

融通通利系列证券投资基金之
融通蓝筹成长证券投资基金
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

融通通利系列证券投资基金由融通债券投资基金、融通深证 100 指数证券投资基金和融通蓝筹成长证券投资基金共同构成。本报告为融通通利系列证券投资基金之子基金融通蓝筹成长证券投资基金（以下简称“本基金”）2018 年半年度报告。

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《融通通利系列证券投资基金基金合同》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。

本报告中的财务资料未经审计。

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	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.....	6
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合规守信情况的说明.....	9
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合规守信情况声明.....	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	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.....	33
7.1 期末基金资产组合情况.....	33
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	34
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.....	34
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	36
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	42
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.....	43
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.....	43
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.....	43
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.....	43
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	43
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	43
7.12 投资组合报告附注.....	44
§ 8 基金份额持有人信息.....	44
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	44
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	44
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.....	44
§ 9 开放式基金份额变动.....	45
§ 10 重大事件揭示.....	45
10.1 基金份额持有人大会决议.....	45
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.....	45
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	45
10.4 基金投资策略的改变.....	45
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	45
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.....	45
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	45
10.8 其他重大事件.....	47
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	48
§ 12 备查文件目录.....	49

12.1 备查文件目录.....	49
12.2 存放地点.....	49
12.3 查阅方式.....	49

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	融通蓝筹成长证券投资基金
基金简称	融通蓝筹成长混合
基金主代码	161605
前端交易代码	161605
后端交易代码	161655
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2003 年 9 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
报告期末基金份额总额	585,248,471.75 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	组合投资，资本增值，为持有人获取长期稳定的投资收益。
投资策略	在对市场趋势判断的前提下，重视仓位选择和行业配置，同时更重视基本面分析，强调通过基本面分析挖掘个股。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×75%+中债综合全价（总值）指数收益率×25%
风险收益特征	力求获得超过市场平均水平的收益，承担相应的风险。

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	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报
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	基金管理人处、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(2018 年 1 月 1 日 - 2018 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-36,806,183.41
本期利润	-52,253,863.68
加权平均基金份额本期利润	-0.0875
本期加权平均净值利润率	-6.89%
本期基金份额净值增长率	-7.00%
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	108,047,630.70
期末可供分配基金份额利润	0.1846
期末基金资产净值	693,296,102.45
期末基金份额净值	1.185
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	328.00%

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

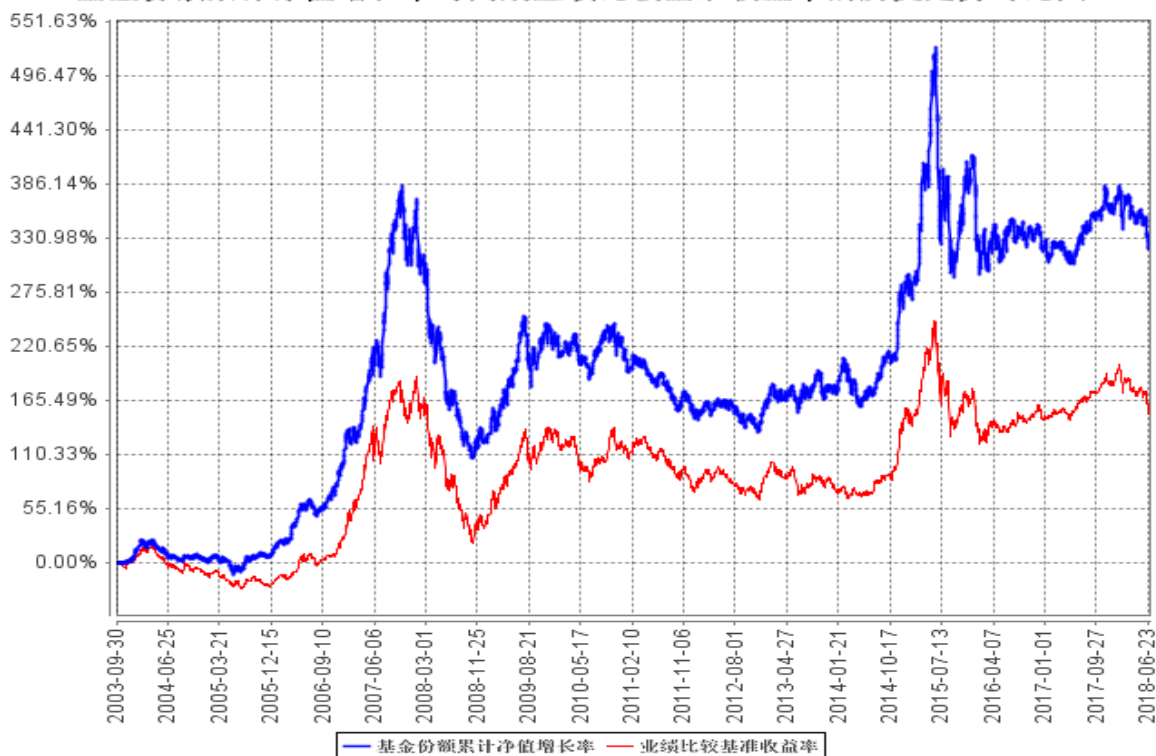
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-5.28%	1.02%	-5.69%	0.96%	0.41%	0.06%
过去三个月	-7.49%	0.87%	-7.25%	0.85%	-0.24%	0.02%
过去六个月	-7.00%	0.98%	-9.21%	0.86%	2.21%	0.12%

过去一年	-0.24%	0.88%	-2.79%	0.71%	2.55%	0.17%
过去三年	-14.33%	1.33%	-15.16%	1.12%	0.83%	0.21%
自基金合同生效起至今	328.00%	1.27%	157.13%	1.29%	170.87%	-0.02%

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

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：本基金业绩比较基准项目分段计算，其中：2009 年 12 月 31 日（含此日）之前采用“国泰君安指数×75%+银行间债券综合指数×25%”，2010 年 1 月 1 日起至 2015 年 9 月 30 日（含此日）采用“沪深 300 指数收益率×75%+中信标普全债指数收益率×25%”，自 2015 年 10 月 1 日起采用新基准“沪深 300 指数收益率×75%+中债综合全价（总值）指数收益率×25%”。

§ 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		
薛冀颖	本基金的基金经理	2015-6-19	-	7	薛冀颖先生，清华大学工学博士、西安电子科技大学工学学士，7 年证券投资从业经历，具有基金从业资格。历任鹏华基金管理有限公司研究员。2014 年 9 月加入融通基金管理有限公司，现任融通蓝筹成长混合基金的基金经理。

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的工作时间为计算标准。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

2018 年上半年市场冲高回落，其中上证综指下跌 13.9%，深证综指下跌 15.36%，创业板综指下跌 11.92%。2018 年上半年蓝筹成长基金持仓相对均衡，主要在于认为大盘蓝筹股在经过去年大幅上涨之后会出现明显分化，一些基本面能够持续超预期的个股仍然具有较好的配置价值，同时较多成长股在过去两年股价调整后估值已经处于较合理水平，一些优质成长股的股价长期来看具有一定吸引力，另外中国经济的韧性有可能超市场预期，一些周期行业的龙头公司也具有一定配置价值。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.185 元；本报告期基金份额净值增长率为-7.00%，业绩比较基准收益率为-9.21%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

今年上半年受中美贸易摩擦、金融去杠杆和社融数据低于预期等影响，证券市场有一定调整，但应该积极看到，经过供给侧改革、房地产去库存、金融去杠杆后，中国经济的韧性有望超市场预期，预计中国经济在较长时期内能够保持平稳增长。目前时点来看，较多优质公司股价已经有一定幅度的调整，而所处的行业景气度仍然较高，公司基本面再也不断向上，长期来看是值得布局的时点。预计未来整体市场仍有一定压制因素，风险偏好不会大幅提升，市场仍然会偏好现金流充裕、管理层优秀、发展前景明确的优质公司，对个股的筛选会更加苛刻，需要对各行业的景气变化和未来的发展潜力有更深入的研究和认知，在此基础上，挑选出竞争优势突出、发展前景

广阔、财务状况良好、盈利稳健增长的优质公司，并择时进行配置。

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其适用性的情况后及时修订估值方法，以保证其持续适用。估值政策和程序的修订须经公司总经理办公会议审批后方可实施。基金在采用新投资策略或投资新品种时，应评价现有估值政策和程序的适用性。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

本基金管理人于 2018 年 1 月 9 日实施利润分配，以 2017 年 12 月 31 日的可分配收益为基准，每 10 份基金份额派发现金红利 0.100 元。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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蓝筹成长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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，融通蓝筹成长证券投资基金的管理人——融通基金管理有限公司在融通蓝筹成长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，融通蓝筹成长证券投资基金对基金份额持有人进行了 1 次利润分配，分配金额为 6,132,354.07 元。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对融通基金管理有限公司编制和披露的融通蓝筹成长证券投资基金 2018 年上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：融通蓝筹成长证券投资基金

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	108,419,645.85	77,688,497.10
结算备付金		8,171,091.40	6,184,221.93
存出保证金		859,327.06	629,950.96
交易性金融资产	6.4.7.2	679,877,841.37	693,147,542.22
其中：股票投资		490,058,478.17	523,269,542.22
基金投资		-	-
债券投资		189,819,363.20	169,878,000.00
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		-	15,780,816.70

应收利息	6.4.7.5	3,625,616.78	4,892,074.73
应收股利		-	-
应收申购款		32,195.08	85,215.13
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		800,985,717.54	798,408,318.77
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		98,978,345.30	-
应付赎回款		352,791.78	458,450.41
应付管理人报酬		882,080.88	1,013,937.55
应付托管费		147,013.49	168,989.58
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	5,236,867.70	3,267,127.27
应交税费		1,249,200.00	1,249,200.00
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	843,315.94	849,132.44
负债合计		107,689,615.09	7,006,837.25
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	585,248,471.75	616,131,615.61
未分配利润	6.4.7.10	108,047,630.70	175,269,865.91
所有者权益合计		693,296,102.45	791,401,481.52
负债和所有者权益总计		800,985,717.54	798,408,318.77

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.185 元，基金份额总额 585,248,471.75 份。

6.2 利润表

会计主体：融通蓝筹成长证券投资基金

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		-30,977,827.10	28,698,310.78
1. 利息收入		3,490,459.31	3,077,251.17
其中：存款利息收入	6.4.7.11	310,374.52	326,977.61
债券利息收入		3,180,084.79	2,750,273.56
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		-19,025,750.13	-20,253,370.67
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-22,400,538.28	-22,146,738.88
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	279,240.10	-441,625.00
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	3,095,548.05	2,334,993.21
3. 公允价值变动收益	6.4.7.17	-15,447,680.27	45,867,964.95
4. 汇兑收益		-	-
5. 其他收入	6.4.7.18	5,143.99	6,465.33
减：二、费用		21,276,036.58	13,739,244.99
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	5,633,016.49	5,897,911.89
2. 托管费	6.4.10.2.2	938,836.05	982,985.28
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	14,595,305.89	6,741,914.38
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.20	108,878.15	116,433.44
三、利润总额		-52,253,863.68	14,959,065.79
减：所得税费用		-	-
四、净利润		-52,253,863.68	14,959,065.79

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：融通蓝筹成长证券投资基金

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）	616,131,615.61	175,269,865.91	791,401,481.52
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-52,253,863.68	-52,253,863.68
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-30,883,143.86	-8,836,017.46	-39,719,161.32
其中：1. 基金申购款	8,540,397.14	2,430,255.89	10,970,653.03
2. 基金赎回款	-39,423,541.00	-11,266,273.35	-50,689,814.35
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-6,132,354.07	-6,132,354.07
五、期末所有者权益（基金净值）	585,248,471.75	108,047,630.70	693,296,102.45
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）	689,010,366.15	127,219,610.87	816,229,977.02
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	14,959,065.79	14,959,065.79
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-23,984,353.62	-4,312,091.31	-28,296,444.93
其中：1. 基金申购款	12,006,545.22	1,878,207.55	13,884,752.77
2. 基金赎回款	-35,990,898.84	-6,190,298.86	-42,181,197.70
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-6,867,738.70	-6,867,738.70
五、期末所有者权益（基	665,026,012.53	130,998,846.65	796,024,859.18

金净值)			
------	--	--	--

注：报表附注为本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：

<u>张帆</u>	<u>颜锡廉</u>	<u>刘美丽</u>
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

融通蓝筹成长证券投资基金(以下简称“本基金”)是融通通利系列证券投资基金(以下简称“本系列基金”)之子基金,本系列基金经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2003]第 94 号《关于同意融通通利系列证券投资基金设立的批复》核准,由融通基金管理有限公司依照《证券投资基金管理暂行办法》及其实施细则、《开放式证券投资基金试点办法》等有关规定(后由《中华人民共和国证券投资基金法》及相关法规替代)和《融通通利系列证券投资基金基金契约》(后更名为《融通通利系列证券投资基金基金合同》)发起,并于 2003 年 9 月 30 日募集成立。本基金为契约型开放式,存续期限不定,本基金首次设立,包括认购资金利息共募集人民币 766,073,014.14 元,其中认购资金为人民币 765,997,626.40 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道验字(2003)第 138 号验资报告予以验证,认购资金产生利息为人民币 75,387.74 元。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《融通通利系列证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围仅限于具有良好流动性的金融工具,包括国内依法公开发行上市的股票、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金的投资范围中投资股票、债券的比例不低于基金资产总值的 80%;投资于国家债券的比例不低于基金资产净值的 20%;权证投资市值不超过基金资产净值的 3%;持有现金及到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。根据本基金的基金管理人于 2010 年 2 月 6 日发布的《融通基金管理有限公司关于变更旗下部分基金业绩比较基准的公告》,本基金的业绩比较基准变更为:沪深 300 指数收益率 X 75%+中信标普全债指数收益率 X 25%。根据本基金的基金管理人于 2015 年 11 月 11 日发布的《融通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金变更业绩比较基准及修改相关基金合同的公告》,自 2015 年 10 月 1 日起,本基金业绩比较基准变更为:沪深 300 指数收益率 X 75%+中债综合全价(总值)指数收益率 X 25%。

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颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《融通通利系列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 2018 年半年度财务报表符合企业会计准则的要求, 真实、完整地反映了本基金 2018 年 6 月 30 日的财务状况以及 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日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[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	108,419,645.85
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：	108,419,645.85

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		495,480,374.69	490,058,478.17	-5,421,896.52
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	69,501,855.50	69,549,363.20	47,507.70
	银行间市场	119,988,630.00	120,270,000.00	281,370.00
	合计	189,490,485.50	189,819,363.20	328,877.70
资产支持证券		-	-	-
合计		684,970,860.19	679,877,841.37	-5,093,018.82

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/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余额均为零。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中所取得的债券。

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	16,633.58
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	3,309.21
应收债券利息	3,605,325.96
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	348.03
合计	3,625,616.78

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	5,236,292.70
银行间市场应付交易费用	575.00
合计	5,236,867.70

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	750,000.00
应付赎回费	74.73
应付其他	3,981.06
预提费用	89,260.15
合计	843,315.94

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	616,131,615.61	616,131,615.61
本期申购	8,540,397.14	8,540,397.14
本期赎回	-39,423,541.00	-39,423,541.00
本期末	585,248,471.75	585,248,471.75

注：本期申购含红利再投资和转换入份额，本期赎回含转换出份额。

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	503,964,414.22	-328,694,548.31	175,269,865.91
本期利润	-36,806,183.41	-15,447,680.27	-52,253,863.68
本期基金份额交易产生的变动数	-25,280,037.19	16,444,019.73	-8,836,017.46
其中：基金申购款	6,954,205.44	-4,523,949.55	2,430,255.89
基金赎回款	-32,234,242.63	20,967,969.28	-11,266,273.35
本期已分配利润	-6,132,354.07	-	-6,132,354.07
本期末	435,745,839.55	-327,698,208.85	108,047,630.70

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	241,134.82
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	63,034.91
其他	6,204.79
合计	310,374.52

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	4,835,422,787.03
减：卖出股票成本总额	4,857,823,325.31
买卖股票差价收入	-22,400,538.28

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）成交总额	246,880,839.51
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	239,011,466.80
减：应收利息总额	7,590,132.61
买卖债券差价收入	279,240.10

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	3,095,548.05
基金投资产生的股利收益	-
合计	3,095,548.05

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	-15,447,680.27
——股票投资	-15,671,907.97
——债券投资	224,227.70
——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	-15,447,680.27

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	4,391.08
转换费	752.91
合计	5,143.99

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、本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不低于赎回费总额的 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	14,594,055.89
银行间市场交易费用	1,250.00
合计	14,595,305.89

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	39,671.58
信息披露费	49,588.57
其他	300.00
银行汇划费用	1,018.00
债券账户维护费	18,300.00
合计	108,878.15

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准日，本基金无需要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、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
新时代证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	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	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
新时代证券	2,694,731,999.55	27.89%	1,160,934,701.87	25.79%

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	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
-------	----------------------------	---------------------------------

	成交金额	占当期债券 成交总额的比例	成交金额	占当期债券 成交总额的比例
新时代证券	12,225,972.08	8.20%	-	-

6.4.10.1.3 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量 的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
新时代证券	2,464,395.27	27.69%	1,716,805.55	32.79%
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			
	当期佣金	占当期佣金总 量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
新时代证券	1,057,960.78	25.59%	247,397.10	13.07%

注：1、上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费后的净额列示。

2、该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

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	5,633,016.49	5,897,911.89
其中：支付销售机构的客户维护费	693,148.16	728,458.11

注：1、支付基金管理人融通基金管理有限公司的管理费按前一日基金资产净值 1.50%的费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值×1.50%÷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	938,836.05	982,985.28

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25%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×0.25%/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

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
基金合同生效日（2003年9月30日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	3,860,348.02	3,860,348.02
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	3,860,348.02	3,860,348.02
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.66%	0.58%

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

关联方名称	本期末 2018年6月30日		上年度末 2017年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
新时代证券	1,589,825.12	0.27%	1,589,825.12	0.26%

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	
	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	108,419,645.85	241,134.82	19,160,687.01	289,137.21

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

本基金本报告期及上年度可比期间均无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

金额单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
1	2018-1-9	2018-1-9	0.100	2,154,340.33	3,978,013.74	6,132,354.07	
合计	-	-	0.100	2,154,340.33	3,978,013.74	6,132,354.07	

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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
603693	江苏新能	2018-06-25	2018-07-03	新股流通受限	9.00	9.00	5,384	48,456.00	48,456.00	-
603706	东方环宇	2018-06-29	2018-07-09	新股流通受限	13.09	13.09	1,765	23,103.85	23,103.85	-
603105	芯能科技	2018-06-29	2018-07-09	新股流通受限	4.83	4.83	3,410	16,470.30	16,470.30	-
601138	工业富联	2018-05-28	2019-06-10	新股流通受限	13.77	16.40	495,662	6,825,265.74	8,128,856.80	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

本基金是混合型基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资和债券投资等。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 risk 管理制度，并对风险管理决策和 risk 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；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2018 年 6 月 30 日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券（2017 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。

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期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。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

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、结算备付金及债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	108,419,645.85	-	-	-	108,419,645.85
结算备付金	8,171,091.40	-	-	-	8,171,091.40
存出保证金	859,327.06	-	-	-	859,327.06
交易性金融资产	189,819,363.20	-	-	490,058,478.17	679,877,841.37
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	3,625,616.78	3,625,616.78
应收申购款	-	-	-	32,195.08	32,195.08
资产总计	307,269,427.51	-	-	493,716,290.03	800,985,717.54
负债					

卖出回购金融资产	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	98,978,345.30	98,978,345.30
应付赎回款	-	-	-	352,791.78	352,791.78
应付管理人报酬	-	-	-	882,080.88	882,080.88
应付托管费	-	-	-	147,013.49	147,013.49
应付交易费用	-	-	-	5,236,867.70	5,236,867.70
应付增值税	-	-	-	0.00	0.00
应交税费	-	-	-	1,249,200.00	1,249,200.00
其他负债	-	-	-	843,315.94	843,315.94
负债总计	-	-	-	107,689,615.09	107,689,615.09
利率敏感性缺口	307,269,427.51	-	-	386,026,674.94	693,296,102.45
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	77,688,497.10	-	-	-	77,688,497.10
结算备付金	6,184,221.93	-	-	-	6,184,221.93
存出保证金	629,950.96	-	-	-	629,950.96
交易性金融资产	169,878,000.00	-	-	523,269,542.22	693,147,542.22
应收证券清算款	-	-	-	15,780,816.70	15,780,816.70
应收利息	-	-	-	4,892,074.73	4,892,074.73
应收申购款	-	-	-	85,215.13	85,215.13
资产总计	254,380,669.99	-	-	544,027,648.78	798,408,318.77
负债					
应付赎回款	-	-	-	458,450.41	458,450.41
应付管理人报酬	-	-	-	1,013,937.55	1,013,937.55
应付托管费	-	-	-	168,989.58	168,989.58
应付交易费用	-	-	-	3,267,127.27	3,267,127.27
应付税费	-	-	-	1,249,200.00	1,249,200.00
其他负债	-	-	-	849,132.44	849,132.44
负债总计	-	-	-	7,006,837.25	7,006,837.25

利率敏感度缺口	254,380,669.99	-	-	537,020,811.53	791,401,481.52
---------	----------------	---	---	----------------	----------------

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位：人民币元)	
		本期末	上年度末
		2018年6月30日	2017年12月31日
	市场利率上升 25 个基点	-19,477.07	-47,741.16
市场利率下降 25 个基点	19,519.24	47,807.25	

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。

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中投资于股票、债券的比例不低于基金资产总值的 80%，投资于国家债券的比例不低于本基金资产净值的 20%，权证投资市值不超过基金资产净值的 3%。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	490,058,478.17	70.69	523,269,542.22	66.12
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
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	490,058,478.17	70.69	523,269,542.22	66.12

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 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 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
	沪深 300 指数上升 5%	25,694,021.49	32,362,501.97
	沪深 300 指数下降 5%	-25,694,021.49	-32,362,501.97

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	490,058,478.17	61.18
	其中：股票	490,058,478.17	61.18
2	固定收益投资	189,819,363.20	23.70
	其中：债券	189,819,363.20	23.70
	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	116,590,737.25	14.56
7	其他各项资产	4,517,138.92	0.56
8	合计	800,985,717.54	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	5,428,493.00	0.78
B	采矿业	28,331,756.12	4.09
C	制造业	279,795,132.07	40.36
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,887,559.85	0.56
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	13,179,135.75	1.90
G	交通运输、仓储和邮政业	2,436,766.00	0.35
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	69,698,275.68	10.05
J	金融业	33,615,600.00	4.85
K	房地产业	16,331,280.00	2.36
L	租赁和商务服务业	18,731,354.06	2.70
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	81,226.14	0.01
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	18,541,899.50	2.67
S	综合	-	-
	合计	490,058,478.17	70.69

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

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	461,000	21,736,150.00	3.14
2	601288	农业银行	5,550,000	19,092,000.00	2.75
3	300144	宋城演艺	789,017	18,541,899.50	2.67
4	600028	中国石化	2,600,000	16,874,000.00	2.43
5	601888	中国国旅	261,630	16,851,588.30	2.43

6	600585	海螺水泥	493,959	16,537,747.32	2.39
7	002745	木林森	887,600	15,790,404.00	2.28
8	000333	美的集团	299,997	15,665,843.34	2.26
9	601233	桐昆股份	883,718	15,217,623.96	2.19
10	000568	泸州老窖	250,000	15,215,000.00	2.19
11	300571	平治信息	210,293	14,341,982.60	2.07
12	000066	中国长城	1,604,500	11,407,995.00	1.65
13	002727	一心堂	334,035	10,839,435.75	1.56
14	002572	索菲亚	330,400	10,632,272.00	1.53
15	600584	长电科技	550,000	9,317,000.00	1.34
16	600298	安琪酵母	258,800	9,233,984.00	1.33
17	600276	恒瑞医药	117,745	8,920,361.20	1.29
18	600048	保利地产	720,000	8,784,000.00	1.27
19	300532	今天国际	481,624	8,413,971.28	1.21
20	002439	启明星辰	389,000	8,254,580.00	1.19
21	601138	工业富联	495,662	8,128,856.80	1.17
22	002180	纳思达	293,900	8,070,494.00	1.16
23	000002	万科A	306,800	7,547,280.00	1.09
24	002396	星网锐捷	364,836	7,468,192.92	1.08
25	000338	潍柴动力	830,000	7,262,500.00	1.05
26	000858	五粮液	92,960	7,064,960.00	1.02
27	600801	华新水泥	457,800	6,880,734.00	0.99
28	002065	东华软件	800,000	6,880,000.00	0.99
29	300323	华灿光电	499,930	6,459,095.60	0.93
30	600521	华海药业	238,000	6,352,220.00	0.92
31	000932	华菱钢铁	734,700	6,244,950.00	0.90
32	000063	中兴通讯	477,300	6,219,219.00	0.90
33	600030	中信证券	370,000	6,130,900.00	0.88
34	002415	海康威视	164,915	6,123,293.95	0.88
35	300463	迈克生物	226,800	5,654,124.00	0.82
36	300352	北信源	1,371,400	5,540,456.00	0.80
37	002696	百洋股份	441,700	5,428,493.00	0.78
38	300059	东方财富	380,000	5,008,400.00	0.72
39	600271	航天信息	195,120	4,930,682.40	0.71
40	600588	用友网络	199,930	4,900,284.30	0.71
41	600845	宝信软件	180,790	4,763,816.50	0.69
42	600196	复星医药	114,500	4,739,155.00	0.68
43	603328	依顿电子	424,869	4,609,828.65	0.66
44	601225	陕西煤业	559,946	4,602,756.12	0.66

45	601939	建设银行	700,000	4,585,000.00	0.66
46	600884	杉杉股份	205,000	4,530,500.00	0.65
47	002008	大族激光	76,000	4,042,440.00	0.58
48	600702	舍得酒业	108,787	3,926,122.83	0.57
49	600011	华能国际	600,000	3,816,000.00	0.55
50	601318	中国平安	65,000	3,807,700.00	0.55
51	300232	洲明科技	368,274	3,638,547.12	0.52
52	300164	通源石油	500,000	3,595,000.00	0.52
53	002371	北方华创	69,000	3,427,230.00	0.49
54	002624	完美世界	109,400	3,392,494.00	0.49
55	600188	兖州煤业	250,000	3,260,000.00	0.47
56	000921	海信科龙	308,500	3,196,060.00	0.46
57	002410	广联达	111,000	3,078,030.00	0.44
58	600885	宏发股份	101,600	3,039,872.00	0.44
59	600703	三安光电	155,000	2,979,100.00	0.43
60	600760	中航沈飞	74,206	2,674,384.24	0.39
61	600570	恒生电子	50,000	2,647,500.00	0.38
62	300253	卫宁健康	199,900	2,476,761.00	0.36
63	600859	王府井	110,000	2,339,700.00	0.34
64	300178	腾邦国际	133,696	1,879,765.76	0.27
65	601006	大秦铁路	200,000	1,642,000.00	0.24
66	600782	新钢股份	207,300	1,156,734.00	0.17
67	002832	比音勒芬	30,000	1,110,000.00	0.16
68	601111	中国国航	89,400	794,766.00	0.11
69	300747	锐科激光	1,543	123,995.48	0.02
70	601330	绿色动力	4,971	81,226.14	0.01
71	603650	彤程新材	2,376	50,988.96	0.01
72	603693	江苏新能	5,384	48,456.00	0.01
73	603706	东方环宇	1,765	23,103.85	0.00
74	603105	芯能科技	3,410	16,470.30	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	601288	农业银行	98,470,066.00	12.44
2	600340	华夏幸福	97,289,348.24	12.29
3	000651	格力电器	93,291,308.91	11.79

4	600048	保利地产	92,956,038.36	11.75
5	601155	新城控股	89,043,620.53	11.25
6	300212	易华录	83,322,587.91	10.53
7	601939	建设银行	81,641,719.35	10.32
8	600585	海螺水泥	81,609,623.13	10.31
9	600276	恒瑞医药	76,389,331.38	9.65
10	002110	三钢闽光	71,509,586.27	9.04
11	300144	宋城演艺	67,158,835.14	8.49
12	601336	新华保险	55,921,418.24	7.07
13	601988	中国银行	54,504,502.49	6.89
14	600030	中信证券	53,468,122.48	6.76
15	000932	华菱钢铁	51,885,540.01	6.56
16	600782	新钢股份	48,747,774.08	6.16
17	000333	美的集团	48,241,422.94	6.10
18	601233	桐昆股份	47,987,263.39	6.06
19	300253	卫宁健康	46,512,270.59	5.88
20	300630	普利制药	46,508,272.58	5.88
21	300323	华灿光电	44,491,060.02	5.62
22	002624	完美世界	44,462,515.30	5.62
23	600028	中国石化	44,343,128.13	5.60
24	002422	科伦药业	42,796,021.00	5.41
25	600036	招商银行	42,733,115.04	5.40
26	002727	一心堂	42,685,164.41	5.39
27	002180	纳思达	42,528,672.72	5.37
28	000830	鲁西化工	40,961,986.59	5.18
29	601888	中国国旅	40,533,437.23	5.12
30	300571	平治信息	40,261,562.90	5.09
31	600196	复星医药	39,912,125.97	5.04
32	600702	舍得酒业	37,920,877.71	4.79
33	600298	安琪酵母	37,874,111.18	4.79
34	300170	汉得信息	37,007,867.38	4.68
35	603993	洛阳钼业	36,389,778.00	4.60
36	300558	贝达药业	36,127,019.64	4.56
37	601111	中国国航	35,678,439.73	4.51
38	600038	中直股份	35,396,421.44	4.47
39	002217	合力泰	34,983,371.78	4.42

40	300188	美亚柏科	34,693,545.84	4.38
41	000066	中国长城	33,039,595.33	4.17
42	300482	万孚生物	32,295,342.90	4.08
43	300671	富满电子	31,898,326.60	4.03
44	601601	中国太保	31,746,485.00	4.01
45	000636	风华高科	31,535,909.24	3.98
46	601225	陕西煤业	31,406,654.68	3.97
47	000661	长春高新	31,032,832.00	3.92
48	002557	洽洽食品	30,767,982.30	3.89
49	600740	山西焦化	30,640,156.92	3.87
50	603986	兆易创新	30,627,391.00	3.87
51	600801	华新水泥	29,943,244.37	3.78
52	300122	智飞生物	29,475,397.12	3.72
53	002304	洋河股份	29,448,989.28	3.72
54	603019	中科曙光	28,904,250.00	3.65
55	000977	浪潮信息	28,788,127.70	3.64
56	600280	中央商场	28,776,010.21	3.64
57	600188	兖州煤业	27,956,086.66	3.53
58	601899	紫金矿业	27,654,262.96	3.49
59	600570	恒生电子	27,582,125.61	3.49
60	002475	立讯精密	27,356,172.15	3.46
61	601318	中国平安	26,742,579.58	3.38
62	600703	三安光电	26,646,853.18	3.37
63	002445	中南文化	26,270,765.71	3.32
64	000799	酒鬼酒	26,212,582.00	3.31
65	600522	中天科技	25,287,642.88	3.20
66	002202	金风科技	24,880,947.88	3.14
67	603010	万盛股份	24,664,555.45	3.12
68	603678	火炬电子	24,648,610.00	3.11
69	600856	中天能源	24,550,215.00	3.10
70	300168	万达信息	24,008,592.36	3.03
71	600521	华海药业	23,752,279.01	3.00
72	300059	东方财富	22,336,127.70	2.82
73	600029	南方航空	21,770,785.98	2.75
74	300373	扬杰科技	21,712,143.17	2.74
75	603757	大元泵业	21,605,339.38	2.73

76	300097	智云股份	21,183,296.35	2.68
77	600600	青岛啤酒	20,970,615.56	2.65
78	002371	北方华创	19,775,075.97	2.50
79	002563	森马服饰	19,615,301.01	2.48
80	600584	长电科技	19,596,104.73	2.48
81	600884	杉杉股份	19,522,512.54	2.47
82	002439	启明星辰	19,010,037.52	2.40
83	300452	山河药辅	18,987,126.00	2.40
84	000960	锡业股份	18,915,006.98	2.39
85	300232	洲明科技	18,565,190.77	2.35
86	300164	通源石油	18,541,328.14	2.34
87	600066	宇通客车	18,377,853.65	2.32
88	002138	顺络电子	18,189,500.08	2.30
89	000858	五粮液	17,872,213.19	2.26
90	600271	航天信息	17,647,911.59	2.23
91	603619	中曼石油	17,587,205.71	2.22
92	603799	华友钴业	17,576,147.00	2.22
93	002497	雅化集团	17,299,749.00	2.19
94	000568	泸州老窖	17,254,249.00	2.18
95	600466	蓝光发展	17,229,054.24	2.18
96	002396	星网锐捷	16,999,860.30	2.15
97	300007	汉威科技	16,697,231.00	2.11
98	300470	日机密封	16,654,926.25	2.10
99	002572	索菲亚	16,388,320.00	2.07
100	002065	东华软件	16,159,497.00	2.04
101	300367	东方网力	16,150,282.75	2.04
102	600409	三友化工	16,049,128.28	2.03
103	601566	九牧王	16,048,951.73	2.03

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	600048	保利地产	105,764,973.09	13.36
2	601939	建设银行	95,806,751.01	12.11

3	600340	华夏幸福	93,930,381.66	11.87
4	000651	格力电器	89,045,572.74	11.25
5	601155	新城控股	87,829,066.36	11.10
6	300212	易华录	81,166,415.16	10.26
7	601288	农业银行	76,178,396.00	9.63
8	600276	恒瑞医药	69,237,948.93	8.75
9	002110	三钢闽光	68,819,095.00	8.70
10	600585	海螺水泥	63,992,307.67	8.09
11	000333	美的集团	62,304,116.24	7.87
12	600036	招商银行	59,145,817.82	7.47
13	300630	普利制药	59,052,129.18	7.46
14	601336	新华保险	55,683,699.55	7.04
15	600702	舍得酒业	54,476,045.69	6.88
16	600030	中信证券	53,049,667.56	6.70
17	601988	中国银行	52,336,601.00	6.61
18	603993	洛阳钼业	51,992,045.25	6.57
19	300144	宋城演艺	51,964,645.12	6.57
20	601233	桐昆股份	50,552,601.61	6.39
21	601318	中国平安	47,325,324.99	5.98
22	600782	新钢股份	46,497,925.23	5.88
23	300253	卫宁健康	44,437,621.64	5.62
24	002422	科伦药业	43,134,156.38	5.45
25	000932	华菱钢铁	42,844,772.07	5.41
26	002624	完美世界	41,963,771.21	5.30
27	600887	伊利股份	41,154,770.12	5.20
28	000830	鲁西化工	40,685,475.03	5.14
29	300323	华灿光电	39,315,559.45	4.97
30	600522	中天科技	38,875,448.33	4.91
31	300170	汉得信息	38,005,718.75	4.80
32	601111	中国国航	37,028,585.04	4.68
33	600038	中直股份	36,755,538.93	4.64
34	300558	贝达药业	35,850,833.58	4.53
35	002217	合力泰	34,838,596.29	4.40
36	002180	纳思达	34,428,236.27	4.35
37	002475	立讯精密	34,322,347.96	4.34
38	600196	复星医药	34,305,522.44	4.33
39	300188	美亚柏科	34,278,449.64	4.33
40	300482	万孚生物	32,620,063.23	4.12

41	300671	富满电子	32,361,559.85	4.09
42	600856	中天能源	31,924,212.00	4.03
43	000661	长春高新	31,496,732.97	3.98
44	002727	一心堂	31,369,813.49	3.96
45	600703	三安光电	31,335,988.15	3.96
46	600740	山西焦化	31,057,026.13	3.92
47	601601	中国太保	30,903,708.07	3.90
48	603986	兆易创新	30,694,288.61	3.88
49	600521	华海药业	30,517,934.31	3.86
50	603019	中科曙光	30,345,925.26	3.83
51	000636	风华高科	30,068,686.99	3.80
52	600280	中央商场	29,433,221.62	3.72
53	002202	金风科技	29,382,664.63	3.71
54	002557	洽洽食品	29,328,697.30	3.71
55	002304	洋河股份	29,310,987.00	3.70
56	300122	智飞生物	29,017,978.62	3.67
57	601225	陕西煤业	28,912,578.50	3.65
58	000977	浪潮信息	28,732,128.40	3.63
59	600298	安琪酵母	28,066,976.30	3.55
60	601899	紫金矿业	27,565,284.06	3.48
61	600028	中国石化	27,136,424.58	3.43
62	600029	南方航空	26,902,814.34	3.40
63	603010	万盛股份	26,618,014.40	3.36
64	002866	传艺科技	26,089,373.70	3.30
65	002640	跨境通	25,792,398.55	3.26
66	000858	五粮液	25,762,477.13	3.26
67	002445	中南文化	25,721,269.00	3.25
68	601888	中国国旅	25,684,557.29	3.25
69	000799	酒鬼酒	25,495,142.97	3.22
70	300168	万达信息	24,399,872.72	3.08
71	600570	恒生电子	23,699,009.94	2.99
72	600188	兖州煤业	23,414,234.97	2.96
73	300571	平治信息	23,205,630.70	2.93
74	603678	火炬电子	23,171,671.10	2.93
75	600801	华新水泥	22,956,342.65	2.90
76	002493	荣盛石化	21,662,128.58	2.74
77	000066	中国长城	21,414,826.59	2.71
78	600176	中国巨石	21,369,741.00	2.70

79	300097	智云股份	21,254,600.40	2.69
80	603757	大元泵业	20,426,119.87	2.58
81	002563	森马服饰	20,356,411.24	2.57
82	300373	扬杰科技	20,078,801.78	2.54
83	002138	顺络电子	20,022,613.81	2.53
84	002497	雅化集团	19,890,081.00	2.51
85	600600	青岛啤酒	19,457,492.24	2.46
86	600066	宇通客车	18,733,973.22	2.37
87	000960	锡业股份	18,604,750.68	2.35
88	603799	华友钴业	18,275,210.00	2.31
89	300452	山河药辅	18,167,779.31	2.30
90	300059	东方财富	18,089,374.87	2.29
91	300164	通源石油	17,865,584.03	2.26
92	300232	洲明科技	17,769,335.22	2.25
93	002371	北方华创	17,732,005.69	2.24
94	600409	三友化工	17,222,426.28	2.18
95	300007	汉威科技	17,149,163.00	2.17
96	002396	星网锐捷	17,148,099.40	2.17
97	600466	蓝光发展	16,930,309.63	2.14
98	300470	日机密封	16,773,200.83	2.12
99	601566	九牧王	16,503,454.65	2.09
100	603619	中曼石油	16,281,413.00	2.06

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	4,840,284,169.23
卖出股票收入（成交）总额	4,835,422,787.03

注：表中“买入股票成本（成交）总额”及“卖出股票收入（成交）总额”均指成交金额，即成交单价乘以成交数量，相关交易费用不考虑。

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	28,727,200.00	4.14
2	央行票据	-	-
3	金融债券	161,092,163.20	23.24
	其中：政策性金融债	161,092,163.20	23.24
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	189,819,363.20	27.38

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	170211	17 国开 11	600,000	60,078,000.00	8.67
2	018005	国开 1701	338,140	33,942,493.20	4.90
3	180201	18 国开 01	300,000	30,090,000.00	4.34
4	170207	17 国开 07	200,000	20,000,000.00	2.88
5	020244	18 贴债 27	170,000	16,741,600.00	2.41

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

本基金本报告期末未持有国债期货。

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	859,327.06
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,625,616.78
5	应收申购款	32,195.08
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,517,138.92

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 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

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
33,670	17,381.90	7,067,768.75	1.21%	578,180,703.00	98.79%

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	11,295.81	0.0019%

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（2003年9月30日）基金份额总额	766,073,014.14
本报告期期初基金份额总额	616,131,615.61
本报告期基金总申购份额	8,540,397.14
减：本报告期基金总赎回份额	39,423,541.00
本报告期末基金份额总额	585,248,471.75

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

10.2.1 基金管理人的重大变动

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 基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

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

本基金管理人、基金财产、基金托管业务在本报告期内无诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金的投资策略未发生变更。

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

本报告期内基金管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受任何稽查或处罚等情况。

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	股票交易	应支付该券商的佣金

	交易单元 数量	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	备注
新时代证券	2	2,694,731,999.55	27.89%	2,464,395.27	27.69%	-
中信建投	1	1,533,378,996.08	15.87%	1,428,028.99	16.04%	-
西藏东方财富	1	1,286,883,554.27	13.32%	1,198,475.33	13.47%	-
中金公司	1	1,016,858,219.96	10.52%	946,994.98	10.64%	-
招商证券	2	788,516,544.41	8.16%	718,576.94	8.07%	-
太平洋	1	699,819,240.83	7.24%	637,746.33	7.17%	-
国盛证券	1	541,757,246.96	5.61%	493,704.23	5.55%	-
东兴证券	1	438,100,799.72	4.53%	408,000.87	4.58%	-
华泰证券	1	405,917,341.20	4.20%	369,912.58	4.16%	-
方正证券	1	257,391,077.83	2.66%	234,560.74	2.64%	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	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) 资质雄厚，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，本基金新增国盛证券、方正证券、新时代证券交易单位各 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
新时代证券	12,225,972.08	8.20%	-	-	-	-
中信建投	61,678,695.75	41.36%	-	-	-	-
西藏东方财富	9,466,695.00	6.35%	-	-	-	-
中金公司	28,735,012.60	19.27%	-	-	-	-
招商证券	24,996,447.95	16.76%	-	-	-	-
太平洋	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	4,997,000.00	3.35%	-	-	-	-
华泰证券	7,023,011.97	4.71%	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	披露日期
1	融通金算盘家族之融通蓝筹成长投资基金第十六次分红公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、管理人网站	2018-01-05
2	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	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、管理人网站	2018-01-31
3	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	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、管理人网站	2018-03-13
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	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、管理人网站	2018-03-22

5	关于修改《融通通利系列证券投资基金基金合同》部分条款的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、管理人网站	2018-03-23
6	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	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、管理人网站	2018-03-30
7	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	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、管理人网站	2018-03-30
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	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、管理人网站	2018-04-16
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	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、管理人网站	2018-05-14
10	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银河证券股份有限公司基金申购及定期定额投资申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、管理人网站	2018-05-21
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	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、管理人网站	2018-06-05
12	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	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、管理人网站	2018-06-30

§ 11 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 23 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通利系列证券投资基金设立的文件
- (二) 《融通通利系列证券投资基金基金合同》
- (三) 《融通通利系列证券投资基金托管协议》
- (四) 《融通通利系列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 <http://www.rtfund.com> 查阅。

融通基金管理有限公司

2018 年 8 月 27 日