

# 融通巨潮 100 指数证券投资基金 (LOF) 2018 年年度报告摘要

2018 年 12 月 31 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：2019 年 3 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巨潮 100 指数证券投资基金 (LOF) (以下简称“本基金”) 基金合同规定，于 2019 年 3 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告中的财务资料已经审计，普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	融通巨潮 100 指数 (LOF)	
场内简称	融通巨潮	
基金主代码	161607	
基金运作方式	上市契约型开放式 (LOF)	
基金合同生效日	2005 年 5 月 12 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	655,075,754.77 份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所	
上市日期	2005 年 6 月 16 日	
下属分级基金的基金简称:	融通巨潮 100 指数 A/B	融通巨潮 100 指数 C

下属分级基金的交易代码:	161607	004874
下属分级基金的前端交易代码	161607	004874
下属分级基金的后端交易代码	161657	-
报告期末下属分级基金的份额总额	654,771,338.22 份	304,416.55 份

## 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为增强型指数基金。在控制股票投资组合相对巨潮 100 目标指数跟踪误差的基础上,力求获得超越巨潮 100 目标指数的投资收益,追求长期的资本增值。本基金谋求分享中国经济的持续、稳定增长和中国证券市场发展的成果,实现基金财产的长期增长,为投资者带来稳定的回报。
投资策略	基金以指数化分散投资为主要投资策略,在此基础上进行适度的主动调整,在数量化投资技术与基本面深入研究的结合中谋求基金投资组合在偏离风险及超额收益间的最佳匹配。为控制基金偏离目标指数的风险,本基金力求将基金份额净值增长率与目标指数增长率间的日跟踪误差控制在 0.5%。
业绩比较基准	巨潮 100 指数收益率×95%+银行同业存款利率×5%。
风险收益特征	风险和预期收益率接近市场平均水平。

## 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		融通基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	涂卫东	郭明
	联系电话	(0755) 26948666	(010) 66105799
	电子邮箱	service@mail.rtfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-883-8088、(0755) 26948088	95588
传真		(0755) 26935005	(010) 66105798

## 2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.rtfund.com">http://www.rtfund.com</a>
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人处、深圳证券交易所

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 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	2018 年	2017 年	2016 年
-----------	--------	--------	--------

据和指标					
	融通巨潮 100 指数 A/B	融通巨潮 100 指数 C	融通巨潮 100 指数 A/B	融通巨潮 100 指数 C	融通巨潮 100 指数 A/B
本期已实现收益	-26,292,667.71	-15,511.89	93,081,987.85	940.24	-15,129,624.64
本期利润	-157,174,483.47	-71,341.14	181,294,773.54	-4,646.25	-54,739,542.43
加权平均基金份额本期利润	-0.2376	-0.2534	0.2446	-0.2533	-0.0674
本期基金份额净值增长率	-20.33%	-20.57%	23.85%	11.64%	-5.97%
3.1.2 期末数据 据和指标	2018 年末		2017 年末		2016 年末
期末可供分配基金份额利润	-0.0496	-0.1509	0.0867	0.2322	-0.0421
期末基金资产净值	622,297,301.80	258,494.74	844,685,816.92	99,076.46	798,044,831.60
期末基金份额净值	0.950	0.849	1.267	1.266	1.023

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）。

4、本基金于 2017 年 7 月 5 日增设 C 类份额，该类份额的统计期自 2017 年 7 月 6 日起，无 16 年度可比数据。

### 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

融通巨潮 100 指数 A/B

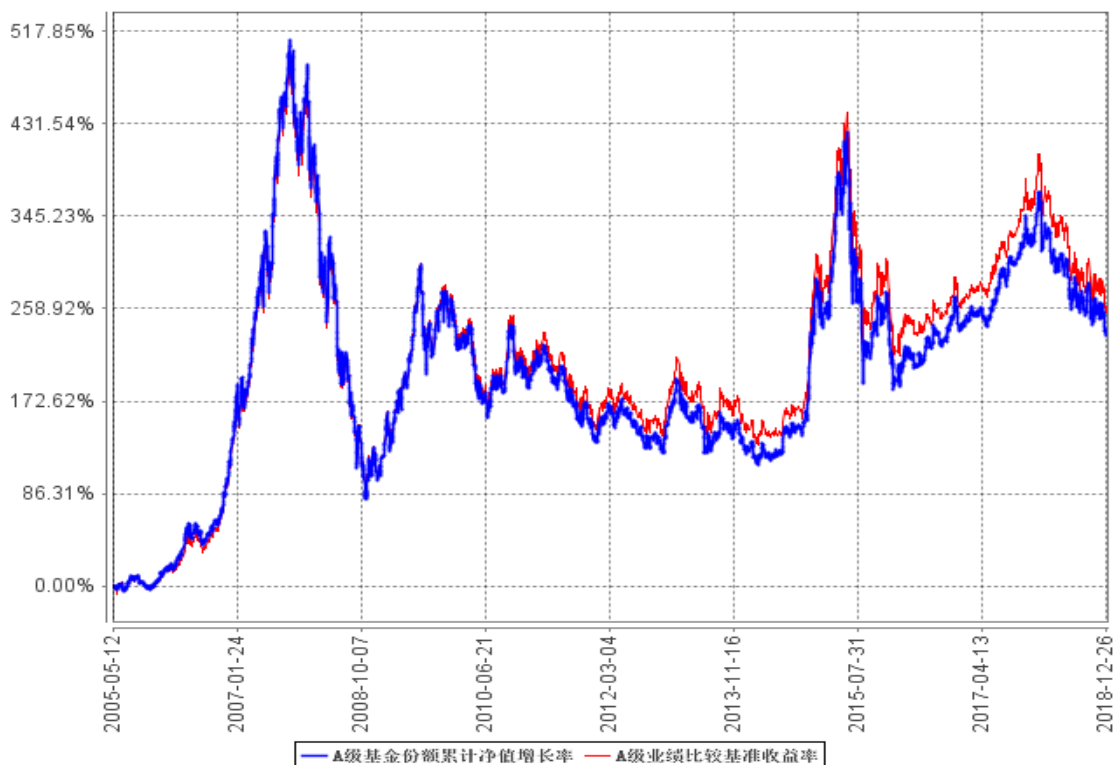
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-12.12%	1.57%	-11.48%	1.54%	-0.64%	0.03%
过去六个月	-10.71%	1.47%	-11.17%	1.44%	0.46%	0.03%
过去一年	-20.33%	1.31%	-21.43%	1.30%	1.10%	0.01%
过去三年	-7.23%	1.14%	-8.68%	1.10%	1.45%	0.04%
过去五年	40.78%	1.52%	37.95%	1.46%	2.83%	0.06%
自基金合同生效起至今	236.21%	1.75%	258.41%	1.66%	-22.20%	0.09%

融通巨潮 100 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
过去三个月	-12.20%	1.57%	-11.48%	1.54%	-0.72%	0.03%
过去六个月	-10.91%	1.46%	-11.17%	1.44%	0.26%	0.02%
过去一年	-20.57%	1.31%	-21.43%	1.30%	0.86%	0.01%
2017 年 7 月 6 日起至今	-11.32%	1.15%	-11.94%	1.14%	0.62%	0.01%

### 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



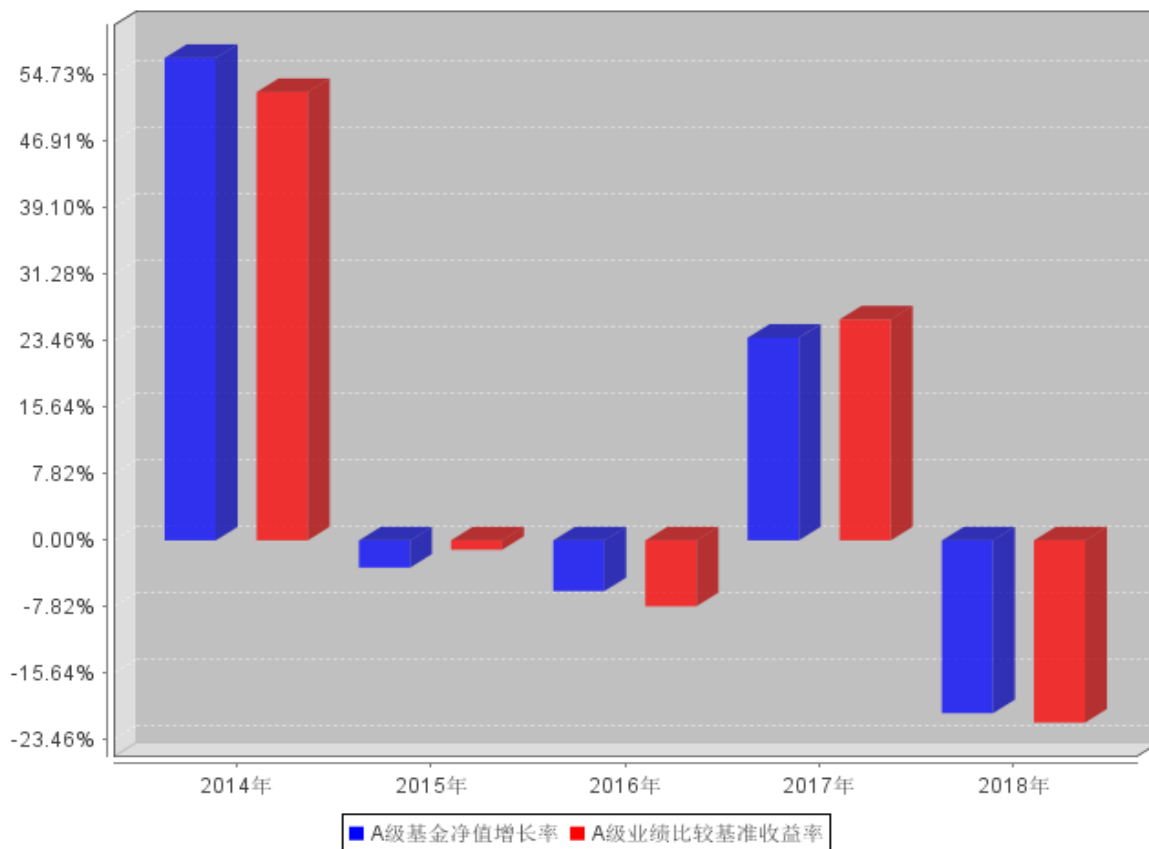
C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



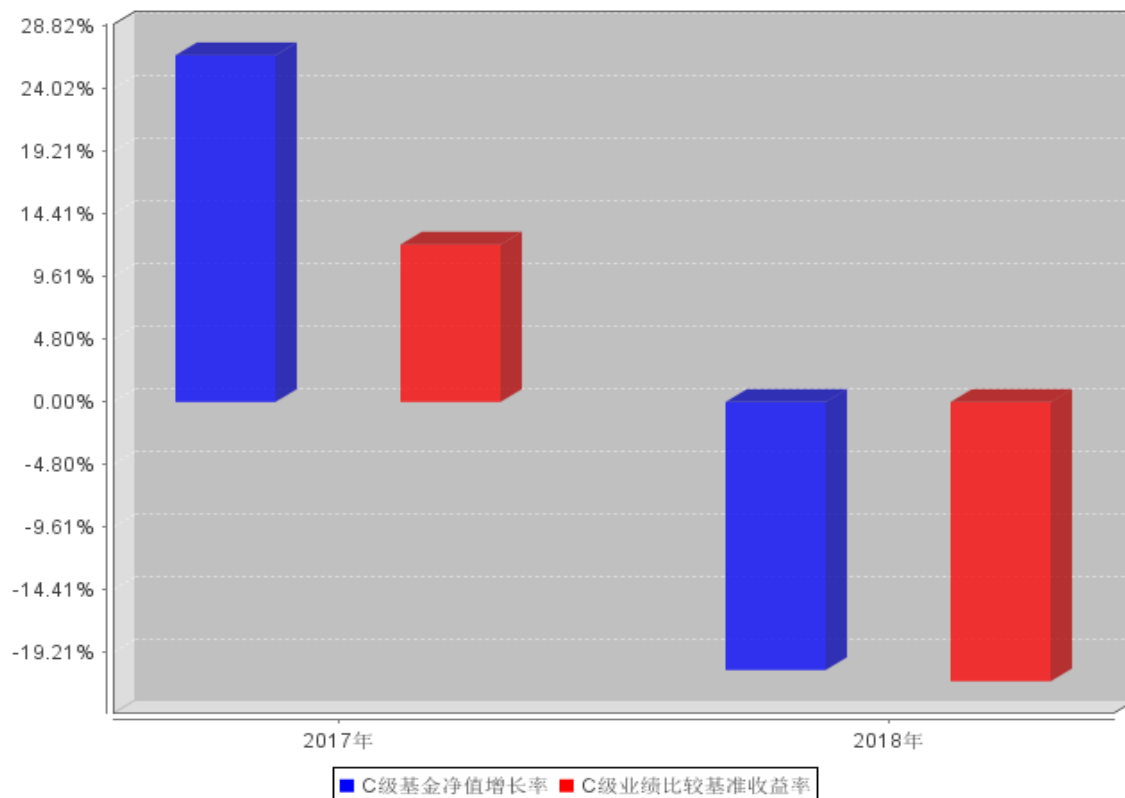
注：本基金于 2017 年 7 月 5 日增设了 C 类份额，该类份额的统计期间为 2017 年 7 月 6 日至本报告期末。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

A级过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



C级过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金于 2017 年 7 月 5 日增设了 C 类份额，该类份额的统计期间为 2017 年 7 月 6 日至本报告期末。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

融通巨潮 100 指数 A/B					
年度	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	年度利润分配合计	备注
2018	0.790	20,949,639.65	31,055,121.43	52,004,761.08	
2017	-	-	-	-	
2016	-	-	-	-	
合计	0.790	20,949,639.65	31,055,121.43	52,004,761.08	

单位：人民币元

融通巨潮 100 指数 C					
年度	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	年度利润分配合计	备注
2018	2.090	229.79	15,717.86	15,947.65	
2017	-	-	-	-	
2016	-	-	-	-	
合计	2.090	229.79	15,717.86	15,947.65	

## § 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 12 月 31 日，公司共管理六十五只开放式基金：即融通新蓝筹证券投资基金、融通债券投资基金、融通蓝筹成长证券投资基金、融通深证 100 指数证券投资基金、融通行业景气证券投资基金、融通巨潮 100 指数证券投资基金(LOF)、融通易支付货币市场证券投资基金、融通动力先锋混合型证券投资基金、融通领先成长混合型证券投资基金(LOF)、融通内需驱动混合型证券投资基金、融通深证成份指数证券投资基金、融通四季添利债券型证券投资基金(LOF)、融通创



业板指数增强型证券投资基金、融通医疗保健行业混合型证券投资基金、融通岁岁添利定期开放债券型证券投资基金、融通通泰保本混合型证券投资基金、融通通源短融债券型证券投资基金、融通通瑞债券型证券投资基金、融通月月添利定期开放债券型证券投资基金、融通健康产业灵活配置混合型证券投资基金、融通转型三动力灵活配置混合型证券投资基金、融通互联网传媒灵活配置混合型证券投资基金、融通新区域新经济灵活配置混合型证券投资基金、融通通鑫灵活配置混合型证券投资基金、融通新能源灵活配置混合型证券投资基金、融通中证军工指数分级证券投资基金、融通中证全指证券公司指数分级证券投资基金、融通跨界成长灵活配置混合型证券投资基金、融通新机遇灵活配置混合型证券投资基金、融通成长 30 灵活配置混合型证券投资基金、融通汇财宝货币市场基金、融通中国风 1 号灵活配置混合型证券投资基金、融通通盈保本混合型证券投资基金、融通增利债券型证券投资基金、融通增鑫债券型证券投资基金、融通增益债券型证券投资基金、融通增祥债券型证券投资基金、融通新消费灵活配置混合型证券投资基金、融通通安债券型证券投资基金、融通通优债券型证券投资基金、融通通乾研究精选灵活配置混合型证券投资基金、融通新趋势灵活配置混合型证券投资基金、融通国企改革新机遇灵活配置混合型证券投资基金、融通通和债券型证券投资基金、融通沪港深智慧生活灵活配置混合型证券投资基金、融通现金宝货币市场基金、融通通祺债券型证券投资基金、融通可转债债券型证券投资基金、融通通福债券型证券投资基金 (LOF)、融通通宸债券型证券投资基金、融通通玺债券型证券投资基金、融通通润债券型证券投资基金、融通中证人工智能主题指数证券投资基金 (LOF)、融通收益增强债券型证券投资基金、融通中国概念债券型证券投资基金 (QDII)、融通逆向策略灵活配置混合型证券投资基金、融通通裕定期开放债券型发起式证券投资基金、融通红利机会主题精选灵活配置混合型证券投资基金、融通通昊定期开放债券型发起式证券投资基金、融通新能源汽车主题精选灵活配置混合型证券投资基金、融通增辉定期开放债券型发起式证券投资基金、融通增悦债券型证券投资基金、融通通捷债券型证券投资基金、融通研究优选混合型证券投资基金、融通丰利四分法证券投资基金 (QDII)。其中，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	2015	-	7	蔡志伟先生，华南师范大学计算机硕士、广州大学计

	的基金 经理	年 2 月 11 日			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：任免日期指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 公平交易制度和控制方法

为了保证旗下的不同投资组合得到公平对待，本基金管理人制定了《融通基金管理有限公司公平交易制度》，公平交易制度所规范的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等所有投资管理活动，并涵盖授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

本基金管理人通过建立科学的投资决策体系，加强交易执行环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段来保证公平交易原则的实现。同时，本基金管理人通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

##### 4.3.2 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。

##### 4.3.3 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。本基金运用指数化投资方式，采取量化策略进行指数增强和风险管理，在控制基金相对巨潮 100 指数基金基准的跟踪误差下，力求最终为投资者带来超越基金基准的收益。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末融通巨潮 100 指数 A/B 基金份额净值为 0.950 元，本报告期基金份额净值增长率为-20.33%；截至本报告期末融通巨潮 100 指数 C 基金份额净值为 0.849 元，本报告期基金份额净值增长率为-20.57%；同期业绩比较基准收益率为-21.43%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2018 年全年 GDP 增速 6.6%，逐季下行，四季度 GDP 增速下滑至 6.4%，为 28 年最低水平。从“三驾马车”对 GDP 贡献来看，消费仍是主要贡献，但高位下行，贡献比例为 76.2%；2018 年四季度投资的贡献有所回升，占 32.4%；而净出口对 GDP 全年均形成拖累，四季度贡献-8.6%。

展望 2019 年，经济下行态势明显，而我国政策也已全面转向，中国已从快速去杠杆过渡为稳杠杆，稳增长、稳就业和守住不发生系统性风险的底线。货币政策方面，宽货币和宽信用成为主基调。总体而言 2019 年经济不容乐观，但政策对冲下行压力，迎来阶段性政策红利期。

2018 年 A 股经历了历史上第五轮熊市，当前已处于底部区域。从市场估值角度看，目前估值处于 A 股历史底部区域的偏低水平，且结构较优。而从全球股市对比来看，A 股市盈率已处于全球较低水平，A 股具备很强的吸引力。从市场盈利角度看，预计 A 股市场 2019 年增速较 2018 年有所回落，2 季度盈利增速探底，3 季度开始回升，全年有所增长。而从市场流动性的角度看，2019 年预计将边际改善，一方面得益于国内政策转向宽信用，另一方面随着 2014 年以来中国金融市场不断加大对外开放，人民币国际化，沪港通、深港通的陆续推出，A 股纳入 MSCI 指数，以及 2019 年内推出沪伦通、A 股纳入富时罗素指数，外资正快速布局 A 股市场。根据央行调查统计司披露到 2018 年 9 月底的数据测算，陆股通北上资金累计流入 6107 亿人民币，预计 2019 年外资仍将加速进入 A 股市场，市场流动性将进一步改善。

总的来看，2019 年 A 股市场机会大于风险。从行业配置的角度看，受益于我国制造业转型升级的新能源汽车、工业机器人、光伏等高端制造业，以及涉及国家安全的核心技术领域：5G、网络安全、芯片和军工将长期受益。而从 2019 年增量资金风险偏好的角度看，由于增量资金主要来自海外、保险、养老金和社保等长线资金，其多偏好低估值、高分红和稳定 ROE 的企业，而此类

企业主要集中于金融、地产和共用事业，相信相关行业也将有较好的投资机会。

具体到本基金跟踪的巨潮 100 指数，成分股高度集中于长线资金偏好的金融、地产等低估值高分红的企业，2019 年将受益于增量资金配置需求。

#### 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。

估值委员会定期对经济环境是否发生重大变化、证券发行机构是否发生影响证券价格的重大事件以及估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后及时修订估值方法，以保证其持续适用。估值政策和程序的修订须经公司总经理办公会议审批后方可实施。基金在采用新投资策略或投资新品种时，应评价现有估值政策和程序的适用性。其中研究部负责定期对经济环境是否发生重大变化、证券发行机构是否发生影响证券价格的重大事件以及估值政策和程序进行评价，金融工程小组负责估值方法的研究、价格的计算及复核，登记清算部进行具体的估值核算并与基金托管人核对，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

本基金于 2018 年 1 月 15 日实施利润分配，以 2017 年 12 月 31 日的可分配收益为基准，融通巨潮 100 指数 A/B 每 10 份基金份额派发红利 0.79 元，巨潮 100 指数 C 每 10 份基金份额派发红利 2.09 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巨潮 100 指数证券投资基金 (LOF) 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,融通巨潮 100 指数证券投资基金 (LOF) 的管理人——融通基金管理有限公司在融通巨潮 100 指数证券投资基金 (LOF) 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,融通巨潮 100 指数证券投资基金 (LOF) 对基金份额持有人进行了 1 次利润分配,分配金额为 52,020,708.73。

### 5.3 托管人对本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巨潮 100 指数证券投资基金 (LOF) 2018 年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 审计报告

本基金 2018 年年度财务会计报告已经审计,普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了标准无保留意见的审计报告(普华永道中天审字(2019)第 21153 号),投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体:融通巨潮 100 指数证券投资基金 (LOF)

报告截止日: 2018 年 12 月 31 日

单位:人民币元

资产	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
<b>资产:</b>		
银行存款	18,288,606.38	18,442,518.79
结算备付金	840,072.20	1,096,057.97
存出保证金	55,864.08	153,798.33

交易性金融资产	602,097,203.29	827,197,305.50
其中：股票投资	586,975,203.79	797,123,905.99
基金投资	-	-
债券投资	15,121,999.50	30,073,399.51
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	2,679,272.89	-
应收利息	387,827.36	950,873.44
应收股利	-	-
应收申购款	44,473.31	90,522.17
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	624,393,319.51	847,931,076.20
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
	<b>2018 年 12 月 31 日</b>	<b>2017 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债：</b>		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	158,578.00	919,862.38
应付管理人报酬	712,372.53	938,544.48
应付托管费	109,595.78	144,391.47
应付销售服务费	90.44	33.42
应付交易费用	526,472.15	802,290.34
应交税费	0.13	-

应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	330,413.94	341,060.73
负债合计	1,837,522.97	3,146,182.82
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	655,075,754.77	666,682,049.47
未分配利润	-32,519,958.23	178,102,843.91
所有者权益合计	622,555,796.54	844,784,893.38
负债和所有者权益总计	624,393,319.51	847,931,076.20

注：报告截止日 2018 年 12 月 31 日，融通巨潮 100 指数基金 (LOF) 基金份额总额为 655,075,754.77 份；其中融通巨潮 100 指数基金 (LOF) A/B 类基金份额净值为 0.950 元，基金份额为 654,771,338.22 份；融通巨潮 100 指数基金 (LOF) C 类基金份额净值为 0.849 元，基金份额为 304,416.55 份。

## 7.2 利润表

会计主体：融通巨潮 100 指数证券投资基金 (LOF)

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
一、收入	-143,128,559.02	201,330,175.02
1. 利息收入	925,539.30	1,066,428.68
其中：存款利息收入	137,204.13	138,266.22
债券利息收入	788,335.17	928,162.46
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	-13,148,702.27	111,873,025.91

其中：股票投资收益	-30,082,090.57	94,383,495.94
基金投资收益	-	-
债券投资收益	74,782.82	194,440.59
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	16,858,605.48	17,295,089.38
3. 公允价值变动收益	-130,937,645.01	88,207,199.20
4. 汇兑收益	-	-
5. 其他收入	32,248.96	183,521.23
<b>减：二、费用</b>	<b>14,117,265.59</b>	<b>20,040,047.73</b>
1. 管理人报酬	9,510,131.58	10,969,818.03
2. 托管费	1,463,097.15	1,687,664.30
3. 销售服务费	1,098.31	44.34
4. 交易费用	2,683,854.52	6,913,801.06
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 税金及附加	0.03	-
7. 其他费用	459,084.00	468,720.00
<b>三、利润总额</b>	<b>-157,245,824.61</b>	<b>181,290,127.29</b>
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润</b>	<b>-157,245,824.61</b>	<b>181,290,127.29</b>

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：融通巨潮 100 指数证券投资基金 (LOF)

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 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)	666,682,049.47	178,102,843.91	844,784,893.38
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	-157,245,824.61	-157,245,824.61
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-11,606,294.70	-1,356,268.80	-12,962,563.50
其中: 1. 基金申购款	61,457,969.08	12,024,120.32	73,482,089.40
2. 基金赎回款	-73,064,263.78	-13,380,389.12	-86,444,652.90
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-52,020,708.73	-52,020,708.73
五、期末所有者权益 (基金净值)	655,075,754.77	-32,519,958.23	622,555,796.54
项目	上年度可比期间		
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 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)	780,158,852.72	17,885,978.88	798,044,831.60
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	181,290,127.29	181,290,127.29
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-113,476,803.25	-21,073,262.26	-134,550,065.51
其中: 1. 基金申购款	122,343,604.55	21,066,735.94	143,410,340.49
2. 基金赎回款	-235,820,407.80	-42,139,998.20	-277,960,406.00



关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日		2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 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	500,289,132.94	28.54%	1,197,308,519.58	26.49%

#### 7.4.3.1.2 权证交易

无。

#### 7.4.3.1.3 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 12 月 31 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	465,917.21	28.75%	-	-
关联方名称	上年度可比期间			
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 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	1,115,053.57	26.69%	260,720.20	32.50%

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。

#### 7.4.3.2 关联方报酬

##### 7.4.3.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	9,510,131.58	10,969,818.03
其中:支付销售机构的客户维护费	1,903,740.26	2,152,790.38

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 1.30% 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:

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.30\% / \text{当年天数}。$$

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。

#### 7.4.3.2.2 基金托管费

单位: 人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,463,097.15	1,687,664.30

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 0.20% 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:

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.20\% / \text{当年天数}。$$

#### 7.4.3.2.3 销售服务费

单位: 人民币元

获得销售服务费的 各关联方名称	本期		
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	融通巨潮 100 指数 A/B	融通巨潮 100 指数 C	合计
融通基金管理有限公司	-	1,086.42	1,086.42
合计	-	1,086.42	1,086.42
获得销售服务费的	上年度可比期间		

各关联方名称	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	融通巨潮 100 指数 A/B	融通巨潮 100 指数 C	合计
融通基金管理有限公司	-	44.34	44.34
合计	-	44.34	44.34

注：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：

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

#### 7.4.3.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

#### 7.4.3.4 各关联方投资本基金的情况

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

无。

##### 7.4.3.4.2 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

无。

#### 7.4.3.5 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 12 月 31 日		2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	18,288,606.38	124,910.93	18,442,518.79	102,833.78

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。

#### 7.4.3.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 7.4.3.7 其他关联交易事项的说明

无。

## 7.4.4 期末 (2018 年 12 月 31 日) 本基金持有的流通受限证券

## 7.4.4.1 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

7.4.12.1.1 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 (股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601138	工业富联	2018-5-28	2019-6-10	网下中签流通受限	13.77	10.97	351,533	4,840,609.41	3,856,317.01	-
601860	紫金银行	2018-12-20	2019-1-3	新股流通受限	3.14	3.14	15,970	50,145.80	50,145.80	-

7.4.12.1.2 受限证券类别: 债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
110049	海尔转债	2018-12-20	2019-1-18	新债流通受限	100.00	100.00	570	56,999.50	56,999.50	-

注: 基金可作为特定投资者, 认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份, 所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

## 7.4.4.2 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	复牌开盘价	数量 (股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600030	中信证券	2018-12-25	重大事项停牌	16.01	2019-1-10	17.15	1,065,100	18,727,294.12	17,052,251.00	-

## 7.4.4.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

## § 8 投资组合报告

## 8.1 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	586,975,203.79	94.01
	其中：股票	586,975,203.79	94.01
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	15,121,999.50	2.42
	其中：债券	15,121,999.50	2.42
	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	19,128,678.58	3.06
8	其他各项资产	3,167,437.64	0.51
9	合计	624,393,319.51	100.00

## 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	12,514,380.34	2.01
B	采矿业	16,404,708.79	2.64
C	制造业	179,043,710.77	28.76
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	11,253,056.28	1.81
E	建筑业	20,033,785.85	3.22
F	批发和零售业	4,805,336.00	0.77
G	交通运输、仓储和邮政业	9,108,903.64	1.46
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	15,905,611.81	2.55
J	金融业	259,050,096.78	41.61
K	房地产业	21,634,187.32	3.48

L	租赁和商务服务业	7,070,068.60	1.14
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	556,823,846.18	89.44

## 8.2.2 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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	21,379,492.51	3.43
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,658,675.00	0.91
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	7,400.00	0.00
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	3,055,644.30	0.49
J	金融业	50,145.80	0.01
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	30,151,357.61	4.84

### 8.3 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

#### 8.3.1 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前十名股票投资明细

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	601318	中国平安	977,334	54,828,437.40	8.81
2	600519	贵州茅台	49,147	28,997,221.47	4.66
3	600036	招商银行	882,923	22,249,659.60	3.57
4	601166	兴业银行	1,356,531	20,266,573.14	3.26
5	600030	中信证券	1,065,100	17,052,251.00	2.74
6	601288	农业银行	4,492,308	16,172,308.80	2.60
7	601328	交通银行	2,768,587	16,030,118.73	2.57
8	000333	美的集团	431,237	15,895,395.82	2.55
9	300498	温氏股份	478,013	12,514,380.34	2.01
10	600016	民生银行	2,132,625	12,219,941.25	1.96

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于基金管理人融通基金管理有限公司网站 (<http://www.rtfund.com>) 的年度报告正文。

#### 8.3.2 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前五名股票投资明细

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	002463	沪电股份	1,076,200	7,716,354.00	1.24
2	300750	宁德时代	88,750	6,549,750.00	1.05
3	600027	华电国际	1,191,300	5,658,675.00	0.91
4	601138	工业富联	351,533	3,856,317.01	0.62
5	600498	烽火通信	110,800	3,154,476.00	0.51

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于基金管理人融通基金

管理有限公司网站 (<http://www.rtfund.com>) 的年度报告正文。

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 8.4.1 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	601229	上海银行	19,517,428.42	2.31
2	300498	温氏股份	18,546,098.54	2.20
3	600919	江苏银行	15,004,899.00	1.78
4	600276	恒瑞医药	14,113,026.36	1.67
5	600887	伊利股份	14,048,858.96	1.66
6	300059	东方财富	13,864,729.90	1.64
7	000333	美的集团	13,664,663.31	1.62
8	600519	贵州茅台	13,249,397.00	1.57
9	002463	沪电股份	12,990,671.00	1.54
10	601318	中国平安	12,409,042.55	1.47
11	600030	中信证券	12,400,468.46	1.47
12	601939	建设银行	12,355,121.00	1.46
13	600837	海通证券	12,281,953.00	1.45
14	002304	洋河股份	12,228,721.98	1.45
15	000063	中兴通讯	12,194,792.00	1.44
16	601688	华泰证券	11,800,009.06	1.40
17	600104	上汽集团	11,245,182.23	1.33
18	600309	万华化学	11,229,987.15	1.33
19	002230	科大讯飞	11,008,173.90	1.30
20	600036	招商银行	10,741,572.00	1.27

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。

##### 8.4.2 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	601318	中国平安	21,433,092.13	2.54
2	601166	兴业银行	19,361,044.46	2.29
3	601229	上海银行	17,942,007.74	2.12
4	300498	温氏股份	17,173,066.56	2.03
5	601989	中国重工	15,883,997.04	1.88
6	600519	贵州茅台	15,148,607.00	1.79
7	000333	美的集团	15,108,168.50	1.79
8	000725	京东方 A	13,757,208.00	1.63
9	600887	伊利股份	13,129,863.54	1.55
10	600036	招商银行	12,737,642.43	1.51
11	600837	海通证券	12,581,932.52	1.49
12	600016	民生银行	12,140,461.00	1.44
13	600104	上汽集团	12,071,220.06	1.43
14	000651	格力电器	11,768,201.00	1.39
15	601328	交通银行	11,285,007.50	1.34
16	000001	平安银行	10,988,538.82	1.30
17	600068	葛洲坝	10,912,742.00	1.29
18	601169	北京银行	10,430,880.72	1.23
19	600028	中国石化	10,411,194.55	1.23
20	000063	中兴通讯	10,376,000.94	1.23

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。

#### 8.4.3 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	857,594,083.50
卖出股票收入（成交）总额	906,733,860.12

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。

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	15,065,000.00	2.42
	其中：政策性金融债	15,065,000.00	2.42
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）	56,999.50	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	15,121,999.50	2.43

#### 8.6 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	180407	18 农发 07	100,000	10,043,000.00	1.61
2	018005	国开 1701	50,000	5,022,000.00	0.81
3	110049	海尔转债	570	56,999.50	0.01

#### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序前十名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。

#### 8.8 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。

#### 8.9 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。

#### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 8.10.1 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。

##### 8.10.2 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 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。

8.11.2 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。

8.11.3 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。

8.12.2 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。

8.12.3 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	55,864.08
2	应收证券清算款	2,679,272.89
3	应收股利	-
4	应收利息	387,827.36
5	应收申购款	44,473.31
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,167,437.64

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

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	600030	中信证券	17,052,251.00	2.74	重大事项停牌

8.12.5.2 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	601138	工业富联	3,856,317.01	0.62	网下中签流通受限

§9 基金份额持有人信息

9.1 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
融通巨潮 100 指数 A/B	48,925	13,383.16	130,881.37	0.02%	654,640,456.85	99.98%
融通巨潮 100 指数 C	49	6,212.58	0.00	0.00%	304,416.55	100.00%
合计	48,974	13,375.99	130,881.37	0.02%	654,944,873.40	99.98%

9.2 期末上市基金前十名持有人

融通巨潮 100 指数 A/B

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例
1	宋適午	383,500.00	2.99%
2	方燕秋	336,807.00	2.62%
3	王翔	159,800.00	1.24%
4	仇培红	148,000.00	1.15%
5	杨裕祯	130,000.00	1.01%
6	陈远中	127,800.00	1.00%
7	蔡惠珍	127,700.00	0.99%
8	林学英	117,800.00	0.92%
9	李刚	113,822.00	0.89%
10	刘京	107,672.00	0.84%

9.3 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	融通巨潮 100 指数 A/B	66,550.34	0.0102%
	融通巨潮 100 指	10,873.43	3.5719%

	数 C		
	合计	77,423.77	0.0118%

#### 9.4 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、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金	融通巨潮 100 指数 A/B	0
	融通巨潮 100 指数 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	融通巨潮 100 指数 A/B	0
	融通巨潮 100 指数 C	0
	合计	0

#### § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	融通巨潮 100 指数 A/B	融通巨潮 100 指数 C
基金合同生效日 (2005 年 5 月 12 日) 基金份额总额	513,527,198.43	-
本报告期期初基金份额总额	666,603,776.50	78,272.97
本报告期期间基金总申购份额	60,764,524.65	693,444.43
减:本报告期期间基金总赎回份额	72,596,962.93	467,300.85
本报告期期间基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	654,771,338.22	304,416.55

#### § 11 重大事件揭示

##### 11.1 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。

##### 11.2 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

###### 11.2.1 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关于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。

###### 11.2.2 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更。

### 11.3 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。

### 11.4 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。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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。本年度应支付的审计费为人民币 80,000.00 元。

### 11.6 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。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 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	
光大证券	1	662,216,552.33	37.78%	616,720.02	38.05%	-
新时代证券	1	500,289,132.94	28.54%	465,917.21	28.75%	-
银河证券	1	493,824,469.99	28.17%	450,022.58	27.77%	-
东吴证券	1	96,599,822.48	5.51%	88,031.98	5.43%	-
兴安证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
广州证券	2	-	-	-	-	-

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

无。

#### 11.7.2 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
光大证券	5,022,500.00	31.75%	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	10,797,281.80	68.25%	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
兴安证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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 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。

融通基金管理有限公司

二〇一九年三月二十七日