠的公告

上海证券报、管理人网站

2016-05-13

19

关于融通基金管理有限公司旗下开放式基金新增奕丰金融服务（深圳）有限公司为代销机构的公告

上海证券报、管理人网站

2016-05-13

20

关于融通基金管理有限公司旗下部分开放式基金在深圳市新兰德证券投资咨询有限公司开通定期定额投资业务及参加基金申购

上海证券报、管理人网站

2016-05-24

21

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好买基金销售有限公司为代销机构并参加其申购费率优惠的公告

上海证券报、管理人网站

2016-06-20

22

关于融通基金管理有限公司旗下开放式基金在上海陆金所资产管理有限公司开通定期定额投资业务并参加其申购费率优惠活动

上海证券报、管理人网站

2016-06-24

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

融通证券分级

2,405

15,009.03

3,924,772.23

10.87%

32,171,939.61

89.13%
证券 A 基
134
550,148.77
68,878,286.00
93.43%
4,841,649.00
6.57%
证券 B 基
2,784
26,479.86
4,647,842.00
6.30%
69,072,093.00
93.70%
合计
5,323
34,479.91
77,450,900.23
42.20%
106,085,681.61

57.80%
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

融通证券分级

0.00

0.0000%

证券 A 基

0.00

0.0000%

证券 B 基

6.56

0.0000%

合计

6.56

0.0000%

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的情况

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
融通证券分级

0

证券 A 基

0

证券 B 基

0

合计

0

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
融通证券分级

0

证券 A 基

0

证券 B 基

0

合计

0

开放式基金份额变动（仅适用于开放式基金）

单位：份

项目

融通证券分级

证券 A 基

证券 B 基

基金合同生效日的基金份额总额

240,398,178.85

--

本报告期期初基金份额总额

51,630,302.04

405,439,734.00

405,439,735.00

本报告期基金总申购份额

1,082,394,029.00

--减：本报告期基金总赎回份额

1,145,994,779.90

--本报告期基金拆分变动份额

48,067,160.70

-331,719,799.00

-331,719,800.00

本报告期期末基金份额总额

36,096,711.84

73,719,935.00

73,719,935.00

注：拆分变动份额为本报告期发生的配对转换份额及不定期折算份额。

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

--%

--%

-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

--%

--%

-影响投资者决策的其他重要信息

-备查文件目录

- (一) 中国证监会批准融通中证全指证券公司指数分级证券投资基金设立的文件
- (二) 《融通中证全指证券公司指数分级证券投资基金基金合同》
- (三) 《融通中证全指证券公司指数分级证券投资基金托管协议》
- (四) 《融通中证全指证券公司指数分级证券投资基金招募说明书》及其定期更新
- (五) 融通基金管理有限公司业务资格批件和营业执照
- (六) 报告期内在指定报刊上披露的各项公告

存放地点

基金管理人、基金托管人处。

查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件，或登陆本基金管理人网站

<http://www.rtfund.com> 查询。