

融通通利系列证券投资基金之  
融通深证 100 指数证券投资基金  
2019 年半年度报告摘要

2019 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：2019 年 8 月 24 日

## § 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深证 100 指数证券投资基金（以下简称“本基金”）2019 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 2019 年 8 月 23 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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	融通深证 100 指数	
基金主代码	161604	
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	4,555,511,133.74 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 100 指数 A/B	融通深证 100 指数 C
下属分级基金的交易代码	161604	004876
下属分级基金的前端交易代码	161604	—
下属分级基金的后端交易代码	161654	—
报告期末下属分级基金的份额总额	4,549,882,824.48 份	5,628,309.26 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	运用指数化投资方式，通过控制股票投资组合与深证 100 指数的跟踪误差，力求实现对深证 100 指数的有效跟踪，谋求分享中国经济的持续、稳定增长和中国证券市场的发展，实现基金资产的长期增长，为投资者带来稳定回报。
投资策略	以非债券资产 90% 以上的资金对深证 100 指数的成份股进行股票指数化投资。股票指数化投资部分不得低于基金资产的 50%，采用复制法跟踪深证 100 指数，对于因流动性等原因导致无法完全复制深证 100 指数的情况，将采用剩余组合替换等方法避免跟踪误差扩大。
业绩比较基准	深证 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
	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) 66105798

### 2.4 信息披露方式

登载基金半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>
基金半年度报告备置地点	基金管理人处、基金托管人处

### § 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(2019年1月1日-2019年6月30日)	
	融通深证 100 指数 A/B	融通深证 100 指数 C
本期已实现收益	-98,713,948.05	-76,956.30
本期利润	1,270,111,262.90	542,986.06
加权平均基金份额本期利润	0.2838	0.1352
本期基金份额净值增长率	32.95%	32.67%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)	
期末可供分配基金份额利润	0.1170	0.1085
期末基金资产净值	5,082,207,067.79	6,238,848.48
期末基金份额净值	1.117	1.108

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 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
过去一个月	4.69%	1.28%	4.52%	1.29%	0.17%	-0.01%
过去三个月	-2.95%	1.76%	-3.04%	1.76%	0.09%	0.00%
过去六个月	32.95%	1.73%	32.88%	1.72%	0.07%	0.01%

过去一年	2.90%	1.70%	3.95%	1.68%	-1.05%	0.02%
过去三年	11.12%	1.29%	14.17%	1.27%	-3.05%	0.02%
自基金合同生效起至今	303.56%	1.73%	399.18%	1.69%	-95.62%	0.04%

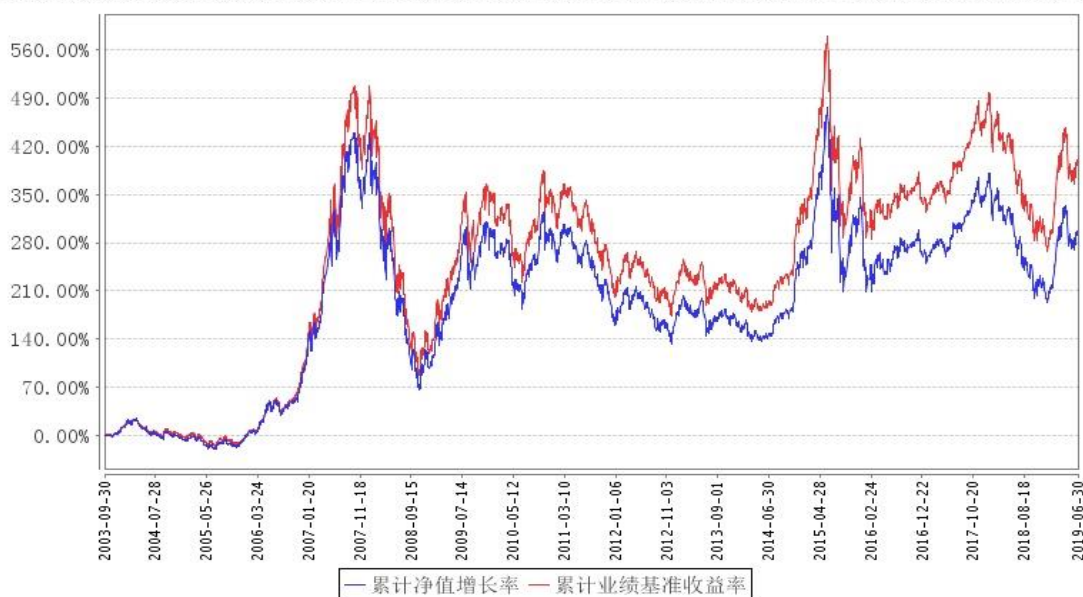
融通深证 100 指数 C

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
过去一个月	4.63%	1.28%	4.52%	1.29%	0.11%	-0.01%
过去三个月	-3.06%	1.75%	-3.04%	1.76%	-0.02%	-0.01%
过去六个月	32.67%	1.72%	32.88%	1.72%	-0.21%	0.00%
过去一年	2.45%	1.70%	3.95%	1.68%	-1.50%	0.02%
自基金合同生效起至今	-2.87%	1.45%	1.16%	1.44%	-4.03%	0.01%

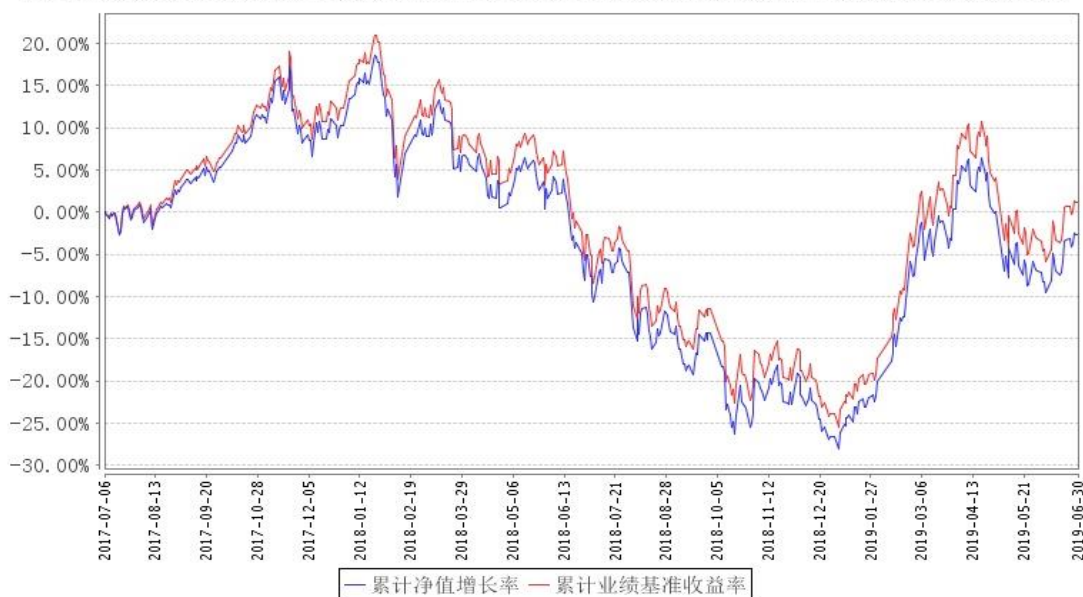
注：本基金业绩比较基准项目分段计算，其中：2005 年 8 月 21 日之前（含此日）采用“深证 100 指数×75%+银行间债券综合指数×25%”，2005 年 8 月 22 日起使用新基准即“深证 100 指数收益率×95%+银行同业存款利率×5%”。

### 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

融通深证100指数A/B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



融通深证100指数C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 日增加 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 2019 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、融通中证全指证券公司指数分级证券投资基金、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、融通核心价值混合型证券投资基金 (QDII) (原融通丰利四分法证券投资基金 (QDII) 转型而来)、融通超短债债券型证券投资基金、融通通盈灵活配置混合型证券投资基金 (原融通通盈保本混合型证券投资基金转型而来)、融通通慧混合型证券投资基金 (原融通国企改革新机遇灵活配置混合型证券投资基金转型而来)。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期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
何天翔	本基金的基金经理、指数与量化投资部副总监	2014/10/25	-	11	何天翔先生, 厦门大学经济学硕士, 11 年证券投资从业经历, 具有基金从业资格。2008 年 7 月至 2010 年 3 月就职于华泰联合证券有限责任公司任金融工程分析师。2010 年 3 月加入融通基金管理有限公司, 历任金融工程研究员、专户投资经理、融通中证大农业指数证券投资基金 (LOF) 基金经理、融通国企改革新机遇灵活配置混合型证券投资基金基金经理, 现任指数与量化投资部副总监、融通深证 100 指数证券投资基金基金经理、融通中证军工指数分级证券投资基金基金经理、融通中证全指证券公司指数分级证券投资基金基金经理、融通新趋势灵活配置混合型证券投资基金基金经理、融通通瑞债

					券型证券投资基金基金经理、融通中证人工智能主题指数证券投资基金 (LOF) 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

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

本基金管理人对报告期内不同时间窗下（日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行了分析，各投资组合的同向交易价差均处于合理范围之内。

报告期内，本基金管理人严格执行了公平交易的原则和制度。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金报告期内未发生异常交易。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

在严格遵守基金合同的前提下实现持有人利益的最大化是本基金管理的核心思想，并将此原则贯彻于基金的运作始终。本基金运用指数化投资策略，通过控制股票投资权重与深证 100 指数成份股自然权重的偏离，有效控制跟踪误差，为投资者提供投资深证 100 指数的一个有效工具。

本报告期内，本基金日均跟踪偏离为 0.04%，年化跟踪误差为 0.93%，符合基金合同约定。其中成份股中兴通讯的停复牌和估值重估、部分成份股长期停牌等因素对本基金的跟踪误差造成一定影响。

##### 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 100 指数 A/B 基金份额净值为 1.117 元，本报告期基金份额净值增长率为 32.95%；截至本报告期末融通深证 100 指数 C 基金份额净值为 1.108 元，本报告期基金份额净值增长率为 32.67%；同期业绩比较基准收益率为 32.88%。



#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

受内外多重因素影响，经济有下行压力，但在坚持实施稳健的货币政策，坚持实施积极的财政政策，着力减税降费、补短板调结构，坚持改革开放，持续供给侧结构性改革，做好预期管理等多项政策下，市场对经济增速已经形成一定的预期值。今年以来，更多的新兴市场开始降息，市场对美联储的降息预期也在上升，显示出海外经济的不确定性。

目前 A 股市场整体估值水平合理，市场波动率近年来有所降低，市场参与结构改善，在证券市场加大开放的形势下，全球资金逐步配置进来，指数化投资的比例也在较快提升，基于此我们认为虽然短期市场不确定因素较多，但长期趋势乐观。

深 100 指数当前 TTM 市盈率约为 21 倍，略低于历史平均水平，中国经济正处于转型关键期，而转型的主要动力来自于消费和科技，深 100 指数是主流宽基指数中消费和科技股票占比最高的指数之一，从指数结构看，长期战略看好深 100 指数。

#### 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。

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 2019 年 3 月 1 日实施利润分配，以 2019 年 2 月 22 日的可分配收益为基准，融通深证 100 指数 A/B 类每 10 份基金份额派发现金红利 0.20 元，融通深证 100 指数 C 类每 10 份基金份

额派发现金红利 0.20 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深证 100 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 100 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 100 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 100 指数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 89,308,790.07 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深证 100 指数证券投资基金 2019 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 100 指数证券投资基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		
银行存款	85,660,689.96	93,803,482.06
结算备付金	1,601,956.08	210,518.07
存出保证金	221,534.72	174,552.89
交易性金融资产	5,011,953,359.31	3,760,583,071.14
其中：股票投资	4,820,102,095.71	3,580,365,071.14
基金投资	-	-

债券投资	191,851,263.60	180,218,000.00
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	-	-
应收利息	2,615,691.73	3,752,408.32
应收股利	-	-
应收申购款	2,630,581.66	1,523,860.65
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	5,104,683,813.46	3,860,047,893.13
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
	<b>2019年6月30日</b>	<b>2018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	-	18,173,833.16
应付赎回款	9,790,206.35	64,448,058.65
应付管理人报酬	4,043,739.50	3,588,461.63
应付托管费	808,747.89	717,692.33
应付销售服务费	2,107.09	417.96
应付交易费用	663,118.43	811,212.80
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	929,977.93	1,000,166.15
负债合计	16,237,897.19	88,739,842.68
<b>所有者权益:</b>		
实收基金	4,555,511,133.74	4,406,771,820.93
未分配利润	532,934,782.53	-635,463,770.48
所有者权益合计	5,088,445,916.27	3,771,308,050.45
负债和所有者权益总计	5,104,683,813.46	3,860,047,893.13

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额总额 4,555,511,133.74 份，其中融通深证 100 指数 A/B 基金份额总额为 4,549,882,824.48 份，基金份额净值 1.117 元；融通深证 100 指数 C 基金份额总额为 5,628,309.26 份，基金份额净值 1.108 元。

## 6.2 利润表

会计主体：融通深证 100 指数证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
一、收入	1,300,377,557.81	-808,619,801.10
1. 利息收入	2,872,002.22	4,601,004.70
其中：存款利息收入	291,877.18	421,636.64
债券利息收入	2,580,125.04	4,179,368.06
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	-72,649,232.97	319,481,961.04
其中：股票投资收益	-119,545,398.10	277,364,233.13
基金投资收益	-	-
债券投资收益	2,607,847.06	3,474,284.93
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	44,288,318.07	38,643,442.98
3. 公允价值变动收益	1,369,445,153.31	-1,133,931,509.36
4. 汇兑收益	-	-
5. 其他收入	709,635.25	1,228,742.52
减：二、费用	29,723,308.85	43,896,263.53
1. 管理人报酬	23,471,022.56	32,870,136.66
2. 托管费	4,694,204.41	6,574,027.31
3. 销售服务费	8,505.43	817.89
4. 交易费用	1,408,483.80	4,268,295.71
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 税金及附加	-	8.11
7. 其他费用	141,092.65	182,977.85
三、利润总额	1,270,654,248.96	-852,516,064.63
减：所得税费用	-	-
四、净利润	1,270,654,248.96	-852,516,064.63

## 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：融通深证 100 指数证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期
	2019 年 1 月 1 日至 2019 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)	4,406,771,820.93	-635,463,770.48	3,771,308,050.45
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,270,654,248.96	1,270,654,248.96
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	148,739,312.81	-12,946,905.88	135,792,406.93
其中：1. 基金申购款	856,733,926.68	64,358,003.51	921,091,930.19
2. 基金赎回款	-707,994,613.87	-77,304,909.39	-785,299,523.26
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-89,308,790.07	-89,308,790.07
五、期末所有者权益(基金净值)	4,555,511,133.74	532,934,782.53	5,088,445,916.27
项目	上年度可比期间 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)	6,099,589,804.74	1,718,063,298.03	7,817,653,102.77
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-852,516,064.63	-852,516,064.63
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-1,065,100,822.02	-331,587,960.83	-1,396,688,782.85
其中：1. 基金申购款	404,306,480.98	97,836,082.73	502,142,563.71
2. 基金赎回款	-1,469,407,303.00	-429,424,043.56	-1,898,831,346.56
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)	5,034,488,982.72	533,959,272.57	5,568,448,255.29

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：

张帆	颜锡廉	刘美丽
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 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。

#### 6.4.2 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。

#### 6.4.3 关联方关系

##### 6.4.3.1 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。

##### 6.4.3.2 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、注册登记机构、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。

#### 6.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

##### 6.4.4.2 关联方报酬

###### 6.4.4.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年6月30日	2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	23,471,022.56	32,870,136.66
其中:支付销售机构的客户维护费	3,194,693.73	3,407,833.32

注:1.支付基金管理人融通基金管理有限公司的基金管理费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:日基金管理费=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。

###### 6.4.4.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年6月30日	2018年1月1日至2018年6月30日

当期发生的基金应支付的托管费	4,694,204.41	6,574,027.31
----------------	--------------	--------------

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。

#### 6.4.4.2.3 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 2019年1月1日至2019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 100 指数 A/B 类	融通深证 100 指数 C 类	合计
融通基金	-	1,854.46	1,854.46
中国工商银行	-	-	-
合计	-	1,854.46	1,854.46
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 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 100 指数 A/B 类	融通深证 100 指数 C 类	合计
融通基金	-	817.89	817.89
中国工商银行	-	-	-
合计	-	817.89	817.89

注：根据基金持有人大会表决通过的《关于融通深证 100 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，本基金增设 C 类基金份额，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：

日销售服务费=前一日 C 类基金资产净值× 0.40% / 当年天数。

#### 6.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.4.4.2 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。

6.4.4.5 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 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018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	85,660,689.96	285,492.13	142,686,470.43	403,105.22

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。

6.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.4.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.5 期末(2019年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.5.1 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
300788	中信出版	2019-06-27	2019-07-05	新股流通受限	14.85	14.85	1,556	23,106.60	23,106.60	-

6.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

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	4,820,102,095.71	94.43
	其中：股票	4,820,102,095.71	94.43
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	191,851,263.60	3.76
	其中：债券	191,851,263.60	3.76
	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	87,262,646.04	1.71
8	其他各项资产	5,467,808.11	0.11
9	合计	5,104,683,813.46	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

## 7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

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	239,140,673.61	4.70
B	采矿业	-	-
C	制造业	3,075,133,503.50	60.43
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	20,636,289.80	0.41
F	批发和零售业	87,300,811.44	1.72
G	交通运输、仓储和邮政业	11,746,764.00	0.23
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	253,405,297.60	4.98
J	金融业	491,375,188.46	9.66
K	房地产业	296,668,793.61	5.83
L	租赁和商务服务业	56,953,436.05	1.12
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	13,891,073.47	0.27
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	72,746,298.79	1.43
R	文化、体育和娱乐业	18,977,784.16	0.37
S	综合	-	-
	合计	4,637,975,914.49	91.15

## 7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

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	-	-
C	制造业	99,752,868.19	1.96
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	17,499,858.80	0.34
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	22,366,470.00	0.44
J	金融业	9,655,165.00	0.19
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	17,086,037.63	0.34
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	15,765,781.60	0.31
S	综合	-	-
	合计	182,126,181.22	3.58

### 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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	000651	格力电器	6,346,061	349,033,355.00	6.86
2	000333	美的集团	6,229,521	323,062,959.06	6.35
3	000858	五粮液	2,579,979	304,308,523.05	5.98
4	300498	温氏股份	5,182,614	185,848,538.04	3.65
5	000002	万科A	6,206,954	172,615,390.74	3.39
6	000001	平安银行	11,785,678	162,406,642.84	3.19
7	002415	海康威视	4,787,828	132,048,296.24	2.60
8	000725	京东方A	34,285,303	117,941,442.32	2.32
9	000063	中兴通讯	3,377,240	109,861,617.20	2.16
10	300059	东方财富	7,035,492	95,330,916.60	1.87

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>）的半年度报告正文。

#### 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（元）	占基金资产净值比例（%）
----	------	------	-------	---------	--------------

1	002311	海大集团	1,198,500	37,033,650.00	0.73
2	300454	深信服	255,500	22,366,470.00	0.44
3	002032	苏泊尔	278,500	21,118,655.00	0.42
4	002602	世纪华通	1,760,296	19,222,432.32	0.38
5	002607	中公教育	1,244,431	17,086,037.63	0.34
6	300413	芒果超媒	383,500	15,742,675.00	0.31
7	002938	鹏鼎控股	431,000	12,654,160.00	0.25
8	002939	长城证券	578,500	9,655,165.00	0.19
9	002841	视源股份	124,000	9,611,240.00	0.19
10	002120	韵达股份	288,340	8,886,638.80	0.17

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>）的半年度报告正文。

#### 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	002311	海大集团	36,931,262.44	0.98
2	300750	宁德时代	25,376,620.77	0.67
3	300454	深信服	22,629,261.00	0.60
4	000651	格力电器	21,164,572.72	0.56
5	002032	苏泊尔	20,034,831.54	0.53
6	002602	世纪华通	19,974,582.36	0.53
7	002607	中公教育	16,265,221.78	0.43
8	300142	沃森生物	15,336,752.38	0.41
9	000002	万科A	14,929,435.25	0.40
10	300413	芒果超媒	14,783,767.32	0.39
11	000001	平安银行	14,260,250.41	0.38
12	300760	迈瑞医疗	11,503,785.36	0.31
13	300059	东方财富	11,161,112.36	0.30
14	002938	鹏鼎控股	11,106,632.64	0.29
15	000860	顺鑫农业	10,697,539.08	0.28
16	300122	智飞生物	10,463,263.00	0.28
17	300601	康泰生物	10,170,624.04	0.27
18	000858	五粮液	10,105,537.40	0.27
19	002841	视源股份	9,030,992.00	0.24
20	000703	恒逸石化	8,542,335.30	0.23

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	38,478,896.08	1.02
2	000333	美的集团	32,980,797.61	0.87
3	002049	紫光国微	25,398,342.82	0.67
4	300253	卫宁健康	20,496,573.00	0.54
5	002797	第一创业	19,030,445.24	0.50
6	002450	*ST 康得	18,395,012.16	0.49
7	000503	国新健康	18,277,292.71	0.48
8	002340	格林美	18,003,315.16	0.48
9	000001	平安银行	17,417,619.00	0.46
10	002092	中泰化学	17,365,495.00	0.46
11	000830	鲁西化工	16,757,782.68	0.44
12	002572	索菲亚	16,485,126.21	0.44
13	002415	海康威视	15,375,919.00	0.41
14	000540	中天金融	14,621,394.00	0.39
15	000983	西山煤电	14,196,021.35	0.38
16	002142	宁波银行	13,676,930.76	0.36
17	300498	温氏股份	12,482,199.23	0.33
18	002310	东方园林	11,848,037.50	0.31
19	000413	东旭光电	11,084,000.00	0.29
20	000858	五粮液	10,852,159.00	0.29

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	463,642,764.36
卖出股票收入（成交）总额	474,150,478.48

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	49,730,000.00	0.98
2	央行票据	-	-
3	金融债券	142,121,263.60	2.79
	其中：政策性金融债	142,121,263.60	2.79
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	191,851,263.60	3.77
----	----	----------------	------

#### 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	180410	18 农发 10	700,000	70,049,000.00	1.38
2	199918	19 贴现国债 18	500,000	49,730,000.00	0.98
3	160420	16 农发 20	400,000	40,016,000.00	0.79
4	190402	19 农发 02	300,000	29,949,000.00	0.59
5	108603	国开 1804	21,060	2,107,263.60	0.04

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的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。

#### 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	221,534.72
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,615,691.73
5	应收申购款	2,630,581.66
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,467,808.11

### 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

本基金本报告期末积极投资前五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

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 100 指数 A/B	313,377	14,518.88	97,538,364.01	2.14%	4,452,344,460.47	97.86%
融通深证 100 指数 C	997	5,645.24	0.00	0.00%	5,628,309.26	100.00%
合计	314,374	14,490.74	97,538,364.01	2.14%	4,457,972,769.73	97.86%

### 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 100 指数 A/B	905,937.37	0.0199%
	融通深证 100 指数 C	54,781.93	0.9733%

	合计	960,719.30	0.0211%
--	----	------------	---------

### 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 100 指数 A/B	10~50
	融通深证 100 指数 C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	融通深证 100 指数 A/B	0~10
	融通深证 100 指数 C	0
	合计	0~10

### § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	融通深证 100 指数 A/B	融通深证 100 指数 C
基金合同生效日（2003 年 9 月 30 日）基金份额总额	477,689,377.16	-
本报告期期初基金份额总额	4,405,327,498.80	1,444,322.13
本报告期基金总申购份额	845,414,843.47	11,319,083.21
减：本报告期基金总赎回份额	700,859,517.79	7,135,096.08
本报告期期末基金份额总额	4,549,882,824.48	5,628,309.26

### § 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

本报告期基金管理和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

在本报告期内没有涉及基金管理人、基金财产、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、托管人及其高级管理人员无受监管部门稽查或处罚的情形。

## 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	2	459,072,218.43	49.21%	418,354.09	49.21%	-
海通证券	1	240,729,160.05	25.80%	219,377.90	25.80%	-
中信证券	2	120,369,719.74	12.90%	109,693.13	12.90%	-
天风证券	1	69,212,467.66	7.42%	63,073.84	7.42%	-
华泰证券	1	29,107,228.30	3.12%	26,525.43	3.12%	-
光大证券	1	14,401,083.58	1.54%	13,123.81	1.54%	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
西藏东方财富	1	-	-	-	-	-
中泰证券	3	-	-	-	-	-
中信证券 (山东)	1	-	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
浙商证券	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

本报告期内基金新增长江证券和中泰证券交易单元各 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
长江证券	22,874,273.98	55.62%	-	-	-	-
海通证券	18,248,720.00	44.38%	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
西藏东方 财富	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信证券 (山东)	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-

长城证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-

融通基金管理有限公司

2019 年 8 月 24 日