融通深证成份指数证券投资基金

2017 年半年度报告

2017 年 6 月 30 日

基金管理人：融通基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2017 年 8 月 28 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融通深证成份指数证券投资基金（以下简称“本基金”）基金合同规定，于 2017 年 8 月 22 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 2017 年 1 月 1 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 6

2.1 基金基本情况 6

2.2 基金产品说明 6

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 7

§4 管理人报告 8

4.1 基金管理人及基金经理情况 8

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 10

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 10

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 10

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 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

§5 托管人报告 11

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 11

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 12

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 12

§6 半年度财务会计报告（未经审计） 12

6.1 资产负债表 12

6.2 利润表 13

6.3 所有者权益（基金净值）变动表 14

6.4 报表附注 15
§7 投资组合报告 31
7.1 期末基金资产组合情况 31
7.2 期末按行业分类的股票投资组合 32
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 33
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 48
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 48
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 48
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 48
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 48
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 48
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 48
7.12 投资组合报告附注 49
§8 基金份额持有人信息 49
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 49
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 50
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的情况 50
§9 开放式基金份额变动 50
§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 基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动 51
10.4 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 51
10.5 基金投资策略的改变 51
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况 51
10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 51
10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况 51
10.9 其他重大事件 52
§11 备查文件目录 54

11.1 备查文件目录 54
11.2 存放地点 54
11.3 查阅方式 54

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	融通深证成份指数证券投资基金
基金简称	融通深证成份指数
基金主代码	161612
前端交易代码	161612
后端交易代码	161662
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010 年 11 月 15 日
基金管理人	融通基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	185,393,262.77 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采取完全复制方法进行指数化投资，通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段，力争将本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪误差控制在 0.35%以内，年化跟踪误差控制在 4%以内，以实现对深证成份指数的有效跟踪。
投资策略	本基金为被动式指数基金，原则上采用完全复制指数的投资策略，按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整，力争实现基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪误差控制在 0.35%以内、年化跟踪误差控制在 4%的投资目标。
业绩比较基准	深证成份指数收益率×95% + 银行活期存款利率×5%
风险收益特征	本基金为股票型指数基金，属于高风险高收益的基金品种，其收益和风险均高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		融通基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	涂卫东	郭明
	联系电话	（0755）26948666	（010）66105799
	电子邮箱	service@mail.rtfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-883-8088、（0755）26948088	95588
传真		（0755）26935005	（010）66105798
注册地址		深圳市南山区华侨城汉唐大厦 13、14 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		深圳市南山区华侨城汉唐大厦 13、14 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		518053	100140
法定代表人		高峰	易会满

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.rtfund.com
基金半年度报告备置地点	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	深圳市南山区华侨城汉唐大厦 13、14 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(2017 年 1 月 1 日 - 2017 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-3,936,462.70
本期利润	8,965,087.51
加权平均基金份额本期利润	0.0469
本期加权平均净值利润率	5.65%
本期基金份额净值增长率	5.51%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-25,729,346.65
期末可供分配基金份额利润	-0.1388
期末基金资产净值	159,663,916.12
期末基金份额净值	0.861
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-12.82%

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）。

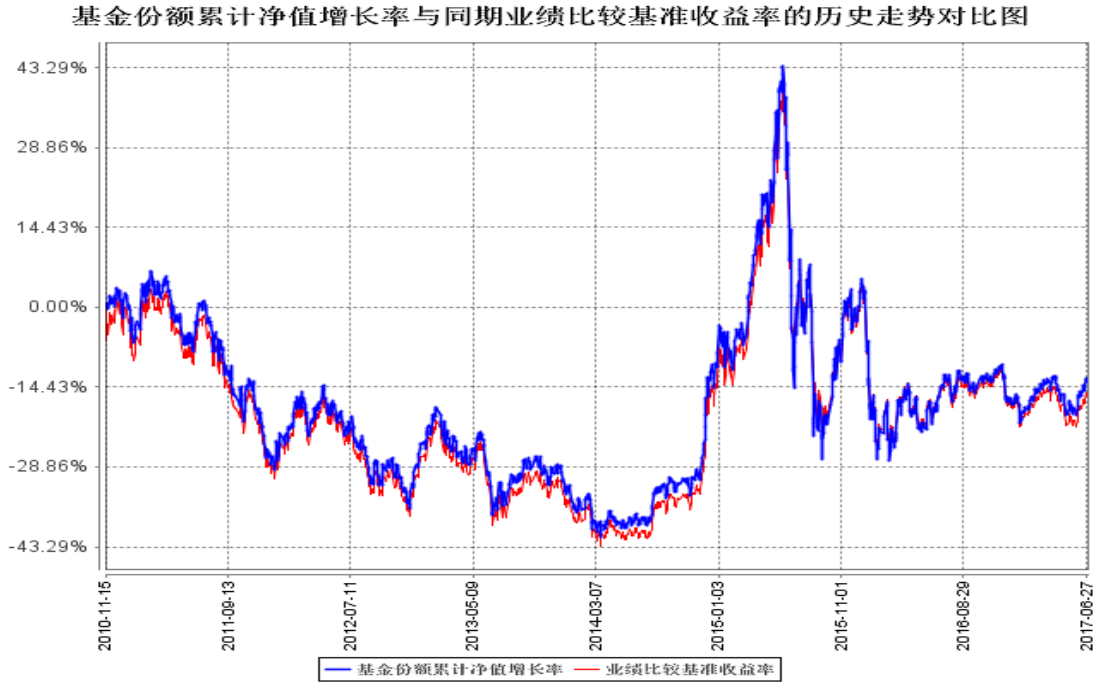
3.2 基金净值表现

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	6.82%	0.79%	6.40%	0.79%	0.42%	0.00%
过去三个月	1.89%	0.85%	0.93%	0.83%	0.96%	0.02%
过去六个月	5.51%	0.80%	3.32%	0.79%	2.19%	0.01%
过去一年	3.73%	0.85%	0.42%	0.84%	3.31%	0.01%
过去三年	40.63%	1.99%	41.88%	1.87%	-1.25%	0.12%
自基金合同生效起至今	-12.82%	1.65%	-15.44%	1.59%	2.62%	0.06%

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



§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：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 2017 年 6 月 30 日，公司共管理六十六只开放式基金：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、融通可转债债券基金、融通通泰保本混合基金、融通通泽混合基金、融通通福债券基金（LOF）、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、融通新区域新经济混合基金、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、融通中证大农业指数基金（LOF）、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、融通新消费混合基金、融通增丰债券基金、融通通安债券基金、融通通优债券基金、融通通乾研究精选混合基金、融通新趋势混合基金、融通通景混合基金、融通国企改革新机遇混合基金、融通通尚混合基金、融通新优选混合基金、融通通裕债券基金、融通通和债券基金、融通沪港深智慧生活混合基金、融通现金宝货币市场基金、融通通祺债券基金、融通稳利债券基金、融通通宸债券基金、融通通玺债券基金和融通通穗债券基金、融通通弘债券基金、融通通润债券基金、融通通颐定期开放债券基金、融通人工智能指数基金（LOF）。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。

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		
蔡志伟	本基金的基金经理	2016 年 11 月 19 日	-	6	蔡志伟先生，华南师范大学计算机硕士、广州大学计算机学士，金融风险管理师（FRM），6 年证券投资从业经历，具有基金从业资格。曾就职于汇丰软件开发广东有限公司任高级软件工程师(SSE)。2011 年 6 月加入融通基金管理有限公司，历任风险管理专员、金融工程研究员，现任融通巨潮 100 指数(LOF)、融通深证成份指数、融通创业板指数基金的基金经理。
李勇	本基金的基金经理	2010 年 11 月 15 日	2017 年 1 月 7 日	12	李勇先生，厦门大学经济学硕士、安徽大学数学学士，12 年证券投资从业经历，具有基金从业资格。2005 年 1 月入职融通基金管理有限公司，历任金融工程研究员、基金经理助理职务。现任融通深证成份指数、融通创业板指数、融通巨潮 100 指数 (LOF)基金的基金经理。

注：任免日期根据基金管理人对外披露的任免日期填写；证券从业年限以从事证券业务相关

工作的时间为计算标准。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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，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）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

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

4.4.2 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 0.861 元；本报告期基金份额净值增长率为 5.51%，业绩比较基准收益率为 3.32%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

回顾 2017 年上半年，全球经济在不同程度上第一次呈现出同步复苏的态势，欧洲、英国经济好于预期，而美国经济弱于预期。国内经济受益于全球经济弱复苏，出口得以改善，同时在供给侧改革政策有力执行的情况下，资源品价格上涨带动了工业的恢复，房地产去库存带动了房地产的景气，支撑了中国经济好于预期。

展望下半年，中国经济可能在四季度之后有所回落，但总体幅度不深、斜率不陡。下行力量来自去库存、房地产调控、金融去杠杆、财政整顿等，支撑力量来自出口复苏和制造业投资恢复等。在中国经济长期 L 型，经济波动幅度收敛的格局下，证券市场风险偏好企稳回升，预计市场

将震荡上行。震荡市场中业绩为王，今年以来上证 50 创 16 年以来新高，而创业板创出新低，市场呈现两极分化的格局，根本原因在于盈利趋势的变化，根据已披露的创业板业绩预告测算，创业板业绩增速持续回落。因此，震荡市中本基金将积极投资于行业景气度上行，同时盈利确定性高的龙头价值型企业，以及成长性优异的企业。

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。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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配，符合法律法规和基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万的情形。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对融通深证成份指数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，融通深证成份指数证券投资基金的管理人——融通基金管理有限公司在融通深证成份指数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，融通深证成份指数证券投资基金未进行利润分配。

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

本托管人依法对融通基金管理有限公司编制和披露的融通深证成份指数证券投资基金 2017 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：融通深证成份指数证券投资基金

报告截止日： 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	8,829,269.80	10,323,801.72
结算备付金		18,940.56	-
存出保证金		3,169.30	2,089.24
交易性金融资产	6.4.7.2	151,664,664.18	148,526,535.77
其中：股票投资		151,664,664.18	148,526,535.77
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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	1,475.91	2,086.33
应收股利		-	-
应收申购款		44,372.47	96,299.55
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		160,561,892.22	158,950,812.61
负债和所有者权益	**附注号**	**本期末 2017 年 6 月 30 日**	**上年度末 2016 年 12 月 31 日**

负 债：			
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		-	-
应付证券清算款		98.93	-
应付赎回款		652,159.09	17,686.07
应付管理人报酬		128,434.87	137,609.98
应付托管费		25,686.98	27,522.01
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	12,496.24	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	79,099.99	60,072.46
负债合计		897,976.10	242,890.52
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	185,393,262.77	194,606,497.03
未分配利润	6.4.7.10	-25,729,346.65	-35,898,574.94
所有者权益合计		159,663,916.12	158,707,922.09
负债和所有者权益总计		160,561,892.22	158,950,812.61

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.861 元，基金份额总额 185,393,262.77 份。

6.2 利润表

会计主体：融通深证成份指数证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
一、收入		10,052,541.10	-32,463,482.33
1.利息收入		30,899.70	41,013.80
其中：存款利息收入	6.4.7.11	30,899.70	41,013.80
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		-2,891,681.42	-2,654,358.31
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-3,851,132.06	-3,573,321.29

基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	959,450.64	918,962.98
3.公允价值变动收益	6.4.7.17	12,901,550.21	-29,873,777.96
4.汇兑收益		-	-
5.其他收入	6.4.7.18	11,772.61	23,640.14
减：二、费用		1,087,453.59	1,089,264.92
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	785,615.56	815,355.66
2．托管费	6.4.10.2.2	157,123.05	163,071.09
3．销售服务费		-	-
4．交易费用	6.4.7.19	73,676.62	26,656.87
5．利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6．其他费用	6.4.7.20	71,038.36	84,181.30
三、利润总额		8,965,087.51	-33,552,747.25
减：所得税费用		-	-
四、净利润		8,965,087.51	-33,552,747.25

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：融通深证成份指数证券投资基金
本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 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）	194,606,497.03	-35,898,574.94	158,707,922.09
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	8,965,087.51	8,965,087.51
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-9,213,234.26	1,204,140.78	-8,009,093.48
其中：1.基金申购款	10,711,137.45	-1,974,499.27	8,736,638.18
2.基金赎回款	-19,924,371.71	3,178,640.05	-16,745,731.66
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-	-
五、期末所有者权益（基	185,393,262.77	-25,729,346.65	159,663,916.12

金净值）			
项目	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 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）	199,246,622.25	2,629,751.50	201,876,373.75
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-33,552,747.25	-33,552,747.25
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	1,988,275.18	-1,289,913.21	698,361.97
其中：1.基金申购款	30,475,139.30	-6,580,648.97	23,894,490.33
2.基金赎回款	-28,486,864.12	5,290,735.76	-23,196,128.36
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-1,979,809.71	-1,979,809.71
五、期末所有者权益（基金净值）	201,234,897.43	-34,192,718.67	167,042,178.76

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：

张帆	颜锡廉	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

融通深证成份指数证券投资基金(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[2010]606 号《关于核准融通深证成份指数证券投资基金募集的批复》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《融通深证成份指数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 1,848,674,651.50 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2010)第 315 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《融通深证成份指数证券投资基金基金合同》于 2010 年 11 月 15 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,848,841,553.44 份基金份额，其中认购资金利息折合 166,901.94 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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《融通深证成份指数证券投资基金基金合同》的

有关规定，本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括标的指数的成份股与备选成份股、新股（一级市场初次发行或增发）、债券以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。投资于指数成份股与备选成份股的资产不低于股票资产的 90%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为：深证成份指数收益率×95% + 银行活期存款利率×5%。

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》、《 融通深证成份指数证券投资基金 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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金的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 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年 1 月 1 日至 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。

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 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 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

根据财政部、国家税务总局财税[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》、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 。

(2)对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

(4)基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

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 2017 年 6 月 30 日
活期存款	8,829,269.80
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	8,829,269.80

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2017 年 6 月 30 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		183,092,485.91	151,664,664.18	-31,427,821.73
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	183,092,485.91	151,664,664.18	-31,427,821.73

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/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

本基金本报告期末各项买入返售金融资产期末余额为零。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无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 2017 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	1,467.00
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	7.65
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	1.26
合计	1,475.91

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	12,496.24
银行间市场应付交易费用	-
合计	12,496.24

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
应付赎回费	2,094.33
预提费用	69,424.36
应付后端申购费	7,581.30
合计	79,099.99

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	194,606,497.03	194,606,497.03
本期申购	10,711,137.45	10,711,137.45
本期赎回	-19,924,371.71	-19,924,371.71
本期末	185,393,262.77	185,393,262.77

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.10 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	73,719,981.27	-109,618,556.21	-35,898,574.94
本期利润	-3,936,462.70	12,901,550.21	8,965,087.51
本期基金份额交易产生的变动数	-3,278,242.27	4,482,383.05	1,204,140.78
其中：基金申购款	3,792,650.76	-5,767,150.03	-1,974,499.27
基金赎回款	-7,070,893.03	10,249,533.08	3,178,640.05
本期已分配利润	-	-	-
本期末	66,505,276.30	-92,234,622.95	-25,729,346.65

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	29,961.71
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	216.78

其他	721.21
合计	30,899.70

注：其他为申购款利息收入和结算保证金收入。

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	27,380,004.08
减：卖出股票成本总额	31,231,136.14
买卖股票差价收入	-3,851,132.06

6.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	959,450.64
基金投资产生的股利收益	-
合计	959,450.64

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	12,901,550.21
——股票投资	12,901,550.21
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-

——权证投资	-
3.其他	-
合计	12,901,550.21

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	11,325.94
转换费分成	446.67
其他	-
合计	11,772.61

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25%归入基金资产。

2. 基金转换收取转换费和补差费，其中转换费的 25%归入转出基金的基金资产。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	73,676.62
银行间市场交易费用	-
合计	73,676.62

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
审计费用	19,835.79
信息披露费	49,588.57
银行费用	114.00
帐户维护费	1,500.00
其他	-
合计	71,038.36

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

截止资产负债表日，本基金无需作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，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	基金管理人、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人、基金销售机构

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

本基金本报告期及上年度可比期间均未租用关联方的交易单元。

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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	785,615.56	815,355.66
其中：支付销售机构的客户维护费	325,910.65	340,447.09

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 1.00%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×1.00% / 当年天数。

2.客户维护费是基金管理人与基金销售机构约定的依据销售机构销售基金的保有量提取一定比例的费用，用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	157,123.05	163,071.09

注：支付基金托管人中国工商银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基金托管费＝前一日基金资产净值×0.20%/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

本基金本报告期及上年度可比期间均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

本报告期内及上年度可比期间，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

本报告期末及上年度末，基金管理人主要股东及其控制的机构均未持有本基金份额。

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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	8,829,269.80	29,961.71	11,745,701.00	40,021.91

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

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）在承销期承销的股票。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金无其他关联交易事项的说明。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内无利润分配。

6.4.12 期末（2017 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

金额单位：人民币元

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
002879	长缆科技	2017-6-5	2017-7-7	新股流通受限	18.02	18.02	1,313	23,660.26	23,660.26	-
002882	金龙羽	2017-6-15	2017-7-17	新股流通受限	6.20	6.20	2,966	18,389.20	18,389.20	-
300670	大烨智能	2017-6-26	2017-7-3	新股流通受限	10.93	10.93	1,259	13,760.87	13,760.87	-
300672	国科微	2017-6-30	2017-7-12	新股流通受限	8.48	8.48	1,257	10,659.36	10,659.36	-
300671	富满电子	2017-6-27	2017-7-5	新股流通受限	8.11	8.11	942	7,639.62	7,639.62	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

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
300104	乐视网	2017-4-17	重大资产重组	28.64	-	-	29,226	730,333.90	837,032.64	-
000100	TCL 集团	2017-4-21	重大事项	3.43	2017-7-26	3.72	204,820	568,421.58	702,532.60	-
000656	金科股份	2017-5-5	重大资产重组	6.54	2017-7-5	5.92	77,700	571,769.66	508,158.00	-
002252	上海莱士	2017-4-21	重大事项	20.24	-	-	22,330	414,124.98	451,959.20	-
000503	海虹控股	2017-5-11	重大资产重组	24.93	-	-	18,000	1,110,765.38	448,740.00	-
002426	胜利精密	2017-1-16	重大事项	7.68	-	-	47,900	415,292.28	367,872.00	-
300088	长信科技	2016-9-12	重大资产重组	14.98	2017-8-9	14.50	23,900	308,967.25	358,022.00	-

002129	中环股份	2016-4-25	重大事项	8.27	-	-	41,700	1,062,794.48	344,859.00	-
000887	中鼎股份	2017-4-27	重大资产重组	22.09	2017-7-14	19.88	15,500	496,504.15	342,395.00	-
002168	深圳惠程	2017-1-23	重大资产重组	16.99	-	-	18,700	252,759.84	317,713.00	-
002049	紫光国芯	2017-2-20	重大资产重组	30.82	2017-7-17	27.74	9,500	399,268.86	292,790.00	-
002075	沙钢股份	2016-9-19	重大资产重组	16.12	-	-	17,300	226,457.00	278,876.00	-
300134	大富科技	2017-2-9	重大资产重组	23.36	-	-	10,300	397,439.00	240,608.00	-
002013	中航机电	2017-5-12	重大事项	10.33	2017-8-2	11.36	22,447	253,389.04	231,877.51	-
300367	东方网力	2016-12-15	重大资产重组	20.63	2017-7-3	18.01	11,150	336,766.42	230,024.50	-
300271	华宇软件	2017-6-22	重大资产重组	16.59	2017-7-4	16.80	11,882	253,212.69	197,122.38	-
300267	尔康制药	2017-5-10	重大事项	11.46	-	-	17,084	261,724.00	195,782.64	-
000034	神州数码	2017-3-21	重大资产重组	24.45	2017-7-18	22.01	7,900	175,512.00	193,155.00	-
002642	荣之联	2017-4-10	重大事项	25.06	2017-7-7	22.54	7,600	269,057.54	190,456.00	-
002025	航天电器	2016-9-12	重大资产重组	24.95	2017-7-4	22.46	7,421	181,039.42	185,153.95	-
002399	海普瑞	2017-4-28	重大事项	20.23	-	-	9,094	245,474.49	183,971.62	-
300291	华录百纳	2017-4-18	重大资产重组	20.02	-	-	9,132	425,352.10	182,822.64	-
000061	农 产 品	2017-6-28	重大事项	9.06	-	-	18,800	405,501.56	170,328.00	-
300098	高新兴	2017-6-22	重大事项	12.90	2017-7-3	13.15	12,000	161,858.00	154,800.00	-
002128	露天煤业	2017-3-17	重大资产重组	8.70	2017-8-14	9.57	17,400	196,659.92	151,380.00	-
002600	江粉磁材	2017-2-27	重大资产重组	11.46	2017-8-9	6.25	13,000	135,175.00	148,980.00	-
300075	数字政通	2017-6-29	重大事项	20.94	2017-7-17	18.86	6,700	181,084.25	140,298.00	-
002358	森源电气	2017-5-12	重大资产重组	17.02	2017-7-12	16.68	8,000	188,024.22	136,160.00	-
300085	银之杰	2017-6-30	重大事项	18.50	2017-7-7	18.88	7,210	271,748.15	133,385.00	-
300364	中文在线	2017-2-13	重大资产重组	33.40	-	-	3,900	174,817.00	130,260.00	-
002505	大康农业	2017-3-13	重大资产重组	3.01	-	-	42,700	139,110.15	128,527.00	-
002625	光启技术	2017-4-12	重大资产重组	36.36	-	-	3,502	180,930.83	127,332.72	-
002610	爱康科技	2017-5-12	重大事项	2.44	2017-8-2	2.44	49,000	160,230.00	119,560.00	-
002010	传化智联	2017-6-30	重大事项	15.26	2017-7-4	16.77	7,600	143,048.29	115,976.00	-
000099	中信海直	2017-5-4	重大资产重组	11.26	-	-	10,281	215,213.63	115,764.06	-

300413	快乐购	2017-4-5	重大资产重组	20.29	-	-	5,700	142,566.00	115,653.00	-
002681	奋达科技	2017-6-22	重大资产重组	12.59	2017-7-3	12.70	8,680	139,386.93	109,281.20	-
002143	印纪传媒	2017-4-18	重大资产重组	24.93	-	-	4,200	104,612.00	104,706.00	-
000693	ST 华泽	2016-3-1	重大事项	12.50	-	-	8,000	106,400.00	100,000.00	-
300276	三丰智能	2017-6-29	重大资产重组	16.50	2017-7-7	16.95	4,601	100,531.85	75,916.50	-
002619	艾格拉斯	2017-5-24	重大资产重组	6.37	-	-	9,540	97,944.00	60,769.80	-

注：本基金截至 2017 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。

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

本基金本报告期末未持有因从事银行间市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

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从事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

本基金是指数型基金。本基金主要投资于标的指数的成份股与备选成份股。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，在董事会下设立风险控制与审计委员会，主要负责公司运行合规性的监督、核查以及公司内外部审计的沟通、监督和核查工作。委员会对董事会负责；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直接责任人，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；风险管理小组由总经理

办公会决定的投资专业人员和金融工程人员组成，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。

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行中国工商银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

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 2017 年 6 月 30 日，本基金无债券投资(2016 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

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%。本基金所持全部证券在证券交易所上市交易，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 2017 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。

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。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、存出保证金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	8,829,269.80	-	-	-	8,829,269.80
结算备付金	18,940.56	-	-	-	18,940.56

存出保证金	3,169.30	-	-	-	3,169.30
交易性金融资产	-	-	-	151,664,664.18	151,664,664.18
应收利息	-	-	-	1,475.91	1,475.91
应收申购款	41,547.74	-	-	2,824.73	44,372.47
资产总计	8,892,927.40	-	-	151,668,964.82	160,561,892.22
负债					
应付证券清算款	-	-	-	98.93	98.93
应付赎回款	-	-	-	652,159.09	652,159.09
应付管理人报酬	-	-	-	128,434.87	128,434.87
应付托管费	-	-	-	25,686.98	25,686.98
应付交易费用	-	-	-	12,496.24	12,496.24
其他负债	-	-	-	79,099.99	79,099.99
负债总计	-	-	-	897,976.10	897,976.10
利率敏感度缺口	8,892,927.40	-	-	150,770,988.72	159,663,916.12
上年度末 2016 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	10,323,801.72	-	-	-	10,323,801.72
存出保证金	2,089.24	-	-	-	2,089.24
交易性金融资产	-	-	-	148,526,535.77	148,526,535.77
应收利息	-	-	-	2,086.33	2,086.33
应收申购款	65,202.40	-	-	31,097.15	96,299.55
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	10,391,093.36	-	-	148,559,719.25	158,950,812.61
负债					
应付赎回款	-	-	-	17,686.07	17,686.07
应付管理人报酬	-	-	-	137,609.98	137,609.98
应付托管费	-	-	-	27,522.01	27,522.01
其他负债	-	-	-	60,072.46	60,072.46
负债总计	-	-	-	242,890.52	242,890.52
利率敏感度缺口	10,391,093.36	-	-	148,316,828.73	158,707,922.09

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

于 2017 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券(2016 年 12 月 31 日：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2016 年 12 月 31 日：同)。

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股票和债券，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。

本基金运用指数化投资方式，通过控制股票投资组合与深证成份指数的跟踪误差，力求实现对深证成份指数的有效跟踪。金融工程小组负责对基金组合的跟踪误差和风险进行评估，定期提交组合跟踪误差和风险监控报告。在跟踪误差超过一定范围时，通知基金经理和相关部门，及时进行投资组合的调整。投资决策委员会根据市场变化对投资组合计划提出风险防范措施。监察稽核部对投资的决策和执行过程进行日常监督。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金股票资产占基金资产的比例为 90%-95%，其中投资深证成份指数成份股及其备选成份股的资产不低于股票资产的 90%；并保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。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。

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 2017 年 6 月 30 日		上年度末 2016 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产-股票投资	151,664,664.18	94.99	148,526,535.77	93.58
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	151,664,664.18	94.99	148,526,535.77	93.58

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除深证成份指数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 （ 2017 年 6 月 30 日 ）	上年度末 （ 2016 年 12 月 31 日 ）
	深证成份指数上升 5%	7,668,584.57	7,937,970.12
	深证成份指数下降 5%	-7,668,584.57	-7,937,970.12

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[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》的规定：(1) 金融商品持有期间(含到期)取得的非保本收益(合同中未明确承诺到期本金可全部收回的投资收益)，不征收增值税；(2) 纳税人购入基金、信托、理财产品等各类资产管理产品持有至到期，不属于金融商品转让；(3) 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。上述政策自 2016 年 5 月 1 日起执行。

此外，根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》及 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，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。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

§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	151,664,664.18	94.46
	其中：股票	151,664,664.18	94.46
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	8,848,210.36	5.51
7	其他资产	49,017.68	0.03
8	合计	160,561,892.22	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	3,562,184.12	2.23
B	采掘业	1,822,626.45	1.14
C	制造业	93,592,319.44	58.62
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,112,054.10	1.32
E	建筑业	3,298,378.04	2.07
F	批发和零售业	3,789,853.99	2.37
G	交通运输、仓储和邮政业	671,232.71	0.42
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	15,819,896.27	9.91
J	金融业	9,492,838.02	5.95
K	房地产业	7,944,629.73	4.98
L	租赁和商务服务业	1,963,841.97	1.23
M	科学研究和技术服务业	137,640.64	0.09
N	水利、环境和公共设施管理业	2,311,219.94	1.45
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,207,446.48	0.76
R	文化、体育和娱乐业	3,110,641.87	1.95
S	综合	390,747.00	0.24
	合计	151,227,550.77	94.72

7.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	100,000.00	0.06
C	制造业	329,473.79	0.21
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	7,639.62	0.00
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	-	-
	合计	437,113.41	0.27

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

7.3.1 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：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	000651	格力电器	118,902	4,895,195.34	3.07
2	000333	美的集团	111,297	4,790,222.88	3.00
3	000725	京东方A	634,998	2,641,591.68	1.65
4	000858	五 粮 液	46,205	2,571,770.30	1.61
5	000002	万　科A	102,800	2,566,916.00	1.61
6	002415	海康威视	74,035	2,391,330.50	1.50
7	300498	温氏股份	91,248	2,138,853.12	1.34
8	000001	平安银行	210,709	1,978,557.51	1.24
9	000063	中兴通讯	58,677	1,392,991.98	0.87
10	002450	康得新	59,857	1,347,979.64	0.84
11	000776	广发证券	75,560	1,303,410.00	0.82
12	002304	洋河股份	13,835	1,201,016.35	0.75
13	002024	苏宁云商	95,805	1,077,806.25	0.68
14	001979	招商蛇口	48,863	1,043,713.68	0.65
15	000538	云南白药	10,942	1,026,906.70	0.64
16	002230	科大讯飞	23,909	953,969.10	0.60
17	000423	东阿阿胶	13,113	942,693.57	0.59
18	000166	申万宏源	160,320	897,792.00	0.56
19	000568	泸州老窖	17,743	897,440.94	0.56
20	002456	欧菲光	48,035	872,795.95	0.55
21	002466	天齐锂业	16,040	871,774.00	0.55
22	002142	宁波银行	44,195	852,963.50	0.53

23	002241	歌尔股份	43,914	846,661.92	0.53
24	002236	大华股份	37,064	845,429.84	0.53
25	000783	长江证券	88,725	840,225.75	0.53
26	300104	乐视网	29,226	837,032.64	0.52
27	000069	华侨城A	80,644	811,278.64	0.51
28	300072	三聚环保	21,609	800,613.45	0.50
29	000338	潍柴动力	59,870	790,284.00	0.50
30	000413	东旭光电	70,200	787,644.00	0.49
31	300059	东方财富	65,276	784,617.52	0.49
32	000625	长安汽车	53,597	772,868.74	0.48
33	002008	大族激光	21,500	744,760.00	0.47
34	300070	碧水源	39,322	733,355.30	0.46
35	300136	信维通信	17,795	712,155.90	0.45
36	000100	TCL 集团	204,820	702,532.60	0.44
37	002594	比亚迪	13,844	691,507.80	0.43
38	002673	西部证券	48,148	684,664.56	0.43
39	000839	中信国安	67,500	674,325.00	0.42
40	300124	汇川技术	26,098	666,542.92	0.42
41	002475	立讯精密	22,600	660,824.00	0.41
42	002202	金风科技	41,350	639,684.50	0.40
43	000768	中航飞机	33,360	615,158.40	0.39
44	300024	机器人	31,025	604,987.50	0.38
45	002736	国信证券	45,600	604,200.00	0.38
46	002460	赣锋锂业	12,700	587,375.00	0.37
47	000895	双汇发展	24,517	582,278.75	0.36
48	300408	三环集团	27,250	571,977.50	0.36
49	002739	万达院线	11,203	571,016.91	0.36
50	000728	国元证券	46,500	568,230.00	0.36
51	000963	华东医药	11,262	559,721.40	0.35
52	002572	索菲亚	13,300	545,300.00	0.34
53	000157	中联重科	119,141	534,943.09	0.34
54	002065	东华软件	23,800	518,602.00	0.32
55	002508	老板电器	11,800	513,064.00	0.32
56	300003	乐普医疗	23,100	510,741.00	0.32
57	000623	吉林敖东	22,215	508,501.35	0.32
58	000656	金科股份	77,700	508,158.00	0.32
59	002007	华兰生物	13,900	507,350.00	0.32
60	002044	美年健康	28,900	491,300.00	0.31
61	002271	东方雨虹	13,129	487,085.90	0.31

62	000540	中天城投	69,100	480,245.00	0.30
63	002085	万丰奥威	24,680	480,026.00	0.30
64	002310	东方园林	28,600	478,192.00	0.30
65	000661	长春高新	3,697	477,319.67	0.30
66	000793	华闻传媒	46,600	471,592.00	0.30
67	000709	河钢股份	112,000	469,280.00	0.29
68	000826	启迪桑德	13,200	463,584.00	0.29
69	300156	神雾环保	14,138	463,160.88	0.29
70	000630	铜陵有色	160,200	454,968.00	0.29
71	002252	上海莱士	22,330	451,959.20	0.28
72	300017	网宿科技	37,443	451,937.01	0.28
73	000503	海虹控股	18,000	448,740.00	0.28
74	000060	中金岭南	39,661	444,203.20	0.28
75	000066	长城电脑	48,928	440,841.28	0.28
76	300315	掌趣科技	53,650	437,784.00	0.27
77	002340	格林美	72,310	437,475.50	0.27
78	002465	海格通信	40,030	429,922.20	0.27
79	000876	新 希 望	51,900	426,618.00	0.27
80	000750	国海证券	76,200	419,100.00	0.26
81	000425	徐工机械	111,100	416,625.00	0.26
82	002405	四维图新	21,000	414,960.00	0.26
83	000559	万向钱潮	36,800	390,816.00	0.24
84	000009	中国宝安	48,300	390,747.00	0.24
85	000997	新 大 陆	17,000	385,730.00	0.24
86	300115	长盈精密	13,049	380,769.82	0.24
87	000402	金 融 街	32,133	376,598.76	0.24
88	000686	东北证券	37,450	376,372.50	0.24
89	300266	兴源环境	12,200	374,784.00	0.23
90	002081	金 螳 螂	34,077	374,165.46	0.23
91	000581	威孚高科	14,316	370,784.40	0.23
92	000998	隆平高科	16,800	369,936.00	0.23
93	000039	中集集团	20,500	369,615.00	0.23
94	000778	新兴铸管	55,100	369,170.00	0.23
95	002074	国轩高科	11,701	369,166.55	0.23
96	002426	胜利精密	47,900	367,872.00	0.23
97	300296	利亚德	19,300	362,840.00	0.23
98	300088	长信科技	23,900	358,022.00	0.22
99	000983	西山煤电	40,006	350,852.62	0.22
100	002092	中泰化学	27,300	346,710.00	0.22

101	002129	中环股份	41,700	344,859.00	0.22
102	000887	中鼎股份	15,500	342,395.00	0.21
103	000786	北新建材	21,496	340,496.64	0.21
104	002385	大北农	54,050	339,974.50	0.21
105	000970	中科三环	22,700	335,506.00	0.21
106	002050	三花股份	20,327	331,736.64	0.21
107	000917	电广传媒	29,300	331,090.00	0.21
108	300027	华谊兄弟	40,533	327,911.97	0.21
109	300144	宋城演艺	15,685	327,345.95	0.21
110	002027	分众传媒	23,100	317,856.00	0.20
111	002168	深圳惠程	18,700	317,713.00	0.20
112	002183	怡 亚 通	36,800	317,584.00	0.20
113	000999	华润三九	9,890	314,007.50	0.20
114	002311	海大集团	17,140	313,147.80	0.20
115	000050	深天马Ａ	15,200	312,664.00	0.20
116	002038	双鹭药业	10,613	309,368.95	0.19
117	002500	山西证券	32,200	308,476.00	0.19
118	002185	华天科技	42,590	308,351.60	0.19
119	002407	多氟多	13,950	306,760.50	0.19
120	002179	中航光电	9,794	305,474.86	0.19
121	300033	同花顺	4,900	304,829.00	0.19
122	000415	渤海金控	45,082	303,401.86	0.19
123	002294	信立泰	8,500	303,110.00	0.19
124	002573	清新环境	16,100	303,002.00	0.19
125	300142	沃森生物	24,500	302,820.00	0.19
126	002366	台海核电	6,400	300,224.00	0.19
127	002410	广联达	15,962	300,085.60	0.19
128	002146	荣盛发展	30,300	299,061.00	0.19
129	300015	爱尔眼科	12,748	296,518.48	0.19
130	000400	许继电气	16,400	294,544.00	0.18
131	002049	紫光国芯	9,500	292,790.00	0.18
132	000488	晨鸣纸业	22,500	290,250.00	0.18
133	002422	科伦药业	17,416	287,712.32	0.18
134	002195	二三四五	39,950	285,642.50	0.18
135	002223	鱼跃医疗	11,910	282,028.80	0.18
136	000566	海南海药	21,200	281,112.00	0.18
137	000878	云南铜业	21,302	280,973.38	0.18
138	002030	达安基因	12,874	280,524.46	0.18
139	300055	万邦达	15,200	279,680.00	0.18

140	002470	金正大	37,068	279,122.04	0.17
141	002075	沙钢股份	17,300	278,876.00	0.17
142	000960	锡业股份	20,400	277,644.00	0.17
143	000028	国药一致	3,387	274,008.30	0.17
144	002273	水晶光电	13,250	273,347.50	0.17
145	000598	兴蓉环境	47,900	269,198.00	0.17
146	300058	蓝色光标	34,322	268,398.04	0.17
147	002583	海能达	16,540	266,128.60	0.17
148	300159	新研股份	20,100	266,124.00	0.17
149	000977	浪潮信息	15,300	264,996.00	0.17
150	300168	万达信息	18,200	264,810.00	0.17
151	300383	光环新网	19,500	264,420.00	0.17
152	000547	航天发展	25,000	261,250.00	0.16
153	300418	昆仑万维	11,400	260,718.00	0.16
154	002051	中工国际	12,514	259,415.22	0.16
155	002384	东山精密	10,500	259,350.00	0.16
156	002400	省广股份	32,169	258,317.07	0.16
157	300146	汤臣倍健	18,800	258,312.00	0.16
158	002217	合力泰	26,000	256,880.00	0.16
159	000046	泛海控股	29,400	256,662.00	0.16
160	000883	湖北能源	51,100	256,522.00	0.16
161	002138	顺络电子	13,800	256,404.00	0.16
162	000671	阳 光 城	43,350	252,297.00	0.16
163	000825	太钢不锈	57,600	250,560.00	0.16
164	002439	启明星辰	13,400	249,240.00	0.16
165	300113	顺网科技	9,230	248,287.00	0.16
166	300355	蒙草生态	23,040	247,449.60	0.16
167	002001	新 和 成	12,742	247,322.22	0.15
168	000792	盐湖股份	23,623	246,860.35	0.15
169	300244	迪安诊断	7,800	245,388.00	0.15
170	002004	华邦健康	31,250	244,687.50	0.15
171	002108	沧州明珠	18,207	243,063.45	0.15
172	000930	中粮生化	22,500	242,550.00	0.15
173	000988	华工科技	16,599	242,179.41	0.15
174	000513	丽珠集团	3,550	241,755.00	0.15
175	300134	大富科技	10,300	240,608.00	0.15
176	002019	亿帆鑫富	14,400	240,192.00	0.15
177	000697	炼石有色	11,700	239,499.00	0.15
178	300197	铁汉生态	17,892	237,605.76	0.15

179	002491	通鼎互联	17,600	236,544.00	0.15
180	000059	华锦股份	23,300	233,233.00	0.15
181	000078	海王生物	38,600	232,758.00	0.15
182	000938	紫光股份	3,800	232,256.00	0.15
183	002013	中航机电	22,447	231,877.51	0.15
184	002714	牧原股份	8,500	231,370.00	0.14
185	002343	慈文传媒	6,100	230,946.00	0.14
186	300367	东方网力	11,150	230,024.50	0.14
187	000627	天茂集团	28,400	229,472.00	0.14
188	000089	深圳机场	24,479	228,878.65	0.14
189	002635	安洁科技	6,300	228,186.00	0.14
190	000738	中航动控	11,651	228,010.07	0.14
191	002221	东华能源	20,894	227,953.54	0.14
192	002640	跨境通	10,700	227,375.00	0.14
193	000758	中色股份	32,238	225,988.38	0.14
194	002078	太阳纸业	30,700	225,645.00	0.14
195	002555	三七互娱	8,800	225,016.00	0.14
196	000732	泰禾集团	13,436	224,112.48	0.14
197	002431	棕榈股份	20,250	223,155.00	0.14
198	002152	广电运通	26,775	222,500.25	0.14
199	002176	江特电机	25,475	222,142.00	0.14
200	300122	智飞生物	11,600	221,676.00	0.14
201	300002	神州泰岳	26,532	221,276.88	0.14
202	000729	燕京啤酒	32,900	221,088.00	0.14
203	300324	旋极信息	12,100	220,704.00	0.14
204	000939	凯迪生态	43,200	220,320.00	0.14
205	000979	中弘股份	83,660	219,189.20	0.14
206	000516	国际医学	39,250	218,622.50	0.14
207	002250	联化科技	15,253	218,117.90	0.14
208	002131	利欧股份	66,150	217,633.50	0.14
209	300203	聚光科技	7,700	216,524.00	0.14
210	002292	奥飞娱乐	12,800	216,320.00	0.14
211	000008	神州高铁	29,700	216,216.00	0.14
212	000006	深振业A	24,500	215,845.00	0.14
213	000800	一汽轿车	21,200	215,604.00	0.14
214	300253	卫宁健康	27,512	214,868.72	0.13
215	002048	宁波华翔	10,300	214,858.00	0.13
216	000806	银河生物	15,900	214,650.00	0.13
217	300014	亿纬锂能	11,775	213,716.25	0.13

218	002701	奥瑞金	33,420	213,553.80	0.13
219	002373	千方科技	15,600	212,784.00	0.13
220	002191	劲嘉股份	22,700	212,472.00	0.13
221	000592	平潭发展	38,100	210,312.00	0.13
222	002424	贵州百灵	11,100	209,346.00	0.13
223	002501	利源精制	18,400	209,208.00	0.13
224	002665	首航节能	28,880	207,936.00	0.13
225	000012	南　玻Ａ	22,100	206,193.00	0.13
226	002624	完美世界	6,000	205,800.00	0.13
227	000031	中粮地产	27,287	205,471.11	0.13
228	000712	锦龙股份	12,500	204,625.00	0.13
229	300077	国民技术	14,900	203,981.00	0.13
230	002353	杰瑞股份	12,851	203,302.82	0.13
231	000898	鞍钢股份	35,500	200,930.00	0.13
232	300090	盛运环保	21,200	200,764.00	0.13
233	002589	瑞康医药	13,010	200,354.00	0.13
234	300274	阳光电源	18,060	200,285.40	0.13
235	300166	东方国信	14,899	200,093.57	0.13
236	000027	深圳能源	29,530	198,736.90	0.12
237	000860	顺鑫农业	9,900	198,099.00	0.12
238	000690	宝新能源	33,100	197,938.00	0.12
239	300271	华宇软件	11,882	197,122.38	0.12
240	300433	蓝思科技	6,774	197,055.66	0.12
241	002411	必康股份	6,800	196,656.00	0.12
242	300182	捷成股份	20,545	196,410.20	0.12
243	000600	建投能源	16,000	196,320.00	0.12
244	300251	光线传媒	23,940	196,068.60	0.12
245	300267	尔康制药	17,084	195,782.64	0.12
246	300133	华策影视	17,460	195,552.00	0.12
247	002444	巨星科技	12,500	194,750.00	0.12
248	000034	神州数码	7,900	193,155.00	0.12
249	000807	云铝股份	26,700	192,774.00	0.12
250	000518	四环生物	25,100	192,015.00	0.12
251	000727	华东科技	67,700	191,591.00	0.12
252	002153	石基信息	8,400	190,932.00	0.12
253	002642	荣之联	7,600	190,456.00	0.12
254	300026	红日药业	40,300	189,813.00	0.12
255	002477	雏鹰农牧	42,800	189,604.00	0.12
256	002368	太极股份	6,800	188,292.00	0.12

257	000519	江南红箭	14,915	187,929.00	0.12
258	300257	开山股份	8,900	187,612.00	0.12
259	002544	杰赛科技	8,200	186,960.00	0.12
260	300068	南都电源	11,100	186,924.00	0.12
261	300079	数码视讯	31,938	186,837.30	0.12
262	000156	华数传媒	12,500	186,375.00	0.12
263	002025	航天电器	7,421	185,153.95	0.12
264	000088	盐 田 港	17,600	184,976.00	0.12
265	002570	贝因美	13,564	184,470.40	0.12
266	002174	游族网络	5,801	184,239.76	0.12
267	002399	海普瑞	9,094	183,971.62	0.12
268	002266	浙富控股	37,600	183,488.00	0.11
269	300291	华录百纳	9,132	182,822.64	0.11
270	002022	科华生物	10,500	182,385.00	0.11
271	000158	常山股份	11,500	181,700.00	0.11
272	002522	浙江众成	11,100	181,485.00	0.11
273	300199	翰宇药业	11,800	181,012.00	0.11
274	300001	特锐德	10,800	181,008.00	0.11
275	002281	光迅科技	8,100	179,982.00	0.11
276	002043	兔 宝 宝	13,000	179,920.00	0.11
277	002630	华西能源	15,500	179,645.00	0.11
278	000685	中山公用	16,400	179,580.00	0.11
279	000926	福星股份	14,600	178,120.00	0.11
280	300020	银江股份	12,800	177,152.00	0.11
281	000667	美好集团	53,510	177,118.10	0.11
282	002603	以岭药业	10,068	175,787.28	0.11
283	002244	滨江集团	25,400	175,768.00	0.11
284	300207	欣旺达	14,902	175,694.58	0.11
285	002672	东江环保	10,400	175,656.00	0.11
286	002643	万润股份	11,900	175,644.00	0.11
287	000829	天音控股	16,200	174,960.00	0.11
288	002390	信邦制药	20,050	174,635.50	0.11
289	300347	泰格医药	7,200	174,240.00	0.11
290	002602	世纪华通	4,800	174,048.00	0.11
291	002104	恒宝股份	18,500	173,715.00	0.11
292	300287	飞利信	18,900	173,502.00	0.11
293	002285	世联行	21,600	173,232.00	0.11
294	002155	湖南黄金	18,045	172,690.65	0.11
295	002595	豪迈科技	7,700	171,171.00	0.11

296	300294	博雅生物	4,150	171,146.00	0.11
297	002261	拓维信息	14,600	170,966.00	0.11
298	000061	农 产 品	18,800	170,328.00	0.11
299	002421	达实智能	27,800	170,136.00	0.11
300	300170	汉得信息	16,500	170,115.00	0.11
301	002018	华信国际	24,780	169,743.00	0.11
302	000687	华讯方舟	11,200	169,568.00	0.11
303	002440	闰土股份	11,100	169,386.00	0.11
304	000021	深科技	19,600	168,168.00	0.11
305	002268	卫 士 通	9,920	166,854.40	0.10
306	002036	联创电子	10,100	166,650.00	0.10
307	000766	通化金马	10,400	166,192.00	0.10
308	000601	韶能股份	23,300	166,129.00	0.10
309	000937	冀中能源	27,115	165,943.80	0.10
310	002489	浙江永强	26,000	165,880.00	0.10
311	002299	圣农发展	11,100	165,057.00	0.10
312	002709	天赐材料	4,000	164,680.00	0.10
313	300009	安科生物	9,970	163,607.70	0.10
314	000718	苏宁环球	27,890	163,435.40	0.10
315	002023	海特高新	15,900	163,293.00	0.10
316	000961	中南建设	24,900	162,348.00	0.10
317	002089	新 海 宜	23,900	161,803.00	0.10
318	002280	联络互动	14,850	161,568.00	0.10
319	300216	千山药机	6,600	161,370.00	0.10
320	000587	金洲慈航	10,800	160,920.00	0.10
321	300185	通裕重工	61,600	160,776.00	0.10
322	000049	德赛电池	3,100	160,611.00	0.10
323	000975	银泰资源	12,700	160,401.00	0.10
324	000848	承德露露	16,060	160,278.80	0.10
325	000901	航天科技	5,900	160,244.00	0.10
326	300118	东方日升	11,400	160,170.00	0.10
327	000959	首钢股份	22,900	160,071.00	0.10
328	300053	欧比特	11,900	160,055.00	0.10
329	002047	宝鹰股份	18,500	159,840.00	0.10
330	000543	皖能电力	27,340	159,392.20	0.10
331	300273	和佳股份	13,080	159,052.80	0.10
332	002716	金贵银业	8,200	157,358.00	0.10
333	002396	星网锐捷	8,098	156,696.30	0.10
334	000882	华联股份	43,400	156,674.00	0.10

335	002375	亚厦股份	17,450	155,479.50	0.10
336	002517	恺英网络	4,400	154,836.00	0.10
337	300098	高新兴	12,000	154,800.00	0.10
338	002056	横店东磁	20,500	153,750.00	0.10
339	000777	中核科技	7,700	153,692.00	0.10
340	000973	佛塑科技	19,842	153,180.24	0.10
341	300116	坚瑞消防	14,200	152,650.00	0.10
342	002326	永太科技	11,000	152,460.00	0.10
343	002276	万马股份	15,100	152,359.00	0.10
344	002123	梦网荣信	13,700	152,207.00	0.10
345	300431	暴风集团	6,360	151,558.80	0.09
346	002128	露天煤业	17,400	151,380.00	0.09
347	000090	天健集团	13,620	151,182.00	0.09
348	002325	洪涛股份	20,700	151,110.00	0.09
349	002055	得润电子	6,600	150,018.00	0.09
350	002067	景兴纸业	25,400	149,098.00	0.09
351	002600	江粉磁材	13,000	148,980.00	0.09
352	000762	西藏矿业	10,500	148,785.00	0.09
353	002308	威创股份	11,400	148,770.00	0.09
354	002151	北斗星通	5,300	148,135.00	0.09
355	000875	吉电股份	29,200	147,460.00	0.09
356	002512	达华智能	9,100	146,965.00	0.09
357	000751	锌业股份	29,900	146,809.00	0.09
358	002437	誉衡药业	19,991	145,534.48	0.09
359	300352	北信源	25,200	145,404.00	0.09
360	002130	沃尔核材	22,600	145,318.00	0.09
361	000620	新华联	20,300	144,333.00	0.09
362	300496	中科创达	5,100	144,330.00	0.09
363	001696	宗申动力	18,900	143,073.00	0.09
364	002237	恒邦股份	13,600	142,664.00	0.09
365	000801	四川九洲	14,900	142,593.00	0.09
366	300010	立思辰	11,001	142,462.95	0.09
367	000902	新洋丰	15,800	142,200.00	0.09
368	002245	澳洋顺昌	15,700	141,614.00	0.09
369	300222	科大智能	6,200	140,678.00	0.09
370	300075	数字政通	6,700	140,298.00	0.09
371	000541	佛山照明	15,350	139,838.50	0.09
372	002106	莱宝高科	13,800	139,794.00	0.09
373	002073	软控股份	16,300	138,224.00	0.09

374	300012	华测检测	29,728	137,640.64	0.09
375	300078	思创医惠	12,780	137,129.40	0.09
376	002463	沪电股份	29,964	136,336.20	0.09
377	002358	森源电气	8,000	136,160.00	0.09
378	002663	普邦园林	25,000	135,750.00	0.09
379	300096	易联众	9,900	135,432.00	0.08
380	002031	巨轮智能	43,400	134,974.00	0.08
381	300238	冠昊生物	5,301	134,380.35	0.08
382	002303	美盈森	17,384	134,204.48	0.08
383	002121	科陆电子	15,600	134,160.00	0.08
384	300036	超图软件	8,200	134,070.00	0.08
385	000650	仁和药业	22,350	133,653.00	0.08
386	000563	陕国投Ａ	25,800	133,386.00	0.08
387	300085	银之杰	7,210	133,385.00	0.08
388	002156	通富微电	13,100	133,358.00	0.08
389	002482	广田集团	14,750	132,602.50	0.08
390	002428	云南锗业	12,400	132,432.00	0.08
391	000733	振华科技	8,300	131,970.00	0.08
392	300212	易华录	5,200	131,196.00	0.08
393	002657	中科金财	4,500	130,455.00	0.08
394	300364	中文在线	3,900	130,260.00	0.08
395	300101	振芯科技	9,300	130,200.00	0.08
396	002481	双塔食品	19,500	130,065.00	0.08
397	002413	雷科防务	11,600	129,920.00	0.08
398	000426	兴业矿业	14,400	129,888.00	0.08
399	002099	海翔药业	19,300	128,538.00	0.08
400	002505	大康农业	42,700	128,527.00	0.08
401	002041	登海种业	9,700	128,525.00	0.08
402	002429	兆驰股份	41,750	128,172.50	0.08
403	000558	莱茵体育	16,800	127,680.00	0.08
404	002625	龙生股份	3,502	127,332.72	0.08
405	002668	奥马电器	6,440	126,868.00	0.08
406	002224	三 力 士	11,400	126,540.00	0.08
407	300310	宜通世纪	9,534	126,039.48	0.08
408	000062	深圳华强	4,700	124,691.00	0.08
409	002005	德豪润达	26,000	124,020.00	0.08
410	300147	香雪制药	12,074	123,999.98	0.08
411	002242	九阳股份	6,300	123,921.00	0.08
412	002474	榕基软件	11,400	123,690.00	0.08

413	002190	成飞集成	4,600	123,280.00	0.08
414	000969	安泰科技	14,101	123,101.73	0.08
415	002284	亚太股份	10,900	120,990.00	0.08
416	002063	远光软件	11,608	120,955.36	0.08
417	300292	吴通控股	17,800	120,506.00	0.08
418	000539	粤电力Ａ	22,600	120,458.00	0.08
419	002610	爱康科技	49,000	119,560.00	0.07
420	002329	皇氏集团	12,400	119,164.00	0.07
421	002690	美亚光电	6,200	118,916.00	0.07
422	002180	艾派克	4,900	118,384.00	0.07
423	000957	中通客车	10,100	118,170.00	0.07
424	002550	千红制药	19,880	118,087.20	0.07
425	300377	赢时胜	10,350	117,886.50	0.07
426	300228	富瑞特装	10,378	116,856.28	0.07
427	300011	鼎汉技术	7,300	116,800.00	0.07
428	000851	高鸿股份	12,800	116,352.00	0.07
429	002010	传化股份	7,600	115,976.00	0.07
430	000099	中信海直	10,281	115,764.06	0.07
431	300413	快乐购	5,700	115,653.00	0.07
432	300043	星辉娱乐	14,000	114,940.00	0.07
433	002467	二六三	14,490	114,760.80	0.07
434	002563	森马服饰	13,500	114,480.00	0.07
435	002161	远 望 谷	14,100	114,210.00	0.07
436	002498	汉缆股份	31,200	114,192.00	0.07
437	002318	久立特材	13,750	112,475.00	0.07
438	000869	张　裕Ａ	3,000	111,600.00	0.07
439	300032	金龙机电	8,000	111,600.00	0.07
440	300226	上海钢联	3,000	111,600.00	0.07
441	002471	中超控股	22,700	111,003.00	0.07
442	002681	奋达科技	8,680	109,281.20	0.07
443	002052	同洲电子	17,200	109,048.00	0.07
444	002249	大洋电机	16,500	108,570.00	0.07
445	002371	七星电子	4,500	107,640.00	0.07
446	300336	新文化	6,880	106,364.80	0.07
447	300202	聚龙股份	6,400	105,728.00	0.07
448	300037	新宙邦	4,600	105,708.00	0.07
449	300458	全志科技	4,007	105,544.38	0.07
450	002095	生 意 宝	3,040	105,062.40	0.07
451	002143	印纪传媒	4,200	104,706.00	0.07

452	300188	美亚柏科	6,000	103,740.00	0.07
453	002721	金一文化	6,900	103,017.00	0.06
454	002773	康弘药业	1,950	101,985.00	0.06
455	000555	神州信息	6,100	101,870.00	0.06
456	300083	劲胜精密	11,000	101,640.00	0.06
457	300073	当升科技	4,000	99,760.00	0.06
458	300359	全通教育	7,600	99,332.00	0.06
459	300178	腾邦国际	7,700	98,560.00	0.06
460	300339	润和软件	7,802	98,305.20	0.06
461	002699	美盛文化	7,120	98,256.00	0.06
462	002445	中南文化	7,500	96,375.00	0.06
463	002588	史丹利	12,500	96,125.00	0.06
464	002298	中电鑫龙	8,700	94,569.00	0.06
465	002631	德尔未来	6,400	94,272.00	0.06
466	300221	银禧科技	6,700	93,130.00	0.06
467	002157	正邦科技	20,400	92,820.00	0.06
468	002414	高德红外	5,000	91,500.00	0.06
469	002488	金固股份	7,900	91,403.00	0.06
470	002797	第一创业	9,920	91,363.20	0.06
471	002717	岭南园林	3,400	91,120.00	0.06
472	000810	创维数字	7,500	90,975.00	0.06
473	300432	富临精工	3,800	90,820.00	0.06
474	002493	荣盛石化	9,300	90,768.00	0.06
475	002197	证通电子	7,000	87,920.00	0.06
476	000795	英洛华	14,100	87,561.00	0.05
477	002416	爱施德	8,100	87,399.00	0.05
478	000681	视觉中国	5,500	86,130.00	0.05
479	002229	鸿博股份	7,501	84,011.20	0.05
480	000987	越秀金控	7,200	83,736.00	0.05
481	002568	百润股份	4,700	78,114.00	0.05
482	002751	易尚展示	2,100	77,805.00	0.05
483	300191	潜能恒信	2,900	77,198.00	0.05
484	300369	绿盟科技	6,600	72,996.00	0.05
485	300386	飞天诚信	4,000	71,160.00	0.04
486	002432	九安医疗	5,802	66,897.06	0.04
487	002577	雷柏科技	2,900	66,613.00	0.04
488	300368	汇金股份	4,400	63,272.00	0.04
489	002703	浙江世宝	2,300	62,997.00	0.04
490	002782	可立克	3,000	62,850.00	0.04

491	002619	巨龙管业	9,540	60,769.80	0.04
492	300506	名家汇	2,100	59,283.00	0.04
493	002653	海思科	4,500	58,545.00	0.04
494	002695	煌上煌	2,600	55,536.00	0.03
495	300516	久之洋	800	50,792.00	0.03
496	300512	中亚股份	1,900	38,532.00	0.02
497	300474	景嘉微	1,000	35,400.00	0.02

7.3.2 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：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	300005	探路者	13,500	106,380.00	0.07
2	000693	ST 华泽	8,000	100,000.00	0.06
3	300276	三丰智能	4,601	75,916.50	0.05
4	300666	江丰电子	2,276	43,448.84	0.03
5	002879	长缆科技	1,313	23,660.26	0.01
6	002881	美格智能	989	22,608.54	0.01
7	002882	金龙羽	2,966	18,389.20	0.01
8	300669	沪宁股份	841	14,650.22	0.01
9	300670	大烨智能	1,259	13,760.87	0.01
10	300672	国科微	1,257	10,659.36	0.01
11	300671	富满电子	942	7,639.62	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300498	温氏股份	2,541,472.20	1.60
2	000333	美的集团	674,423.00	0.42
3	000066	长城电脑	505,345.00	0.32
4	000963	华东医药	463,590.07	0.29
5	002044	美年健康	401,143.00	0.25
6	300296	利亚德	336,913.00	0.21
7	000059	华锦股份	290,044.00	0.18
8	000008	神州高铁	289,828.00	0.18
9	000413	东旭光电	263,868.00	0.17
10	002643	万润股份	252,600.00	0.16
11	300458	全志科技	236,521.00	0.15

12	002797	第一创业	215,884.00	0.14
13	000651	格力电器	204,935.00	0.13
14	002036	联创电子	198,481.00	0.13
15	300118	东方日升	191,412.00	0.12
16	300185	通裕重工	190,960.00	0.12
17	002716	金贵银业	189,856.00	0.12
18	002411	必康股份	186,964.00	0.12
19	002635	安洁科技	186,446.00	0.12
20	002481	双塔食品	185,457.00	0.12

注："买入金额"是指买入股票成交金额，即成交单价乘以成交数量，相关交易费用不考虑。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	000002	万　科Ａ	1,229,210.00	0.77
2	000963	华东医药	551,155.00	0.35
3	000651	格力电器	476,567.53	0.30
4	000748	长城信息	385,890.00	0.24
5	000333	美的集团	384,158.00	0.24
6	000725	京东方Ａ	230,689.00	0.15
7	000410	沈阳机床	223,086.00	0.14
8	002450	康得新	216,541.00	0.14
9	000511	*ST 烯碳	213,495.00	0.13
10	000816	智慧农业	212,544.00	0.13
11	000858	五 粮 液	203,320.00	0.13
12	000401	冀东水泥	200,196.00	0.13
13	002028	思源电气	197,524.20	0.12
14	000666	经纬纺机	197,088.00	0.12
15	000616	海航投资	186,900.00	0.12
16	000572	海马汽车	182,182.00	0.11
17	002312	三泰控股	176,076.00	0.11
18	002852	道道全	173,555.05	0.11
19	000652	泰达股份	171,920.00	0.11
20	000001	平安银行	171,294.00	0.11

注："卖出金额"是指卖出股票成交金额，即成交单价乘以成交数量，相关交易费用不考虑。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	21,467,714.34
卖出股票收入（成交）总额	27,380,004.08

注：“买入股票成本（成交）总额”和“卖出股票收入（成交）总额”均按成交单价乘以成交数量填列，相关交易费用不考虑。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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持有资产支持证券。

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持有贵金属。

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。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期未投资股指期货。

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

本基金本报告期未投资国债期货。

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。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体报告期内没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

7.12.2 本基金投资的前十名股票未超出本基金合同规定的备选股票库。

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	3,169.30
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,475.91
5	应收申购款	44,372.47
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	49,017.68

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

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资部分前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 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：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	000693	ST 华泽	100,000.00	0.06	重大资产重组
2	300276	三丰智能	75,916.50	0.05	重大资产重组

§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
6,659	27,841.01	198,051.80	0.11%	185,195,210.97	99.89%

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	66,325.28	0.0358%

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的情况

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

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2010 年 11 月 15 日）基金份额总额	1,848,841,553.44
本报告期期初基金份额总额	194,606,497.03
本报告期基金总申购份额	10,711,137.45
减:本报告期基金总赎回份额	19,924,371.71
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	185,393,262.77

§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 基金管理人重大人事变动

（1）2017 年 3 月 4 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公告》，经本基金管理人第五届董事会第十七次临时会议审议并通过，同意孟朝霞女士辞去公司总经理职务，并决定由公司董事长高峰先生代为履行公司总经理职务。

（2）2017 年 6 月 3 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》，经本基金管理人第五届董事会第十八次临时会议决议审议并通过，决定由张帆先生担任公司总经理职务，公司董事长高峰先生不再代为履行公司总经理职务。

10.2.2 基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动

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)，该事务所自本基金合同生效以来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

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。

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	
安信证券	1	27,658,013.38	59.16%	25,204.82	59.25%	-
长江证券	1	8,435,655.95	18.04%	7,687.48	18.07%	-
光大证券	1	3,060,852.88	6.55%	2,724.52	6.40%	-
中信证券	1	2,665,798.40	5.70%	2,429.33	5.71%	-
华泰证券	1	2,322,341.09	4.97%	2,116.40	4.98%	-
天风证券	1	1,565,028.33	3.35%	1,426.23	3.35%	-
平安证券	1	730,280.17	1.56%	665.44	1.56%	-
长城证券	1	174,893.06	0.37%	159.38	0.37%	-
海通证券	1	139,337.72	0.30%	126.98	0.30%	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-

东兴证券	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，本基金新增申万宏源证券交易单元 1 个，东兴证券交易单元 1 个，停用中山证券交易单元 1 个。

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

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。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	披露方式	披露日期
1	融通基金管理有限公司关于新增天津国美基金销售有限公司为代销机构并参加其申购费率优惠活动的公告	证券时报、管理人网站	2017-1-6
2	融通深证成份指数证券投资基金基金经理	证券时报、管理人网站	2017-1-7

	变更公告		
3	融通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加北京肯特瑞财富投资管理有限公司申购费率优惠的公告	证券时报、管理人网站	2017-2-20
4	关于融通基金管理有限公司旗下部分开放式基金参加交通银行股份有限公司申购及定期定额投资业务费率优惠活动的公告	证券时报、管理人网站	2017-2-23
5	融通基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	证券时报、管理人网站	2017-3-4
6	融通基金管理有限公司关于上海分公司负责人及经营场所变更的公告	证券时报、管理人网站	2017-3-29
7	融通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加上海万得投资顾问有限公司申购费率优惠的公告	证券时报、管理人网站	2017-3-30
8	关于融通基金管理有限公司旗下开放式基金参加中国工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	证券时报、管理人网站	2017-3-31
9	融通基金管理有限公司关于新增北京乐融多源投资咨询有限公司为代销机构并参加其申购费率优惠活动的公告	证券时报、管理人网站	2017-4-6
10	关于融通基金管理有限公司旗下部分开放式基金参加交通银行股份有限公司申购及定期定额投资业务费率优惠活动的公告	证券时报、管理人网站	2017-4-22
11	融通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金在中信银行股份有限公司开通定期定额投资业务及基金转换业务的公告	证券时报、管理人网站	2017-5-24
12	融通基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	证券时报、管理人网站	2017-6-3
13	融通基金管理有限公司关于新增上海通华	证券时报、管理人网站	2017-6-14

	财富资产管理有限公司为代销机构的公告		

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 影响投资者决策的其他重要信息

为更好地满足投资者的理财需求，融通基金管理有限公司经与基金托管人中国工商银行股份有限公司协商一致，并报中国证监会备案，决定于 2017 年 7 月 5 日起，对融通深证成份指数证券投资基金增设 C 类基金份额（基金简称：融通深证成份指数 C，基金代码：004875），同时根据最新法律法规对《基金合同》和《托管协议》进行了相应修改。详见本基金管理人于 2017 年 7 月 5 日在《证券时报》及公司官方网站发布的《融通基金管理有限公司关于融通深证成份指数证券投资基金增设 C 类基金份额并修订基金合同部分条款的公告》。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

（一）中国证监会批准融通深证成份指数证券投资基金设立的文件

（二）《融通深证成份指数证券投资基金基金合同》

（三）《融通深证成份指数证券投资基金托管协议》

（四）《融通深证成份指数证券投资基金招募说明书》及其更新

（五）《融通基金管理有限公司开放式基金业务管理规则》

（六）融通基金管理有限公司业务资格批件和营业执照

（七）基金托管人中国工商银行业务资格批件和营业执照

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 www.rtfund.com 查询。