

融通深证成份指数证券投资基金 2018 年半年度报告

2018 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：2018 年 8 月 27 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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 2018 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 2018 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
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.....	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	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.....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15

6.4 报表附注.....	16
§ 7 投资组合报告.....	34
7.1 期末基金资产组合情况.....	34
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	34
7.3 报告期内股票投资组合的重大变动.....	49
7.4 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	50
7.5 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.....	51
7.6 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.....	51
7.7 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.....	51
7.8 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.....	51
7.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	51
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	51
7.11 投资组合报告附注.....	52
§ 8 基金份额持有人信息.....	52
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	52
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	53
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.....	53
§ 9 开放式基金份额变动.....	53
§ 10 重大事件揭示.....	54
10.1 基金份额持有人大会决议.....	54
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.....	54
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	54
10.4 基金投资策略的改变.....	54
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	54
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.....	54
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	54
10.8 其他重大事件.....	56
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	58
11.1 影响投资者决策的其他重要信息.....	58
§ 12 备查文件目录.....	58

12.1 备查文件目录.....	58
12.2 存放地点.....	58
12.3 查阅方式.....	59

§ 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	
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	158,419,565.51 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	融通深证成份指数 A/B	融通深证成份指数 C
下属分级基金的交易代码:	161612	004875
下属分级基金的前端交易代码	161612	004875
下属分级基金的后端交易代码	161662	-
报告期末下属分级基金的份额总额	158,406,257.61 份	13,307.90 份

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
	联系电话	(0755) 26948666
	电子邮箱	service@mail.rtfund.com
客户服务电话	400-883-8088、(0755) 26948088	95588
传真	(0755) 26935005	(010) 66105799
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

基金级别	融通深证成份指数 A/B	融通深证成份指数 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2018 年 1 月 1 日 - 2018 年 6 月 30 日)	报告期(2018 年 1 月 1 日 - 2018 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-8,918,197.29	-914.76
本期利润	-18,855,151.64	-16,219.01
加权平均基金份额本期利润	-0.1183	-0.3546
本期加权平均净值利润率	-13.35%	-40.03%
本期基金份额净值增长率	-13.27%	-13.85%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	-33,130,996.36	-2,871.27
期末可供分配基金份额利润	-0.2092	-0.2158
期末基金资产净值	125,275,261.25	10,436.63
期末基金份额净值	0.791	0.784
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2018 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	-19.90%	-9.36%

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

融通深证成份指数 A/B

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	-7.81%	1.62%	-8.46%	1.64%	0.65%	-0.02%
过去三个月	-12.21%	1.26%	-13.04%	1.27%	0.83%	-0.01%
过去六个月	-13.27%	1.28%	-14.29%	1.30%	1.02%	-0.02%
过去一年	-8.13%	1.09%	-10.32%	1.10%	2.19%	-0.01%
过去三年	-29.73%	1.79%	-32.77%	1.68%	3.04%	0.11%
自基金合同生效起至今	-19.90%	1.59%	-24.17%	1.54%	4.27%	0.05%

融通深证成份指数 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-7.87%	1.61%	-8.46%	1.64%	0.59%	-0.03%
过去三个月	-12.30%	1.25%	-13.04%	1.27%	0.74%	-0.02%
过去六个月	-13.85%	1.29%	-14.29%	1.30%	0.44%	-0.01%
自基金合同生效起至今	-9.36%	1.10%	-10.58%	1.10%	1.22%	0.00%

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

A级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金于 2017 年 7 月 5 日增设 C 类份额，本基金 C 类份额的统计区间为 2017 年 7 月 6 日至本报告期末。

§ 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 Asset Management Co., Ltd.）40%。

截至2018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、融通动力先锋混合基金、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、融通汇财宝货币基金、融通可转债债券基金、融通通泰保本混合基金、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、融通月月添利定期开放债券基金、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、融通国企改革新机遇混合基金、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、融通通穗债券基金、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）、融通新动力混合基金、融通收益增强债券基金、融通中国概念债券基金（QDII）、融通逆向策略混合基金、融通通裕定期开放债券发起式基金、融通红利机会主题精选混合基金、融通通昊定期开放债券发起式基金、融通新能源汽车主题精选混合基金。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。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		

蔡志伟	本基金的基金经理	2016 年 11 月 19 日	-	7	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），7 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。
-----	----------	------------------	---	---	---

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合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规和本基金合同的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益，无损害基金持有人利益的行为，本基金投资组合符合有关法律法规的规定及基金合同的约定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一直坚持公平对待旗下所有投资组合的原则，在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等各个环节保证公平交易制度的严格执行。

本基金管理人对报告期内不同时间窗下（日内、3 日内、5 日内）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

截至本报告期末融通深证成份指数 A/B 基金份额净值为 0.791 元，本报告期基金份额净值增长率为-13.27%；截至本报告期末融通深证成份指数 C 基金份额净值为 0.784 元，本报告期基金份额净值增长率为-13.85%；同期业绩比较基准收益率为-14.29%。

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 2018 年上半年，国内宏观经济总体保持平稳，GDP 同比增长 6.8%，连续 12 个季度保持在 6.7%-6.9% 的区间，经济韧性强；物价保持温和上涨，CPI 同比上涨 2%，6 月 PPI 上涨 4.7%，通胀压力不大。

展望下半年，宽货币和紧信用仍将是货币政策的主基调，但是央行会对货币宽松的程度相机抉择，防止市场对信用违约过度恐慌。同时，在中美长期博弈的影响下，市场流动性环境整体偏紧、风险偏好不时受到扰动。

从市场估值的角度看，在上半年宏观去杠杆以及贸易战的扰动下，当前估值已回到历史底部区域，继续往下空间有限；而从盈利的角度看，伴随中国 2016 年度过产能周期拐点后，A 股盈利能力持续处于较高水平，体现在经济新常态下量增长平稳，而质提升明显。而从政策的角度看，从三去到一补，预计下半年有望开启。从全球范围看制造业是中国优势产业，智能制造既能够提升传统制造业的竞争力，又能够形成新的增长点，将是中国产业发展的重点方向。我国的产业升级将以互联网、大数据、人工智能和实体经济深度融合为突破口，推动我国产业向产业链中高端转移。

在此宏观产业背景下，展望 2018 年下半年，A 股有望震荡上行。这主要源于市场估值已处历史底部，本轮企业盈利回升将可持续。从结构来看，优秀成长股盈利趋势向好，预计下半年将能产生较好的 Alpha。从行业的角度看，符合中国产业升级的智能制造如新能源汽车、5G、AI、医疗健康和有自主可控替代迫切性的集成电路、大飞机、信息安全等将有较好的投资机会。

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、参考独立第三方估值服务机构的估值数据等一种或多种方式的有效结合，减少或避免估值偏差的发生。估值委员会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本基金基金经理。

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、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与基金托管人核对，同时负责对外进行信息披露。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。本基金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。

截至本报告期末，本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司、中证指数有限公司签订服务协议，由其提供相关债券品种和流通受限股票的估值参考数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配，符合法律法规和基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对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 2018 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：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
----	-----	------------------------	--------------------------

资产：			
银行存款	6.4.7.1	2,064,842.75	8,388,202.36
结算备付金		-	11,165.86
存出保证金		3,203.01	5,490.10
交易性金融资产	6.4.7.2	122,870,113.32	146,076,642.10
其中：股票投资		117,816,056.32	145,819,080.88
基金投资		-	-
债券投资		5,054,057.00	257,561.22
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	51,176.54	1,671.46
应收股利		-	-
应收申购款		565,837.42	17,154.66
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		125,555,173.04	154,500,326.54
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017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		-	-
应付赎回款		58,148.61	99,865.11
应付管理人报酬		106,747.16	130,631.36
应付托管费		21,349.44	26,126.26
应付销售服务费		2.50	1.87
应付交易费用	6.4.7.7	13,594.33	9,004.60
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	69,633.12	40,094.52
负债合计		269,475.16	305,723.72
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	158,419,565.51	169,157,334.19
未分配利润	6.4.7.10	-33,133,867.63	-14,962,731.37
所有者权益合计		125,285,697.88	154,194,602.82
负债和所有者权益总计		125,555,173.04	154,500,326.54

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，基金份额总额为 158,419,565.51 份；其中 A/B 类基金份额净值为 0.791，基金份额为 158,406,257.61 份；C 类基金份额净值为 0.784，基金份额为 13,307.90 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：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
一、收入		-17,892,554.67	10,052,541.10
1. 利息收入		59,601.27	30,899.70
其中：存款利息收入	6.4.7.11	19,171.13	30,899.70
债券利息收入		40,430.14	-
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		-8,007,344.08	-2,891,681.42
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-8,845,420.57	-3,851,132.06
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	47,045.61	-
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	791,030.88	959,450.64
3. 公允价值变动收益	6.4.7.17	-9,952,258.60	12,901,550.21
4. 汇兑收益		-	-
5. 其他收入	6.4.7.18	7,446.74	11,772.61
减：二、费用		978,815.98	1,087,453.59
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	699,258.59	785,615.56
2. 托管费	6.4.10.2.2	139,851.68	157,123.05
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	95.45	-
4. 交易费用	6.4.7.19	70,041.86	73,676.62
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		0.04	
7. 其他费用	6.4.7.20	69,568.36	71,038.36
三、利润总额		-18,871,370.65	8,965,087.51
减：所得税费用		-	-
四、净利润		-18,871,370.65	8,965,087.51

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：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 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）	169,157,334.19	-14,962,731.37	154,194,602.82
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-18,871,370.65	-18,871,370.65
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-10,737,768.68	700,234.39	-10,037,534.29
其中：1. 基金申购款	10,189,083.15	-1,212,219.38	8,976,863.77
2. 基金赎回款	-20,926,851.83	1,912,453.77	-19,014,398.06
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（基金净值）	158,419,565.51	-33,133,867.63	125,285,697.88
项目	上年度可比期间 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（基金净值）	185,393,262.77	-25,729,346.65	159,663,916.12

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

颜锡康

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。

根据本基金的基金管理人于2017年7月5日发布的《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》,自2017年7月5日起对本基金进行份额分类,原有基金份额为A/B类份额,增设C类份额。在投资者申购时收取前端申购费用的份额,称为A类份额;在投资者赎回时收取后端申购费用的份额,称为B类份额;不收取申购费用,而是从本类别基金资产中计提销售服务费并按照持有期限收取赎回费的份额,称为C类份额。本基金分类后,本基金原有基金份额将自动划归为本基金A/B类基金份额。

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,包括深证成份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。本基金力求将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,以实现深证成份指数的有效跟踪。本基金标的指数使用费由基金管理人融通基金管理有限公司承担,不计入本基金费用。本基金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 X 95%+银行活期存款利率 X 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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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 2018 年 6 月 30 日的财务状况以及 2018 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 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1)资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为,暂适用简易计税方法,按照 3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在 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。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税,对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务,以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货,可以选择按照实际买入价计算销售额,或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2)对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股票的股息、红利收

入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

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

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

(5)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
活期存款	2,064,842.75
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计：	2,064,842.75

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	145,779,780.18	117,816,056.32	-27,963,723.86
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	5,043,257.00	5,054,057.00
	银行间市场	-	-
	合计	5,043,257.00	5,054,057.00
资产支持证券	-	-	-

基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	150,823,037.18	122,870,113.32	-27,952,923.86

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 2018年6月30日
应收活期存款利息	771.46
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	50,403.82
应收资产支持证券利息	-
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	51,176.54

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 2018年6月30日
交易所市场应付交易费用	13,594.33
银行间市场应付交易费用	-
合计	13,594.33

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	208.76
预提费用	69,424.36
合计	69,633.12

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

融通深证成份指数 A/B		
项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	169,149,923.82	169,149,923.82
本期申购	9,914,107.23	9,914,107.23
本期赎回	-20,657,773.44	-20,657,773.44
本期末	158,406,257.61	158,406,257.61

金额单位：人民币元

融通深证成份指数 C		
项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	7,410.37	7,410.37
本期申购	274,975.92	274,975.92
本期赎回	-269,078.39	-269,078.39
本期末	13,307.90	13,307.90

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

融通深证成份指数 A/B			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	56,747,526.95	-71,709,594.84	-14,962,067.89
本期利润	-8,918,197.29	-9,936,954.35	-18,855,151.64
本期基金份额交易产生的变动数	-3,490,578.06	4,176,801.23	686,223.17
其中：基金申购款	3,074,644.91	-4,272,788.37	-1,198,143.46

基金赎回款	-6,565,222.97	8,449,589.60	1,884,366.63
本期已分配利润	-	-	-
本期末	44,338,751.60	-77,469,747.96	-33,130,996.36

单位：人民币元

融通深证成份指数 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-1,011.66	348.18	-663.48
本期利润	-914.76	-15,304.25	-16,219.01
本期基金份额交易产生的变动数	-708.09	14,719.31	14,011.22
其中：基金申购款	-43,675.51	29,599.59	-14,075.92
基金赎回款	42,967.42	-14,880.28	28,087.14
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-2,634.51	-236.76	-2,871.27

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
活期存款利息收入	18,986.20
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	145.04
其他	39.89
合计	19,171.13

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 2018年1月1日至2018年6月30日
卖出股票成交总额	26,657,018.96
减：卖出股票成本总额	35,502,439.53
买卖股票差价收入	-8,845,420.57

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交	5,621,941.27

总额	
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	5,402,318.02
减：应收利息总额	172,577.64
买卖债券差价收入	47,045.61

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 2018年1月1日至2018年6月30日
股票投资产生的股利收益	791,030.88
基金投资产生的股利收益	-
合计	791,030.88

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
1. 交易性金融资产	-9,952,258.60
——股票投资	-9,963,696.06
——债券投资	11,437.46
——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	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-9,952,258.60

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日

基金赎回费收入	7,446.74
合计	7,446.74

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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	70,041.86
银行间市场交易费用	-
合计	70,041.86

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
审计费用	19,835.79
信息披露费	49,588.57
银行费用	144.00
合计	69,568.36

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（“融通基金”）	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 2018年1月1日至2018年6 月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30 日
当期发生的基金应支付的管理费	699,258.59	785,615.56
其中：支付销售机构的客户维护费	289,769.79	325,910.65

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 2018年1月1日至2018年6 月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30 日
当期发生的基金应支付的托管费	139,851.68	157,123.05

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。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的	本期
----------	----

各关联方名称	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	融通深证成份指数 A/B	融通深证成份指数 C	合计
融通基金	-	95.45	95.45
合计	-	95.45	95.45
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	融通深证成份指数 A/B	融通深证成份指数 C	合计
融通基金	-	-	-
合计	-	-	-

注：本基金 A/B 类份额不收取销售服务费。

支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值 0.40% 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：

$$C \text{ 类日销售服务费} = \text{前一日 C 类基金资产净值} \times 0.40\% / \text{当年天数}。$$

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

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人以外的其他关联方未投资本基金。

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		上年度可比期间	
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 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	2,064,842.75	18,986.20	8,829,269.80	29,961.71

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间均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（2018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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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
002450	康得新	2018-6-4	重大事项停牌	17.08	-	-	43,857	874,929.76	749,077.56	-
002739	万达电影	2017-7-4	重大事项停牌	52.04	-	-	11,203	896,400.75	583,004.12	-
002252	上海莱士	2018-2-23	重大事项停牌	19.52	-	-	26,930	507,107.57	525,673.60	-
000540	中天金融	2017-8-21	重大事项停牌	4.87	-	-	99,150	816,909.51	482,860.50	-
002310	东方园林	2018-5-25	重大事项停牌	15.03	-	-	27,600	399,391.10	414,828.00	-
300072	三聚环保	2018-6-19	重大事项停牌	23.28	2018-7-10	18.38	17,409	307,318.76	405,281.52	-
000793	华闻传媒	2018-2-1	重大事项停牌	8.40	2018-7-16	7.55	33,800	676,100.58	283,920.00	-
002075	沙钢股份	2016-9-19	重大事项停牌	16.12	-	-	17,300	226,457.00	278,876.00	-
000825	太钢不锈	2018-4-16	重大事项停牌	6.00	-	-	45,300	336,816.52	271,800.00	-
300146	汤臣倍健	2018-1-31	重大事项停牌	16.60	2018-7-31	16.50	15,000	315,172.85	249,000.00	-
000566	海南海药	2017-11-22	重大事项停牌	12.89	2018-7-9	11.60	18,500	455,392.21	238,465.00	-
300266	兴源环境	2018-2-5	重大事项停牌	19.99	2018-7-2	11.96	11,600	263,457.29	231,884.00	-
000415	渤海金控	2018-1-17	重大事项停牌	5.84	2018-7-17	5.19	35,682	370,270.79	208,382.88	-
002602	世纪华通	2018-6-12	重大事项停牌	32.50	-	-	6,300	202,550.00	204,750.00	-

002408	齐翔腾达	2018-6-19	重大事项停牌	12.28	-	-	16,000	172,519.13	196,480.00	-
000939	*ST 凯迪	2017-11-16	重大事项停牌	4.99	2018-7-2	4.74	37,700	312,391.22	188,123.00	-
002147	新光圆成	2018-1-18	重大事项停牌	14.76	-	-	11,740	143,725.01	173,282.40	-
300324	旋极信息	2018-5-30	重大事项停牌	9.49	-	-	17,913	163,990.91	169,994.37	-
002610	爱康科技	2018-6-5	重大事项停牌	2.10	-	-	75,500	226,186.42	158,550.00	-
000008	神州高铁	2018-6-6	重大事项停牌	4.96	2018-8-7	4.46	31,800	277,205.89	157,728.00	-
300090	盛运环保	2018-6-4	重大事项停牌	8.32	2018-6-1	8.32	18,700	244,271.77	155,584.00	-
002051	中工国际	2018-4-4	重大事项停牌	15.27	-	-	9,814	219,790.11	149,859.78	-
002573	清新环境	2018-6-19	重大事项停牌	11.55	-	-	12,900	290,594.59	148,995.00	-
300197	铁汉生态	2018-5-28	重大事项停牌	5.37	-	-	26,088	220,310.58	140,092.56	-
002426	胜利精密	2018-6-19	重大事项停牌	3.60	2018-7-3	3.26	38,700	335,528.42	139,320.00	-
002665	首航节能	2018-5-29	重大事项停牌	5.80	-	-	23,180	245,569.67	134,444.00	-
002411	必康股份	2018-6-19	重大事项停牌	28.34	-	-	4,700	127,352.30	133,198.00	-
002699	美盛文化	2018-2-5	重大事项停牌	18.76	2018-7-2	16.88	6,320	114,915.14	118,563.20	-
002431	棕榈股份	2018-5-30	重大事项停牌	6.71	-	-	17,250	193,458.26	115,747.50	-
000666	经纬纺机	2018-3-12	重大事项停牌	18.08	-	-	6,300	121,870.52	113,904.00	-
002716	金贵银业	2018-5-3	重大事项停牌	16.84	-	-	6,700	155,126.26	112,828.00	-
002668	奥马电器	2018-6-15	重大事项停牌	20.10	-	-	5,540	125,273.04	111,354.00	-
000723	美锦能源	2018-3-27	重大事项停牌	5.43	2018-8-2	3.97	20,500	141,714.71	111,315.00	-
002089	新海宜	2018-4-20	重大事项停牌	6.05	2018-7-20	5.45	17,900	149,633.62	108,295.00	-
002477	雏鹰农牧	2018-6-14	重大事项停牌	3.31	-	-	32,700	216,438.15	108,237.00	-
300118	东方日升	2018-5-7	重大事项停牌	10.80	2018-8-7	9.63	9,600	157,056.00	103,680.00	-
002437	誉衡药业	2018-6-11	重大事项停牌	6.20	2018-8-13	5.57	15,891	182,891.93	98,524.20	-
000587	金洲慈航	2018-6-15	重大事项停牌	4.96	2018-7-2	4.46	17,500	238,282.66	86,800.00	-
002512	达华智能	2018-6-19	重大事项停牌	9.70	-	-	8,500	152,172.52	82,450.00	-
000426	兴业矿业	2018-6-19	重大事项停牌	7.21	-	-	11,100	97,902.00	80,031.00	-
002143	印纪传媒	2018-2-2	重大事项停牌	12.09	2018-7-9	10.88	6,420	99,941.82	77,617.80	-
002011	盾安环境	2018-5-2	重大事项停牌	6.40	2018-7-3	10.68	10,500	84,857.83	67,200.00	-

300317	珈伟股份	2018-2-5	重大事项停牌	11.90	2018-7-3	10.71	5,586	86,531.21	66,473.40	-
000564	供销大集	2017-11-28	重大事项停牌	4.78	2018-7-20	4.29	10,900	70,414.00	52,102.00	-
000693	*ST 华泽	2018-5-2	重大事项停牌	3.31	-	-	8,000	106,400.00	26,480.00	-

注：本基金截至 2018 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内控优先和全员风险管理理念，高度重视风险管理的组织保障和制度保障，建立了完备的风险管理组织及相应的制度和流程，力争在风险最小化的前提下，确保基金份额持有人利益最大化。

董事会对有效的风险管理承担最终责任，负责确定公司风险管理总体目标，制定公司风险管理战略和风险应对策略；审议重大事件、重大决策的风险评估意见，审批重大风险的解决方案，批准公司基本风险管理制度；审议公司风险管理报告。在董事会下设立风险控制与审计委员会，履行相应风险管理和监督职责。

公司管理层对有效的风险管理承担直接责任，根据董事会的风险管理战略，制定与公司发展战略、整体风险承受能力相匹配的风险管理制度，并确保风险管理制度得以全面、有效执行。在公司管理层下设立风险管理委员会，负责指导、协调和监督各职能部门和个业务单元开展风险管理工作；制定相关风险控制政策，审批风险管理重要流程和风险限额，并与公司整体业务发展战略和风险承受能力相一致；识别公司各项业务所涉及各类重大风险，对重大风险、重大决策和

重要业务流程的风险进行评估，制定重大风险的解决方案；识别和评估新产品、新业务的新增风险，并制定控制措施；重点关注内控机制薄弱环节和那些可能给公司带来重大损失的事件，提出控制措施和解决方案；协调突发性重大风险事件的处理；审定风险事件责任人的责任；根据公司风险管理总体策略和各职能部门与业务单元职责分工，组织实施风险应对方案。

各业务部门在执行业务事项时需遵守相关法律法规，遵守公司业务管理制度，执行风险管理的基本制度流程，定期对本部门的风险进行评估，对其风险管理制度和流程的有效性负责。公司所有员工是本岗位风险管理的直接责任人，各业务部门负责人是其部门风险管理的第一责任人，基金经理是相应投资组合风险管理的第一责任人。

风险管理部对公司风险管理承担独立评估、监控、检查和报告职责，负责执行公司的风险管理战略和决策，拟定公司风险管理制度，并协同各业务部门制定风险管理流程、评估指标；对风险进行定性和定量评估，改进风险管理方法、技术和模型，组织推动建立、持续优化风险管理信息系统；对新产品、新业务进行独立监测和评估，提出风险防范和控制建议；负责督促相关部门落实风险管理委员会的各项决策和风险管理制度，并对风险管理决策和风险管理制度执行情况进行检查、评估和报告。

监察稽核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，确保既定的风险管理措施得到有效的贯彻执行，发现内控缺失和管理漏洞，提出改进要求和建议，并报告法规和制度的执行情况。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国工商银行，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 2018 年 6 月 30 日，本基金未持有除国债、政策性金融债以外的债券。(2017 年 12 月 31 日：0.17%)。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

于 2018 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。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制)，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

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 2018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	2,064,842.75	-	-	-	2,064,842.75
存出保证金	3,203.01	-	-	-	3,203.01
交易性金融资产	5,054,057.00	-	-	117,816,056.32	122,870,113.32
应收利息	-	-	-	51,176.54	51,176.54

应收申购款	-	-	-	565,837.42	565,837.42
资产总计	7,122,102.76	-	-	118,433,070.28	125,555,173.04
负债					
应付赎回款	-	-	-	58,148.61	58,148.61
应付管理人报酬	-	-	-	106,747.16	106,747.16
应付托管费	-	-	-	21,349.44	21,349.44
应付销售服务费	-	-	-	2.50	2.50
应付交易费用	-	-	-	13,594.33	13,594.33
其他负债	-	-	-	69,633.12	69,633.12
负债总计	-	-	-	269,475.16	269,475.16
利率敏感度缺口	7,122,102.76	-	-	118,163,595.12	125,285,697.88
上年度末 2017 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	8,388,202.36	-	-	-	8,388,202.36
结算备付金	11,165.86	-	-	-	11,165.86
存出保证金	5,490.10	-	-	-	5,490.10
交易性金融资产	-	12,399.92	245,161.30	145,819,080.88	146,076,642.10
应收利息	-	-	-	1,671.46	1,671.46
应收申购款	-	-	-	17,154.66	17,154.66
资产总计	8,404,858.32	12,399.92	245,161.30	145,837,907.00	154,500,326.54
负债					
应付赎回款	-	-	-	99,865.11	99,865.11
应付管理人报酬	-	-	-	130,631.36	130,631.36
应付托管费	-	-	-	26,126.26	26,126.26
应付销售服务费	-	-	-	1.87	1.87
应付交易费用	-	-	-	9,004.60	9,004.60
其他负债	-	-	-	40,094.52	40,094.52
负债总计	-	-	-	305,723.72	305,723.72
利率敏感度缺口	8,404,858.32	12,399.92	245,161.30	145,532,183.28	154,194,602.82

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 2018 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 4.03%(2017 年 12 月 31 日：0.17%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2017 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 2018 年 6 月 30 日		上年度末 2017 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	117,816,056.32	94.04	145,819,080.88	94.57
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	117,816,056.32	94.04	145,819,080.88	94.57

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除深证成份指数收益率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 (2018年6月30日)	上年度末 (2017年12月31日)
	深证成份指数收益率上升 5%	5,882,688.72	7,385,912.49
	深证成份指数收益率下降 5%	-5,882,688.72	-7,385,912.49

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§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	117,816,056.32	93.84
	其中：股票	117,816,056.32	93.84
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	5,054,057.00	4.03
	其中：债券	5,054,057.00	4.03
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	2,064,842.75	1.64
8	其他各项资产	620,216.97	0.49
9	合计	125,555,173.04	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	2,576,722.96	2.06
B	采矿业	979,910.71	0.78
C	制造业	74,622,771.88	59.56

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,321,161.20	1.05
E	建筑业	2,032,823.84	1.62
F	批发和零售业	3,314,111.73	2.65
G	交通运输、仓储和邮政业	981,905.30	0.78
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,301,116.20	9.02
J	金融业	6,469,014.24	5.16
K	房地产业	6,082,967.62	4.86
L	租赁和商务服务业	1,961,496.43	1.57
M	科学研究和技术服务业	142,916.00	0.11
N	水利、环境和公共设施管理业	1,190,174.26	0.95
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,633,364.09	1.30
R	文化、体育和娱乐业	2,527,869.40	2.02
S	综合	179,340.00	0.14
	合计	117,317,665.86	93.64

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	采矿业	26,480.00	0.02
C	制造业	470,880.66	0.38
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	1,029.80	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	498,390.46	0.40

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	000333	美的集团	87,497	4,569,093.34	3.65
2	000651	格力电器	90,902	4,286,029.30	3.42
3	000858	五粮液	35,005	2,660,380.00	2.12
4	002415	海康威视	66,535	2,470,444.55	1.97
5	000002	万科A	76,900	1,891,740.00	1.51
6	000725	京东方A	493,198	1,745,920.92	1.39
7	300498	温氏股份	72,548	1,597,506.96	1.28
8	000001	平安银行	159,609	1,450,845.81	1.16
9	002304	洋河股份	10,735	1,412,726.00	1.13
10	300059	东方财富	74,271	978,891.78	0.78
11	002230	科大讯飞	29,863	957,706.41	0.76
12	002027	分众传媒	99,864	955,698.48	0.76
13	002024	苏宁易购	66,805	940,614.40	0.75
14	000538	云南白药	8,542	913,652.32	0.73
15	002008	大族激光	16,900	898,911.00	0.72
16	000568	泸州老窖	13,743	836,398.98	0.67
17	000338	潍柴动力	90,340	790,475.00	0.63
18	002475	立讯精密	35,000	788,900.00	0.63
19	002142	宁波银行	47,794	778,564.26	0.62
20	000776	广发证券	57,360	761,167.20	0.61
21	002594	比亚迪	15,844	755,441.92	0.60
22	002450	康得新	43,857	749,077.56	0.60
23	001979	招商蛇口	37,063	706,050.15	0.56
24	002236	大华股份	31,164	702,748.20	0.56
25	002466	天齐锂业	14,031	695,797.29	0.56
26	300003	乐普医疗	17,400	638,232.00	0.51
27	000661	长春高新	2,797	636,876.90	0.51
28	002044	美年健康	27,480	621,048.00	0.50
29	300124	汇川技术	18,798	616,950.36	0.49
30	002456	欧菲光	38,235	616,730.55	0.49
31	000963	华东医药	12,743	614,849.75	0.49
32	000100	TCL 集团	205,020	594,558.00	0.47
33	000063	中兴通讯	45,377	591,262.31	0.47
34	002739	万达电影	11,203	583,004.12	0.47

35	002422	科伦药业	18,016	578,313.60	0.46
36	002460	赣锋锂业	14,550	561,339.00	0.45
37	000166	申万宏源	125,820	549,833.40	0.44
38	002252	上海莱士	26,930	525,673.60	0.42
39	002202	金风科技	40,815	515,901.60	0.41
40	000423	东阿阿胶	9,513	511,894.53	0.41
41	300015	爱尔眼科	15,821	510,860.09	0.41
42	000895	双汇发展	18,417	486,392.97	0.39
43	300408	三环集团	20,650	485,275.00	0.39
44	000540	中天城投	99,150	482,860.50	0.39
45	300136	信维通信	15,095	463,869.35	0.37
46	000413	东旭光电	76,300	462,378.00	0.37
47	000069	华侨城 A	63,244	457,254.12	0.36
48	300142	沃森生物	22,300	445,554.00	0.36
49	000503	海虹控股	14,000	444,920.00	0.36
50	300070	碧水源	31,422	437,708.46	0.35
51	000783	长江证券	78,425	425,847.75	0.34
52	002310	东方园林	27,600	414,828.00	0.33
53	300024	机器人	23,425	407,595.00	0.33
54	300122	智飞生物	8,900	407,086.00	0.32
55	300072	三聚环保	17,409	405,281.52	0.32
56	000768	中航飞机	25,160	393,502.40	0.31
57	002241	歌尔股份	38,514	392,457.66	0.31
58	300347	泰格医药	6,200	383,594.00	0.31
59	002736	国信证券	41,900	381,290.00	0.30
60	002572	索菲亚	11,700	376,506.00	0.30
61	000977	浪潮信息	15,690	374,206.50	0.30
62	300296	利亚德	28,550	367,724.00	0.29
63	000157	中联重科	89,341	367,191.51	0.29
64	000625	长安汽车	40,597	365,373.00	0.29
65	000425	徐工机械	84,100	356,584.00	0.28
66	002410	广联达	12,662	351,117.26	0.28
67	000703	恒逸石化	23,440	348,787.20	0.28
68	000830	鲁西化工	20,400	348,432.00	0.28
69	002049	紫光国芯	7,700	339,724.00	0.27
70	002007	华兰生物	10,400	334,464.00	0.27
71	002405	四维图新	16,500	334,125.00	0.27
72	002340	格林美	54,610	330,390.50	0.26
73	300017	网宿科技	30,743	329,257.53	0.26

74	002065	东华软件	37,300	320,780.00	0.26
75	300144	宋城演艺	13,585	319,247.50	0.25
76	002001	新和成	16,301	309,066.96	0.25
77	000998	隆平高科	16,300	307,418.00	0.25
78	002038	双鹭药业	8,013	304,413.87	0.24
79	002050	三花股份	16,027	302,108.95	0.24
80	000786	北新建材	16,296	301,964.88	0.24
81	002179	中航光电	7,694	300,066.00	0.24
82	002271	东方雨虹	17,629	299,869.29	0.24
83	002384	东山精密	12,400	297,600.00	0.24
84	000623	吉林敖东	16,515	296,939.70	0.24
85	002146	荣盛发展	34,000	296,820.00	0.24
86	300168	万达信息	14,400	293,760.00	0.23
87	000418	小天鹅 A	4,200	291,270.00	0.23
88	000728	国元证券	38,600	285,640.00	0.23
89	300601	康泰生物	4,600	285,430.00	0.23
90	002508	老板电器	9,300	284,766.00	0.23
91	000793	华闻传媒	33,800	283,920.00	0.23
92	000792	盐湖股份	26,200	283,484.00	0.23
93	002714	牧原股份	6,300	280,098.00	0.22
94	002311	海大集团	13,240	279,364.00	0.22
95	002075	沙钢股份	17,300	278,876.00	0.22
96	000860	顺鑫农业	7,400	277,500.00	0.22
97	002092	中泰化学	28,600	275,704.00	0.22
98	002673	西部证券	36,248	273,672.40	0.22
99	002797	第一创业	40,220	272,289.40	0.22
100	000825	太钢不锈	45,300	271,800.00	0.22
101	002081	金螳螂	26,877	271,457.70	0.22
102	000630	铜陵有色	121,200	267,852.00	0.21
103	002129	中环股份	34,100	267,003.00	0.21
104	300253	卫宁健康	21,512	266,533.68	0.21
105	002589	瑞康医药	19,510	266,116.40	0.21
106	002078	太阳纸业	27,200	263,568.00	0.21
107	002217	合力泰	31,700	261,525.00	0.21
108	002294	信立泰	7,000	260,190.00	0.21
109	300383	光环新网	19,300	258,813.00	0.21
110	000066	长城电脑	36,328	258,292.08	0.21
111	000513	丽珠集团	5,791	254,514.45	0.20
112	002195	二三四五	59,445	254,424.60	0.20

113	000876	新希望	40,100	254,234.00	0.20
114	300146	汤臣倍健	15,000	249,000.00	0.20
115	000709	河钢股份	84,300	248,685.00	0.20
116	000839	中信国安	52,200	246,906.00	0.20
117	002465	海格通信	30,630	245,958.90	0.20
118	002176	江特电机	25,175	244,701.00	0.20
119	000050	深天马A	17,200	244,584.00	0.20
120	000656	金科股份	50,400	241,920.00	0.19
121	000581	威孚高科	10,816	239,141.76	0.19
122	000826	启迪桑德	13,680	239,126.40	0.19
123	002493	荣盛石化	22,550	232,716.00	0.19
124	000690	宝新能源	33,400	232,464.00	0.19
125	300266	兴源环境	11,600	231,884.00	0.19
126	002268	卫士通	10,520	229,651.60	0.18
127	300166	东方国信	15,399	226,827.27	0.18
128	000983	西山煤电	30,106	226,096.06	0.18
129	002439	启明星辰	10,600	224,932.00	0.18
130	000961	中南建设	35,400	223,374.00	0.18
131	002624	完美世界	7,200	223,272.00	0.18
132	000060	中金岭南	45,441	220,843.26	0.18
133	002223	鱼跃医疗	11,324	220,704.76	0.18
134	002127	南极电商	23,400	219,726.00	0.18
135	000488	晨鸣纸业	17,000	219,640.00	0.18
136	300009	安科生物	11,898	219,399.12	0.18
137	000778	新兴铸管	50,700	216,996.00	0.17
138	002035	华帝股份	8,800	214,984.00	0.17
139	300450	先导智能	7,088	214,341.12	0.17
140	002019	亿帆鑫富	12,100	213,565.00	0.17
141	002085	万丰奥威	22,680	213,192.00	0.17
142	000596	古井贡酒	2,400	213,072.00	0.17
143	300088	长信科技	36,700	212,860.00	0.17
144	000039	中集集团	16,000	212,480.00	0.17
145	002352	顺丰控股	4,700	211,500.00	0.17
146	002500	山西证券	31,200	210,288.00	0.17
147	002821	凯莱英	2,400	209,352.00	0.17
148	002558	巨人网络	8,800	209,264.00	0.17
149	000999	华润三九	7,490	208,446.70	0.17
150	000415	渤海金控	35,682	208,382.88	0.17
151	300170	汉得信息	12,800	207,872.00	0.17

152	000750	国海证券	58,200	207,774.00	0.17
153	300315	掌趣科技	49,650	207,537.00	0.17
154	002221	东华能源	21,194	207,065.38	0.17
155	002110	三钢闽光	12,900	206,787.00	0.17
156	000997	新大陆	13,000	204,750.00	0.16
157	002602	世纪华通	6,300	204,750.00	0.16
158	002640	跨境通	13,400	201,268.00	0.16
159	300433	蓝思科技	9,374	196,666.52	0.16
160	002408	齐翔腾达	16,000	196,480.00	0.16
161	000887	中鼎股份	13,600	195,976.00	0.16
162	002470	金正大	28,468	195,859.84	0.16
163	300418	昆仑万维	10,300	194,464.00	0.16
164	002074	国轩高科	13,800	194,028.00	0.15
165	000040	东旭蓝天	19,200	193,920.00	0.15
166	002262	恩华药业	9,600	192,096.00	0.15
167	300027	华谊兄弟	31,133	191,779.28	0.15
168	002013	中航机电	25,270	191,293.90	0.15
169	000732	泰禾集团	9,736	189,365.20	0.15
170	002183	怡亚通	28,400	188,860.00	0.15
171	002371	七星电子	3,800	188,746.00	0.15
172	000932	华菱钢铁	22,200	188,700.00	0.15
173	000939	*ST凯迪	37,700	188,123.00	0.15
174	000671	阳光城	31,450	187,756.50	0.15
175	002185	华天科技	33,290	187,755.60	0.15
176	300251	光线传媒	18,340	186,701.20	0.15
177	000402	金融街	23,033	185,415.65	0.15
178	002153	石基信息	6,300	182,700.00	0.15
179	000988	华工科技	12,599	182,055.55	0.15
180	300182	捷成股份	23,945	181,503.10	0.14
181	000960	锡业股份	15,100	181,351.00	0.14
182	000686	东北证券	28,150	180,441.50	0.14
183	000009	中国宝安	36,600	179,340.00	0.14
184	000938	紫光股份	2,800	175,280.00	0.14
185	000975	银泰资源	17,280	175,219.20	0.14
186	000930	中粮生化	17,000	175,100.00	0.14
187	300271	华宇软件	9,882	174,713.76	0.14
188	300014	亿纬锂能	9,875	173,800.00	0.14
189	002147	新光圆成	11,740	173,282.40	0.14
190	002385	大北农	41,950	173,253.50	0.14

191	002273	水晶光电	13,415	172,651.05	0.14
192	300558	贝达药业	3,100	172,577.00	0.14
193	000046	泛海控股	30,300	172,407.00	0.14
194	002506	协鑫集成	36,800	172,224.00	0.14
195	000559	万向钱潮	25,100	170,680.00	0.14
196	300073	当升科技	5,000	170,300.00	0.14
197	300324	旋极信息	17,913	169,994.37	0.14
198	000401	冀东水泥	19,100	169,417.00	0.14
199	002138	顺络电子	10,500	168,105.00	0.13
200	002497	雅化集团	15,900	167,586.00	0.13
201	002030	达安基因	10,691	164,855.22	0.13
202	300274	阳光电源	18,360	164,689.20	0.13
203	002373	千方科技	12,600	164,430.00	0.13
204	002491	通鼎互联	14,800	163,836.00	0.13
205	000681	视觉中国	5,700	163,590.00	0.13
206	300413	快乐购	4,300	163,142.00	0.13
207	000729	燕京啤酒	24,100	162,193.00	0.13
208	000970	中科三环	17,100	159,885.00	0.13
209	002032	苏泊尔	3,100	159,650.00	0.13
210	002610	爱康科技	75,500	158,550.00	0.13
211	000528	柳工	14,800	158,508.00	0.13
212	000008	神州高铁	31,800	157,728.00	0.13
213	300316	晶盛机电	11,820	157,087.80	0.13
214	002280	联络互动	27,450	157,014.00	0.13
215	000547	航天发展	20,100	156,981.00	0.13
216	000717	韶钢松山	23,800	156,128.00	0.12
217	300090	盛运环保	18,700	155,584.00	0.12
218	300010	立思辰	12,701	155,460.24	0.12
219	300287	飞利信	21,500	154,585.00	0.12
220	002341	新纶科技	11,600	154,164.00	0.12
221	000878	云南铜业	16,102	153,613.08	0.12
222	002407	多氟多	10,850	152,117.00	0.12
223	002353	杰瑞股份	9,351	151,953.75	0.12
224	300203	聚光科技	5,900	151,040.00	0.12
225	000627	天茂集团	21,500	150,930.00	0.12
226	002281	光迅科技	7,100	150,520.00	0.12
227	002023	海特高新	12,000	150,480.00	0.12
228	000591	太阳能	41,100	150,426.00	0.12
229	000883	湖北能源	36,600	150,426.00	0.12

230	002051	中工国际	9,814	149,859.78	0.12
231	000898	鞍钢股份	26,900	149,833.00	0.12
232	002028	思源电气	8,900	149,431.00	0.12
233	002573	清新环境	12,900	148,995.00	0.12
234	300113	顺网科技	8,530	148,507.30	0.12
235	002399	海普瑞	6,694	148,205.16	0.12
236	002440	闰土股份	12,650	147,878.50	0.12
237	300033	同花顺	3,800	147,706.00	0.12
238	000598	兴蓉环境	36,300	147,378.00	0.12
239	002396	星网锐捷	7,198	147,343.06	0.12
240	002174	游族网络	7,401	147,279.90	0.12
241	002563	森马服饰	10,100	144,430.00	0.12
242	002168	深圳惠程	14,000	143,920.00	0.11
243	300618	寒锐钴业	1,120	143,740.80	0.11
244	000807	云铝股份	27,700	143,486.00	0.11
245	300133	华策影视	13,460	143,349.00	0.11
246	300188	美亚柏科	7,800	142,740.00	0.11
247	002366	台海核电	10,000	142,600.00	0.11
248	000516	国际医学	29,650	142,023.50	0.11
249	000078	海王生物	29,500	141,895.00	0.11
250	000089	深圳机场	18,479	141,364.35	0.11
251	300115	长盈精密	10,849	140,711.53	0.11
252	002583	海能达	16,840	140,614.00	0.11
253	300055	万邦达	12,200	140,178.00	0.11
254	300197	铁汉生态	26,088	140,092.56	0.11
255	300058	蓝色光标	24,522	139,775.40	0.11
256	300285	国瓷材料	7,000	139,580.00	0.11
257	002368	太极股份	4,800	139,536.00	0.11
258	002426	胜利精密	38,700	139,320.00	0.11
259	002383	合众思壮	8,400	139,020.00	0.11
260	002603	以岭药业	9,868	137,954.64	0.11
261	002004	华邦健康	27,050	137,414.00	0.11
262	002601	佰利联	10,600	137,058.00	0.11
263	000738	中航动控	10,251	136,645.83	0.11
264	002244	滨江集团	26,200	136,240.00	0.11
265	002701	奥瑞金	24,720	134,971.20	0.11
266	002665	首航节能	23,180	134,444.00	0.11
267	002411	必康股份	4,700	133,198.00	0.11
268	002600	江粉磁材	25,600	132,864.00	0.11

269	300036	超图软件	6,500	132,535.00	0.11
270	300355	蒙草生态	22,040	132,460.40	0.11
271	002597	金禾实业	6,500	131,820.00	0.11
272	300226	上海钢联	2,200	131,670.00	0.11
273	002517	恺英网络	18,300	131,577.00	0.11
274	002131	利欧股份	62,510	131,271.00	0.10
275	000799	酒鬼酒	4,700	130,425.00	0.10
276	002358	森源电气	8,600	129,430.00	0.10
277	000028	国药一致	2,587	129,091.30	0.10
278	000848	承德露露	12,160	128,774.40	0.10
279	002285	世联行	20,500	128,535.00	0.10
280	000917	电广传媒	22,200	127,872.00	0.10
281	300463	迈克生物	5,100	127,143.00	0.10
282	300199	翰宇药业	8,900	127,092.00	0.10
283	002191	劲嘉股份	16,900	126,243.00	0.10
284	002372	伟星新材	7,100	125,599.00	0.10
285	002831	裕同科技	2,500	125,000.00	0.10
286	002152	广电运通	21,175	124,509.00	0.10
287	002555	三七互娱	10,200	123,930.00	0.10
288	300496	中科创达	4,200	123,774.00	0.10
289	300026	红日药业	33,900	123,735.00	0.10
290	002595	豪迈科技	7,100	123,469.00	0.10
291	002151	北斗星通	4,800	123,360.00	0.10
292	002343	慈文传媒	6,560	123,131.20	0.10
293	002745	木林森	6,900	122,751.00	0.10
294	000758	中色股份	27,238	122,571.00	0.10
295	300098	高新兴	15,323	122,277.54	0.10
296	300367	东方网力	9,750	121,875.00	0.10
297	300159	新研股份	17,200	121,776.00	0.10
298	000059	华锦股份	17,500	120,575.00	0.10
299	000800	一汽轿车	16,000	119,680.00	0.10
300	002501	利源精制	19,300	119,660.00	0.10
301	002699	美盛文化	6,320	118,563.20	0.09
302	002266	浙富控股	31,500	118,125.00	0.09
303	300244	迪安诊断	6,200	117,862.00	0.09
304	002444	巨星科技	10,700	117,807.00	0.09
305	000031	中粮地产	20,287	117,258.86	0.09
306	002250	联化科技	13,253	116,891.46	0.09
307	000902	新洋丰	12,700	116,840.00	0.09

308	002431	棕榈股份	17,250	115,747.50	0.09
309	002709	天赐材料	3,000	115,620.00	0.09
310	300377	赢时胜	8,500	115,515.00	0.09
311	002180	纳斯达	4,200	115,332.00	0.09
312	000935	四川双马	7,400	114,552.00	0.09
313	000016	深康佳 A	21,800	114,450.00	0.09
314	000666	经纬纺机	6,300	113,904.00	0.09
315	000989	九芝堂	6,000	113,400.00	0.09
316	300101	振芯科技	8,000	113,040.00	0.09
317	002716	金贵银业	6,700	112,828.00	0.09
318	002108	沧州明珠	19,029	111,700.23	0.09
319	300212	易华录	4,720	111,628.00	0.09
320	000507	珠海港	11,900	111,622.00	0.09
321	002025	航天电器	4,821	111,365.10	0.09
322	002668	奥马电器	5,540	111,354.00	0.09
323	000723	美锦能源	20,500	111,315.00	0.09
324	002419	天虹商场	7,600	110,960.00	0.09
325	300207	欣旺达	12,302	110,841.02	0.09
326	000012	南玻 A	22,385	110,805.75	0.09
327	000027	深圳能源	22,430	110,804.20	0.09
328	002505	大康农业	51,400	109,996.00	0.09
329	000156	华数传媒	11,400	109,896.00	0.09
330	300222	科大智能	5,900	109,386.00	0.09
331	000006	深振业 A	18,600	108,996.00	0.09
332	002128	露天煤业	12,000	108,720.00	0.09
333	000933	*ST 神火	22,600	108,706.00	0.09
334	300373	扬杰科技	3,800	108,680.00	0.09
335	002672	东江环保	8,300	108,647.00	0.09
336	002089	新海宜	17,900	108,295.00	0.09
337	002477	雏鹰农牧	32,700	108,237.00	0.09
338	300308	中际装备	1,800	108,072.00	0.09
339	300053	欧比特	9,300	107,880.00	0.09
340	000926	福星股份	15,000	107,850.00	0.09
341	002056	横店东磁	15,200	106,552.00	0.09
342	000718	苏宁环球	28,990	106,393.30	0.08
343	002120	新海股份	1,999	106,046.95	0.08
344	002390	信邦制药	14,450	105,774.00	0.08
345	300628	亿联网络	1,600	105,456.00	0.08
346	300476	胜宏科技	6,800	104,720.00	0.08

347	300145	中金环境	13,300	104,139.00	0.08
348	002449	国星光电	9,780	104,059.20	0.08
349	300294	博雅生物	3,350	103,816.50	0.08
350	300054	鼎龙股份	11,900	103,768.00	0.08
351	300118	东方日升	9,600	103,680.00	0.08
352	002155	湖南黄金	15,145	103,591.80	0.08
353	300459	金科娱乐	10,700	103,362.00	0.08
354	002812	创新股份	2,100	103,173.00	0.08
355	300068	南都电源	8,600	103,028.00	0.08
356	002839	张家港行	16,900	102,921.00	0.08
357	300257	开山股份	6,700	102,443.00	0.08
358	002156	通富微电	9,400	101,802.00	0.08
359	000021	深科技	14,900	101,618.00	0.08
360	002402	和而泰	12,200	101,260.00	0.08
361	002596	海南瑞泽	9,800	100,548.00	0.08
362	002091	江苏国泰	15,600	99,060.00	0.08
363	002389	南洋科技	7,300	98,842.00	0.08
364	002437	誉衡药业	15,891	98,524.20	0.08
365	300002	神州泰岳	23,532	98,128.44	0.08
366	002157	正邦科技	24,100	98,087.00	0.08
367	002212	南洋股份	8,200	97,498.00	0.08
368	002292	奥飞娱乐	10,900	97,337.00	0.08
369	000563	陕国投 A	28,600	97,240.00	0.08
370	002036	联创电子	7,400	97,088.00	0.08
371	000400	许继电气	12,400	96,844.00	0.08
372	000036	华联控股	16,300	96,822.00	0.08
373	002670	国盛金控	8,976	96,671.52	0.08
374	000685	中山公用	12,100	96,437.00	0.08
375	000727	华东科技	51,200	96,256.00	0.08
376	300078	思创医惠	9,980	94,610.40	0.08
377	002424	贵州百灵	8,300	94,288.00	0.08
378	002400	省广股份	29,169	94,215.87	0.08
379	000712	锦龙股份	9,400	93,812.00	0.07
380	002048	宁波华翔	7,600	93,708.00	0.07
381	002421	达实智能	23,100	93,555.00	0.07
382	002249	大洋电机	21,700	93,527.00	0.07
383	000034	神州数码	5,800	92,684.00	0.07
384	002354	天神娱乐	10,000	92,600.00	0.07
385	000980	金马股份	13,000	92,430.00	0.07

386	300001	特锐德	8,100	92,016.00	0.07
387	000869	张裕A	2,300	91,678.00	0.07
388	002123	梦网荣信	10,300	91,567.00	0.07
389	002299	圣农发展	5,900	91,391.00	0.07
390	001965	招商公路	11,100	90,354.00	0.07
391	000910	大亚科技	5,300	89,570.00	0.07
392	300323	华灿光电	6,900	89,148.00	0.07
393	002916	深南电路	1,400	88,914.00	0.07
394	002237	恒邦股份	9,700	88,561.00	0.07
395	300020	银江股份	9,300	88,443.00	0.07
396	002061	*ST江化	8,400	87,948.00	0.07
397	002664	信质电机	3,500	87,850.00	0.07
398	000088	盐田港	13,300	87,647.00	0.07
399	002544	杰赛科技	6,400	87,616.00	0.07
400	000937	冀中能源	21,315	87,604.65	0.07
401	002468	申通快递	5,100	87,465.00	0.07
402	000587	金洲慈航	17,500	86,800.00	0.07
403	002055	得润电子	5,400	86,130.00	0.07
404	000667	美好集团	40,410	86,073.30	0.07
405	300699	光威复材	1,900	85,880.00	0.07
406	002073	软控股份	14,900	85,675.00	0.07
407	000979	中弘股份	84,264	85,106.64	0.07
408	002047	宝鹰股份	14,400	84,384.00	0.07
409	002635	安洁科技	4,900	84,280.00	0.07
410	000921	海信科龙	8,100	83,916.00	0.07
411	300083	劲胜精密	17,400	83,868.00	0.07
412	002222	福晶科技	6,400	83,456.00	0.07
413	300038	梅泰诺	7,800	83,148.00	0.07
414	002242	九阳股份	4,700	83,143.00	0.07
415	002251	步步高	7,300	83,074.00	0.07
416	000901	航天科技	8,250	82,665.00	0.07
417	002512	达华智能	8,500	82,450.00	0.07
418	000592	平潭发展	28,900	82,076.00	0.07
419	000155	*ST川化	14,600	81,906.00	0.07
420	300085	银之杰	6,310	81,903.80	0.07
421	002308	威创股份	9,700	80,510.00	0.06
422	002807	江阴银行	14,300	80,366.00	0.06
423	000877	天山股份	11,900	80,325.00	0.06
424	000687	华讯方舟	8,700	80,127.00	0.06

425	002233	塔牌集团	7,000	80,080.00	0.06
426	000158	常山股份	11,650	80,035.50	0.06
427	000426	兴业矿业	11,100	80,031.00	0.06
428	002043	兔宝宝	10,400	79,664.00	0.06
429	002245	澳洋顺昌	12,300	79,581.00	0.06
430	002303	美盈森	14,984	79,115.52	0.06
431	002434	万里扬	9,000	79,020.00	0.06
432	002503	搜于特	22,400	78,400.00	0.06
433	002429	兆驰股份	31,550	78,244.00	0.06
434	002143	印纪传媒	6,420	77,617.80	0.06
435	002657	中科金财	4,900	77,616.00	0.06
436	000553	沙隆达 A	4,900	77,469.00	0.06
437	300676	华大基因	800	77,448.00	0.06
438	000822	山东海化	11,100	77,367.00	0.06
439	000061	农产品	14,300	77,220.00	0.06
440	300666	江丰电子	1,400	77,182.00	0.06
441	002841	视源股份	1,440	76,910.40	0.06
442	000525	红太阳	4,500	76,275.00	0.06
443	000762	西藏矿业	7,900	76,077.00	0.06
444	000090	天健集团	12,264	76,036.80	0.06
445	002608	江苏国信	11,000	75,900.00	0.06
446	002773	康弘药业	1,450	75,414.50	0.06
447	300431	暴风集团	4,960	75,292.80	0.06
448	000537	广宇发展	7,800	75,192.00	0.06
449	300156	神雾环保	11,138	74,290.46	0.06
450	002643	万润股份	9,900	73,953.00	0.06
451	002428	云南锗业	9,500	73,340.00	0.06
452	000789	万年青	6,700	73,298.00	0.06
453	002642	荣之联	7,900	72,601.00	0.06
454	000539	粤电力 A	17,100	72,504.00	0.06
455	000600	建投能源	12,900	71,853.00	0.06
456	002489	浙江永强	19,500	70,980.00	0.06
457	002542	中化岩土	13,200	70,488.00	0.06
458	000555	神州信息	5,300	70,384.00	0.06
459	300075	数字政通	5,200	70,148.00	0.06
460	002509	天广中茂	24,100	70,131.00	0.06
461	000990	诚志股份	5,000	70,000.00	0.06
462	300273	和佳股份	10,280	69,698.40	0.06
463	300364	中文在线	9,855	69,379.20	0.06

464	002010	传化股份	5,700	69,255.00	0.06
465	000062	深圳华强	3,500	68,600.00	0.05
466	300134	大富科技	7,600	67,944.00	0.05
467	000049	德赛电池	2,400	67,728.00	0.05
468	002011	盾安环境	10,500	67,200.00	0.05
469	300317	珈伟股份	5,586	66,473.40	0.05
470	002320	海峡股份	3,500	66,325.00	0.05
471	000710	贝瑞基因	1,300	65,468.00	0.05
472	300474	景嘉微	1,400	65,072.00	0.05
473	002482	广田集团	10,750	64,177.50	0.05
474	002302	西部建设	5,800	62,466.00	0.05
475	300458	全志科技	3,407	61,053.44	0.05
476	002190	成飞集成	3,500	59,815.00	0.05
477	002920	德赛西威	2,000	59,800.00	0.05
478	300310	宜通世纪	9,334	59,550.92	0.05
479	000959	首钢股份	14,300	58,773.00	0.05
480	002625	龙生股份	4,913	57,531.23	0.05
481	002522	浙江众成	8,800	56,936.00	0.05
482	000612	焦作万方	10,800	56,700.00	0.05
483	002261	拓维信息	12,100	55,660.00	0.04
484	300291	华录百纳	7,632	53,805.60	0.04
485	000564	西安民生	10,900	52,102.00	0.04
486	000806	银河生物	12,000	51,960.00	0.04
487	002080	中材科技	5,800	49,300.00	0.04
488	000615	京汉股份	7,800	49,062.00	0.04
489	002648	卫星石化	4,400	48,532.00	0.04
490	000987	越秀金控	5,400	42,444.00	0.03
491	002681	奋达科技	4,880	42,260.80	0.03
492	300116	坚瑞消防	12,700	35,052.00	0.03
493	000617	*ST 济柴	2,400	26,976.00	0.02
494	002911	佛燃股份	1,100	24,563.00	0.02
495	002907	华森制药	800	22,456.00	0.02
496	000766	通化金马	1,800	21,384.00	0.02
497	002018	华信国际	1,080	1,566.00	0.00
498	002276	万马股份	100	584.00	0.00
499	000620	新华联	100	567.00	0.00
500	002099	海翔药业	100	513.00	0.00
501	002130	沃尔核材	100	436.00	0.00
502	002175	东方网络	100	381.00	0.00

503	000018	神州长城	100	332.00	0.00
504	000751	锌业股份	100	326.00	0.00
505	000875	吉电股份	100	283.00	0.00
506	300185	通裕重工	100	181.00	0.00

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	000566	海南海药	18,500	238,465.00	0.19
2	300747	锐科激光	1,543	123,995.48	0.10
3	300276	三丰智能	4,601	56,040.18	0.04
4	300005	探路者	13,500	52,380.00	0.04
5	000693	*ST 华泽	8,000	26,480.00	0.02
6	002467	二六三	190	1,029.80	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	002027	分众传媒	438,759.00	0.28
2	000830	鲁西化工	354,029.00	0.23
3	002236	大华股份	337,230.00	0.22
4	002594	比亚迪	301,284.00	0.20
5	002035	华帝股份	290,823.00	0.19
6	000401	冀东水泥	276,157.00	0.18
7	000040	东旭蓝天	269,949.00	0.18
8	300601	康泰生物	262,181.00	0.17
9	000591	太阳能	234,869.00	0.15
10	002202	金风科技	227,696.00	0.15
11	000717	韶钢松山	224,027.00	0.15
12	002497	雅化集团	223,471.00	0.14
13	002821	凯莱英	210,311.00	0.14
14	002074	国轩高科	207,132.00	0.13
15	300316	晶盛机电	205,919.00	0.13
16	000703	恒逸石化	200,711.00	0.13
17	002262	恩华药业	190,838.00	0.12
18	000932	华菱钢铁	188,478.00	0.12

19	000413	东旭光电	186,424.00	0.12
20	002597	金禾实业	176,607.00	0.11

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	000651	格力电器	658,180.00	0.43
2	000002	万科A	503,064.00	0.33
3	000333	美的集团	490,154.00	0.32
4	000858	五粮液	409,848.00	0.27
5	002236	大华股份	407,736.00	0.26
6	000725	京东方A	374,553.00	0.24
7	002202	金风科技	309,954.00	0.20
8	000001	平安银行	299,417.00	0.19
9	002916	深南电路	298,851.04	0.19
10	002074	国轩高科	260,714.50	0.17
11	300104	乐视网	253,681.68	0.16
12	002926	华西证券	248,642.94	0.16
13	002925	盈趣科技	245,106.12	0.16
14	300498	温氏股份	239,700.00	0.16
15	002415	海康威视	237,637.00	0.15
16	000697	炼石有色	231,010.00	0.15
17	300750	宁德时代	222,151.45	0.14
18	002920	德赛西威	208,833.30	0.14
19	000063	中兴通讯	198,964.00	0.13
20	300454	深信服	183,417.40	0.12

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	17,463,111.03
卖出股票收入（成交）总额	26,657,018.96

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	1,038,857.00	0.83
2	央行票据	-	-
3	金融债券	4,015,200.00	3.20
	其中：政策性金融债	4,015,200.00	3.20
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	5,054,057.00	4.03

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	018005	国开 1701	40,000	4,015,200.00	3.20
2	019585	18 国债 03	10,000	1,000,800.00	0.80
3	019579	17 国债 24	380	38,057.00	0.03

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

本基金本报告期末未持有股指期货。

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

本基金本报告期末未持有国债期货。

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

本基金本报告期末持有国债期货。

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	3,203.01
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	51,176.54
5	应收申购款	565,837.42
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	620,216.97

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	000566	海南海药	238,465.00	0.19	重大事项停牌
2	000693	*ST 华泽	26,480.00	0.02	重大事项停牌

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
融通深证成份指数 A/B	7,208	21,976.45	198,051.80	0.13%	158,208,205.81	99.87%
融通深证成份指数 C	23	578.60	0.00	0.00%	13,307.90	100.00%
合计	7,231	21,908.39	198,051.80	0.13%	158,221,513.71	99.87%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	融通深证成份指数 A/B	58,413.22	0.0369%
	融通深证成份指数 C	285.54	2.1456%
	合计	58,698.76	0.0371%

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	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	融通深证成份指数 A/B	0
	融通深证成份指数 C	0
	合计	0
本基金基金经理持 有本开放式基金	融通深证成份指数 A/B	0
	融通深证成份指数 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	融通深证成份指 数 A/B	融通深证成份指 数 C
基金合同生效日 (2010 年 11 月 15 日) 基金 份额总额	1,848,841,553.44	-
本报告期初基金份额总额	169,149,923.82	7,410.37

本报告期基金总申购份额	9,914,107.23	274,975.92
减:本报告期基金总赎回份额	20,657,773.44	269,078.39
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	158,406,257.61	13,307.90

§ 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

2018年7月28日，本基金管理人发布了《融通基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，经本基金管理人第六届董事会第五次临时会议审议并通过，同意刘晓玲女士辞去公司副总经理职务。

10.2.2 基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产及基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘请的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙），该事务所自基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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	
长江证券	1	41,945,855.03	96.98%	38,225.55	96.98%	-

天风证券	1	1,306,886.87	3.02%	1,190.91	3.02%	-
中信证券(山东)	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
西藏东方财富	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	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，本基金新增中信证券（山东）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

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
长江证券	5,402,367.27	50.79%	-	-	-	-
天风证券	42,294.00	0.40%	-	-	-	-
中信证券（山东）	5,043,257.00	47.41%	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
西藏东方财富	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
海通证券	148,900.00	1.40%	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	披露方式	披露日期
1	关于中泰证券代销的旗下部分开放式基金开展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	2018-1-31

2	关于新时代证券代销的旗下部分开放式基金新增开通定期定额投资业务的公告	证券时报、管理人网站	2018-3-13
3	关于修改《融通深证成份指数证券投资基金基金合同》部分条款的公告	证券时报、管理人网站	2018-3-22
4	融通基金关于新增中证金牛（北京）投资咨询有限公司为代销机构并开通定期定额投资业务、转换业务及参加其申购费率优惠活动的公告	证券时报、管理人网站	2018-3-22
5	关于融通基金管理有限公司旗下部分开放式基金在中国民生银行股份有限公司开通转换业务的公告	证券时报、管理人网站	2018-3-22
6	关于融通基金管理有限公司旗下部分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	2018-3-30
7	关于融通旗下部分开放式基金参加交通银行手机银行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	2018-3-30
8	融通基金关于新增北京蛋卷基金销售有限公司为代销机构并开通定期定额投资业务、转换业务及参加其申购费率优惠活动的公告	证券时报、管理人网站	2018-4-16
9	融通基金管理有限公司关于新增金惠家保险代理有限公司为代销机构并开通定期定额投资业务、转换业务及参加其申购费率优惠活动的公告	证券时报、管理人网站	2018-5-14
10	融通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加中国银河证券股份有限公司基金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	2018-5-21
11	关于融通基金管理有限公司旗下基金参加嘉实财富管理有限公司申购费率优惠的费率调整公告	证券时报、管理人网站	2018-6-5
12	关于融通基金管理有限公司旗下部分开放式基	证券时报、管理人网站	2018-6-30

金参加中国交通银行股份有限公司基金申购及定期定额投资业务费率优惠活动的公告		
---------------------------------------	--	--

§ 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

1、根据 2016 年 12 月 25 日财政部、国家税务总局联合下发的《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》（财税〔2016〕140 号）、2017 年 1 月 10 日财政部、国家税务总局联合下发的《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》（财税〔2017〕2 号）及财政部 2017 年 6 月 30 日发布的《关于资管产品增值税有关问题的通知》（财税〔2017〕56 号）的通知，现明确自 2018 年 1 月 1 日起，基金管理人运营公募基金及资管产品（以下简称“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。

自 2018 年 1 月 1 日（含）起，本基金管理人将对旗下存续及新增产品发生的增值税应税行为按照相关规定以及税务机关的要求计算和缴纳增值税税款及附加税费。前述税款及附加税费是产品管理、运作和处分过程中发生的，将由产品资产承担，从产品资产中提取缴纳，可能对产品收益水平有所影响，敬请广大投资者知悉。

2、根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》的要求，本基金管理人经与基金托管人协商一致，对本基金合同进行了修订和更新。本次修订和更新仅涉及与《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》相关的条款，包括前言、释义、基金份额的申购与赎回、基金的投资、基金资产估值、基金的信息披露等，具体内容详见 2018 年 3 月 22 日基金管理人网站披露的相关公告和修订更新后的法律文件。

§ 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

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。

融通基金管理有限公司

2018 年 8 月 27 日